

# 2023

## Relatório Mensal

### Janeiro

### Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, item 3.2.6 Nível 1, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.





Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	98.496.874,81	9,18%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.195.311,33	0,11%	6.574.841.764,48	0,02%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	82.120.429,85	7,65%	5.664.338.306,58	1,45%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.880.902,65	1,11%	5.926.967.108,44	0,20%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.709.936,87	1,74%	6.562.900.517,46	0,29%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.370.813,64	1,81%	175.946.256,35	11,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.100.014,23	0,48%	2.846.054.203,16	0,18%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.266.168,08	1,24%	237.946.634,26	5,58%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.749.109,47	1,28%	3.389.466.663,61	0,41%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.287.573,66	0,49%	5.210.677.767,90	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.786.435,08	4,45%	6.830.711.830,39	0,70%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.127.552,76	3,55%	7.844.346.137,20	0,49%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.103.108,72	2,06%	6.631.421.970,83	0,33%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	24.845.055,73	2,32%	722.487.782,65	3,44%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	34.357.395,33	3,20%	909.292.349,38	3,78%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	35.337.093,12	3,29%	15.285.936.736,43	0,23%	7º III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.450.646,70	0,51%	319.399.280,50	1,71%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.380.701,19	1,43%	2.164.364.253,13	0,71%	7º III a
MAG FI RENDA FIXA	22.597.341,19	2,11%	451.545.253,44	5,00%	7º III a
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	48.034.933,41	4,48%	529.470.986,22	9,07%	7º III a
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	23.163.103,70	2,16%	525.852.212,07	4,40%	7º III a
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	8.167,93	0,00%	0,00		7º V a
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.138.665,62	1,04%	287.658.144,60	3,87%	7º V b
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1.200.779,40	0,11%	28.315.352,56	4,24%	7º V b
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.027.596,30	0,47%	206.121.918,54	2,44%	8º I
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	19.055.279,88	1,78%	304.530.953,62	6,26%	8º I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	14.876.856,13	1,39%	300.903.956,27	4,94%	8º I

**Investimentos**

\$ 1.073.005.377,88

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 44.929,84

**Total Carteira**

\$ 1.073.050.307,72

**Governança (Pró Gestão)**

NIVEL 2 27/08/2024

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.299.492,10	0,87%	1.448.491.252,20	0,64%	8º I	Investimentos
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.045.209,05	1,03%	449.013.561,06	2,46%	8º I	\$ 1.073.005.377,88
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	14.064.220,28	1,31%	385.813.980,58	3,65%	8º I	Disponibilidades Financeiras
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.701.701,98	0,53%	1.435.113.157,11	0,40%	8º I	\$ 44.929,84
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.853.670,21	0,64%	37.460.046,41	18,30% ▲	8º I	Total Carteira
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	80.097.205,52	7,46%	1.234.110.529,44	6,49%	8º I	\$ 1.073.050.307,72
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	20.584.356,66	1,92%	915.770.265,91	2,25%	8º I	Governança (Pró Gestão)
META VALOR FI AÇÕES	18.517.393,10	1,73%	236.322.350,81	7,84%	8º I	📄 NIVEL 2 27/08/2024
MULTINVEST FI AÇÕES	5.408.213,31	0,50%	57.617.848,55	9,39%	8º I	
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	2.531.132,66	0,24%	20.140.814,81	12,57%	8º I	
OCCAM FIC AÇÕES	31.342.099,56	2,92%	1.046.806.300,19	2,99%	8º I	
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	53.657.815,35	5,00%	337.840.119,68	15,88% ▲	8º I	
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.236.378,23	0,67%	129.656.756,96	5,58%	8º I	
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.938.066,58	0,18%	346.753.055,62	0,56%	8º I	
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6.231.659,11	0,58%	183.613.336,38	3,39%	9º II	
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	9.039.246,22	0,84%	6.800.000.000,00	0,13%	9º II	
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO E...	10.185.749,35	0,95%	14.900.000.000,00	0,07%	9º II	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	12.034.492,32	1,12%	286.065.832,19	4,21%	9º II	
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	20.671.814,14	1,93%	666.179.313,31	3,10%	9º III	
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.183.063,38	0,11%	115.004.325,52	1,03%	9º III	
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.977.083,36	0,37%	26.064.757,13	15,26% ▲	9º III	
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.019.914,65	0,47%	1.448.474.101,11	0,35%	9º III	
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.334.853,28	0,22%	124.955.047,37	1,87%	10º I	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	25.242.265,06	2,35%	494.455.251,27	5,11%	10º I	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	6.876.730,05	0,64%	46.139.970,70	14,90%	10º I	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	10.398.321,49	0,97%	131.153.175,44	7,93%	10º I	
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	15.442.764,26	1,44%	161.665.059,83	9,55%	10º I	

*[Handwritten signatures and initials in blue ink]*

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	17.589.858,00	1,64%	2.530.614.285,59	0,70%	10º II
LA SHOPPING CENTERS FIP MULTIESTRATÉGIA	6.261.011,30	0,58%	305.892.941,09	2,05%	10º II
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.493.392,03	0,14%	0,00		11º
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.902.856,78	0,27%	90.855.594,26	3,20%	11º
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	10.175.501,73	0,95%	0,00		11º

Investimentos

💰 1.073.005.377,88

Disponibilidades Financeiras

💰 44.929,84

Total Carteira

💰 1.073.050.307,72

Governança (Pró Gestão)

📄 NIVEL 2 27/08/2024

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2024	18/08/2022	A mercado	7.607	4.109,157710	31.258.362,70
NTN-B - 15/05/2035	17/08/2022	A mercado	17.040	3.945,922072	67.238.512,11

