

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre 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 (Março / 2023)

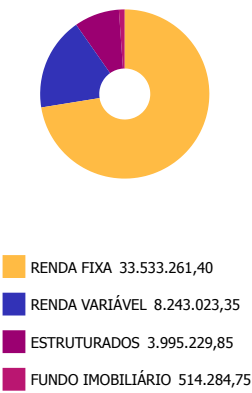
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.992.474,07	4,30%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	391.253,35	0,85%	960	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.715.737,38	3,71%	1.124	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.545.969,99	5,50%	333	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	630.157,19	1,36%	794	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.422.683,90	9,56%	935	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.786.228,04	8,18%	920	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	75.566,93	0,16%	689	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.070.042,46	2,31%	2.288	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRAPRESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.698.460,77	5,83%	147	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRAPRESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.207.457,62	4,77%	343	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.293.904,01	2,80%	235	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.909.727,58	4,13%	211	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.977.450,24	8,59%	356	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA GENIAL	S/Info		2.047.823,58	4,42%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.768.324,29	5,98%	33	2,21%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	866.393,77	1,87%	39	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	697.620,88	1,51%	1.588	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	436.929,59	0,94%	2.969	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BRAPRESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.003.648,34	4,33%	149	0,50%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	518.166,29	1,12%	187	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.803.866,07	3,90%	86	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	851.890,14	1,84%	77	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	551.379,76	1,19%	20	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	513.128,51	1,11%	32	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.431.669,99	3,09%	181	0,45%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.428.681,63	3,09%	22	0,92%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.134.878,23	2,45%	124	0,16%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	514.284,75	1,11%		0,64%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			46.285.799,35				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Março / 2023)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	1.992.474,07	4,30%	0,00%	15,00%	81,95%	35.938.738,50
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	14.637.639,24	31,62%	19,45%	21,85%	81,95%	23.293.573,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	12.087.000,22	26,11%	19,86%	25,65%	65,00%	17.998.769,36
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	2.047.823,58	4,42%	0,00%	2,50%	20,00%	7.209.336,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	2.768.324,29	5,98%	0,00%	0,00%	5,00%	-454.034,32
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.314.289,97
Total Renda Fixa	100,00%	33.533.261,40	72,45%	39,31%	65,00%	258,90%	

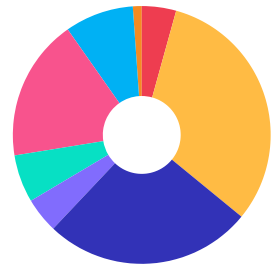


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	8.243.023,35	17,81%	1,89%	20,88%	35,00%	7.957.006,42
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.995.229,85	8,63%	3,75%	5,00%	10,00%	633.350,09
Artigo 11º	5,00%	514.284,75	1,11%	1,59%	2,12%	5,00%	1.800.005,22
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	12.752.537,95	27,55%	7,23%	28,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.628.579,94
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	4.628.579,94
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	14.407.554,58	31,13	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	8.338.248,36	18,01	0,00
ITAÚ UNIBANCO	6.633.206,45	14,33	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.673.211,19	10,10	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.768.324,29	5,98	1,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	1.992.474,07	4,30	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.909.727,58	4,13	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.070.042,46	2,31	0,01
TRÍGONO CAPITAL	1.064.508,27	2,30	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	866.393,77	1,87	0,00
ZION INVEST	514.284,75	1,11	-

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	1.992.474,07	4,30	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	14.637.639,24	31,62	19,45	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	12.087.000,22	26,11	19,86	65,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	2.768.324,29	5,98	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	8.243.023,35	17,81	1,89	35,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.995.229,85	8,63	3,75	10,00
Artigo 11º	514.284,75	1,11	1,59	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,58%	4,71%	4,71%	7,06%	10,21%	20,24%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,39%	4,37%	4,37%	6,83%	9,61%	19,14%	1,11%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38%	4,37%	4,37%	6,90%	9,91%	19,41%	1,08%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,33%	3,84%	3,84%	7,30%	11,98%	33,35%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,35%	-2,88%	-2,88%	-3,13%	-9,59%	-19,72%	1,39%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,23%	3,35%	3,35%	6,61%	13,19%	19,00%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20%	3,25%	3,25%	6,44%	12,84%	18,35%	0,25%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,52%	4,38%	4,38%	7,03%	10,38%	20,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	4,32%	4,32%	6,89%	10,27%	19,62%	0,89%	0,02%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1,50%	4,20%	4,20%	6,64%	9,92%	18,25%	0,89%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,66%	3,98%	3,98%	4,22%	7,51%	12,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,65%	3,91%	3,91%	4,01%	7,31%	11,86%	1,62%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	3,21%	3,21%	6,65%	13,70%	21,72%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	3,11%	3,11%	6,53%	13,53%	21,94%	0,06%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,15%	3,19%	3,19%	6,43%	13,02%	20,00%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,01%	2,79%	2,79%	5,62%	11,39%	17,07%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,06%	3,57%	3,57%	5,10%	10,05%	14,83%	1,02%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	3,25%	3,25%	5,55%	11,71%	14,38%	0,19%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,43%	4,12%	4,12%	3,57%	9,39%	16,97%	1,62%	0,03%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,17%	3,14%	3,14%	6,45%	13,36%	17,75%	0,17%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,81%	1,02%	1,02%	3,09%	9,84%	15,99%	1,66%	0,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,39%	3,30%	3,30%	6,16%	12,27%	19,48%	0,64%	0,01%

