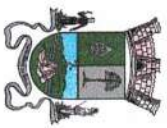


**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
**ESTADO DE SÃO PAULO**

**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**

**FEVEREIRO/2023**

Este relatório tem como objetivo demonstrar a análise do relatório de investimentos, de acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento a Política de Investimentos do mês em referência, e a aprovação pelo Conselho Fiscal.



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
**ESTADO DE SÃO PAULO**

## PARECER COMITE DE INVESTIMENTOS DEZEMBRO/2022

O comitê de investimentos do **INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPEÇERICA DA SERRA-ITAPREV**, fazendo uso de sua competência que lhe confere o Decreto Municipal Nº 2352/2015, em sua reunião ordinária do dia 22 de março de 2023, analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês de dezembro/2022 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

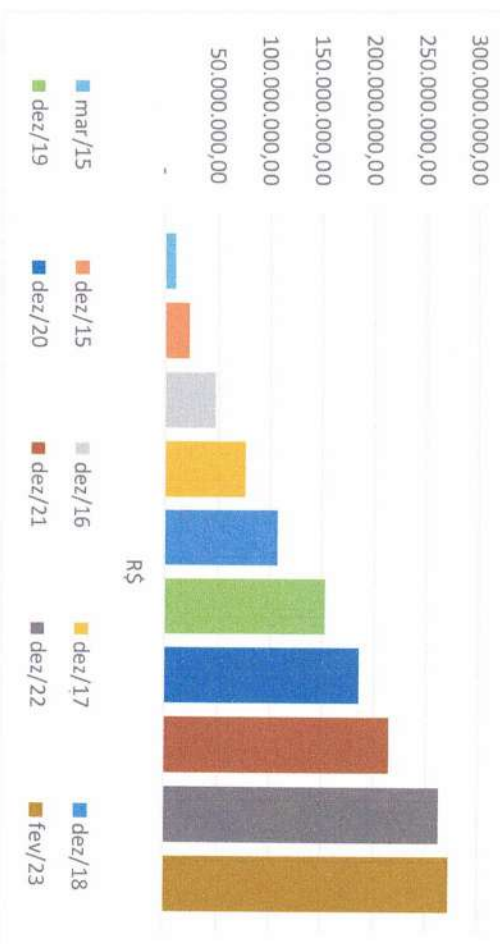
### 1) CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do **Instituto de Previdência do município de Itapeçerica da Serra-ITAPREV**, no mês de janeiro de 2023 apresentou valorização de 1,69 encerrando o mês com recursos aplicados no valor total de R\$ 273.219.972,55 (Duzentos e setenta e três milhões, duzentos e dezenove mil, novecentos e setenta e dois reais e cinquenta e cinco centavos)

Início Itaprev

Ano	R\$
mar/15	9.333.541,95
dez/15	22.750.600,24
dez/16	47.169.736,15
dez/17	76.356.500,87
dez/18	107.384.837,09
dez/19	152.862.799,62
dez/20	186.459.080,35
dez/21	214.632.111,69
dez/22	263.411.729,77
fev/23	273.027.916,94

Comparativo Evolução Patrimônio





## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

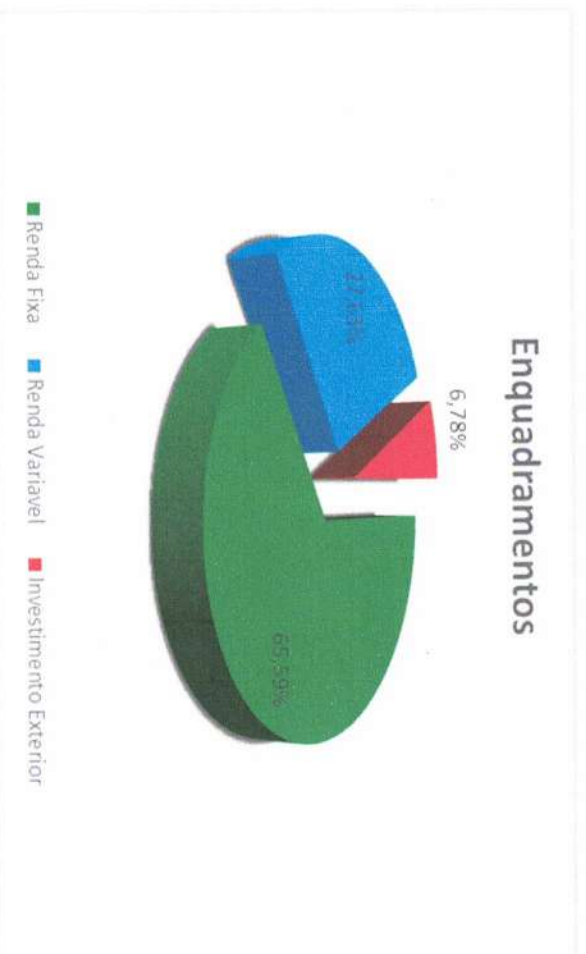
### 2) COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

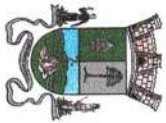
A carteira de investimentos do Instituto de Previdência do município de Itapetininga da Serra-ITAPREV, atende aos requisitos de limites e enquadramento da resolução Nº 3922/2010 e suas alterações e, aos limites e enquadramentos aprovados na política de investimentos vigente sendo composta por:

65,88% em investimentos denominados Renda fixa;

27,42% em investimentos denominados Renda Variável; e

6,70% em investimentos denominados exterior.





**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPÁ, DA SERRA**  
**ESTADO DE SÃO PAULO**

Recursos por fundo de Investimento

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	14.436.417,67	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	18.473,14	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.516.141,58	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.745.861,20	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.682.905,03	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	10.678.375,17	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	15.568.324,23	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	15.316.179,31	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	19.116.326,68	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.901.931,70	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.597.826,39	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.211.795,56	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.236.349,52	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.810.434,63	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.452.758,79	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	10.176.157,94	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.693.139,19	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.823.219,25	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.724.071,86	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	10.052.800,19	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	D+0		7.708.705,79	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	D+0		7.711.990,68	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	18/04/2018	5.301.318,54	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	Renda Fixa
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	3.145.628,90	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	Renda Fixa
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>			<b>183.627.132,94</b>		



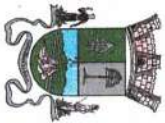
**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.585.410,32	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.769.094,17	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	D+15	Não há	5.590.145,27	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	6.314.002,77	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
FINACAP MAURITSSAD FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.580.997,21	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.869.357,79	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	D+13	Não há	1.037.161,59	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.133.543,18	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
SOI FIC AÇÕES	D+0	Não há	2.728.124,40	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.782.272,12	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.930.687,44	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.249.079,04	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.027.030,35	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.042.891,50	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.993.895,02	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
CAIXA JURROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	4.076.722,20	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+3 du	25 meses	3.066.017,79	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	4.131.692,60	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	520.350,43	Artigo 11º	Renda Variável
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>		<b>76.428.475,19</b>		

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.407.453,25	Artigo 9º, Inciso II	Invest. exterior
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	D+4 du	Não há	1.397.562,91	Artigo 9º, Inciso II	Invest. exterior
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.766.736,21	Artigo 9º, Inciso III	Invest. exterior
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	8.112.168,77	Artigo 9º, Inciso III	Invest. exterior
<b>INVEST. EXTERIOR</b>	<b>INVEST. EXTERIOR</b>		<b>18.683.921,14</b>		

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
			172.400,55	Artigo 6º	

<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>183.627.132,94</b>
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>76.428.475,19</b>
<b>INVEST. EXTERIOR</b>	<b>18.683.921,14</b>
<b>DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS</b>	<b>172.400,55</b>
<b>TOTAL DE RECURSOS</b>	<b>278.911.929,82</b>



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO

RECURSOS PREVIDENCIARIOS	<b>273.219.972,55</b>
RECURSOS TAXA ADMINISTRATIVA	<b>5.711.612,33</b>
<b>TOTAL DE RECURSOS ITAPREV</b>	<b>278.931.584,88</b>

### 3) META ATUARIAL

O retorno da carteira de investimentos do **instituto de Previdência do Município de ITAPEÇERICA DA SERRA – ITAPREV**, no acumulado do ano é positivo em 1,20% (Um virgula VINTE por cento), acima da meta atuarial acumulada de IPCA+5,06% que em FEVEREIRO ficou acumulada 2,17% (Dois virgula dezessete por cento)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno no Mês	Retorno Mês	Meta	Retorno acumulado	Retorno acum.	Meta acum.	Gap (%)
Janeiro	263.411.729,77	10.897.991,24	5.634.066,11	273.219.972,55	4.544.317,65	1,69%	0,96%	4.544.317,65	1,69%	0,96%	176,19%
Fevereiro	273.219.972,55	32.905.272,17	31.765.834,85	273.027.916,94	-1.331.492,93	-0,49%	1,20%	3.212.824,72	1,20%	2,17%	55,26%
						-0,49%	1,20%	3.212.824,72	1,20%	2,17%	55,26%



Retorno obtido no mês	<b>-0,49%</b>
Meta atuarial do mês	<b>1,20%</b>
Retorno da carteira em 2022	<b>1,20%</b>
Meta atuarial em 2022	<b>2,17%</b>