Investimentos  
\$ 1.073.005.377,88

Disponibilidades Financeiras  
\$ 44.929,84

Total Carteira  
\$ 1.073.050.307,72

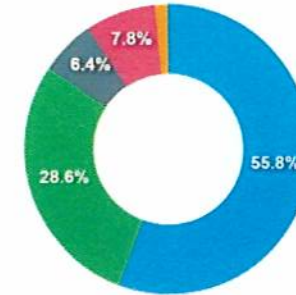
Governança (Pró Gestão)  
📅 NIVEL 2 27/08/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	9,18%	98.496.874,81 90,82% 974.553.432,91
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	25,97%	278.697.356,34 74,03% 794.352.951,38
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	19,49%	209.166.270,37 50,51% 541.968.945,03
7º V a - FIDC Cota Sênior	10,00%	0,00%	8.167,93 10,00% 107.296.862,84
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	10,00%	1,15%	12.339.445,02 8,85% 94.965.585,75
8º I - Fundos de Ações	40,00%	28,63%	307.236.686,90 11,37% 121.983.436,19
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,49%	37.491.147,00 6,51% 69.813.883,77
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,88%	30.851.875,53 7,12% 76.453.155,24
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,62%	60.294.934,14 4,38% 47.010.096,63
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	2,22%	23.850.869,30 2,78% 29.801.646,09
11º - Fundos Imobiliários	10,00%	1,36%	14.571.750,54 8,64% 92.733.280,23

Governança (Pró Gestão)

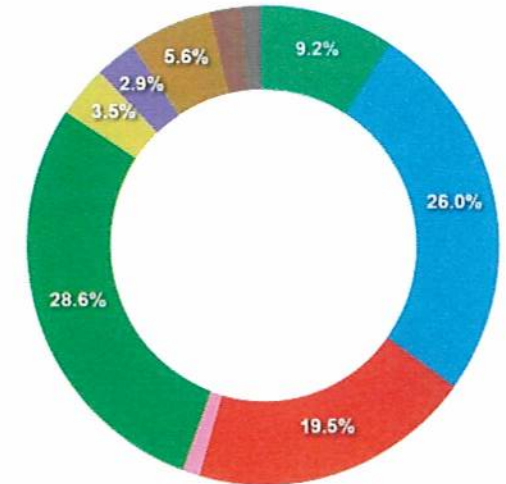
NIVEL 2 27/08/2024

Segmentos



Renda Fixa  
Renda Variável  
Exterior  
Estruturados  
Fundo Imobiliário

Artigos



Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	9,18%	5,00%	10,00%	20,00%	116.113.186,73	8º I - Fundos de Ações	28,63%	30,00%	33,00%	40,00%	121.983.436,19
7º I b - FI 100% Títulos TN	25,97%	15,00%	19,00%	40,00%	150.522.766,75	9º II - Constituídos no Brasil	3,49%	2,00%	5,00%	10,00%	69.813.883,77
7º III a - FI Referenciados RF	19,49%	5,00%	14,00%	40,00%	220.053.852,72	9º III - Ações - BDR Nível I	2,88%	2,00%	5,00%	10,00%	76.453.155,24
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	32.191.509,23	10º I - Fundos Multimercados	5,62%	2,00%	3,00%	8,00%	25.549.090,48
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	32.183.341,30	10º II - Fundos em Participaçõ...	2,22%	0,00%	2,00%	5,00%	29.801.646,09
7º V b - Fundos de RF - Crêdit...	1,15%	4,00%	6,00%	10,00%	94.965.585,75	11º - Fundos Imobiliários	1,36%	0,00%	2,00%	5,00%	39.080.764,85



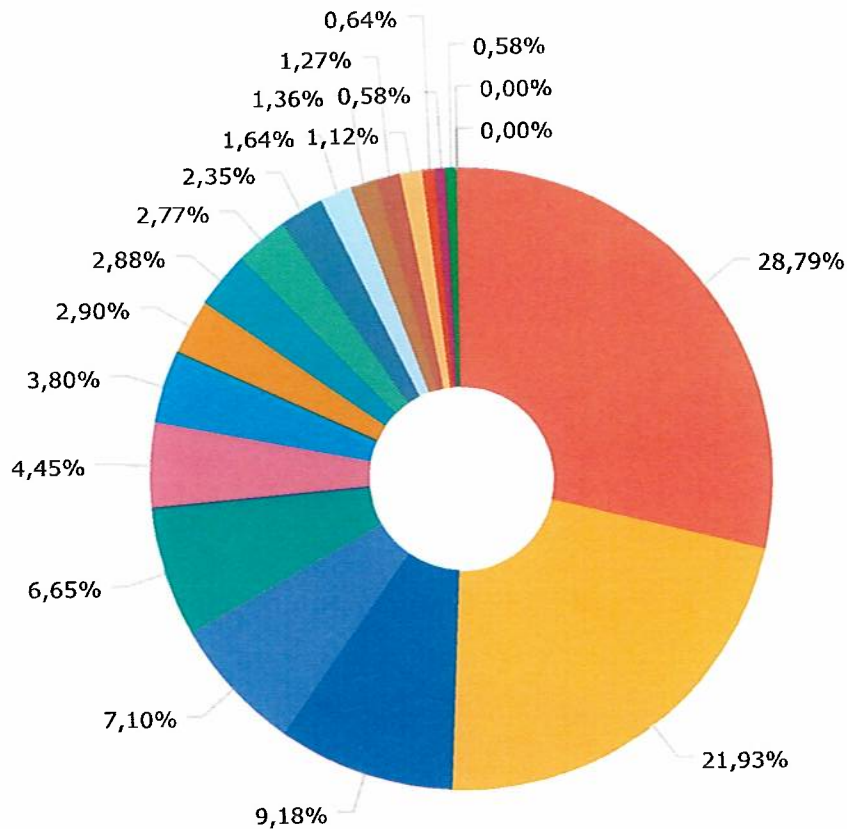
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>NÃO DEFINIDO - BENCHMARK</b>								
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	1,92	1,92					7,22	15,21
<b>CDI - BENCHMARK</b>								
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,10	0,10	2,44	6,37	13,03	21,16	0,99	2,08
MAG FI RENDA FIXA	1,09	1,09	3,32	6,79	13,01	18,94	0,02	0,04
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,09	1,09	3,28	6,72	12,90	19,34	0,05	0,10
	1,21	1,21	2,62	6,13	11,45	13,29	0,59	1,23
<b>CDI + 3,50% AO ANO - BENCHMARK</b>								
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1,43	1,43	4,20	8,56	16,76	26,89		
<b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>								
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,37	4,37	7,06	-3,63	-16,72	-5,42		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,79	1,79	2,08	-4,18	-15,19	-1,59	8,22	17,31
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,88	1,88	3,05	-3,51	-15,53	-4,97	8,14	17,15
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,05	3,05	-0,65	-4,95	-19,95	-15,59	8,80	18,53
	5,11	5,11	5,36	-5,27	-23,54	-17,42	9,55	20,11
<b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>								
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,84	1,84	-4,05	7,43	3,98	-8,02	7,87	16,58
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,67	1,67	0,80	6,86	3,84		3,62	7,62
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,94	3,94	-3,74	7,30	3,49	8,97	9,12	19,20
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,83	3,83	-6,87	3,78	2,02	4,15	8,29	17,46
OCCAM FIC AÇÕES	3,34	3,34	-1,37	10,15	1,85	-7,39	9,31	19,61
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	2,75	2,75	-5,24	8,21	0,82	-3,26	7,93	16,70
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	3,33	3,33	-1,67	7,26	0,34	-3,51	9,58	20,18
	3,71	3,71	-2,37	9,46	-3,43	-3,51	9,02	19,00

