

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

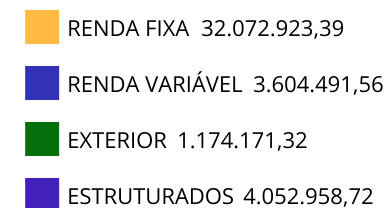
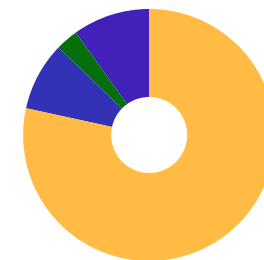
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	1.859.207,82	4,55%	360	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	506.966,38	1,24%	348	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	1.040.040,55	2,54%	287	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	712.701,63	1,74%	228	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.685.827,98	9,01%	1.184	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	2.940.370,35	7,19%	76.872	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	577.750,44	1,41%	935	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.909.898,55	4,67%	159	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	6.549.122,44	16,01%	1.088	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.504.743,16	18,35%	356	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.036.310,51	7,42%	210	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.749.983,58	4,28%	87	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	335.441,65	0,82%	23.459	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	D+4	Não há	252.585,52	0,62%	6.856	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	89.236,41	0,22%	1.588	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	351.050,80	0,86%	11.847	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	33.741,69	0,08%	2.969	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	291.460,20	0,71%	4.488	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	203.313,18	0,50%	31.545	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	514.601,10	1,26%	23.239	0,04%	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	243.149,26	0,59%	187	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	353.057,96	0,86%	6.920	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	170.434,93	0,42%	2.474	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	54.076,11	0,13%	2.635	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÃO...	D+24	Não há	233.165,95	0,57%	17	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	479.176,80	1,17%	11.521	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	295.711,25	0,72%	24.206	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	485.260,66	1,19%	158	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	393.199,41	0,96%	500	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	345.497,06	0,84%	124	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	353.706,83	0,86%	940	0,51%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	3.128.474,97	7,65%	3.244	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	225.279,86	0,55%	698	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		5.225,62	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			40.904.544,99				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.225,62				Artigo 6º
PL Total			40.909.770,61				

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

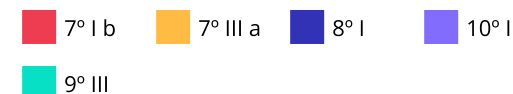
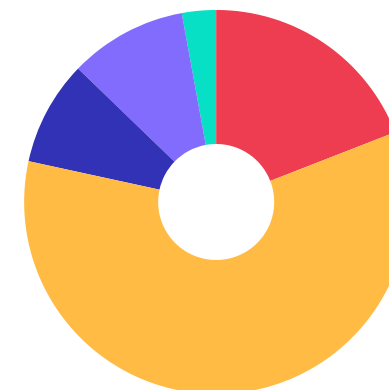
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	33,00%	100,00%	40.904.544,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	7.804.744,36	19,08%	0,00%	8,50%	100,00%	33.099.800,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	24.268.179,03	59,33%	0,00%	33,00%	60,00%	274.547,96
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.090.454,50
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	409.045,45
Total Renda Fixa	100,00%	32.072.923,39	78,41%	0,00%	77,50%	271,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.604.491,56	8,81%	0,00%	9,00%	20,00%	4.576.417,44
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	4.090.454,50
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.052.958,72	9,91%	0,00%	10,00%	10,00%	37.495,78
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	7.657.450,28	18,72%	0,00%	19,50%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.174.171,32	2,87%	0,00%	3,00%	10,00%	2.916.283,18
Total Exterior	10,00%	1.174.171,32	2,87%	0,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.195.718,44	42,04	-
CAIXA DTVM	10.480.166,69	25,62	-
ITAÚ UNIBANCO	9.959.183,40	24,35	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.036.310,51	7,42	0,00
ITAÚ DTVM	233.165,95	0,57	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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 Março/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,73%	3,61%	3,61%	1,83%	5,03%	5,39%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,66%	3,50%	3,50%	1,65%	4,70%	4,58%	2,40%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,23%	3,35%	3,35%	6,61%	13,19%	19,00%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,21%	3,33%	3,33%	6,53%	12,96%	18,52%	0,25%	0,00%
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,55%	2,86%	2,86%	5,91%	13,02%	-	0,73%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,08%	2,99%	2,99%	6,03%	12,15%	18,06%	0,01%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,12%	2,67%	2,67%	5,99%	12,84%	20,67%	0,04%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,16%	3,17%	3,17%	6,49%	13,25%	20,92%	0,02%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,38%	3,31%	3,31%	6,05%	12,33%	22,28%	0,29%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,24%	3,36%	3,36%	6,45%	13,47%	-	0,39%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	3,64%	3,64%	7,77%	11,11%	20,82%	0,19%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	4,06%	4,06%	6,88%	9,39%	-	0,90%	0,03%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

