

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023





Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

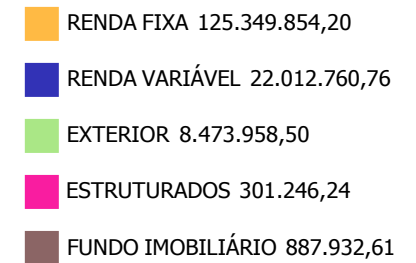
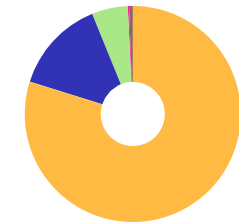
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			823.679,56	0,52%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	6.282.207,55	4,00%	360	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	5.931.624,03	3,78%	42	3,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	840.498,46	0,54%	140	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	7.224.151,43	4,60%	348	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.871.237,57	3,74%	236	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	10.455.900,67	6,66%	287	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.750.726,36	1,11%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	3.251.036,68	2,07%	23	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.286.010,14	5,91%	794	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.083.297,24	0,69%	920	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	D+1	Não há	7.477.205,93	4,76%	18	7,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	22.125.331,41	14,09%	1.088	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	23.083.322,43	14,70%	1.000	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	12.739.202,40	8,11%	465	0,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	D+45 a ...	01/08/2016	2.270.397,01	1,45%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	379.281,48	0,24%	98	1,11%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	4.474.743,85	2,85%	120	1,90%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.848.078,96	1,81%	1.588	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.880.252,91	1,20%	31.545	0,24%	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
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.385.089,90	1,52%	23.239	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.103.934,71	0,70%	6.787	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.956.902,66	1,25%	124	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.483.145,84	0,94%	2.931	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	3.097.341,03	1,97%	43	0,63%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.612.482,66	1,03%	148	0,81%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	1.006.836,52	0,64%	54	3,20%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.183.653,40	2,03%	1.298	3,35%	Artigo 8º, Inciso I
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.455.042,17	0,93%	220	2,68%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	2.078.959,41	1,32%	6.113	0,24%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	2.331.396,00	1,48%	241	0,80%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.063.603,09	2,59%	500	0,20%	Artigo 9º, Inciso III
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRAS...	Não se ...	Não se aplica	285.988,55	0,18%	21	0,11%	Artigo 10º, Inciso II
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	15.257,69	0,01%	112	0,59%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	274.456,00	0,17%		0,02%	Artigo 11º
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	S/Info	Não se aplica	300.926,61	0,19%		0,02%	Artigo 11º
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	312.550,00	0,20%		0,32%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1.350,00	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			157.025.752,31				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.350,00				Artigo 6º
PL Total			157.027.102,31				

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%	823.679,56	0,52%	0,00%	0,55%	10,00%	14.878.895,67
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	59.453.896,06	37,86%	25,00%	38,15%	75,00%	58.315.418,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	57.947.856,24	36,90%	20,00%	33,85%	50,00%	20.565.019,92
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	8,00%	12.562.060,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	2.649.678,49	1,69%	0,00%	1,65%	2,00%	490.836,56
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	4.474.743,85	2,85%	0,00%	2,80%	5,00%	3.376.543,77
Total Renda Fixa	100,00%	125.349.854,20	79,83%	45,00%	77,00%	150,00%	

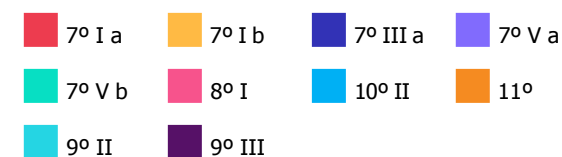
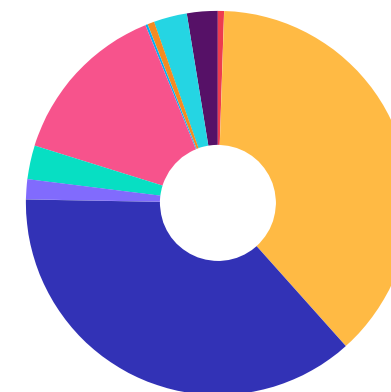