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,74	3,74	-5,38	6,78	-4,03	-11,33	8,90	18,73
SULAMÉRICA EQUITIES FIC AÇÕES	2,87	2,87	-4,52	8,73	-4,86	-17,92	10,30	21,69
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,66	4,66	-6,75	5,94	-4,99	-31,52	8,04	16,93
MULTINVEST FIC AÇÕES	3,74	3,74	-6,15	0,40	-8,96	-18,06	10,52	22,15
4UM SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,98	0,98	-14,12	0,02	-9,75	-8,96	11,65	24,53
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	11,15	11,15	18,75	2,77	-24,33	-37,97	10,07	21,21
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	7,54	7,54	5,67	0,53	-25,58	-40,97	14,22	29,94
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,21	0,21	-1,09	3,65			1,40	2,94
<b>IBX - BENCHMARK</b>	<b>3,51</b>	<b>3,51</b>	<b>-2,34</b>	<b>9,39</b>	<b>0,75</b>	<b>-1,38</b>		
META VALOR FIC AÇÕES	4,90	4,90	-6,65	11,74	-6,11	-16,49	13,12	27,64
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,65	2,65	-9,11	2,60	-8,68	-13,68	6,87	14,46
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	8,33	8,33	-9,29	9,21	-12,74	-13,29	13,47	28,38
<b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>	<b>1,44</b>	<b>1,44</b>	<b>1,90</b>	<b>3,99</b>	<b>10,86</b>	<b>16,26</b>		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,41	1,41	1,94	4,22	10,56	15,58	1,19	2,51
<b>IMA-B - BENCHMARK</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>-0,99</b>	<b>2,84</b>	<b>7,15</b>	<b>5,93</b>		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01	-0,01	-1,03	2,70	6,90	5,39	2,90	6,11
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,06	-0,06	-1,78	1,79	6,03	4,43	2,95	6,22
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,39	1,39	2,20	1,37	4,62	2,47	0,93	1,96
<b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>	<b>1,40</b>	<b>1,40</b>	<b>2,01</b>	<b>4,40</b>	<b>11,19</b>	<b>16,27</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11	1,11	3,26	6,67	14,65	22,60	0,00	0,00
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37	1,37	1,95	4,36	11,08	15,87	1,14	2,40
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,37	1,37	1,92	4,27	10,93	15,65	1,15	2,42
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1,37	1,37	1,92	4,24	10,86	14,85	1,15	2,41