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 BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	3,63%	3,63%	4,49%	4,23%	-	0,19%	0,05%

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%	-	-
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	1,44%	4,96%	4,96%	8,97%	18,04%	22,22%	3,17%	0,03%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,81%	1,02%	1,02%	3,09%	9,84%	15,99%	1,66%	0,04%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,14%	3,09%	3,09%	6,08%	13,30%	21,32%	0,11%	0,01%
Global BDRX (Benchmark)	2,99%	8,73%	8,73%	13,01%	-3,04%	-8,03%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-2,91%	-7,16%	-7,16%	-7,41%	-15,10%	-12,65%	-	-
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	-3,91%	-3,46%	-3,46%	3,09%	-16,35%	-14,81%	8,00%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,40%	-7,50%	-7,50%	-9,34%	-17,88%	-12,70%	8,24%	0,19%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-0,66%	1,42%	1,42%	-17,19%	-15,69%	-32,08%	16,71%	0,30%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	-0,28%	-1,49%	-1,49%	2,54%	-6,83%	-2,11%	7,46%	0,22%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-4,98%	-6,82%	-6,82%	-12,67%	-19,47%	-28,82%	8,31%	0,24%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-3,71%	-7,97%	-7,97%	-10,17%	-18,09%	-12,92%	8,31%	0,21%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,53%	-5,20%	-5,20%	-6,00%	-9,84%	-0,94%	8,37%	0,18%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-6,04%	-13,01%	-13,01%	-25,05%	-38,86%	-50,90%	14,99%	0,29%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1,22%	-2,69%	-2,69%	-5,18%	-8,79%	-2,11%	10,18%	0,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-3,63%	-7,48%	-7,48%	-11,55%	-19,29%	-27,13%	8,80%	0,23%
IDIV (Benchmark)	-2,02%	-4,08%	-4,08%	-1,06%	-6,43%	4,48%	-	-