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	22.012.760,76	14,02%	10,00%	16,70%	23,50%	14.888.291,03
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.851.287,62
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	301.246,24	0,19%	0,00%	0,15%	0,50%	483.882,52
Artigo 11º	5,00%	887.932,61	0,57%	0,00%	0,65%	1,00%	682.324,91
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	23.201.939,61	14,78%	10,00%	17,50%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	4.410.355,41	2,81%	0,00%	0,00%	0,00%	-4.410.355,41
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.063.603,09	2,59%	2,00%	5,50%	10,00%	11.638.972,14
Total Exterior	10,00%	8.473.958,50	5,40%	2,00%	5,50%	10,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	60.822.027,83	38,73	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	49.517.234,65	31,53	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	25.479.021,14	16,23	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.871.237,57	3,74	0,00
ITAÚ DTVM	3.097.341,03	1,97	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	2.331.396,00	1,48	0,03
OLIVEIRA TRUST	2.270.397,01	1,45	0,02
META ASSET MANAGEMENT	1.612.482,66	1,03	0,80
ICATU VANGUARDA	1.483.145,84	0,94	0,00
WESTERN ASSET	1.455.042,17	0,93	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.006.836,52	0,64	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	823.679,56	0,52	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	575.382,61	0,37	0,00
PETRA CAPITAL	379.281,48	0,24	0,02
BRZ INVESTIMENTOS	285.988,55	0,18	0,01
PÁTRIA INVESTIMENTOS	15.257,69	0,01	0,00

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 '	823.679,56	0,52	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	59.453.896,06	37,86	25,00	75,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	57.947.856,24	36,90	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	2.649.678,49	1,69	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	4.474.743,85	2,85	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	22.012.760,76	14,02	10,00	23,50
Artigo 9º, Inciso III	4.063.603,09	2,59	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso II	301.246,24	0,19	0,00	0,50
Artigo 11º	887.932,61	0,57	0,00	1,00

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 Março/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	1,28%	3,56%	3,56%	7,18%	14,64%	23,45%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	-18,54%	-16,61%	-16,61%	-13,52%	-7,05%	1,37%	0,00%	0,00%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,25%	3,59%	3,59%	6,80%	10,93%	30,87%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,51%	0,69%	0,69%	3,31%	5,48%	17,01%	0,10%	0,05%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,49%	4,30%	4,30%	6,77%	10,77%	18,31%	0,88%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,23%	3,35%	3,35%	6,61%	13,19%	19,00%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,20%	3,29%	3,29%	6,50%	12,91%	18,51%	0,25%	0,01%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	1,20%	3,30%	3,30%	6,52%	12,98%	18,74%	0,26%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,52%	4,38%	4,38%	7,03%	10,38%	20,01%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	3,20%	3,20%	6,47%	13,12%	24,66%	0,00%	0,01%
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%
IMA-B (Benchmark)	2,66%	3,98%	3,98%	4,22%	7,51%	12,36%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,78%	1,40%	1,40%	1,54%	1,74%	0,78%	2,06%	0,05%
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
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%



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
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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,15%	3,08%	3,08%	6,43%	13,24%	21,06%	0,03%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,44%	-0,55%	-0,55%	10,67%	-55,33%	-57,76%	0,09%	0,61%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	3,02%	3,02%	6,39%	13,33%	21,44%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	4,04%	4,04%	6,85%	10,74%	21,40%	0,89%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	3,25%	3,25%	5,55%	11,71%	14,38%	0,19%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
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
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 VALOR FIC AÇÕES	-3,40%	-7,50%	-7,50%	-9,34%	-17,88%	-12,70%	8,24%	0,19%
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 CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-0,90%	-0,05%	-0,05%	-18,40%	-17,23%	-33,60%	16,37%	0,30%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,48%	-7,27%	-7,27%	-11,15%	-16,91%	-15,35%	9,24%	0,21%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-3,60%	-7,25%	-7,25%	-8,62%	-13,74%	-17,01%	8,67%	0,21%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	-5,16%	-9,52%	-9,52%	-12,35%	-17,25%	-21,26%	9,03%	0,22%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	-3,98%	-7,96%	-7,96%	-11,83%	-21,70%	-28,96%	9,08%	0,23%
IBX (Benchmark)	-3,07%	-7,27%	-7,27%	-7,64%	-16,05%	-13,70%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-6,57%	-10,92%	-10,92%	-14,86%	-24,19%	-30,10%	11,16%	0,26%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-3,62%	-6,36%	-6,36%	-35,51%	-40,61%	-45,07%	13,67%	0,29%
IDIV (Benchmark)	-2,02%	-4,08%	-4,08%	-1,06%	-6,43%	4,48%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,20%	-6,87%	-6,87%	-6,49%	-13,40%	-17,43%	8,21%	0,18%
IFIX (Benchmark)	-1,69%	-3,70%	-3,70%	-7,68%	-0,68%	-3,01%	-	-