Ibovespa (Benchmark)	-2,91%	-7,16%	-7,16%	-7,41%	-15,10%	-12,65%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,56%	-3,77%	-3,77%	1,15%	9,19%	-	11,86%	0,26%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,31%	-7,03%	-7,03%	-4,59%	-1,88%	17,82%	14,06%	0,23%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-4,02%	-7,71%	-7,71%	-8,57%	-11,63%	-13,78%	8,40%	0,22%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,53%	-5,20%	-5,20%	-6,00%	-9,84%	-0,94%	8,37%	0,18%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-5,28%	-10,50%	-10,50%	-19,70%	-26,68%	-	10,19%	0,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-5,07%	-10,05%	-10,05%	-18,77%	-26,61%	-29,77%	9,94%	0,25%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,40%	-7,50%	-7,50%	-9,34%	-17,88%	-12,70%	8,24%	0,19%

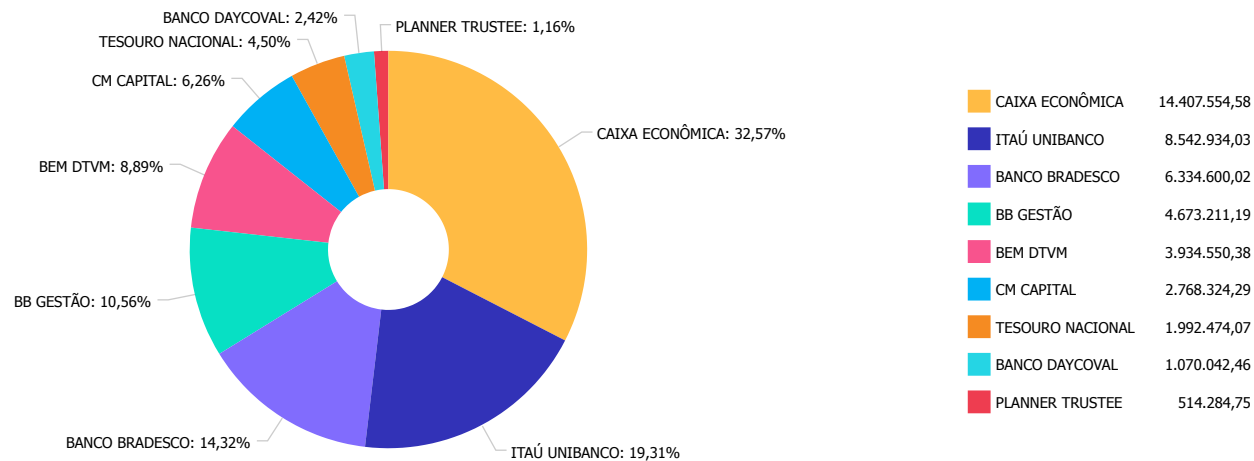
IDIV (Benchmark)	-2,02%	-4,08%	-4,08%	-1,06%	-6,43%	4,48%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,63%	-2,09%	-2,09%	-4,47%	-11,54%	-3,87%	6,89%	0,19%

IFIX (Benchmark)	-1,69%	-3,70%	-3,70%	-7,68%	-0,68%	-3,01%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	0,90%	-20,21%	-20,21%	-43,61%	-42,01%	316,67%	13,83%	0,38%