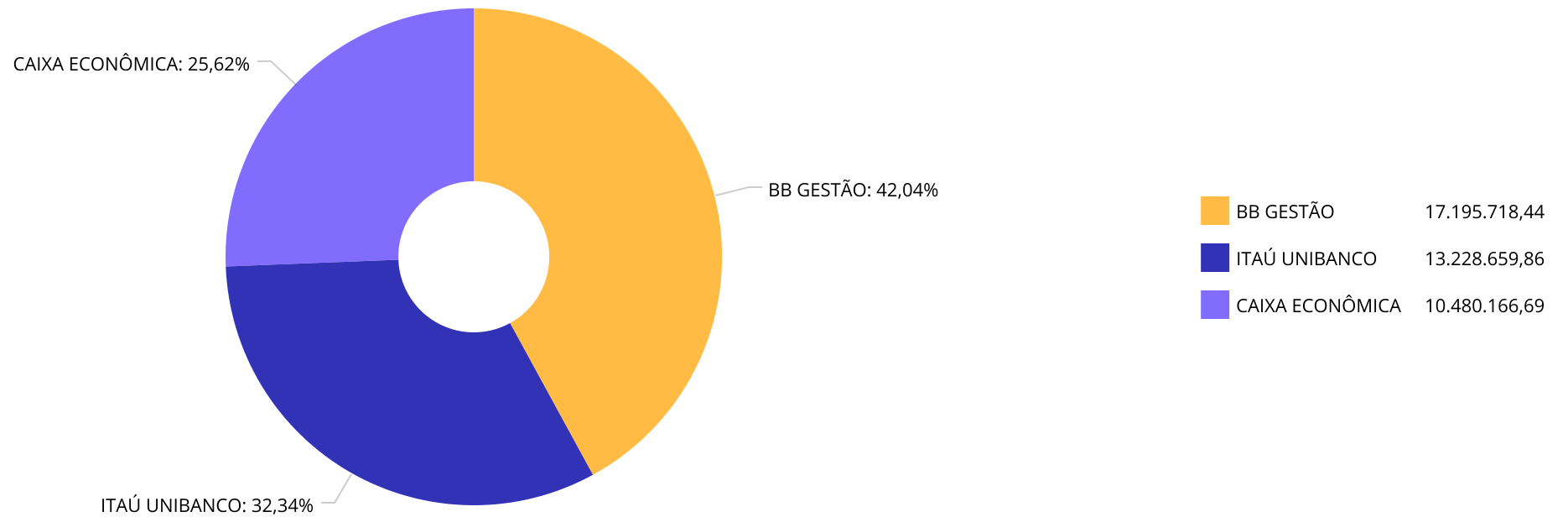
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,63%	-2,09%	-2,09%	-4,47%	-11,54%	-3,87%	6,89%	0,19%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,06%	-4,28%	-4,28%	-1,50%	-7,17%	2,17%	6,94%	0,16%
S&P 500 (Benchmark)	3,51%	7,03%	7,03%	14,61%	-9,29%	3,43%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,57%	7,90%	7,90%	17,13%	-3,11%	14,68%	8,04%	0,22%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	4,03%	8,80%	8,80%	19,42%	-1,09%	19,12%	8,69%	0,24%
SMLL (Benchmark)	-1,74%	-9,51%	-9,51%	-16,40%	-27,95%	-35,01%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-2,39%	-8,74%	-8,74%	-14,80%	-23,37%	-26,75%	10,44%	0,24%

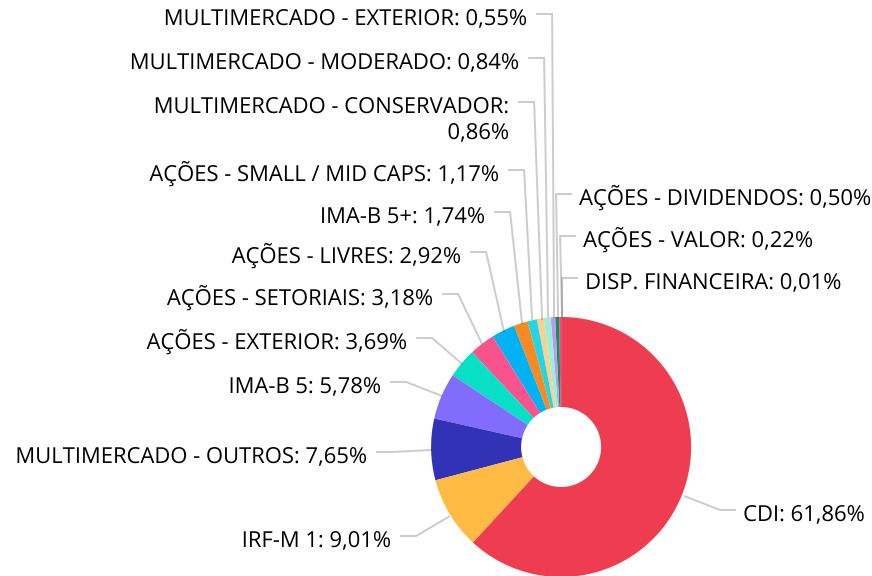
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,99%	8,73%	8,73%	13,01%	-3,04%	-8,03%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3,17%	6,72%	6,72%	16,60%	-4,10%	6,17%	7,47%	20,726%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,19%	8,45%	8,45%	12,27%	-3,59%	-10,72%	8,10%	18,285%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,09%	3,47%	3,47%	9,46%	-4,07%	-8,96%	7,58%	16,771%