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
**ESTADO DE SÃO PAULO**

**4) RETORNO ACUMULADO POR FUNDO DE INVESTIMENTO**

Produto / Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922 / 4.392 / 4.604	SEGMENTO	IRI (IRII)	IRI (II) III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL FI AÇÕES	Artigo 9º, Inciso III	RENDIA VARIÁVEL	5,10%	2,17%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 10º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	4,67%	2,17%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	2,91%	2,17%
BB IDIA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	2,88%	2,17%
BB IMA-8 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	2,79%	2,17%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	2,78%	2,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	2,73%	2,17%
CAIXA BRASIL IMA-8 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	2,72%	2,17%
DAICOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	2,67%	2,17%
CAIXA BRASIL IDIA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	2,56%	2,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	2,49%	2,17%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	Artigo 9º, Inciso III	RENDIA VARIÁVEL	2,20%	2,17%
LETRA FINANCEIRA DAICOVAL TAXA 7,23%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDIA FIXA	2,16%	2,17%
LETRA FINANCEIRA DAICOVAL TAXA 7,00%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDIA VARIÁVEL	2,10%	2,17%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVEST EXTERIUCH	Artigo 9º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA VARIÁVEL	2,02%	2,17%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	Artigo 10º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	1,99%	2,17%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	1,89%	2,17%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	1,77%	2,17%
CAIXA BRASIL IMA-8 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Artigo 10º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	1,72%	2,17%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	Artigo 10º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	1,67%	2,17%
CAIXA JUROS E MÓVEDIS FI MULTIMERCADO LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	1,66%	2,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º, Inciso II, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	1,62%	2,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	1,62%	2,17%
CAIXA BRASIL IDIA PRE 2A FIC RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso II, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	1,58%	2,17%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Artigo 7º, Inciso II, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	1,45%	2,17%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	1,36%	2,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA VARIÁVEL	0,91%	2,17%
BB IMA-8 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 9º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	0,82%	2,17%
BNP PARIBIS ACCESS WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	0,67%	2,17%
TRIGONO DEBENTURES INSTRUCCIONAL FIC AÇÕES	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDIA FIXA	0,55%	2,17%
DAICOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Artigo 7º, Inciso II, Alínea 'a'	RENDIA FIXA	0,53%	2,17%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGICO IMA-8 FI RENDA FIXA	Artigo 10º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	0,49%	2,17%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-0,26%	2,17%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-0,76%	2,17%
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-1,83%	2,17%
BNP PARIBIS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-2,57%	2,17%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-2,69%	2,17%
TARPON WARRIOR FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-2,85%	2,17%
QUELUS VALOR FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-2,86%	2,17%
AE QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-4,34%	2,17%
DAICOVAL BOVESPA ATIVO FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-4,58%	2,17%
FINACAP MAURITSSAND FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-4,58%	2,17%
GUERARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-5,33%	2,17%
SCHRODER BEST IDEAS	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-9,06%	1,29%
SQI FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDIA VARIÁVEL	-20,92%	2,17%

NOVO

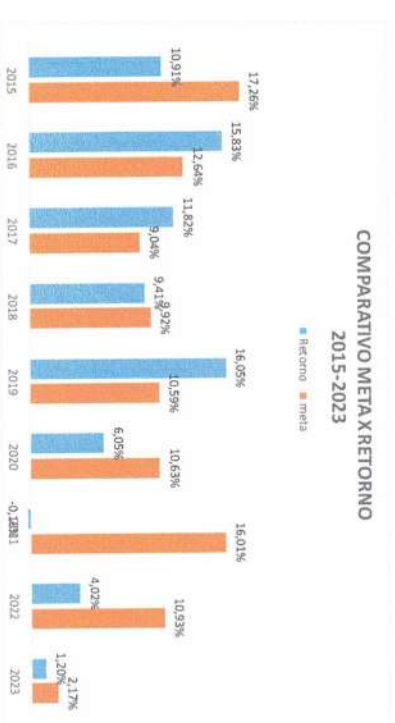
13	Fundos acima da Meta Anual
21	Fundos abaixo da Meta Anual
13	Fundos com rendimento Negativo
47	Total Fundos Investidos

37,66%	Fundos da carteira acima da meta anual no ano
44,68%	Fundos da carteira abaixo da meta anual no ano
37,66%	Fundos da carteira com rendimento negativo no ano



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO

**Retorno acumulado 2015 a 2023**

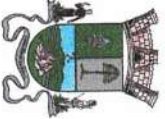


**5) ENQUADRAMENTO**

Em atendimento a Resolução Nº 4963/2021 em substituição a resolução Nº 3922/2010 e suas alterações, e em atendimento aos limites previsto na política de investimentos vigente, a carteira de investimentos do Instituto de Previdência do Município de Itapetereira da Serra, atende aos limites pré-estabelecidos.

Artigos - Renda Fixa	Estratégia de Alocação - Limite - 2023						GAP Superior
	Resol. %	Carteira \$	Carteira %	Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	111.495.811,71
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	129.466.258,54	46,45%	15,00%	30,00%	90,00%	121.399.317,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	30.293.230,49	10,87%	2,00%	5,00%	50,00%	109.076.534,15
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	15.420.696,47	5,53%	0,00%	18,00%	20,00%	40.327.209,38
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	8.446.947,44	3,03%	0,00%	3,00%	5,00%	5.490.029,02
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>183.627.132,94</b>	<b>65,88%</b>	<b>17,00%</b>	<b>66,00%</b>	<b>205,00%</b>	





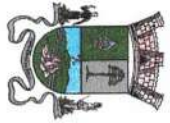
**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO

Artigos - Renda Variável Estruturado - Fundo Imobiliário	Resol. %	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP
		§	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	59.596.905,65	21,38%	10,00%	20,00%	30,00%	24.024.953,13
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	16.311.219,11	5,85%	1,00%	5,50%	10,00%	11.562.733,82
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	8.362.185,88
Artigo 11º	5,00%	520.350,43	0,19%	0,00%	0,50%	3,00%	7.841.835,45
<b>Total Renda Variável / Estruturado /Imobiliario</b>	<b>30,00%</b>	<b>76.428.475,19</b>	<b>27,42%</b>	<b>11,00%</b>	<b>26,00%</b>	<b>46,00%</b>	

Artigos Exterior	Resol. %	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite -			GAP
			%	%	%	%	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.805.016,16	1,01%	0,00%	3,00%	10,00%	25.068.936,77
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	15.878.904,98	5,70%	1,00%	5,00%	10,00%	11.995.047,95
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>18.683.921,14</b>	<b>6,70%</b>	<b>1,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>20,00%</b>	

**6) DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS**

Os recursos financeiros do Instituto de Previdência do Município de Itapacera da Serra, apresenta a seguinte distribuição quanto a gestores, administradores e Subsegmento de aplicações:



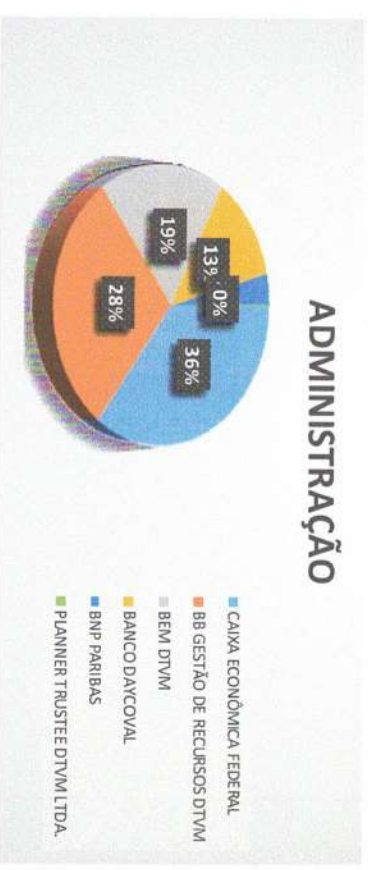
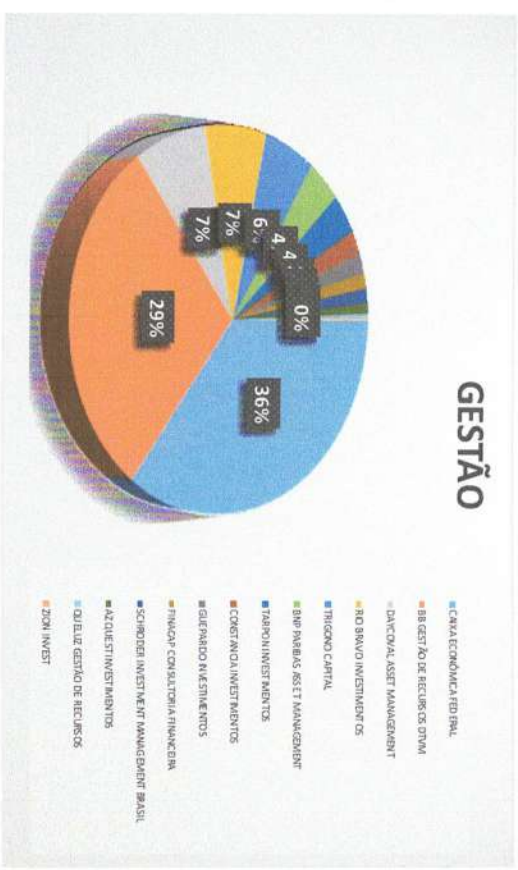
**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO