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

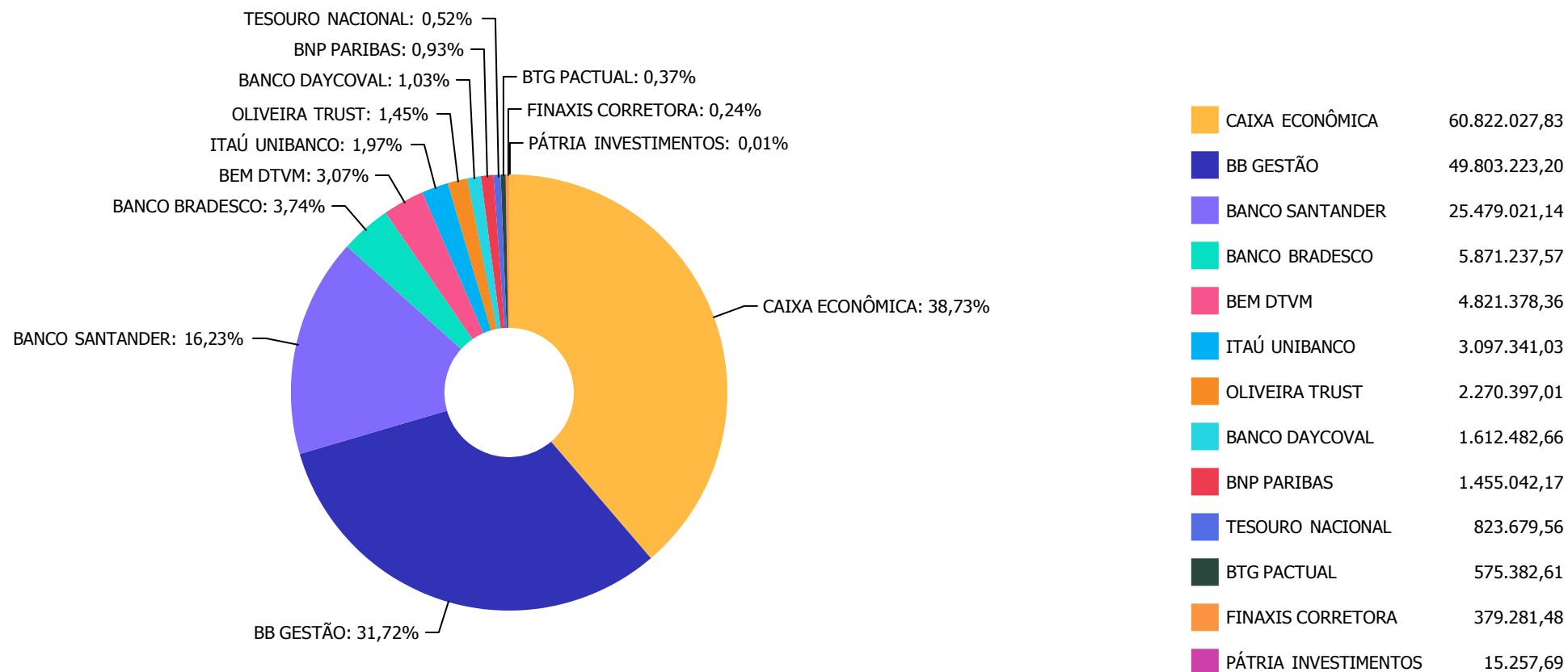
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	-0,23%	-10,88%	-10,88%	-24,37%	-21,80%	-35,63%	8,03%	0,32%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	-0,08%	-6,69%	-6,69%	-13,74%	-7,85%	-28,48%	4,39%	0,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,41%	-0,78%	-0,78%	-10,61%	-3,34%	-37,17%	9,28%	0,14%
IPCA (Benchmark)	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	1,19%	2,43%	2,43%	3,22%	14,14%	102,64%	0,62%	0,03%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,55%	4,44%	4,44%	8,53%	14,59%	39,66%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉGIA	46,26%	46,09%	46,09%	45,89%	32,30%	94,73%	72,89%	0,48%