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



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

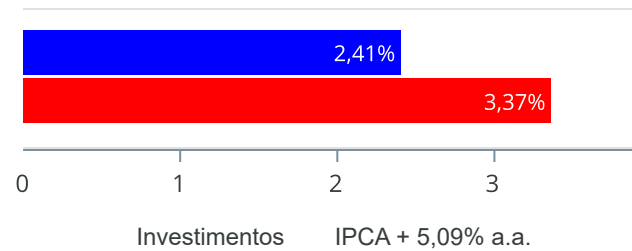


■ CDI	25.308.219,58	■ IRF-M 1	3.685.827,98	■ MULTIMERCADO - OUTROS	3.128.474,97
■ IMA-B 5	2.366.174,20	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.509.612,97	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.302.230,59
■ AÇÕES - LIVRES	1.194.229,49	■ IMA-B 5+	712.701,63	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	479.176,80
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	353.706,83	■ MULTIMERCADO - MODERADO	345.497,06	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	225.279,86
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	204.176,62	■ AÇÕES - VALOR	89.236,41	■ DISP. FINANCEIRA	5.225,62

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	38.107.184,17	3.290.124,85	2.392.124,68	39.598.734,19	593.549,85	593.549,85	1,52%	1,52%	0,97%	0,97%	157,42%	1,67%
Fevereiro	39.598.734,19	5.816.115,61	5.528.971,95	39.881.960,90	-3.916,95	589.632,90	-0,01%	1,51%	1,20%	2,18%	69,46%	1,34%
Março	39.881.960,90	2.699.875,72	2.036.577,54	40.904.544,99	359.285,91	948.918,81	0,89%	2,41%	1,17%	3,37%	71,57%	1,39%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



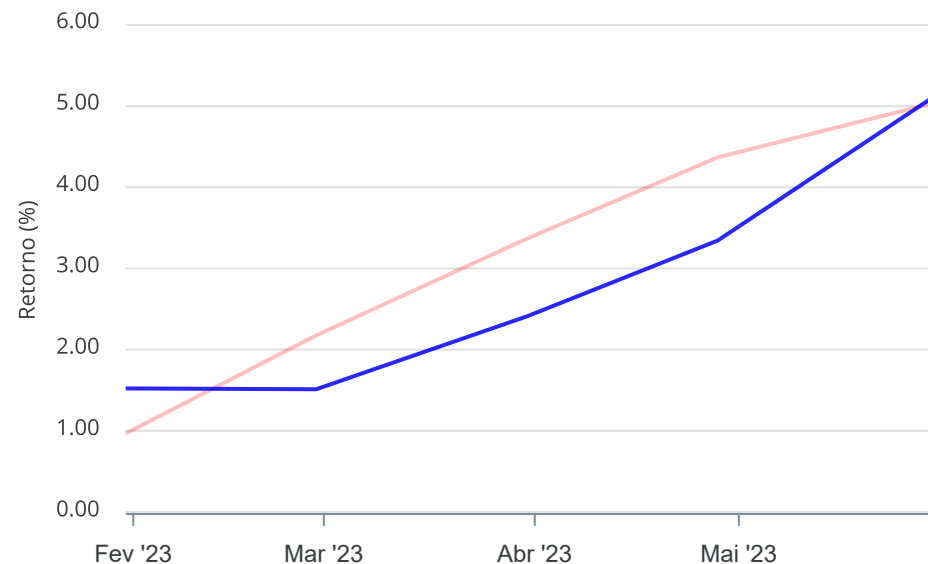
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