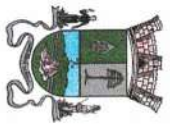
**Gestores**

Gestão	Valor	% s/ Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	94.674.998,22	33,97%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	75.149.264,92	26,96%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	19.635.789,61	7,04%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	17.250.510,58	6,19%
TRIGONO CAPITAL	15.276.109,39	5,48%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	10.176.547,42	3,65%
TARPON INVESTIMENTOS	9.441.083,96	3,39%
CONSTANCIA INVESTIMENTOS	5.590.145,27	2,01%
GUERPARDO INVESTIMENTOS	4.869.357,79	1,75%
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.580.997,21	1,28%
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL	3.531.106,09	1,27%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.585.410,32	0,93%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.037.161,59	0,37%
ZION INVEST	520.350,43	0,19%

**Administradores**

Administrador	Valor	% s/ Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	94.674.998,22	33,97%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	75.149.264,92	26,96%
BEM DTVM	48.851.440,45	17,53%
BANCO DAYCOVAL	33.946.231,36	12,18%
BNP PARIBAS	10.176.547,42	3,65%
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	520.350,43	0,19%

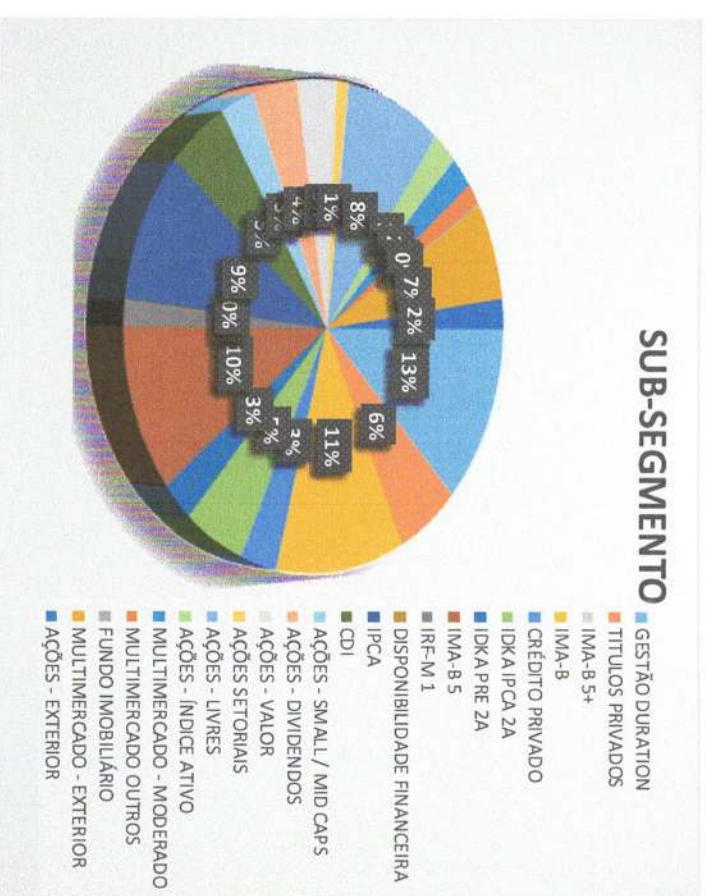


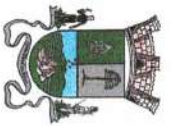


**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPÁ DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO

**Subsegmento das Aplicações**

Sub-Segmento	Valor	% s/Carteira	
GESTÃO DURATION	35.033.621,25	12,56%	GESTÃO DURATION
TÍTULOS PRIVADOS	15.420.696,47	5,53%	TÍTULOS PRIVADOS
IMA-B 5+			LONGUÍSSIMO PRAZO
IMA-B	30.852.031,90	11,06%	
CRÉDITO PRIVADO	8.446.947,44	3,03%	LONGO PRAZO
IDKA IPCA 2A	13.727.937,14	4,92%	
IDKA PRE 2A	7.236.349,52	2,59%	MEDIO PRAZO
IMA-B 5	28.872.475,14	10,35%	
IRF-M 1	4.452.758,79	1,60%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	172.400,55	0,06%	CURTO PRAZO
IPCA	26.246.699,40	9,41%	
CDI	13.337.615,89	4,78%	
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.612.440,67	2,73%	
AÇÕES - DIVIDENDOS	10.249.079,04	3,67%	
AÇÕES - VALOR	9.487.516,59	3,40%	
AÇÕES SETORIAIS	2.728.124,40	0,98%	AÇÕES
AÇÕES - LIVRES	23.205.742,18	8,32%	
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.314.002,77	2,26%	
MULTIMERCADO - MODERADO	6.174.584,10	2,21%	
MULTIMERCADO OUTROS	4.076.722,20	1,46%	MULTIMERCADO
FUNDO IMOBILIÁRIO	520.350,43	0,19%	FUNDO IMOBILIÁRIO
MULTIMERCADO - EXTERIOR	18.683.921,14	6,70%	
AÇÕES - EXTERIOR	6.059.912,81	2,17%	EXTERIOR





**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPÁ DA SERRA**  
**ESTADO DE SÃO PAULO**

**7) RISCO**

Value at Risk (VaR) é um método para avaliar o risco em operações financeiras. O VaR resume, em um número, o risco de um produto financeiro ou o risco de uma carteira de investimentos, de um montante financeiro. Esse número representa a pior perda esperada em um dado horizonte de tempo e é associado a um intervalo de confiança. Existem várias técnicas de avaliação do risco de operações financeiras, tais como Back Test, Stress Test, Expected Shortfall, além do Value at Risk. Essas técnicas visam quantificar o risco de mercado, ou seja, do risco de perdas monetárias decorrentes da variação de preços, de taxas de juros ou de taxas de câmbio.

Normalmente o VaR é calculado com 95%, 97,5% ou 99% de confiança. Este nível de confiança nos indica que é esperada perda maior que a calculada pelo VaR. Assim, ao utilizar 99% de confiança, espera-se que a cada 100 observações do VaR, em pelo menos 1 vez a perda do investimento financeiro seja superior à perda estimada no cálculo do VaR. Assim, com o auxílio da amostra e distribuição dos retornos do ativo que está em análise e o seu desvio padrão, o VaR calcula qual a probabilidade de perda máxima que se pode ter investindo naquele ativo com um intervalo de confiança. Por exemplo, o VaR calculado de um investimento é de 5% com um intervalo de confiança de 99%. Isso nos diz que a perda máxima que esse investimento pode sofrer é de 5%. Vale destacar que em casos como crise financeira, pandemias e eventos “fora da curva”, as perdas não podem ser mensuradas pelo VaR.

**Retorno dos investimentos e benchmark FEVEREIRO/2023**

**Renda Fixa**



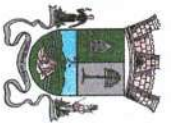
## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Não definido									
Ativos									
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	1,23%	1,80%	3,74%	-	-	-	0,20%	1,92%	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FIC RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	0,90%	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CDI									
Ativos									
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,83%	1,76%	2,74%	5,54%	11,14%	16,04%	0,80%	0,00%	0,30%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	0,23%	0,68%	1,88%	5,37%	12,55%	21,76%	0,35%	0,41%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDE...	1,35%	2,75%	4,11%	6,04%	10,88%	-	0,20%	1,28%	3,32%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRI...	0,90%	1,89%	2,95%	5,94%	11,87%	16,92%	1,00%	0,00%	0,34%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,77%	1,63%	2,53%	5,09%	10,12%	-	1,75%	0,01%	0,28%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,85%	1,90%	3,07%	6,38%	12,99%	19,80%	0,20%	0,04%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVID...	1,08%	2,43%	3,41%	6,59%	12,46%	19,86%	0,15%	0,42%	3,14%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-	-

IDKA IPCA 2 Anos									
Ativos									
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI...	1,48%	2,93%	4,20%	5,90%	10,95%	17,94%	0,20%	1,47%	3,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREV...	1,48%	2,95%	4,20%	6,00%	11,25%	18,21%	0,20%	1,45%	3,31%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,62%	3,08%	4,36%	6,05%	11,25%	18,71%	-	-	-



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPÁ, DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

IMA-B												
Ativos												
Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses				
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	1,36%	1,26%	1,04%	2,90%	7,68%	0,20%	2,45%	3,89%				
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	-1,72%	-1,53%	-1,61%	-0,22%	0,67%	0,20%	6,00%	6,12%				
IMA-B (Benchmark)	1,28%	1,28%	1,08%	3,02%	7,94%	-	-	-				

IMA-B 5												
Ativos												
Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses				
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1,71%	2,91%	3,26%	1,71%	-	0,20%	2,04%	-				
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1,39%	2,67%	3,55%	5,56%	10,96%	0,50%	1,15%	2,81%				
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,44%	2,79%	3,73%	5,73%	11,31%	0,20%	1,19%	3,04%				
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1,43%	2,79%	3,73%	5,76%	11,45%	0,20%	1,18%	3,01%				
IMA-B 5 (Benchmark)	1,41%	2,82%	3,79%	5,87%	11,57%	-	-	-				

