

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

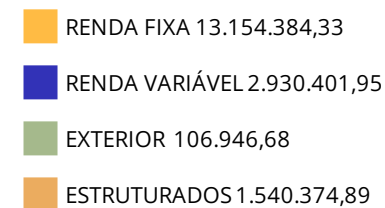
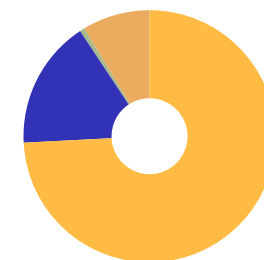
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.414.522,86	7,98%	960	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	950.120,56	5,36%	766	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	314.213,90	1,77%	360	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	313.411,34	1,77%	287	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	788.960,06	4,45%	794	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	71.736,09	0,40%	920	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	0,01	0,00%	689	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	556.622,30	3,14%	1.184	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	544.679,46	3,07%	293	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.560.406,56	8,80%	935	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	523.219,51	2,95%	203	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.188.793,27	12,34%	1.088	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.335.866,88	7,53%	235	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	207.456,59	1,17%	401	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.361.377,33	13,32%	211	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	892.039,60	5,03%	1.588	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	358.151,49	2,02%	2.969	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	482.764,04	2,72%	28	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	398.151,61	2,25%	1.185	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	D+3 du	Não há	119.094,59	0,67%	12.704	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 SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	475.592,77	2,68%	6.356	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	204.607,85	1,15%	86	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	106.946,68	0,60%	500	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	271.969,51	1,53%	181	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	771.424,29	4,35%	124	0,11%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	82.108,88	0,46%	7.689	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	414.872,21	2,34%	3.244	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIO...	Não se ...	Não se aplica	22.997,61	0,13%	2.068	0,02%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			17.732.107,85				

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

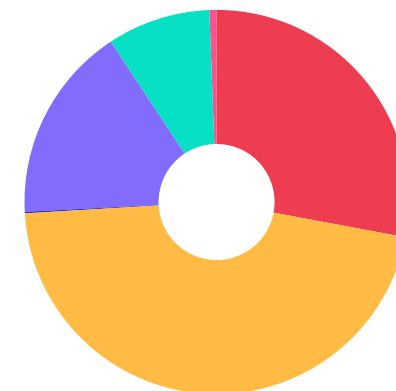
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,39%	81,95%	14.531.462,38
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.954.266,58	27,94%	20,39%	23,00%	81,95%	9.577.195,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	8.177.120,14	46,11%	20,79%	23,00%	60,00%	2.462.144,57
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	3.546.421,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	886.605,39
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	886.605,39
Desenquadrado - RF	0,00%	22.997,61	0,13%	0,00%	0,00%	0,00%	-22.997,61
Total Renda Fixa	100,00%	13.154.384,33	74,18%	41,18%	70,89%	253,90%	



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%	2.930.401,95	16,53%	0,89%	18,11%	20,00%	616.019,62
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.540.374,89	8,69%	3,75%	5,00%	10,00%	232.835,90
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	4.470.776,84	25,21%	4,64%	23,11%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	106.946,68	0,60%	0,00%	5,00%	10,00%	1.666.264,11
Total Exterior	10,00%	106.946,68	0,60%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.473.437,26	47,79	-
CAIXA DTVM	6.186.923,76	34,89	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	2.565.985,18	14,47	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	482.764,04	2,72	0,00
BV ASSET	22.997,61	0,13	0,00

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	4.954.266,58	27,94	20,39	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	8.177.120,14	46,11	20,79	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	2.930.401,95	16,53	0,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	106.946,68	0,60	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.540.374,89	8,69	3,75	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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
IPCA + 5,50% ao ano (Benchmark)	1,20%	3,47%	3,47%	6,55%	10,41%	29,64%	-	-
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR - BBVH11	1,33%	-1,05%	-1,05%	-19,35%	-32,80%	-50,34%	-	0,24%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,58%	4,71%	4,71%	7,06%	10,21%	20,24%	-	-
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%
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%
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,49%	4,32%	4,32%	6,87%	10,13%	19,36%	0,89%	0,03%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,60%	3,84%	3,84%	4,02%	7,07%	11,73%	1,60%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	2,15%	3,89%	3,89%	5,70%	11,55%	13,99%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,12%	3,88%	3,88%	5,70%	11,40%	13,64%	1,33%	0,03%