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 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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	687.554,84	0,00	0,00	712.701,63	25.146,79	3,66%	3,66%	2,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	2.995.017,20	0,00	0,00	3.036.310,51	41.293,31	1,38%	1,38%	0,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	500.590,78	0,00	0,00	506.966,38	6.375,60	1,27%	1,27%	0,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.728.494,69	0,00	0,00	1.749.983,58	21.488,89	1,24%	1,24%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.641.896,08	0,00	0,00	3.685.827,98	43.931,90	1,21%	1,21%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.837.447,47	0,00	0,00	1.859.207,82	21.760,35	1,18%	1,18%	0,19%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.027.908,61	0,00	0,00	1.040.040,55	12.131,94	1,18%	1,18%	0,19%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.473.855,46	0,00	0,00	6.549.122,44	75.266,98	1,16%	1,16%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.421.376,16	0,00	0,00	7.504.743,16	83.367,00	1,12%	1,12%	0,06%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.888.690,44	0,00	0,00	1.909.898,55	21.208,11	1,12%	1,12%	0,04%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.229.132,23	1.700.000,00	0,00	2.940.370,35	11.238,12	0,38%	0,55%	0,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.956.757,15	649.875,72	2.036.577,54	577.750,44	7.695,11	0,30%	1,08%	0,01%
Total Renda Fixa	31.388.721,11	2.349.875,72	2.036.577,54	32.072.923,39	370.904,10	1,17%		0,25%

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	216.556,20	0,00	0,00	225.279,86	8.723,66	4,03%	4,03%	8,69%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	323.875,88	0,00	0,00	335.441,65	11.565,77	3,57%	3,57%	8,04%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	53.426,32	0,00	0,00	54.076,11	649,79	1,22%	1,22%	10,18%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.093.322,37	0,00	0,00	3.128.474,97	35.152,60	1,14%	1,14%	0,11%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	350.000,00	0,00	353.706,83	3.706,83	1,06%	1,44%	3,17%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	342.713,58	0,00	0,00	345.497,06	2.783,48	0,81%	0,81%	1,66%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	292.273,22	0,00	0,00	291.460,20	-813,02	-0,28%	-0,28%	7,46%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	353.381,57	0,00	0,00	351.050,80	-2.330,77	-0,66%	-0,66%	16,71%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	34.299,88	0,00	0,00	33.741,69	-558,19	-1,63%	-1,63%	6,89%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	174.019,69	0,00	0,00	170.434,93	-3.584,76	-2,06%	-2,06%	6,94%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	490.886,79	0,00	0,00	479.176,80	-11.709,99	-2,39%	-2,39%	10,44%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	249.456,35	0,00	0,00	243.149,26	-6.307,09	-2,53%	-2,53%	8,37%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	92.380,39	0,00	0,00	89.236,41	-3.143,98	-3,40%	-3,40%	8,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	241.953,57	0,00	0,00	233.165,95	-8.787,62	-3,63%	-3,63%	8,80%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	534.412,31	0,00	0,00	514.601,10	-19.811,21	-3,71%	-3,71%	8,31%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	262.856,28	0,00	0,00	252.585,52	-10.270,76	-3,91%	-3,91%	8,00%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	213.978,35	0,00	0,00	203.313,18	-10.665,17	-4,98%	-4,98%	8,31%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	375.744,53	0,00	0,00	353.057,96	-22.686,57	-6,04%	-6,04%	14,99%
Total Renda Variável	7.345.537,28	350.000,00	0,00	7.657.450,28	-38.087,00	-0,49%		5,20%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	381.040,10	0,00	0,00	393.199,41	12.159,31	3,19%	3,19%	8,10%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	286.631,11	0,00	0,00	295.711,25	9.080,14	3,17%	3,17%	7,47%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	480.031,30	0,00	0,00	485.260,66	5.229,36	1,09%	1,09%	7,58%
Total Exterior	1.147.702,51	0,00	0,00	1.174.171,32	26.468,81	2,31%		7,73%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.278.545,16	0,00	0,00	7.504.743,16	226.198,00	3,11%	3,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.238.538,92	1.120.780,15	0,00	6.549.122,44	189.803,37	2,98%	3,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.281.820,02	1.301.091,30	0,00	3.685.827,98	102.916,66	2,87%	3,33%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	3.863.787,26	0,00	2.033.108,95	1.909.898,55	79.220,24	2,05%	2,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.795.501,19	1.163.007,17	0,00	3.036.310,51	77.802,15	2,63%	3,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.793.868,50	0,00	0,00	1.859.207,82	65.339,32	3,64%	3,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.693.028,18	0,00	0,00	1.749.983,58	56.955,40	3,36%	3,36%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.003.599,28	0,00	0,00	1.040.040,55	36.441,27	3,63%	3,63%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	800.581,90	4.446.514,06	4.701.894,39	577.750,44	32.548,87	0,62%	2,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	688.633,72	0,00	0,00	712.701,63	24.067,91	3,50%	3,50%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	2.924.723,50	0,00	2.940.370,35	15.646,85	0,53%	2,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.072.997,56	0,00	1.087.360,36	0,00	14.362,80	1,34%	4,32%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	580.854,61	0,00	589.262,92	0,00	8.408,31	1,45%	4,37%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.155.141,27	0,00	1.163.007,17	0,00	7.865,90	0,68%	2,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	500.000,00	0,00	506.966,38	6.966,38	1,39%	4,06%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	180.784,43	0,00	183.040,38	0,00	2.255,95	1,25%	4,05%
Total Renda Fixa	29.427.682,00	11.456.116,18	9.757.674,17	32.072.923,39	946.799,38	3,04%	