IPCA												
Ativos												
Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses				
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIX...	1,04%	2,01%	3,17%	5,58%	11,28%	0,20%	0,28%	1,36%				
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	-	-	-	-	-	0,00%	-	-				
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	-	-	-	-	-	0,00%	-	-				
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,08%	1,99%	3,21%	5,33%	11,04%	0,40%	0,44%	1,74%				
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIX...	1,08%	1,63%	2,41%	4,63%	10,13%	0,30%	1,21%	1,39%				
IPCA (Benchmark)	0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	-	-	-				

IPCA + 6,00% ao ano												
Ativos												
Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses				
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	1,42%	2,76%	3,72%	5,79%	11,92%	0,20%	1,18%	2,82%				
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,26%	2,32%	3,48%	5,69%	11,91%	-	-	-				

IRF-M 1												
Ativos												
Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses				
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1,03%	2,10%	3,28%	6,40%	12,58%	0,20%	0,32%	0,47%				
IRF-M 1 (Benchmark)	0,98%	2,09%	3,30%	6,49%	12,81%	-	-	-				



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO

Renda Variável

Não definido									
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIME...	1,01%	1,72%	3,22%	-	-	-	1,20%	1,32	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CDI									
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,81%	1,98%	2,95%	5,79%	11,20%	15,43%	0,85%	0,69	1,43%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,87%	1,93%	3,12%	6,15%	13,21%	20,11%	0,70%	0,08	0,66%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	0,23%	0,67%	1,88%	5,37%	12,55%	21,76%	0,35%	0,41	1,12%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-	-

Ibovespa									
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,30%	0,50%	-0,04%	-0,39%	-	-	1,20%	1,62	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-7,23%	-4,34%	-6,30%	-3,66%	-6,06%	-11,97%	2,50%	8,17	23,07%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC...	-3,65%	-0,77%	-2,08%	-1,48%	10,98%	40,21%	2,00%	4,9	22,59%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	-3,27%	0,83%	-1,92%	2,63%	20,35%	-	2,50%	8,75	25,56%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-4,98%	-1,83%	-4,61%	-6,44%	-7,03%	-7,76%	2,00%	8,23	22,42%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-1,68%	-0,24%	-4,99%	-1,71%	7,65%	31,82%	2,00%	9,69	27,17%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-5,38%	-2,57%	-5,65%	-8,88%	-3,32%	0,31%	2,00%	7,21	21,22%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	-8,24%	-5,34%	-7,57%	-5,81%	-6,34%	-5,30%	1,50%	8,04	22,91%
FINACAP MAURITSSAD FI AÇÕES	-6,29%	-4,34%	-6,93%	-5,77%	-6,49%	5,10%	2,00%	7,4	19,80%
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,72%	-4,58%	-7,72%	-8,27%	-1,24%	19,59%	1,90%	10,5	28,53%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	-4,06%	-2,69%	-3,98%	-5,17%	-9,76%	3,07%	2,00%	7,9	27,78%
Ibovespa (Benchmark)	-7,49%	-4,38%	-6,72%	-4,19%	-7,26%	-4,64%	-	-	-



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
**ESTADO DE SÃO PAULO**

IBX		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
QUELUZ VALOR FI AÇÕES		-4,48%	-2,84%	-6,51%	-33,22%	-35,80%	-41,93%	2,00%	7,89	30,31%
IBX (Benchmark)		-7,59%	-4,34%	-6,85%	-4,76%	-8,23%	-5,60%	-	-	-

IFIX		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES F...		-10,80%	-20,92%	-30,75%	-45,34%	-16,48%	237,88%	1,60%	29,44	62,30%
IFIX (Benchmark)		-0,45%	-2,05%	-2,05%	-5,64%	2,45%	-2,71%	-	-	-

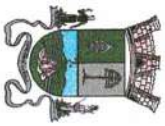
IPCA		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
SOI FIC AÇÕES		-6,91%	6,08%	-	-	-	-	0,00%	15,41	-
IPCA (Benchmark)		0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	16,73%	-	-	-

MSCI ACWI		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO ...		-0,38%	4,66%	-0,46%	4,91%	-0,63%	19,22%	1,20%	7,63	23,99%
MSCI ACWI (Benchmark)		-0,92%	3,71%	-1,93%	3,17%	-8,75%	-9,86%	-	-	-

MSCI USA Extended ESG Focus		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I		0,92%	2,19%	-2,78%	0,93%	-10,03%	-8,35%	1,00%	7,6	17,15%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)		-0,65%	3,28%	-4,48%	0,44%	-9,43%	-5,71%	-	-	-

SMLL		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
AZ QUEST SMALL MILD CAPS FIC AÇÕES		-4,97%	-2,86%	-4,61%	-8,39%	-12,30%	-18,97%	2,00%	5,47	22,06%
SMLL (Benchmark)		-10,52%	-7,90%	-10,68%	-16,48%	-20,22%	-30,84%	-	-	-





## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

### Investimento no Exterior

Global BDRX												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,98%	5,10%	0,06%	0,40%	-10,41%	-10,52%	0,70%	9,98	18,28%			
Global BDRX (Benchmark)	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-	-			
MSCI ACWI												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVE...	-0,80%	2,10%	2,30%	5,19%	-5,46%	-8,90%	0,85%	8,9	16,79%			
MSCI ACWI (Benchmark)	-0,92%	3,71%	-1,93%	3,17%	-8,75%	-9,86%	-	-	-			
MSCI USA Extended ESG Focus												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,92%	2,19%	-2,78%	0,93%	-10,03%	-8,35%	1,00%	7,6	17,15%			
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-0,65%	3,28%	-4,48%	0,44%	-9,43%	-5,71%	-	-	-			
MSCI WORLD												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMEN...	-0,60%	0,91%	-1,36%	2,43%	-5,83%	-2,73%	0,70%	4,98	15,17%			
MSCI WORLD (Benchmark)	-0,45%	4,10%	-1,86%	3,90%	-7,70%	-6,26%	-	-	-			

### 8) DELIBERAÇÕES

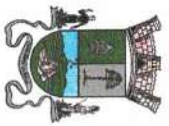
Deliberações do comitê de investimentos:

#### APLICAÇÃO

**CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP** - Aplicações de R\$ 2.000.000,00 em ativo de renda fixa de curto prazo para diversificação da carteira. Os recursos serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

#### RESGATE

**CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP** - Resgate de R\$5.000.000,00 para diversificação da carteira. Os recursos do resgate ficarão aplicado no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES até a realocação.



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**

**ESTADO DE SÃO PAULO**

**RESGATE**

**CAIXA NOVO BRASIL FIC RF IMA-B LP** - Resgate de R\$ 2.282.647,67 para diversificação da carteira. Os recursos do resgate ficarão aplicado no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES até a realocação

**RESGATE**

**CAIXA BRASIL IMA-B TPRF LP** - R\$2.228.207,65 para diversificação da carteira. Os recursos do resgate ficarão aplicado no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES até a realocação.

**APLICAÇÃO**

**CAIXA BRASIL IRF-M1 TP RF LP** - - Aplicações de R\$ 2.000.000,00 em ativo de renda fixa de curto prazo para diversificação da carteira. Os recursos serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

**RESGATE**

**CAIXA BRASIL IRF-M1 TP RF LP** - Resgate de R\$ 1.500.000,00 para diversificação da carteira. Os recursos do resgate ficarão aplicado no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES até a realocação.

**RESGATE**

**CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LP** - Resgate de R\$ 1.500.000,00 para diversificação da carteira. Os recursos do resgate ficarão aplicado no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES até a realocação

**APLICAÇÃO**

**BB IDKA 2 TP RF LP** – Aplicação da amortização de rendimentos semestrais no valor de R\$ 447.343,06 do fundo BB TP XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO.

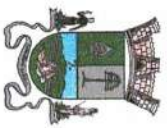
**RESGATE**

**CAIXA BR IDKA IPCA 2A TP RF LP** - Resgate de R\$ 2.000.000,00 para diversificação da carteira. Os recursos do resgate ficarão aplicado no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES até a realocação.

**RESGATE**

**CAIXA BR 2030 II TP RF LP** – Amortização de rendimentos semestrais no valor de R\$ 605.803,80. Os recursos do resgate ficarão aplicado no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES até a realocação.

**RESGATE**



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO

**CAIXA BR ATIVA TP** Resgate de R\$ 3.000.000,00 para diversificação da carteira. Os recursos do resgate ficarão aplicado no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES até a realocação.

**RESGATE**

**BB TP XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO** - Amortização de rendimentos semestrais no valor de R\$ 447.343,06. Os recursos da amortização serão aplicados no fundo BB IDKA 2 TP RF LP.