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

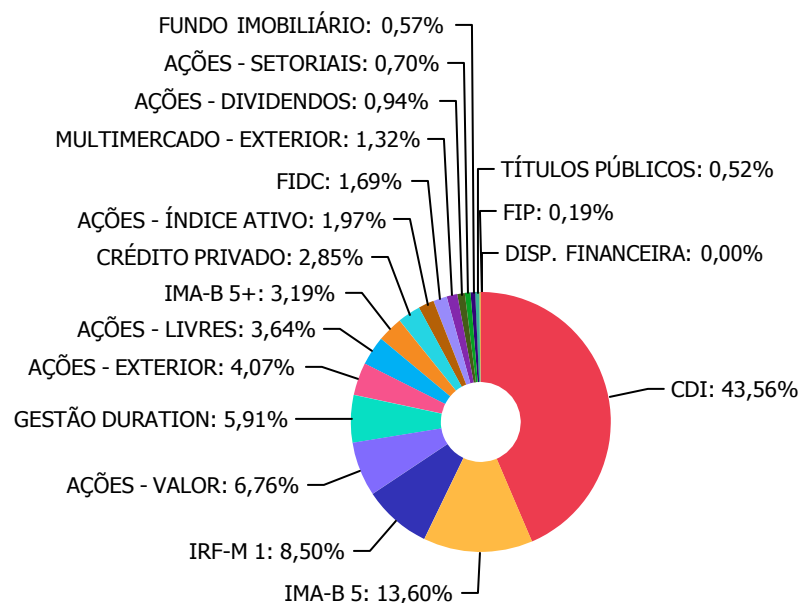
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,99%	8,73%	8,73%	13,01%	-3,04%	-8,03%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,19%	8,45%	-	12,27%	-3,59%	-10,72%	8,10%	0,18%
MSCI WORLD (Benchmark)	0,32%	4,43%	4,43%	10,27%	-1,96%	-11,47%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-1,43%	0,90%	-	9,60%	-2,57%	-18,05%	6,12%	0,15%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,30%	4,02%	4,02%	9,83%	-2,53%	-14,34%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,87%	2,99%	-	13,58%	0,45%	-9,85%	8,34%	0,16%

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





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



■ CDI	68.403.756,91	■ IMA-B 5	21.361.778,71	■ IRF-M 1	13.348.443,50	■ AÇÕES - VALOR	10.607.954,20
■ GESTÃO DURATION	9.286.010,14	■ AÇÕES - EXTERIOR	6.394.999,09	■ AÇÕES - LIVRES	5.720.384,98	■ IMA-B 5+	5.001.763,04
■ CRÉDITO PRIVADO	4.474.743,85	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.097.341,03	■ FIDC	2.649.678,49	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.078.959,41
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.483.145,84	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.103.934,71	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	887.932,61	■ TÍTULOS PÚBLICOS	823.679,56
■ FIP	301.246,24	■ DISP. FINANCEIRA	1.350,00				



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

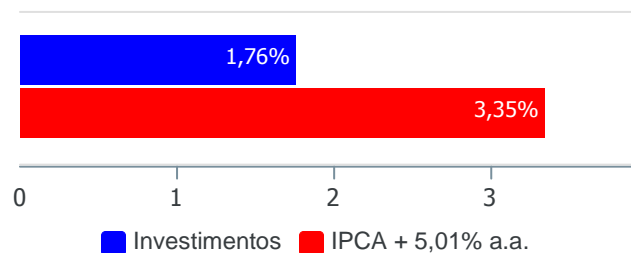
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/06/2004	201	1.451,706521	4.097,908266	291.793,01	823.679,56	Mercado



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	154.461.723,35	1.464.444,11	1.417.474,33	157.124.532,11	2.615.838,98	2.615.838,98	1,69%	1,69%	0,96%	0,96%	176,36%	2,43%
Fevereiro	157.124.532,11	1.589.512,65	1.887.293,80	156.113.877,73	-712.873,23	1.902.965,75	-0,45%	1,23%	1,19%	2,16%	56,91%	2,17%
Março	156.113.877,73	1.505.274,60	1.414.799,26	157.025.752,31	821.399,24	2.724.364,99	0,53%	1,76%	1,16%	3,35%	52,66%	2,11%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