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
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.034.759,46	0,00	0,00	3.128.474,97	93.715,51	3,09%	3,09%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	398.287,92	0,00	200.000,00	225.279,86	26.991,94	6,78%	8,80%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	310.885,86	0,00	0,00	335.441,65	24.555,79	7,90%	7,90%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	346.121,74	0,00	0,00	351.050,80	4.929,06	1,42%	1,42%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	350.000,00	0,00	353.706,83	3.706,83	1,06%	4,96%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	342.022,60	0,00	0,00	345.497,06	3.474,46	1,02%	1,02%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	34.462,75	0,00	0,00	33.741,69	-721,06	-2,09%	-2,09%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	55.571,87	0,00	0,00	54.076,11	-1.495,76	-2,69%	-2,69%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	295.853,92	0,00	0,00	291.460,20	-4.393,72	-1,49%	-1,49%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	96.475,24	0,00	0,00	89.236,41	-7.238,83	-7,50%	-7,50%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	178.047,08	0,00	0,00	170.434,93	-7.612,15	-4,28%	-4,28%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	261.634,67	0,00	0,00	252.585,52	-9.049,15	-3,46%	-3,46%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	256.473,10	0,00	0,00	243.149,26	-13.323,84	-5,20%	-5,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	218.197,87	0,00	0,00	203.313,18	-14.884,69	-6,82%	-6,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	252.013,56	0,00	0,00	233.165,95	-18.847,61	-7,48%	-7,48%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	559.166,28	0,00	0,00	514.601,10	-44.565,18	-7,97%	-7,97%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	525.065,35	0,00	0,00	479.176,80	-45.888,55	-8,74%	-8,74%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	405.843,15	0,00	0,00	353.057,96	-52.785,19	-13,01%	-13,01%
Total Renda Variável	7.570.882,42	350.000,00	200.000,00	7.657.450,28	-63.432,14	-0,82%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	362.551,79	0,00	0,00	393.199,41	30.647,62	8,45%	8,45%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	277.092,52	0,00	0,00	295.711,25	18.618,73	6,72%	6,72%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	468.975,44	0,00	0,00	485.260,66	16.285,22	3,47%	3,47%
Total Exterior	1.108.619,75	0,00	0,00	1.174.171,32	65.551,57	5,91%	

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 CRÉDITO & MERCADO. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

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

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