**APLICAÇÃO**

**RIO BRAVO ESTRATEGICO IMA-B FI RF** - Aplicações de R\$ 10.000.000,00 em ativo de renda fixa com estratégia de proteção ao capital investido para diversificação da carteira. Os recursos serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

**APLICAÇÃO**

**SQL FIC AÇÕES** - - Aplicações de R\$ 3.000.000,00 em ativo de renda variável para diversificação da carteira. Os recursos serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

**Repassse das contribuições dos entes** - Estima-se o recebimento de aproximadamente R\$ 3.100.000,00 (três milhões e cem mil reais) que serão utilizados aproximadamente R\$ 900.000,00 (Novecentos mil reais) para pagamento de benefícios e custeio do RPPS. O Saldo restante ficará aplicado no fundo CX BR DISPONIBILIDADE para futura diversificação da carteira.

**9) Análises Técnicas**

- A carteira do RPPS atende as especificações e enquadramentos e limites da resol. 3922/2010.
- A carteira do RPPS possui 76,99 % de liquidez, permitindo a manutenção do portfólio em casos de mudanças no cenário econômico.
- Não há desequilíbrio ou ativos em liquidação na carteira do RPPS.
- No fechamento de fevereiro, a carteira de investimentos encontra-se com rentabilidade abaixo da meta atuarial acumulada projetada.

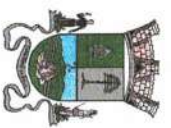
**10) Credenciamento**

**Distribuidores**

Distribuidores com credenciamento válidos.

**Gestores**

Gestores com credenciamento valido



## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

### **Administradores**

Administradores com credenciamento válido.

#### **11) Assuntos Gerais:**

Fevereiro foi marcado pela alta volatilidade, tanto no cenário nacional quanto no internacional, grandes são as expectativas com o novo governo do presidente eleito Lula, quanto ao andamento de reformas, quanto pelo arcabouço fiscal para cumprimentos das promessas de campanhas, quanto pela dívida herdada do governo anterior com subsídio que se enceraram em 21 de dezembro de 2022. As vésperas de completar um ano a Guerra na Ucrânia ainda stressam os mercados, com ameaças de guerra nuclear opor parte da Rússia se as ajudas principalmente de países europeus aumentarem. A disseminação da pandemia de Covid-19 ainda preocupa as economias, mas agora com focos da doença centralizados principalmente na China onde a pandemia começou devido a política de COVID O mas com baixa vacinação da população. A inflação domina os debates econômicos pela magnitude e persistência, uma nova recessão global já é discutida nos bastidores. O comitê de investimentos, desde outubro/2022 acompanha a evolução do fundo QUELUZ VALOR FIA, que desde a aplicação do RPPS em junho/2021 não apresenta retornos satisfatório e em linhas em comparação aos seus pares de mercado, no fechamento de SET/22 o fundo apresenta prejuízo em valor de R\$ 450.021.17 do capital investido de R\$ 2.000.000,00, o comitê de investimentos acompanha a rentabilidade do fundo para efetuar o resgate de no mínimo o capital investido para aplicação em ativos que traga retorno a carteira do RPPS.

Somado ao rendimento abaixo do esperado em outubro/2022 o fundo sofreu expressiva queda de mais de 25% em um dia, conforme fato relevante publicado pela Administradora do fundo, em reunião com os sócios da Queluz Asset Management e o distribuidor do fundo Atina Investimentos, justificando o ocorrido o Sócio da Queluz indicou que foi um fato isolado provocado pelo gestor do fundo Felipe Taylor e que o mesmo foi desligado da empresa após o fato. O comitê de investimento também solicitou parecer a consultoria de investimentos CREDITO E MERCADO e mesma justificou também que foi um fato isolado, apontou a rentabilidade histórica do fundo e da Asset que é satisfatório e também que foi um fato isolado provocado unicamente pelo gestor Felipe Taylor. O comitê manterá o acompanhamento ao fundo buscando a a melhor oportunidade de saída para proteção do capital previdenciário, e estuda ainda uma possível judicialização para ressarcimento dos prejuízos que ocorrerem futuramente. Com a SELLC alta até o final de 2022, os fundos vértices continuam atrativos para valorização dos recursos previdenciários, o comitê de investimentos avaliará novos aportes nesses fundos, com aportes pontuais em fundos de renda variável e investimentos no exterior para composição da carteira.

As atenções se voltam também para o embate entre o presidente Lula e o presidente do Banco Central devido a magnitude da taxa SELLC brasileira hoje em 13,75%, o governo tenta pressionar por uma baixa forçada da taxa para poder realizar investimentos necessários para atender as promessas de campanha, por outro lado, o COPOM, colegiado ao qual o presidente do BC faz parte sinalizada em suas atas um possível novo aumento da taxa em linha com as economias globais, totalmente contrário ao que pede o presidente, apesar da autonomia do BC, é provável de que o presidente do BC ser substituído nos próximos dias por ser indicado pelo governo.

### **NOVOS INVESTIMENTOS**



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**

ESTADO DE SÃO PAULO

**SQI FIC AÇÕES CNPJ: 48.181.725/0001-50**


No mês de dezembro/2022 foi apresentado ao comitê de investimentos em reunião promovida pelo distribuidor DOLLAR BILLS, o fundo SQI FIC AÇÕES, fundo mono ativo que compra cotas da empresa listada na bolsa SINQIA (SQIA3). A SINQIA é uma fintech que oferece sistemas, softwares e soluções tecnológicas para o sistema financeiro brasileiro, fundada em 1996 cresceu por meio de dezenas de fusões e aquisições. A companhia se beneficia do crescimento das fintechs brasileiras, com destaque para os bancos digitais e plataformas de investimentos, esse avanço também abre mercado para a Sinqia como fornecedora de soluções tecnológicas para bancos menores, que investem no digital e empresas não financeiras que expandem para o ecossistema financeiro digital. O comitê de investimentos ainda recebeu em janeiro/2023 os representantes da gestora do fundo Tarpon Asset Management para nova apresentação. Após análise favorável da consultoria de investimento Credito e Mercado, o comitê de investimentos deliberou pelo aporte no fundo SQI FIC AÇÕES no montante de R\$ 3.000.000,00, com alto potencial de crescimento nos próximos a opção de investimentos no fundo tornasse favorável, o fundo ainda possui curto prazo de investimentos (03 anos) o que não afeta o plano de concessão de benefícios, tornando-se boa opção de retorno maiores. O comitê de investimentos notificou o conselho Administrativo pelo ofício N°004/2023 a opção de investimentos no fundo, porem o conselho Administrativo não realizou reunião antes da aplicação, o comitê de investimentos se utilizou do artigo 4.1.2 da política de investimentos vigente.

**RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA CNPJ:49.232.373/0001-87**

Apresentado ao comitê de investimentos por intermediário do distribuidor PRIVATIZA AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTOS o fundo de capital protegido RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA, este fundo investe preponderantemente em ativos ligados ao IMA\_B mas com uma estratégia de proteção em caso de retorno negativos do índice IMA\_B. após análise positiva da consultoria de investimentos Credito e Mercado, o comitê deliberou pelo aporte neste fundo que possui estratégia de proteção do capital em aplicações no segmento de Ima-B em proteção dos investimentos do RPPS no cenário volátil também na renda fixa no ano de 2023. O fundo possui curto período de negociação, o que não interferirá no plano de concessão de benefícios do RPPS. O comitê de investimentos notificou o conselho Administrativo pelo ofício N°004/2023 a opção de investimentos no fundo, porem o conselho Administrativo não realizou reunião antes da aplicação, o comitê de investimentos se utilizou do artigo 4.1.2 da política de investimentos vigente.

  
**José Roberto dos Santos**  
Membro Comitê de investimento  
CPA-10/CGRPPS

  
**Alex Domingues de Castro Santos**  
Membro Comitê de investimento  
CPA-10/CGRPPS

  
**Rafael de Jesus Freitas**  
Membro Comitê de investimento  
CPA-10



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
**ESTADO DE SÃO PAULO**

**APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL**

O Conselho Fiscal, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, aprovou o relatório de investimentos, conforme registro na ata de reunião em anexo



**Conselho Fiscal do ITAPREV**

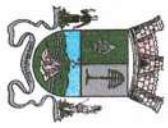
**REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO FISCAL**

Aos dias 15 de março dois mil e vinte três, às 13h30. **97ª (nonagésima sétima reunião)**, do Conselho Fiscal do ITAPREV, reunião ordinária com os senhores membros do Conselho Fiscal, realizada na Sala de Reuniões do Bloco B do Complexo Administrativo da Prefeitura, com Ana Maria Bondezan, Conceição Aparecida Borges Kusuki e o Conselheiro Evandro Ferreira Domingues. Conforme análise do Balancete de Receitas e Despesas do mês de janeiro de dois mil e vinte três, saldo de fechamento R\$ 280.772.424,78 (duzentos e oitenta milhões setecentos e setenta e dois mil quatrocentos e vinte e quatro reais e setenta e oito centavos). Conforme análise do Balancete de Receitas e Despesas do mês de fevereiro de dois mil e vinte três, saldo de fechamento R\$ 285.818.194,30 (duzentos e oitenta cinco milhões oitocentos e dezoito mil cento e noventa e quatro reais e trinta centavos). Em análise das Atas das Reuniões do Comitê de Investimentos, e considerando os dados constantes no Relatório Mensal de Investimentos apresentados, aprovou o Relatório. Foi encerrada esta reunião a qual lavro a ata e assinamos abaixo, ficando confirmada a próxima reunião para o dia 19 de abril dois mil e vinte e três, às 13h, neste mesmo local.