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

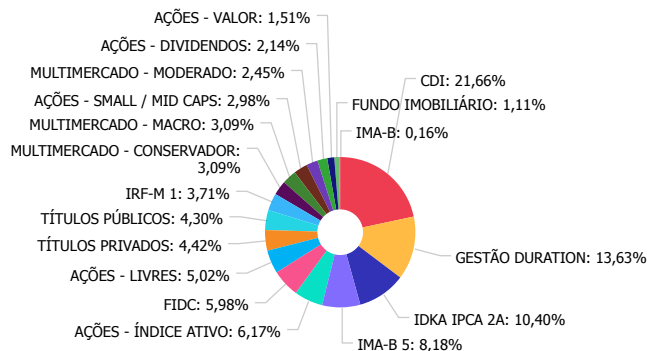
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-1,74%	-9,51%	-9,51%	-16,40%	-27,95%	-35,01%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,97%	-5,49%	-5,49%	-8,87%	-18,08%	-21,20%	4,74%	0,20%

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





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



CDI	10.024.781,86	GESTÃO DURATION	6.308.388,00	IDKA IPCA 2A	4.813.937,25
IMA-B 5	3.786.228,04	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.855.538,48	FIDC	2.768.324,29
AÇÕES - LIVRES	2.322.032,36	TÍTULOS PRIVADOS	2.047.823,58	TÍTULOS PÚBLICOS	1.992.474,07
IRF-M 1	1.715.737,38	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.431.669,99	MULTIMERCADO - MACRO	1.428.681,63
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.379.522,28	MULTIMERCADO - MODERADO	1.134.878,23	AÇÕES - DIVIDENDOS	988.309,35
AÇÕES - VALOR	697.620,88	FUNDO IMOBILIÁRIO	514.284,75	IMA-B	75.566,93

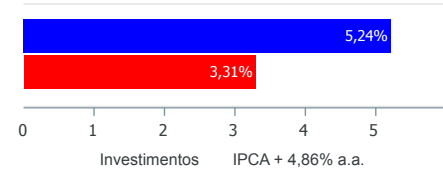
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Março / 2023)

Titulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	30/01/2023	486	4.115,22633700	4.099,740903	2.000.000,00	1.992.474,08	Curva

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	45.217.257,78	1.515.056,25	3.233.034,28	46.125.000,41	2.625.720,66	2.625.720,66	5,81%	5,81%	0,95%	0,95%	612,96%	2,89%
Fevereiro	46.125.000,41	3.995.378,21	2.487.982,92	47.236.647,99	-395.747,71	2.229.972,95	-0,83%	4,93%	1,18%	2,14%	230,17%	2,80%
Março	47.236.647,99	1.554.282,52	2.646.531,45	46.285.799,35	141.400,29	2.371.373,24	0,30%	5,24%	1,15%	3,31%	158,24%	2,48%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



- Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B
- ☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1
- ☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