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



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 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.163.226,16	0,00	0,00	3.251.036,68	87.810,52	2,78%	2,78%	2,06%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.724.651,91	0,00	0,00	1.750.726,36	26.074,45	1,51%	1,51%	0,10%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.408.900,19	0,00	0,00	4.474.743,85	65.843,66	1,49%	1,49%	0,88%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	2.239.984,72	0,00	0,00	2.270.397,01	30.412,29	1,36%	1,36%	0,00%
TÍTULOS PÚBLICOS	813.155,77	0,00	0,00	823.679,56	10.523,79	1,29%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	7.133.300,55	0,00	0,00	7.224.151,43	90.850,88	1,27%	1,27%	0,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	829.959,03	0,00	0,00	840.498,46	10.539,43	1,27%	1,27%	0,89%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.174.779,15	0,00	0,00	9.286.010,14	111.230,99	1,21%	1,21%	0,19%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.801.521,71	0,00	0,00	5.871.237,57	69.715,86	1,20%	1,20%	0,25%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	7.388.738,07	0,00	0,00	7.477.205,93	88.467,86	1,20%	1,20%	0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	6.208.679,98	0,00	0,00	6.282.207,55	73.527,57	1,18%	1,18%	0,19%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.333.933,94	0,00	0,00	10.455.900,67	121.966,73	1,18%	1,18%	0,19%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	21.871.052,03	0,00	0,00	22.125.331,41	254.279,38	1,16%	1,16%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.863.796,96	0,00	0,00	5.931.624,03	67.827,07	1,16%	1,16%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	12.596.733,21	0,00	0,00	12.739.202,40	142.469,19	1,13%	1,13%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.783.237,05	442.682,88	1.406.881,74	23.083.322,43	264.284,24	1,09%	1,15%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.376,22	1.062.591,72	0,00	1.083.297,24	10.329,30	0,96%	1,50%	0,89%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	380.938,46	0,00	0,00	379.281,48	-1.656,98	-0,43%	-0,43%	0,09%
Total Renda Fixa	123.726.965,11	1.505.274,60	1.406.881,74	125.349.854,20	1.524.496,23	1,23%		0,23%



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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	308.200,00	0,00	2.800,00	312.550,00	7.150,00	2,32%	1,41%	9,28%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	301.169,96	0,00	2.725,52	300.926,61	2.482,17	0,82%	-0,08%	4,39%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	275.080,00	0,00	2.392,00	274.456,00	1.768,00	0,64%	-0,23%	8,03%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.113.908,66	0,00	0,00	1.103.934,71	-9.973,95	-0,90%	-0,90%	16,37%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.532.171,15	0,00	0,00	1.483.145,84	-49.025,31	-3,20%	-3,20%	8,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.948.422,66	0,00	0,00	2.848.078,96	-100.343,70	-3,40%	-3,40%	8,24%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.027.370,83	0,00	0,00	1.956.902,66	-70.468,17	-3,48%	-3,48%	9,24%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3.213.051,54	0,00	0,00	3.097.341,03	-115.710,51	-3,60%	-3,60%	8,67%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.044.689,02	0,00	0,00	1.006.836,52	-37.852,50	-3,62%	-3,62%	13,67%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.476.911,57	0,00	0,00	2.385.089,90	-91.821,67	-3,71%	-3,71%	8,31%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.515.285,64	0,00	0,00	1.455.042,17	-60.243,47	-3,98%	-3,98%	9,08%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.978.884,99	0,00	0,00	1.880.252,91	-98.632,08	-4,98%	-4,98%	8,31%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	3.356.934,13	0,00	0,00	3.183.653,40	-173.280,73	-5,16%	-5,16%	9,03%
META VALOR FI AÇÕES	1.725.930,32	0,00	0,00	1.612.482,66	-113.447,66	-6,57%	-6,57%	11,16%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	15.078,71	0,00	0,00	15.257,69	178,98	1,19%	1,19%	0,62%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	195.528,45	0,00	0,00	285.988,55	90.460,10	46,26%	46,26%	72,89%
Total Renda Variável	24.028.617,63	0,00	7.917,52	23.201.939,61	-818.760,50	-3,41%		10,13%



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	3.937.939,98	0,00	0,00	4.063.603,09	125.663,11	3,19%	3,19%	8,10%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	2.311.185,74	0,00	0,00	2.331.396,00	20.210,26	0,87%	0,87%	8,34%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.109.169,27	0,00	0,00	2.078.959,41	-30.209,86	-1,43%	-1,43%	6,12%
Total Exterior	8.358.294,99	0,00	0,00	8.473.958,50	115.663,51	1,38%		7,68%