**Ana Maria Bondezan**  
Presidente do Conselho Fiscal

**Conceição Aparecida Borges Kusuki**  
Secretária do Conselho Fiscal

**Conselheiro Evandro Ferreira Domingues**  
Conselho Fiscal



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA**  
ESTADO DE SÃO PAULO



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**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	14.436.417,67	5,18%	675	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	18.473,14	0,01%	9.636	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.516.141,58	1,98%	965	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.745.861,20	4,21%	765	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.682.905,03	0,60%	527	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	10.678.375,17	3,83%	359	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	15.568.324,23	5,59%	339	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	2027-05-16	15.316.179,31	5,49%	74	5,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	19.116.326,68	6,86%	99	2,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.901.931,70	0,68%	332	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.597.826,39	0,57%	794	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.211.795,56	2,95%	936	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.236.349,52	2,60%	28	10,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.810.434,63	0,65%	926	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.452.758,79	1,60%	1.185	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	10.176.157,94	3,65%	2.433	6,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.693.139,19	2,04%	922	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.823.219,25	3,17%	124	1,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.724.071,86	2,05%	1.002	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	10.052.800,19	3,61%	14	7,92%	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
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	D+0		7.708.705,79	2,77%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	D+0		7.711.990,68	2,77%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	5.301.318,54	1,90%	112	2,31%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	3.145.628,90	1,13%	47.820	0,18%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.585.410,32	0,93%	3.535	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.769.094,17	3,15%	527	5,16%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	D+15	Não há	5.590.145,27	2,01%	3.485	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	6.314.002,77	2,27%	505	4,40%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSTAD FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.580.997,21	1,28%	264	1,54%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.869.357,79	1,75%	41	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	D+13	Não há	1.037.161,59	0,37%	56	3,18%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.133.543,18	0,77%	22	2,35%	Artigo 8º, Inciso I
SQI FIC AÇÕES	D+0	Não há	2.728.124,40	0,98%	6	11,77%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.782.272,12	1,72%	49	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.930.687,44	0,69%	189	1,27%	Artigo 8º, Inciso I
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.249.079,04	3,68%	20	1,94%	Artigo 8º, Inciso I
TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	5.027.030,35	1,80%	32	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTAVEL IS INVESTIMENTO ...	D+5 du	Não há	1.407.453,25	0,50%	53	3,70%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	1.397.562,91	0,50%	255	0,49%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	D+5	Não há	7.766.736,21	2,79%	13.204	1,18%	Artigo 9º, Inciso III

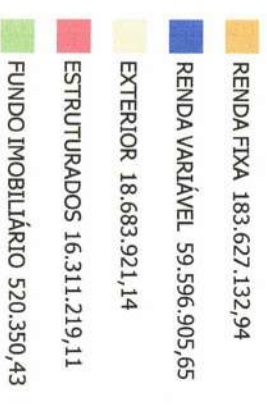
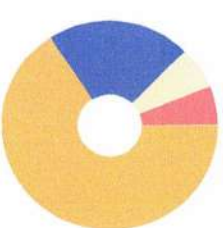
**Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	D+4	Não há	8.112.168,77	2,91%	502	0,41%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.042.891,50	0,73%	98	1,62%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.993.895,02	1,07%	8.152	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	4.076.722,20	1,46%	3.277	0,24%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO...	D+3 du	25 meses	3.066.017,79	1,10%	21	1,46%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	4.131.692,60	1,48%	20	2,55%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI ...	Não se ...	Não se aplica	520.350,43	0,19%		0,65%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		172.400,55	0,06%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			278.739.529,27				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			172.400,55				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			278.911.929,82				Artigo 6º



**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%	10,00%	40,00%	111.495.811,71
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	129.466.258,54	46,45%	15,00%	30,00%	90,00%	121.399.317,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	30.293.230,49	10,87%	2,00%	5,00%	50,00%	109.076.534,15
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	15.420.696,47	5,53%	0,00%	18,00%	20,00%	40.327.209,38
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	8.446.947,44	3,03%	0,00%	3,00%	5,00%	5.490.029,02
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>183.627.132,94</b>	<b>65,88%</b>	<b>17,00%</b>	<b>66,00%</b>	<b>205,00%</b>	

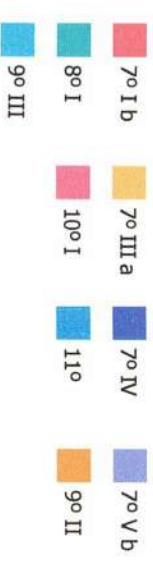
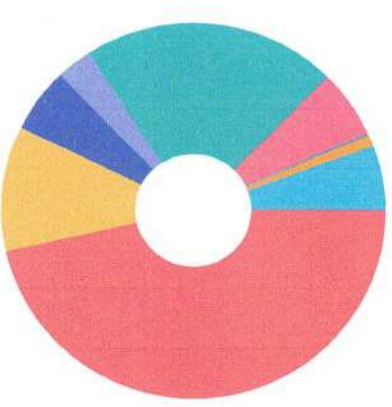




**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2023)**

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	59.596.905,65	21,38%	10,00%	20,00%	30,00%	24.024.953,13
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	16.311.219,11	5,85%	1,00%	5,50%	10,00%	11.562.733,82
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	8.362.185,88
Artigo 11º	5,00%	520.350,43	0,19%	0,00%	0,50%	3,00%	7.841.835,45
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>76.428.475,19</b>	<b>27,42%</b>	<b>11,00%</b>	<b>26,00%</b>	<b>46,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.805.016,16	1,01%	0,00%	3,00%	10,00%	25.068.936,77
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	15.878.904,98	5,70%	1,00%	5,00%	10,00%	11.995.047,95
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>18.683.921,14</b>	<b>6,70%</b>	<b>1,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>20,00%</b>	





# CRÉDITO & MERCADO

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPEÇERICA DA SERRA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2023

## Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2023)

Gestão	Valor	% SI Carteira	% SI/PL Gestão
CAIXA DTVM	94.674.998,22	33,97	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	75.149.264,92	26,96	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	19.635.789,61	7,04	0,17
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	17.250.510,58	6,19	1,10
TRIGONO CAPITAL	15.276.109,39	5,48	0,33
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	10.176.547,42	3,65	0,02
TARPON INVESTIMENTOS	9.441.083,96	3,39	0,15
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	5.590.145,27	2,01	0,34
GUERPARDO INVESTIMENTOS	4.869.357,79	1,75	0,15
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.580.997,21	1,28	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.531.106,09	1,27	0,04
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.585.410,32	0,93	0,01
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.037.161,59	0,37	-
ZION INVEST	520.350,43	0,19	-

## Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	129.466.258,54	46,45	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	30.293.230,49	10,87	2,00	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	8.446.947,44	3,03	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	59.596.905,65	21,38	10,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	2.805.016,16	1,01	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	15.878.904,98	5,70	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	16.311.219,11	5,85	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 11º	520.350,43	0,19	0,00	3,00

**Artigo 20º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)



**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>								
IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	3,08%	4,36%	6,05%	11,25%	18,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	2,95%	4,20%	6,00%	11,25%	18,21%	1,45%	0,03%
<b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>								
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,26%	2,32%	3,48%	5,69%	11,91%	31,16%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	1,39%	2,76%	3,72%	5,79%	11,92%	16,84%	1,18%	0,03%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>								
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,98%	2,09%	3,30%	6,49%	12,81%	17,61%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,97%	2,10%	3,28%	6,40%	12,58%	17,11%	0,32%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,41%	2,82%	3,79%	5,87%	11,57%	18,62%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,39%	2,79%	3,73%	5,76%	11,45%	18,22%	1,18%	0,03%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1,40%	2,79%	3,73%	5,73%	11,31%	17,99%	1,19%	0,03%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,35%	2,67%	3,55%	5,56%	10,96%	16,78%	1,15%	0,03%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,70%	2,91%	3,26%	1,71%	-	-	2,04%	-
<b>IMA-B (Benchmark)</b>								
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	1,28%	1,08%	3,02%	7,94%	8,94%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,27%	1,26%	1,04%	2,90%	7,68%	8,38%	2,45%	0,04%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,81%	-1,53%	-1,61%	-0,22%	0,67%	-3,83%	6,00%	0,06%

**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>CDI (Benchmark)</b>	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,80%	1,90%	3,07%	6,38%	12,99%	19,80%	0,04%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85%	1,89%	2,95%	5,94%	11,87%	16,92%	0,00%	0,00%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,18%	0,68%	1,88%	5,37%	12,55%	21,76%	0,41%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,79%	1,76%	2,74%	5,54%	11,14%	16,04%	0,00%	0,00%
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 AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,73%	1,63%	2,53%	5,09%	10,12%	-	0,01%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	2,75%	4,11%	6,04%	10,88%	-	1,28%	0,03%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	16,73%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,97%	2,01%	3,17%	5,58%	11,28%	13,35%	0,28%	0,01%
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%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,99%	1,99%	3,21%	5,33%	11,04%	14,26%	0,44%	0,02%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	1,05%	1,80%	3,74%	-	-	-	1,92%	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-