ANO

36M

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	73.616,55	0,00	0,00	75.566,93	1.950,38	2,65%	2,65%	1,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.864.345,33	0,00	0,00	1.909.727,58	45.382,25	2,43%	2,43%	1,62%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.643.987,88	0,00	0,00	2.698.460,77	54.472,89	2,06%	2,06%	1,02%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	2.016.254,97	0,00	0,00	2.047.823,58	31.568,61	1,57%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	1.962.958,66	0,00	0,00	1.992.474,07	29.515,41	1,50%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.730.357,85	0,00	0,00	3.786.228,04	55.870,19	1,50%	1,50%	0,89%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.054.271,14	0,00	0,00	1.070.042,46	15.771,32	1,50%	1,50%	0,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.361.882,50	0,00	0,00	4.422.683,90	60.801,40	1,39%	1,39%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	385.917,91	0,00	0,00	391.253,35	5.335,44	1,38%	1,38%	1,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	622.608,95	0,00	0,00	630.157,19	7.548,24	1,21%	1,21%	0,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.695.431,35	0,00	0,00	1.715.737,38	20.306,03	1,20%	1,20%	0,25%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.182.013,73	0,00	0,00	2.207.457,62	25.443,89	1,17%	1,17%	0,03%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.316.304,92	0,00	37.504,97	1.293.904,01	15.104,06	1,15%	1,15%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.933.266,43	0,00	0,00	3.977.450,24	44.183,81	1,12%	1,12%	0,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	3.571.879,87	1.554.282,52	2.609.026,48	2.545.969,99	28.834,08	0,56%	1,01%	0,00%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.758.635,46	0,00	0,00	2.768.324,29	9.688,83	0,35%	0,35%	1,39%
Total Renda Fixa	34.173.733,50	1.554.282,52	2.646.531,45	33.533.261,40	451.776,83	1,32%		0,69%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	509.713,33	0,00	0,00	514.284,75	4.571,42	0,90%	0,90%	13,83%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	444.157,61	0,00	0,00	436.929,59	-7.228,02	-1,63%	-1,63%	6,89%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	531.607,08	0,00	0,00	518.166,29	-13.440,79	-2,53%	-2,53%	8,37%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	892.926,68	0,00	0,00	866.393,77	-26.532,91	-2,97%	-2,97%	4,74%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	722.199,51	0,00	0,00	697.620,88	-24.578,63	-3,40%	-3,40%	8,24%
BRAPESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.087.470,07	0,00	0,00	2.003.648,34	-83.821,73	-4,02%	-4,02%	8,40%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	577.709,34	0,00	0,00	551.379,76	-26.329,58	-4,56%	-4,56%	11,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.900.154,94	0,00	0,00	1.803.866,07	-96.288,87	-5,07%	-5,07%	9,94%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	899.404,79	0,00	0,00	851.890,14	-47.514,65	-5,28%	-5,28%	10,19%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	547.684,53	0,00	0,00	513.128,51	-34.556,02	-6,31%	-6,31%	14,06%
Total Renda Variável	9.113.027,88	0,00	0,00	8.757.308,10	-355.719,78	-3,90%		9,31%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2023**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	0,00	57.914,70	1.992.474,07	2.050.388,77	0,00%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.237.556,64	0,00	0,00	4.422.683,90	185.127,26	4,37%	4,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.629.296,88	0,00	0,00	3.786.228,04	156.931,16	4,32%	4,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.857.567,22	0,00	0,00	3.977.450,24	119.883,02	3,11%	3,11%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.605.442,73	0,00	0,00	2.698.460,77	93.018,04	3,57%	3,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.522.281,70	0,00	2.700.000,00	1.909.727,58	87.445,88	1,93%	4,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	2.882.739,60	5.064.716,98	5.483.683,91	2.545.969,99	82.197,32	1,03%	2,79%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.138.889,50	0,00	0,00	2.207.457,62	68.568,12	3,21%	3,21%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.661.723,99	0,00	0,00	1.715.737,38	54.013,39	3,25%	3,25%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	0,00	2.000.000,00	0,00	2.047.823,58	47.823,58	2,39%	-
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.026.900,53	0,00	0,00	1.070.042,46	43.141,93	4,20%	4,20%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.290.315,34	0,00	37.504,97	1.293.904,01	41.093,64	3,18%	3,19%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	610.336,05	0,00	0,00	630.157,19	19.821,14	3,25%	3,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	374.867,18	0,00	0,00	391.253,35	16.386,17	4,37%	4,37%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.850.424,77	0,00	88.445,07	2.768.324,29	6.344,59	0,22%	-2,88%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	72.726,33	0,00	0,00	75.566,93	2.840,60	3,91%	3,91%
Total Renda Fixa	31.761.068,46	7.064.716,98	8.367.548,65	33.533.261,40	3.075.024,61	7,92%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2023**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.385.990,98	0,00	0,00	1.431.669,99	45.679,01	3,30%	3,30%
BRABESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.385.167,37	0,00	0,00	1.428.681,63	43.514,26	3,14%	3,14%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.123.465,39	0,00	0,00	1.134.878,23	11.412,84	1,02%	1,02%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	446.266,76	0,00	0,00	436.929,59	-9.337,17	-2,09%	-2,09%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	572.969,83	0,00	0,00	551.379,76	-21.590,07	-3,77%	-3,77%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	546.560,22	0,00	0,00	518.166,29	-28.393,93	-5,20%	-5,20%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	551.938,34	0,00	0,00	513.128,51	-38.809,83	-7,03%	-7,03%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	916.680,23	0,00	0,00	866.393,77	-50.286,46	-5,49%	-5,49%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	754.211,74	0,00	0,00	697.620,88	-56.590,86	-7,50%	-7,50%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	951.827,45	0,00	0,00	851.890,14	-99.937,31	-10,50%	-10,50%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	644.570,22	0,00	0,00	514.284,75	-130.285,47	-20,21%	-20,21%
BRABESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.171.071,02	0,00	0,00	2.003.648,34	-167.422,68	-7,71%	-7,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.005.469,77	0,00	0,00	1.803.866,07	-201.603,70	-10,05%	-10,05%
Total Renda Variável	13.456.189,32	0,00	0,00	12.752.537,95	-703.651,37	-5,23%	

Disclaimer

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

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria 1.467, de 02 de junho de 2022. e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