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
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.473.799,99	3.244.453,39	2.324.884,23	23.083.322,43	689.953,28	2,79%	3,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	21.196.834,37	252.186,25	0,00	22.125.331,41	676.310,79	3,15%	3,17%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	12.366.085,75	0,00	0,00	12.739.202,40	373.116,65	3,02%	3,02%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.089.543,47	0,00	0,00	10.455.900,67	366.357,20	3,63%	3,63%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.866.526,50	0,00	1.885.291,67	9.286.010,14	304.775,31	2,80%	3,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	7.142.396,15	0,00	204.969,56	7.224.151,43	286.724,84	4,01%	4,06%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	7.238.519,35	0,00	0,00	7.477.205,93	238.686,58	3,30%	3,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	6.061.427,94	0,00	0,00	6.282.207,55	220.779,61	3,64%	3,64%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.684.060,55	0,00	0,00	5.871.237,57	187.177,02	3,29%	3,29%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.290.432,24	0,00	0,00	4.474.743,85	184.311,61	4,30%	4,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.747.643,38	0,00	0,00	5.931.624,03	183.980,65	3,20%	3,20%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.206.253,72	0,00	93.881,28	3.251.036,68	138.664,24	4,32%	1,40%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	2.188.060,89	0,00	0,00	2.270.397,01	82.336,12	3,76%	-16,61%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.738.735,18	0,00	52.294,00	1.750.726,36	64.285,18	3,70%	0,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	831.530,22	0,00	24.288,72	840.498,46	33.256,96	4,00%	4,04%
TÍTULOS PÚBLICOS	814.482,90	0,00	23.952,37	823.679,56	33.149,03	4,07%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	35.888,87	1.062.591,72	25.709,69	1.083.297,24	10.526,34	0,96%	4,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	30.722,73	0,00	30.754,67	0,00	31,94	0,10%	4,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	29.926,53	0,00	29.684,64	0,00	-241,89	-0,81%	3,91%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	381.363,43	0,00	0,00	379.281,48	-2.081,95	-0,55%	-0,55%



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
Total Renda Fixa	121.414.234,16	4.559.231,36	4.695.710,83	125.349.854,20	4.072.099,51	3,23%	



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
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	195.767,28	0,00	0,00	285.988,55	90.221,27	46,09%	46,09%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	315.000,00	0,00	8.400,00	312.550,00	5.950,00	1,89%	-0,78%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	14.895,09	0,00	0,00	15.257,69	362,60	2,43%	2,43%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.104.499,12	0,00	0,00	1.103.934,71	-564,41	-0,05%	-0,05%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	322.487,42	0,00	8.176,56	300.926,61	-13.384,25	-4,15%	-6,69%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	307.944,00	0,00	7.280,00	274.456,00	-26.208,00	-8,51%	-10,87%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.075.259,45	0,00	0,00	1.006.836,52	-68.422,93	-6,36%	-6,36%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.592.608,59	0,00	0,00	1.483.145,84	-109.462,75	-6,87%	-6,87%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.580.956,09	0,00	0,00	1.455.042,17	-125.913,92	-7,96%	-7,96%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.017.907,41	0,00	0,00	1.880.252,91	-137.654,50	-6,82%	-6,82%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.110.315,59	0,00	0,00	1.956.902,66	-153.412,93	-7,27%	-7,27%
META VALOR FI AÇÕES	1.810.180,70	0,00	0,00	1.612.482,66	-197.698,04	-10,92%	-10,92%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.591.642,06	0,00	0,00	2.385.089,90	-206.552,16	-7,97%	-7,97%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.079.114,50	0,00	0,00	2.848.078,96	-231.035,54	-7,50%	-7,50%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3.339.277,45	0,00	0,00	3.097.341,03	-241.936,42	-7,25%	-7,25%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	3.518.732,98	0,00	0,00	3.183.653,40	-335.079,58	-9,52%	-9,52%
Total Renda Variável	24.976.587,73	0,00	23.856,56	23.201.939,61	-1.750.791,56	-7,01%	



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	3.746.868,61	0,00	0,00	4.063.603,09	316.734,48	8,45%	8,45%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	2.263.679,89	0,00	0,00	2.331.396,00	67.716,11	2,99%	2,99%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.060.352,96	0,00	0,00	2.078.959,41	18.606,45	0,90%	0,90%
Total Exterior	8.070.901,46	0,00	0,00	8.473.958,50	403.057,04	4,99%	

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.