**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
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,90%	1,72%	3,22%	-	-	-	1,32%	-
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,82%	1,93%	3,12%	6,15%	13,21%	20,11%	0,08%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,99%	2,95%	5,79%	11,20%	15,43%	0,69%	0,01%
<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%	-	-
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	-7,86%	-4,34%	-6,30%	-3,66%	-6,06%	-11,97%	8,17%	0,23%
FINACAP MAURITSTAD FIC AÇÕES	-7,49%	-4,34%	-6,94%	-5,77%	-6,49%	5,10%	7,40%	0,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	-6,16%	-2,57%	-5,65%	-8,88%	-3,33%	0,31%	7,21%	0,21%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-5,94%	-1,83%	-4,61%	-6,44%	-7,03%	-7,76%	8,23%	0,22%
TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,00%	-0,77%	-2,08%	-1,48%	10,98%	40,21%	4,90%	0,23%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,69%	-4,58%	-7,72%	-8,27%	-1,24%	19,59%	10,50%	0,29%
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	-9,02%	-5,34%	-7,57%	-5,81%	-6,34%	-5,30%	8,04%	0,23%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-2,53%	-0,24%	-4,99%	-1,71%	7,65%	31,82%	9,69%	0,27%
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,19%	0,83%	-1,92%	2,63%	20,35%	-	8,75%	0,26%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	-6,50%	-2,69%	-3,98%	-5,17%	-9,76%	3,07%	7,90%	0,28%



**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>RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO</b>	0,28%	0,50%	-0,04%	-0,39%	-	-	1,62%	-
<b>IBX (Benchmark)</b>	-7,59%	-4,34%	-6,85%	-4,76%	-8,23%	-5,60%	-	-
<b>QUELUZ VALOR FI AÇÕES</b>	-5,07%	-2,84%	-6,51%	-33,22%	-35,80%	-41,93%	7,89%	0,30%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	-0,45%	-2,05%	-2,05%	-5,64%	2,45%	-2,71%	-	-
<b>BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11</b>	-12,21%	-20,92%	-30,75%	-45,34%	-16,48%	237,88%	29,44%	0,62%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	16,73%	-	-
<b>SOFI AÇÕES</b>	-9,34%	6,08%	-	-	-	-	15,41%	-
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	-0,92%	3,71%	-1,93%	3,17%	-8,75%	-9,86%	-	-
<b>CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP</b>	-1,75%	4,66%	-0,47%	4,91%	-0,63%	19,22%	7,63%	0,24%
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	-0,65%	3,28%	-4,48%	0,44%	-9,43%	-5,71%	-	-
<b>SMML (Benchmark)</b>	-10,52%	-7,90%	-10,68%	-16,48%	-20,22%	-30,84%	-	-
<b>AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES</b>	-5,37%	-2,86%	-4,62%	-8,39%	-12,30%	-18,97%	5,47%	0,22%



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

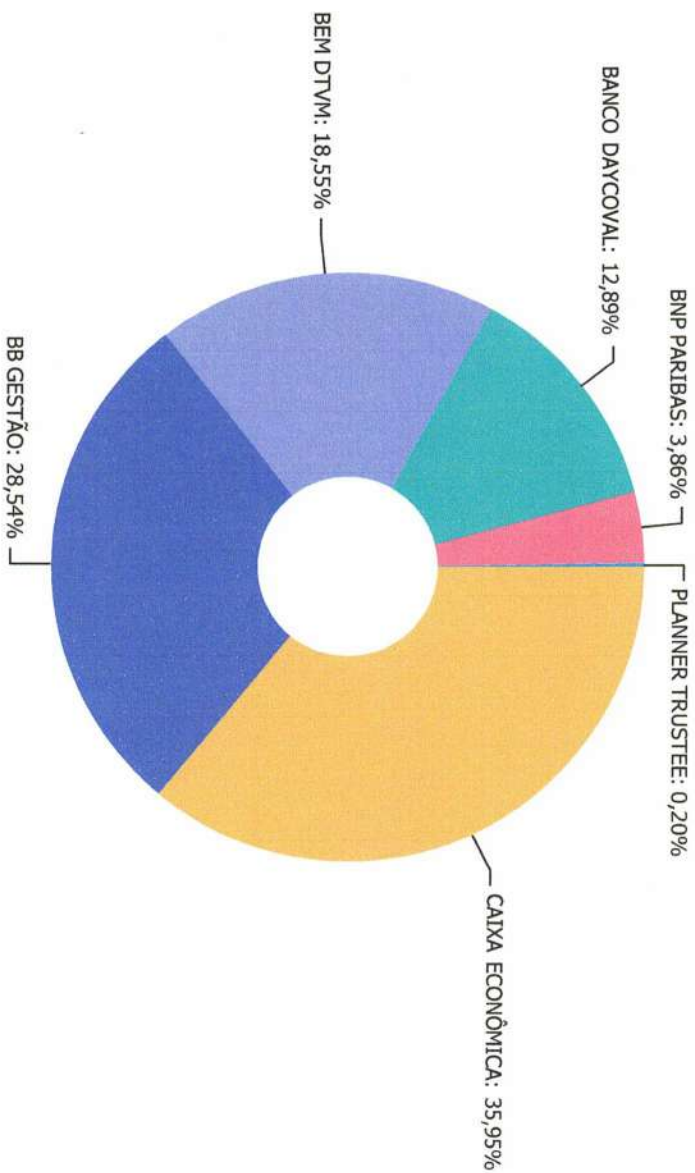
	Mes	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	-0,65%	3,28%	-4,48%	0,44%	-9,43%	-5,71%	-	-
BAÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	-	2,19%	-3,10%	-	-	-	7,60%	0,17%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	-	5,10%	0,14%	-	-	-	9,98%	0,18%
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	-0,45%	4,10%	-1,86%	3,90%	-7,70%	-6,26%	-	-
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIAÇ...	-	0,91%	-3,35%	-	-	-	4,98%	0,15%
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	-0,92%	3,71%	-1,93%	3,17%	-8,75%	-9,86%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-	2,10%	-0,50%	-	-	-	8,90%	0,17%



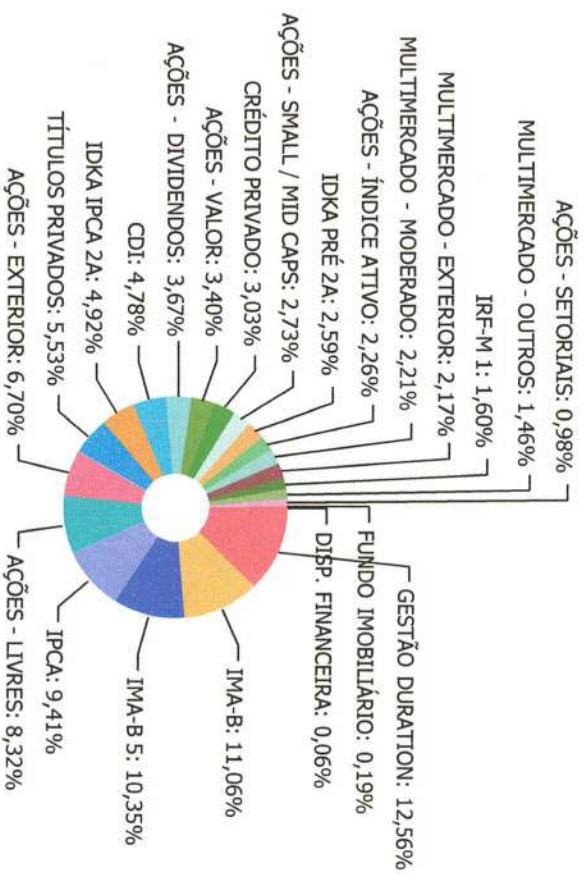
# CRÉDITO & MERCADO

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

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPEVERICA DA SERRA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2023



CAIXA ECONÔMICA	94.674.998,22
BB GESTÃO	75.149.264,92
BEM DTVM	48.851.440,45
BANCO DAYCOVAL	33.946.231,36
BNP PARIBAS	10.176.547,42
PLANNER TRUSTEE	520.350,43



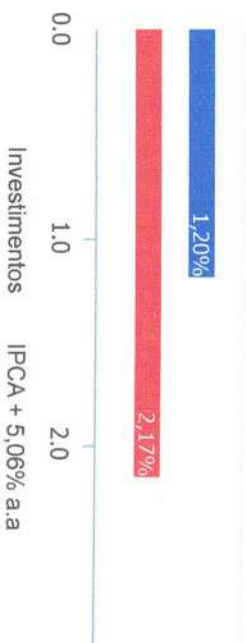
Sub-Segmento	Valor	Sub-Segmento	Valor	Sub-Segmento	Valor
■ GESTÃO DURATION	35.033.621,25	■ IMA-B	30.852.031,90	■ IMA-B 5	28.872.475,14
■ AÇÕES - LIVRES	23.205.742,18	■ AÇÕES - EXTERIOR	18.683.921,14	■ TÍTULOS PRIVADOS	15.420.696,47
■ CDI	13.337.615,89	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	10.249.079,04	■ AÇÕES - VALOR	9.487.516,59
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.612.440,67	■ IDKA PRÉ 2A	7.236.349,52	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.314.002,77
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.059.912,81	■ IRF-M 1	4.452.758,79	■ MULTIMERCADO - OUTROS	4.076.722,20
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	520.350,43	■ DISP. FINANCEIRA	172.400,55		