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 (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,16%	3,08%	3,08%	6,38%	13,21%	21,04%	0,03%	0,00%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,08%	2,99%	2,99%	6,03%	12,15%	18,06%	0,01%	0,00%
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%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,43%	4,12%	4,12%	3,57%	9,39%	16,97%	1,62%	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
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	-3,06%	-21,01%	-21,01%	-22,66%	-	-	18,34%	-
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,39%	3,30%	3,30%	6,16%	12,27%	19,48%	0,64%	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%
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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3,19%	8,45%	8,45%	12,27%	-3,59%	-10,72%	8,10%	0,18%
Ibovespa (Benchmark)	-2,91%	-7,16%	-7,16%	-7,41%	-15,10%	-12,65%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-5,07%	-10,05%	-10,05%	-18,77%	-26,61%	-29,77%	9,94%	0,25%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,23%	-7,75%	-7,75%	-11,66%	-17,37%	-21,63%	8,65%	0,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,40%	-7,50%	-7,50%	-9,34%	-17,88%	-12,70%	8,24%	0,19%
IBX (Benchmark)	-3,07%	-7,27%	-7,27%	-7,64%	-16,05%	-13,70%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	-3,69%	-7,66%	-7,66%	-8,00%	-15,57%	-15,58%	8,67%	0,21%
IDIV (Benchmark)	-2,02%	-4,08%	-4,08%	-1,06%	-6,43%	4,48%	-	-

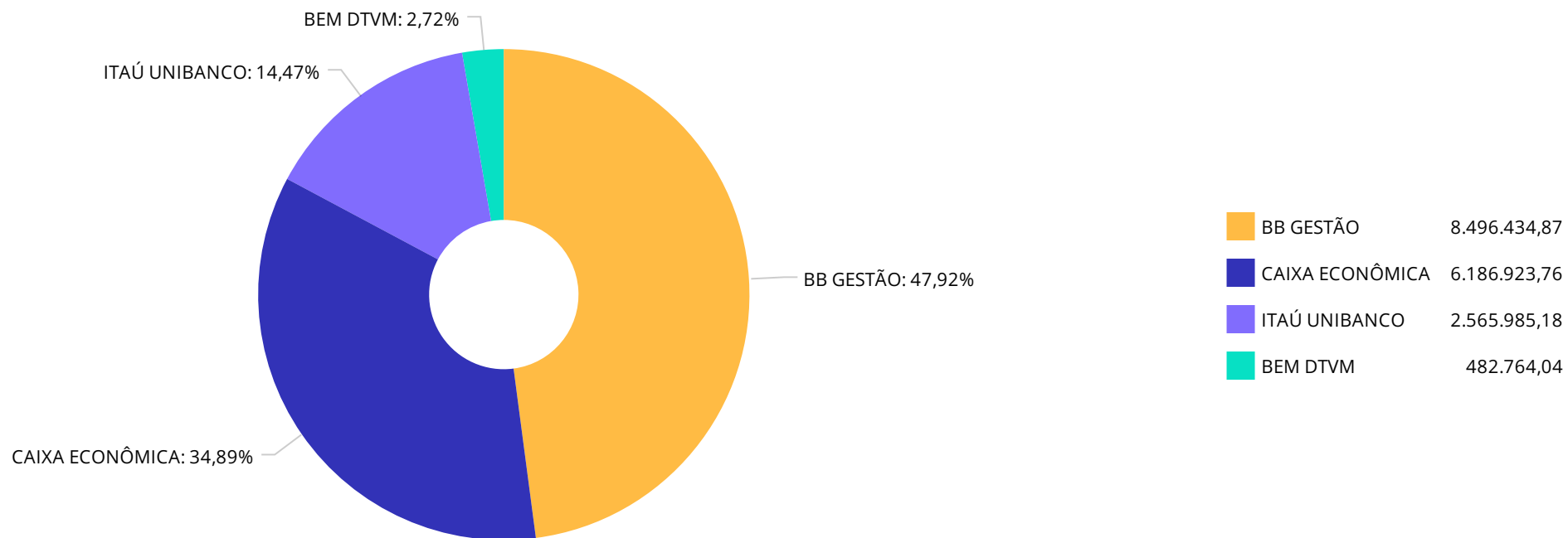
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA VARIÁVEL

	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%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,30%	4,02%	4,02%	9,83%	-2,53%	-14,34%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,98%	8,82%	8,82%	19,38%	-1,19%	19,14%	8,77%	0,24%
SMLL (Benchmark)	-1,74%	-9,51%	-9,51%	-16,40%	-27,95%	-35,01%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	-1,83%	-9,25%	-9,25%	-16,26%	-28,20%	-35,73%	11,46%	0,28%