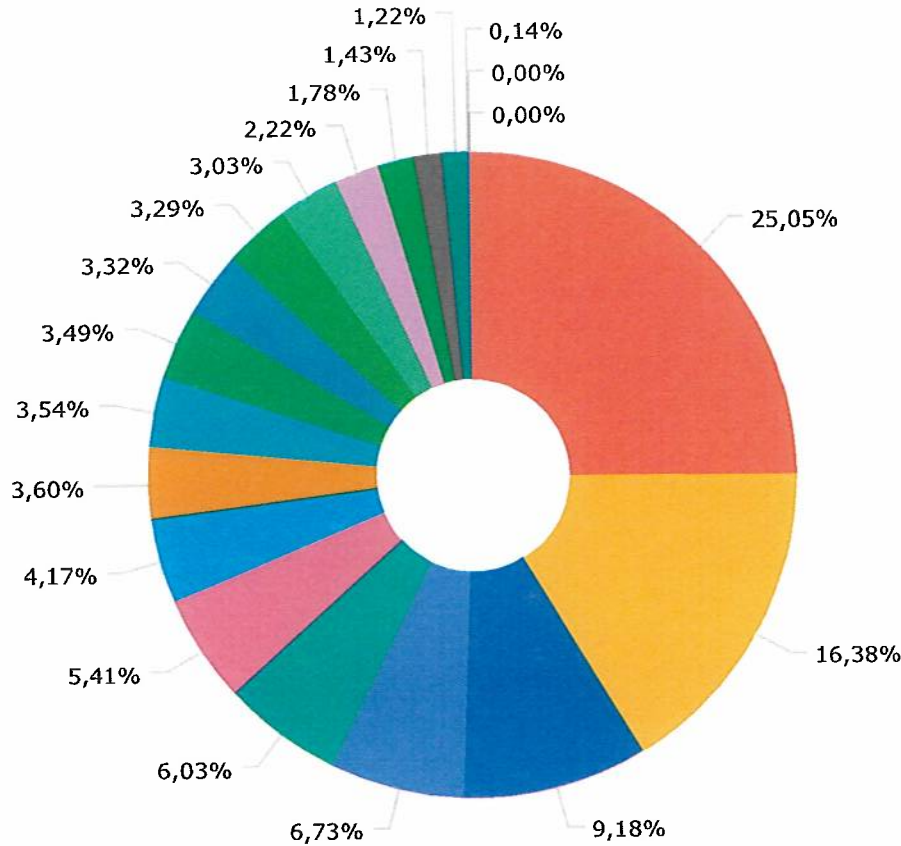


	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,36	1,36	1,93	4,22	10,70	14,87	1,14	2,40
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,21	1,21	3,24	1,09	6,15	17,33	0,24	0,51
<b>IPCA - BENCHMARK</b>	<b>0,53</b>	<b>0,53</b>	<b>1,57</b>	<b>1,50</b>	<b>5,77</b>	<b>16,75</b>		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04	1,04	2,28	6,11	11,10	11,70	0,39	0,81
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,39	1,39	2,20	4,46	10,57		0,93	1,96
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,15	1,15	1,06	3,98	10,23		1,41	2,96
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65	0,65	1,30	4,80	9,80	11,11	1,44	3,04
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57	0,57	0,95	4,72	9,11	9,83	1,76	3,72
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,50	0,50	-0,90	2,12	7,81	13,13	2,23	4,69
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	-1,02	-1,02	-1,35	1,26	6,74	10,75	2,62	5,51
<b>IPCA + 8,00% AO ANO - BENCHMARK</b>	<b>1,21</b>	<b>1,21</b>	<b>3,54</b>	<b>5,49</b>	<b>14,24</b>	<b>36,18</b>		
LA SHOPPING CENTERS FIP MULTISTRATÉGIA	-0,14	-0,14	97,32	96,92	106,18	-42,15		
<b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>	<b>1,10</b>	<b>1,10</b>	<b>3,25</b>	<b>6,75</b>	<b>12,54</b>	<b>16,51</b>		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12	1,12	3,23	6,66	12,31	16,01	0,24	0,51
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06	1,06	3,16	6,58	12,22	15,86	0,26	0,54
<b>S&amp;P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK</b>	<b>6,18</b>	<b>6,18</b>	<b>5,28</b>	<b>-1,30</b>	<b>-9,72</b>	<b>9,76</b>		
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6,38	6,38	7,48	7,64	3,25	31,03	7,52	15,83
<b>SMLL - BENCHMARK</b>	<b>2,92</b>	<b>2,92</b>	<b>-11,39</b>	<b>3,51</b>	<b>-15,47</b>	<b>-24,13</b>		
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	5,36	5,36	-11,35	5,08	-5,27	-15,30	12,51	26,35
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,66	2,66	-8,51	2,61	-7,90	-13,09	6,85	14,42
<b>IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK</b>	<b>1,04</b>	<b>1,04</b>	<b>3,06</b>	<b>4,51</b>	<b>12,12</b>	<b>31,18</b>		

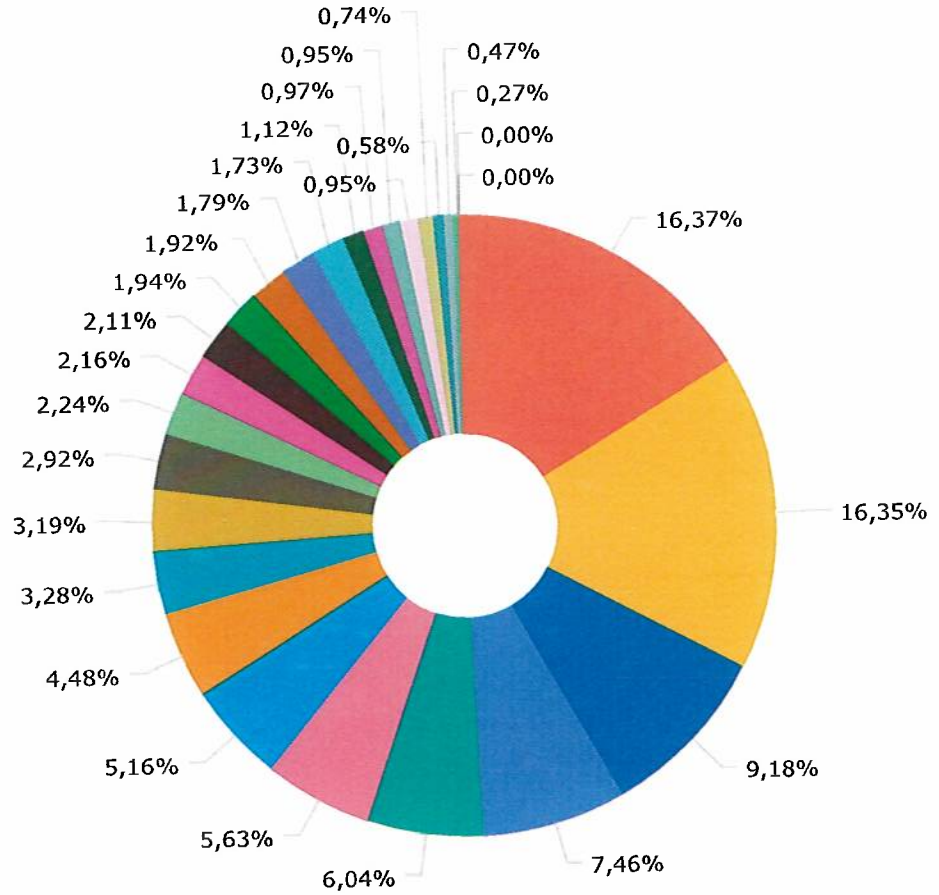
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA</b>	-0,11	-0,11	-0,32	-1,01	59,97	79,40		
<b>MSCI WORLD - BENCHMARK</b>	4,58	4,58	6,03	-0,33	-13,34	-2,56		
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11,38	11,38	-1,91	-7,50	-42,19	-58,97	23,89	50,32
<b>MSCI ACWI - BENCHMARK</b>	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09		
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1,74	1,74	10,26	1,09	-10,98	-4,37	10,91	22,97
<b>IFIX - BENCHMARK</b>	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03		
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-9,93	-9,93	-32,98	-44,66	22,12	-26,38	19,96	42,03
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11								
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11								