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023**

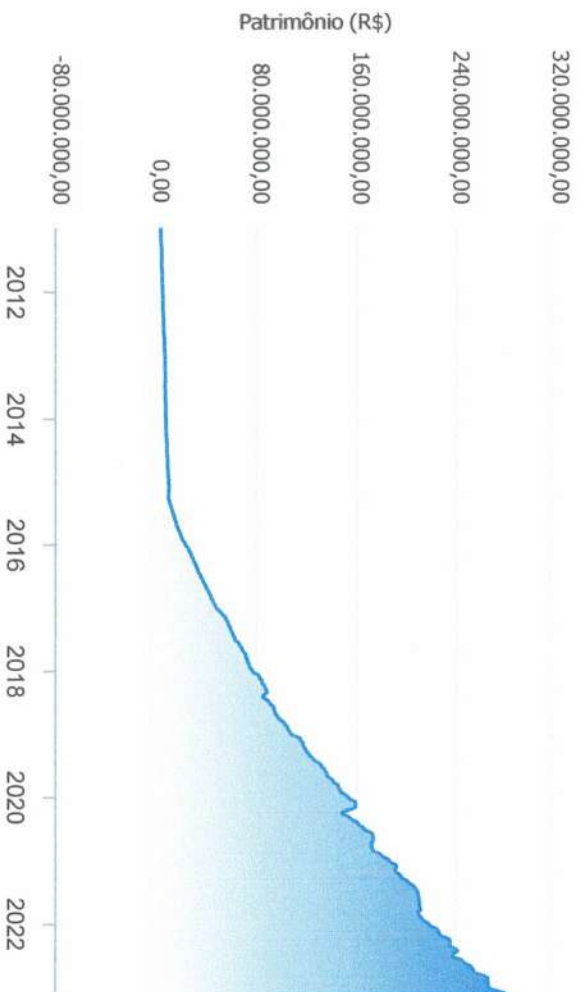
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	Var
Janeiro	263.411.729,77	10.897.991,24	5.634.066,11	273.219.972,55	4.544.317,65	4.544.317,65	1,69%	1,69%	0,96%	0,96%	176,19%	3,54%
Fevereiro	273.219.972,55	32.905.272,17	31.765.834,85	273.027.916,94	-1.331.492,93	3.212.824,72	-0,49%	1,20%	1,20%	2,17%	55,26%	3,85%

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**





Evolução do Patrimônio



ANO

36M

Investimentos

Meta de Rentabilidade

CDI

IMA-B

IMA-B 5

IMA-B 5+

IMA Geral

IRF-M

IRF-M 1

IRF-M 1+

Ibovespa

IBX

SMLL

IDIV

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

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.059.590,37	0,00	0,00	15.316.179,31	256.588,94	1,70%	1,70%	2,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	2.245.231,36	0,00	2.282.647,67	0,00	37.416,31	1,67%	1,22%	2,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.191.868,81	0,00	2.228.207,65	0,00	36.338,84	1,66%	1,26%	2,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.583.817,25	0,00	0,00	11.745.861,20	162.043,95	1,40%	1,40%	1,19%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	5.228.762,54	0,00	0,00	5.301.318,54	72.556,00	1,39%	1,39%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.994.089,73	447.343,06	0,00	5.516.141,58	74.708,79	1,37%	1,49%	1,45%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	10.040.757,52	0,00	0,00	10.176.157,94	135.400,42	1,35%	1,35%	1,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.266.766,64	0,00	1.500.000,00	1.810.434,63	43.667,99	1,34%	1,39%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	15.804.456,81	0,00	447.343,06	15.568.324,23	211.210,48	1,34%	1,34%	1,28%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.468.554,90	0,00	605.803,80	19.116.326,68	253.575,58	1,30%	-1,81%	6,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.661.843,80	0,00	0,00	1.682.905,03	21.061,23	1,27%	1,27%	2,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.118.709,29	2.000.000,00	0,00	8.211.795,56	93.086,27	1,15%	1,50%	1,47%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	7.161.107,26	0,00	0,00	7.236.349,52	75.242,26	1,05%	1,05%	1,92%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	7.634.050,57	0,00	0,00	7.711.990,68	77.940,11	1,02%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	7.631.969,33	0,00	0,00	7.708.705,79	76.736,46	1,01%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	14.296.775,40	0,00	0,00	14.436.417,67	139.642,27	0,98%	0,98%	1,21%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.582.554,73	0,00	0,00	1.597.826,39	15.271,66	0,97%	0,97%	0,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	10.581.567,78	0,00	0,00	10.678.375,17	96.807,39	0,91%	0,91%	0,42%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	11.717.249,82	0,00	3.000.000,00	8.823.219,25	105.969,43	0,90%	0,99%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.850.186,93	0,00	206.476,70	5.693.139,19	49.428,96	0,84%	0,85%	0,00%



**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 AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18.662,47	0,00	323,43	18.473,14	134,10	0,72%	0,73%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.914.678,42	2.000.000,00	1.500.000,00	4.452.758,79	38.080,37	0,64%	0,97%	0,32%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.665.385,97	2.000.000,00	5.000.000,00	5.724.071,86	58.685,89	0,55%	0,80%	0,04%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.052.800,19	52.800,19	0,53%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3.139.975,42	0,00	0,00	3.145.628,90	5.653,48	0,18%	0,18%	0,41%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	3.624.620,69	13.457.929,11	15.201.832,67	1.901.931,70	21.214,57	0,12%	0,79%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>183.483.233,81</b>	<b>29.905.272,17</b>	<b>31.972.634,98</b>	<b>183.627.132,94</b>	<b>2.211.261,94</b>	<b>1,21%</b>		<b>1,69%</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 (%)	(%) Insti	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.906.346,66	0,00	0,00	4.782.272,12	-124.074,54	-2,53%	-2,53%	9,69%
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.056.026,59	0,00	0,00	4.869.357,79	-186.668,80	-3,69%	-3,69%	10,50%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	5.236.711,58	0,00	0,00	5.027.030,35	-209.681,23	-4,00%	-4,00%	4,90%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.696.791,27	0,00	0,00	10.249.079,04	-447.712,23	-4,19%	-4,19%	8,75%
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	1.092.524,47	0,00	0,00	1.037.161,59	-55.362,88	-5,07%	-5,07%	7,89%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.732.202,07	0,00	0,00	2.585.410,32	-146.791,75	-5,37%	-5,37%	5,47%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9.323.266,74	0,00	0,00	8.769.094,17	-554.172,57	-5,94%	-5,94%	8,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	5.957.118,92	0,00	0,00	5.590.145,27	-366.973,65	-6,16%	-6,16%	7,21%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	2.064.901,72	0,00	0,00	1.930.687,44	-134.214,28	-6,50%	-6,50%	7,90%
FINACAP MAURITSSSTAD FIC AÇÕES	3.871.083,62	0,00	0,00	3.580.997,21	-290.086,41	-7,49%	-7,49%	7,40%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	6.852.762,03	0,00	0,00	6.314.002,77	-538.759,26	-7,86%	-7,86%	8,17%
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	2.344.927,50	0,00	0,00	2.133.543,18	-211.384,32	-9,01%	-9,01%	8,04%
SQI FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	2.728.124,40	-271.875,60	-9,06%	-9,34%	15,41%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FIL - ...	592.686,14	0,00	0,00	520.350,43	-72.335,71	-12,20%	-12,20%	29,44%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>60.727.349,31</b>	<b>3.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>60.117.256,08</b>	<b>-3.610.093,23</b>	<b>-5,66%</b>		<b>8,56%</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
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3.038.606,43	0,00	0,00	3.066.017,79	27.411,36	0,90%	0,90%	1,32%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	4.043.391,23	0,00	0,00	4.076.722,20	33.330,97	0,82%	0,82%	0,08%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.027.318,61	0,00	0,00	2.042.891,50	15.572,89	0,77%	0,77%	0,69%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.051.802,65	0,00	0,00	8.112.168,77	60.366,12	0,75%	0,75%	9,98%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.392.713,95	0,00	0,00	1.397.562,91	4.848,96	0,35%	0,35%	8,90%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	7.743.024,96	0,00	0,00	7.766.736,21	23.711,25	0,31%	0,31%	7,60%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	4.120.015,97	0,00	0,00	4.131.692,60	11.676,73	0,28%	0,28%	1,62%
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO...	1.414.127,27	0,00	0,00	1.407.453,25	-6.674,02	-0,47%	-0,47%	4,98%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.047.237,86	0,00	0,00	2.993.895,02	-53.342,84	-1,75%	-1,75%	7,63%
<b>Total Exterior</b>	<b>34.878.238,83</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>34.995.140,25</b>	<b>116.901,42</b>	<b>0,34%</b>		<b>5,57%</b>