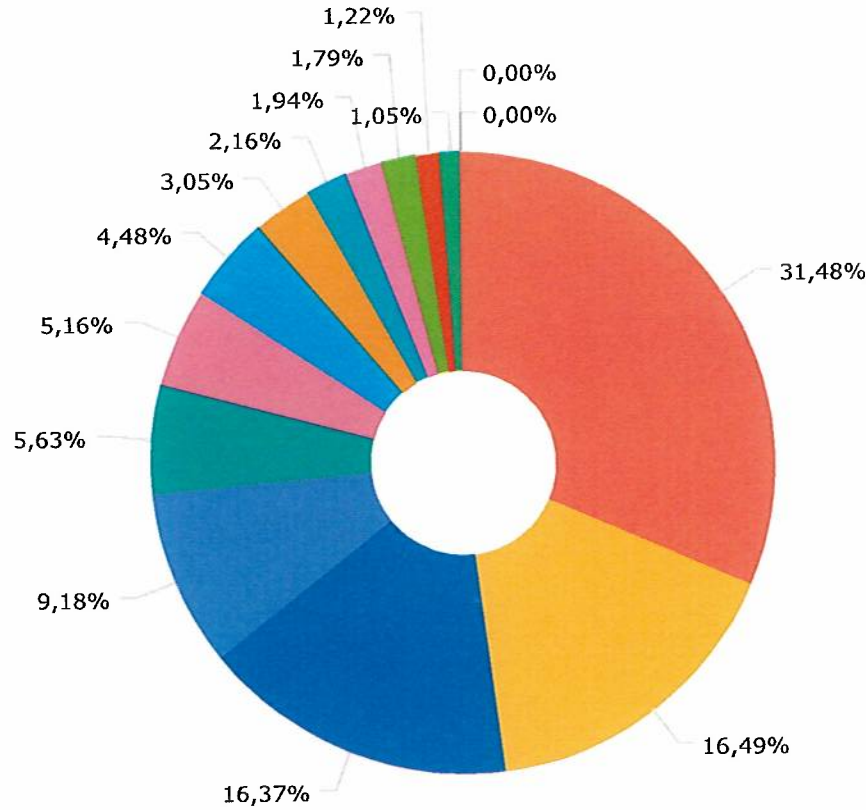
Ibovespa	308.971.474,73
IMA-B 5	235.277.293,07
Títulos Públicos	98.496.874,81
IPCA	76.172.539,24
CDI	71.407.953,21
IDKA IPCA 2 Anos	47.786.435,08
IRF-M 1	40.813.045,59
IMA-B	31.080.658,82
Global BDRX	30.851.875,53
IBX	29.754.951,78
S&P 500 (Moeda Original)	25.242.265,06
IPCA + 6,00% ao ano	17.589.858,00
IFIX	14.571.750,54
SMLL	13.576.341,71
MSCI ACWI	12.034.492,32
Não definido	6.876.730,05
IPCA + 8,00% ao ano	6.261.011,30
MSCI WORLD	6.231.659,11
Disponibilidades Financeiras	44.929,84
CDI + 3,50% ao ano	8.167,93



Renda Fixa Indexados	268.763.299,34
Ações Livre	175.813.973,14
Títulos Públicos	98.496.874,81
Ações Índice Ativo	72.175.208,45
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	64.653.097,76
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	58.099.889,91
Renda Fixa Duração Livre Soberano	44.702.822,33
Ações Valor/Crescimento	38.578.477,79
Multimercados Livre	37.975.439,83
Ações Investimento no Exterior	37.491.147,00
Não classificado	35.585.662,39
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	35.337.093,12
Ações Dividendos	32.465.623,17
Fundos de Participações	23.850.869,30
Ações Small Caps	19.055.279,88
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	15.380.701,19
FII Renda Gestão Ativa	13.078.358,51
FII TVM Gestão Ativa	1.493.392,03
Disponibilidades Financeiras	44.929,84
FIDC Outros	8.167,93



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	175.657.040,89
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	175.448.296,27
TESOURO NACIONAL	98.496.874,81
CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	80.097.205,52
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	64.796.480,97
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	60.385.514,44
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	55.387.495,25
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	48.034.933,41
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	35.221.557,28
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	34.211.207,83
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSO...	31.342.099,56
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	24.082.876,18
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...	23.163.103,70
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L...	22.597.341,19
ITAU UNIBANCO S.A.	20.831.347,89
ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECU...	20.584.356,66
MIRAE ASSET GLOBAL INVESTIMENT...	19.224.995,57
META ASSET MANAGEMENT LTDA.	18.517.393,10
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	12.034.492,32
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	10.375.224,21
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE...	10.208.742,47
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINA...	10.175.501,73
MULTINVEST CAPITAL ADMINISTRAD...	7.939.345,97
LEGATUS GESTORA DE RECURSOS LT...	6.261.011,30
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPA...	5.019.914,65
ZION GESTAO DE RECURSOS LTDA	2.902.856,78
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	44.929,84
GENIAL GESTAO LTDA	8.167,93

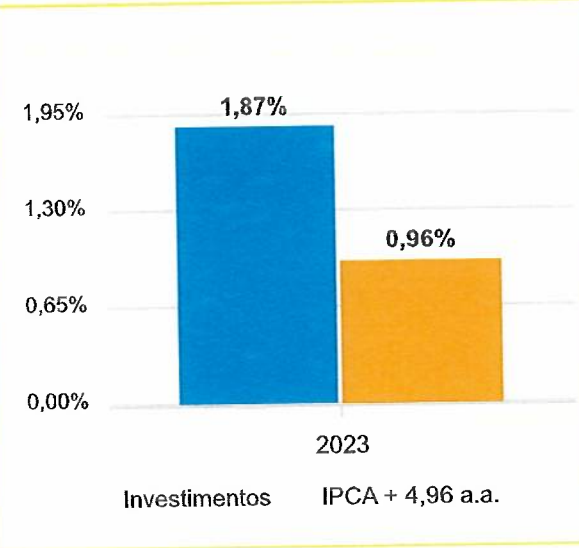


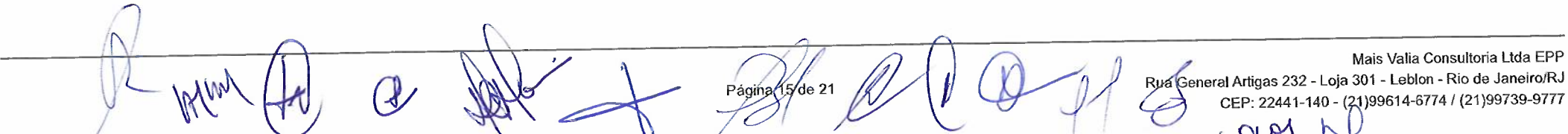
BEM DTVM	337.826.533,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	176.941.688,30
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	175.657.040,89
TESOURO NACIONAL	98.496.874,81
BANCO BRADESCO S.A.	60.385.514,44
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	55.387.495,25
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	48.034.933,41
BANCO DAYCOVAL S.A.	32.717.750,37
INTRAG DTVM LTDA	23.163.103,70
ITAU UNIBANCO S.A.	20.831.347,89
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S...	19.224.995,57
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	13.078.358,51
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	11.251.573,76
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	44.929,84
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	8.167,93



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	1.050.076.797,28	11.232.500,00	8.050.000,00	1.073.005.377,88	19.746.080,60	19.746.080,60	1,87% ▲	1,87%	0,96%	0,96%	194,79%	4,15%

**Gráfico Retorno e Meta Acumulado**



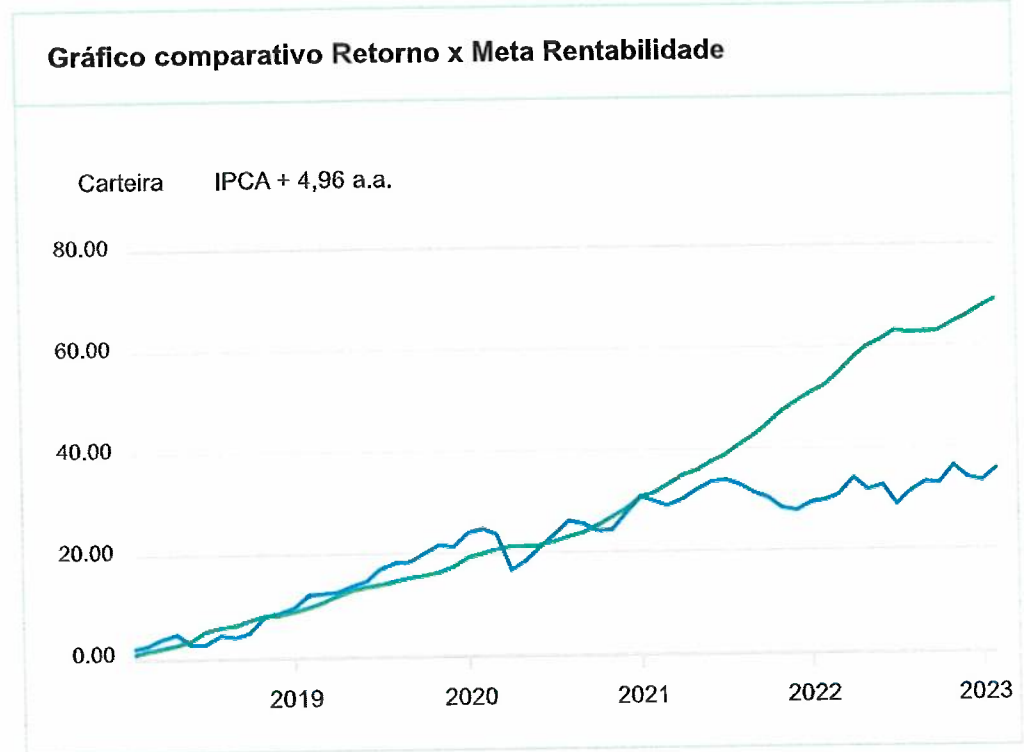


Gráficos

Gráfico Risco x Retorno



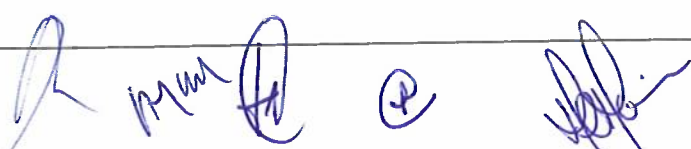
Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



*[Handwritten signatures and initials]*

*[Handwritten signature]*

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	98.958.370,74	0,00	0,00	98.496.874,81	-461.495,93	-0,47% ▼	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.187.619,64	0,00	0,00	1.195.311,33	7.691,69	0,65% ▲	1,44%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	81.006.802,52	0,00	0,00	82.120.429,85	1.113.627,33	1,37% ▲	1,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.882.151,60	0,00	0,00	11.880.902,65	-1.248,95	-0,01% ▼	2,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.491.858,16	22.500,00	0,00	18.709.936,87	195.578,71	1,06% ▲	0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.158.811,34	0,00	0,00	19.370.813,64	212.002,30	1,11% ▲	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.030.221,31	0,00	0,00	5.100.014,23	69.792,92	1,39% ▲	0,93%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	24.704.698,24	0,00	0,00	24.845.055,73	140.357,49	0,57% ▲	1,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	33.895.354,08	0,00	0,00	34.357.395,33	462.041,25	1,36% ▲	1,14%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.107.694,88	0,00	0,00	13.266.168,08	158.473,20	1,21% ▲	0,24%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.560.989,09	0,00	0,00	13.749.109,47	188.120,38	1,39% ▲	0,93%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	31.783.791,13	11.210.000,00	8.050.000,00	35.337.093,12	393.301,99	0,91% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.233.364,00	0,00	0,00	5.287.573,66	54.209,66	1,04% ▲	0,39%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.122.540,11	0,00	0,00	47.786.435,08	663.894,97	1,41% ▲	1,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.610.487,02	0,00	0,00	38.127.552,76	517.065,74	1,37% ▲	1,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.858.032,05	0,00	0,00	22.103.108,72	245.076,67	1,12% ▲	0,24%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.454.170,05	0,00	0,00	5.450.646,70	-3.523,35	-0,06% ▼	2,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.303.888,68	0,00	0,00	15.380.701,19	76.812,51	0,50% ▲	2,23%
MAG FI RENDA FIXA	22.354.515,41	0,00	0,00	22.597.341,19	242.825,78	1,09% ▲	0,05%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	7.793,46	0,00	0,00	8.167,93	374,47	4,80% ▲	-
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	47.386.881,56	0,00	0,00	48.034.933,41	648.051,85	1,37% ▲	1,15%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.127.530,67	0,00	0,00	11.138.665,62	11.134,95	0,10% ▲	0,99%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1.187.138,69	0,00	0,00	1.200.779,40	13.640,71	1,15% ▲	1,41%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	23.400.645,92	0,00	0,00	23.163.103,70	-237.542,22	-1,02% ▼	2,62%
	590.815.350,35	11.232.500,00	8.050.000,00	598.708.114,47	4.710.264,12	0,79%	0,88%

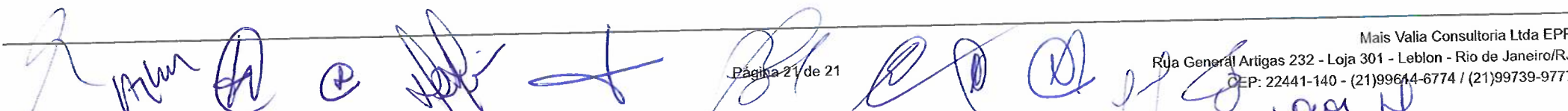


RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.836.821,94	0,00	0,00	5.027.596,30	190.774,36	3,94% ▲	9,12%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	18.870.750,90	0,00	0,00	19.055.279,88	184.528,98	0,98% ▲	11,65%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	14.339.894,40	0,00	0,00	14.876.856,13	536.961,73	3,74% ▲	8,90%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.059.237,54	0,00	0,00	9.299.492,10	240.254,56	2,65% ▲	6,87%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.759.320,22	0,00	0,00	11.045.209,05	285.888,83	2,66% ▲	6,85%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	13.611.457,50	0,00	0,00	14.064.220,28	452.762,78	3,33% ▲	9,58%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.447.938,81	0,00	0,00	5.701.701,98	253.763,17	4,66% ▲	8,04%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.729.911,36	0,00	0,00	6.853.670,21	123.758,85	1,84% ▲	7,87%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	77.142.884,93	0,00	0,00	80.097.205,52	2.954.320,59	3,83% ▲	8,29%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	19.919.477,96	0,00	0,00	20.584.356,66	664.878,70	3,34% ▲	9,31%
META VALOR FI AÇÕES	17.652.432,60	0,00	0,00	18.517.393,10	864.960,50	4,90% ▲	13,12%
MULTINVEST FI AÇÕES	5.212.993,54	0,00	0,00	5.408.213,31	195.219,77	3,74% ▲	10,52%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	2.402.383,83	0,00	0,00	2.531.132,66	128.748,83	5,36% ▲	12,51%
OCCAM FIC AÇÕES	30.502.052,76	0,00	0,00	31.342.099,56	840.046,80	2,75% ▲	7,93%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	51.738.060,99	0,00	0,00	53.657.815,35	1.919.754,36	3,71% ▲	9,02%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.034.443,00	0,00	0,00	7.236.378,23	201.935,23	2,87% ▲	10,30%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.789.075,33	0,00	0,00	1.938.066,58	148.991,25	8,33% ▲	13,47%
-	297.049.137,61	0,00	0,00	307.236.686,90	10.187.549,29	3,43%	9,10%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.307.001,58	0,00	0,00	2.334.853,28	27.851,70	1,21% ▲	0,59%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	17.609.165,00	0,00	0,00	17.589.858,00	-19.307,00	-0,11% ▼	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	23.728.262,07	0,00	0,00	25.242.265,06	1.514.002,99	6,38% ▲	7,52%
LA SHOPPING CENTERS FIP MULTIESTRATÉGIA	6.269.935,85	0,00	0,00	6.261.011,30	-8.924,55	-0,14% ▼	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	6.747.341,01	0,00	0,00	6.876.730,05	129.389,04	1,92% ▲	7,22%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	10.227.501,07	0,00	0,00	10.398.321,49	170.820,42	1,67% ▲	3,62%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	15.409.743,33	0,00	0,00	15.442.764,26	33.020,93	0,21% ▲	1,40%
-	82.298.949,91	0,00	0,00	84.145.803,44	1.846.853,53	2,24%	3,57%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.502.066,39	0,00	0,00	1.493.392,03	-8.674,36	-0,58% ▼	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	3.222.856,74	0,00	0,00	2.902.856,78	-319.999,96	-9,93% ▼	19,96%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	10.108.652,69	0,00	0,00	10.175.501,73	66.849,04	0,66% ▲	-
-	14.833.575,82	0,00	0,00	14.571.750,54	-261.825,28	-1,77%	13,18%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	20.289.966,99	0,00	0,00	20.671.814,14	381.847,15	1,88% ▲	8,14%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.162.301,41	0,00	0,00	1.183.063,38	20.761,97	1,79% ▲	8,22%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5.594.763,01	0,00	0,00	6.231.659,11	636.896,10	11,38% ▲	23,89%
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8.405.131,29	0,00	0,00	9.039.246,22	634.114,93	7,54% ▲	14,22%
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	9.164.207,70	0,00	0,00	10.185.749,35	1.021.541,65	11,15% ▲	10,07%
PLURAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3.859.377,00	0,00	0,00	3.977.083,36	117.706,36	3,05% ▲	8,80%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11.828.165,07	0,00	0,00	12.034.492,32	206.327,25	1,74% ▲	10,91%
WESTERN ASSET FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4.775.871,12	0,00	0,00	5.019.914,65	244.043,53	5,11% ▲	9,55%
	<b>65.079.783,59</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>68.343.022,53</b>	<b>3.263.238,94</b>	<b>5,01%</b>	<b>10,60%</b>



**PARECERNº:001/2023–COMIN/ANGRAPREV**

Os membros participantes da 3ª Reunião Ordinária de 2023 do Comitê de Investimentos - COMIN do Instituto de Previdência de Angra dos Reis - ANGRAPREV, ocorrida em 09 de fevereiro de 2023, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 6º do **DECRETO No 8.534 DE 17 DE OUTUBRO DE 2012, APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de **JANEIRO** de 2023.



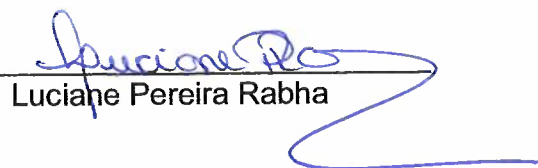
---

Jediael Souza Estoduto



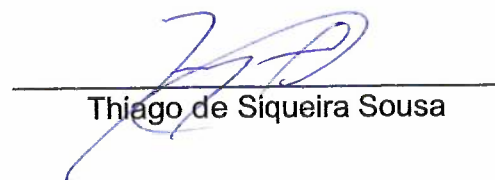
---

Renaldo de Sousa



---

Luciane Pereira Rabha



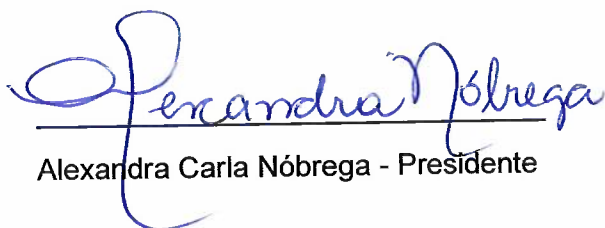
---

Thiago de Siqueira Sousa

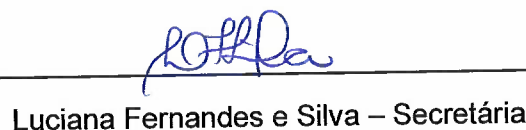


## PARECER Nº 002/2023 – CONSELHO FISCAL – CONFIS

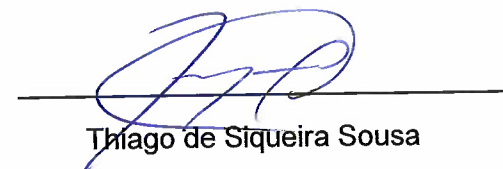
Os membros participantes da 2ª Reunião Ordinária de 2023 do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência de Angra dos Reis – ANGRAPREV, ocorrida em 16 de FEVEREIRO de 2023, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Capítulo II, 1.2, Inciso II da Lei Municipal nº 2.074, de 29 de dezembro de 2008, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos, referente ao mês de JANEIRO de 2023**, opinam **FAVORAVELMENTE** pela aprovação, submetendo-o assim, à apreciação dos membros conselheiros do Conselho de Administração do ANGRAPREV.



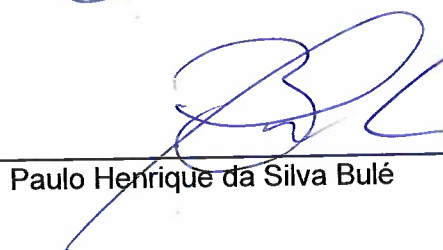
Alexandra Carla Nóbrega - Presidente



Luciana Fernandes e Silva – Secretária



Thiago de Siqueira Sousa



Paulo Henrique da Silva Bulé



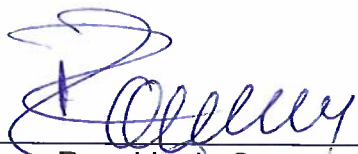
Maria Cecília Moreira Reis



Edilson Winckler Moreira

## PARECER Nº 03/2022–CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO DO ANGRAPREV

Os membros participantes da 2ª Reunião Ordinária de 2023 do Conselho de Administração do Instituto de Previdência de Angra dos Reis - ANGRAPREV, ocorrida em 23 de fevereiro de 2023, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Capítulo II, 1.1, Inciso II da Lei Municipal nº 2.074, de 29 de dezembro de 2008, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos**, referente ao mês de **janeiro de 2022**, deliberam por sua **APROVAÇÃO** final.



Renaldo de Sousa



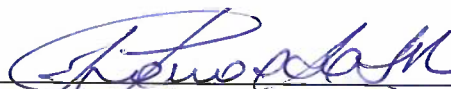
Luciane Pereira Rabha



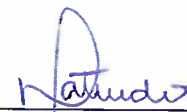
Célia Celestino dos Santos



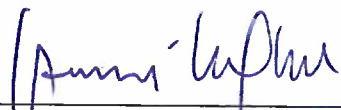
Mauro Ribeiro Garcia



Charlson Haroldo S. Rodrigues



Natália Cristine Dourado Rodrigues



André Gonçalves Malcher



Jedíael Souza Estoduto