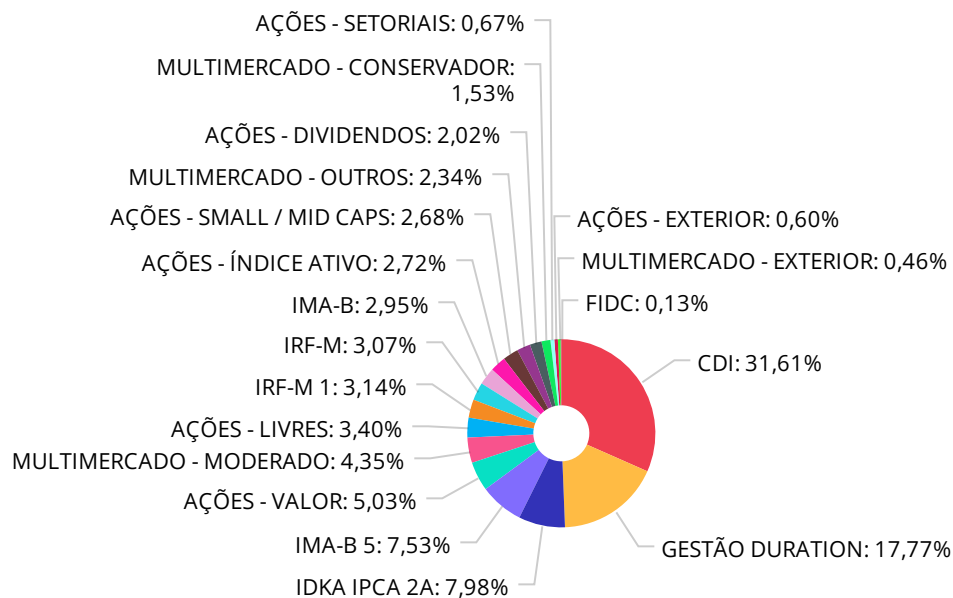
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3,19%	8,45%	8,45%	12,27%	-3,59%	-10,72%	8,10%	18,285%

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



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

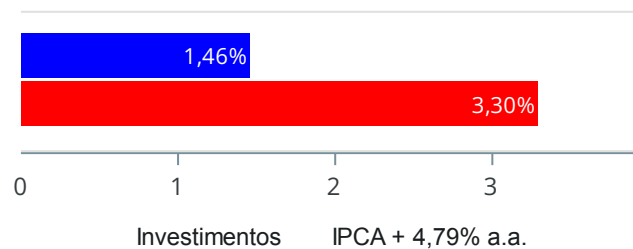


■ CDI	5.605.934,64	■ GESTÃO DURATION	3.150.337,39	■ IDKA IPCA 2A	1.414.522,86
■ IMA-B 5	1.336.070,55	■ AÇÕES - VALOR	892.039,60	■ MULTIMERCADO - MODERADO	771.424,29
■ AÇÕES - LIVRES	602.759,46	■ IRF-M 1	556.622,30	■ IRF-M	544.679,46
■ IMA-B	523.219,52	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	482.764,04	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	475.592,77
■ MULTIMERCADO - OUTROS	414.872,21	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	358.151,49	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	271.969,51
■ AÇÕES - SETORIAIS	119.094,59	■ AÇÕES - EXTERIOR	106.946,68	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	82.108,88
■ FIDC	22.997,61				

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	15.748.217,86	3.020.333,62	3.365.388,50	15.637.150,23	233.987,25	233.987,25	1,49%	1,49%	0,94%	0,94%	157,82%	2,47%
Fevereiro	15.637.150,23	5.060.253,79	4.304.184,87	16.271.289,18	-121.929,97	112.057,28	-0,74%	0,73%	1,18%	2,13%	34,32%	2,32%
Março	16.271.289,18	3.001.843,79	3.218.801,39	16.171.701,81	117.370,23	229.427,51	0,72%	1,46%	1,14%	3,30%	44,23%	2,18%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



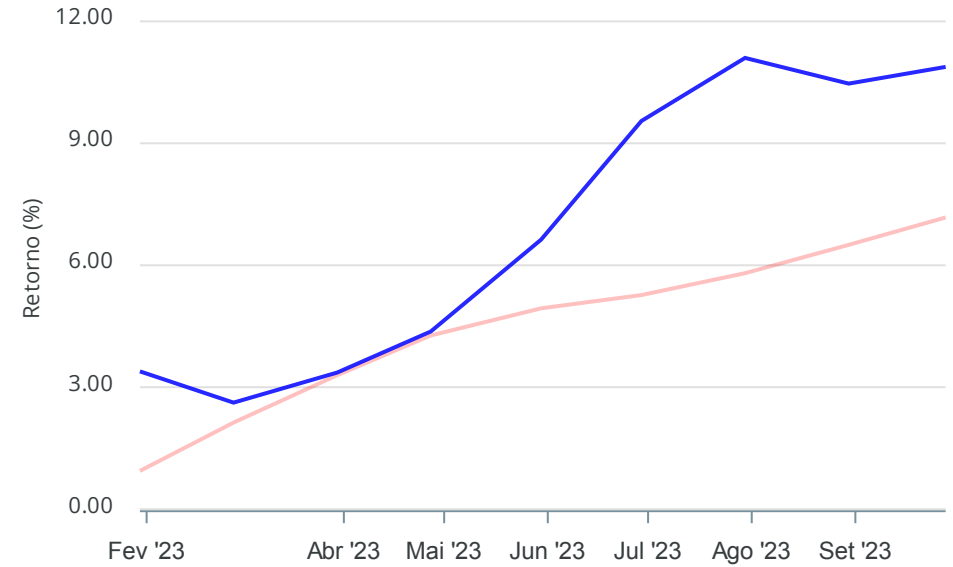
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	509.952,26	0,00	0,00	523.219,51	13.267,25	2,60%	2,60%	1,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.305.262,19	0,00	0,00	2.361.377,33	56.115,14	2,43%	2,43%	1,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	533.359,64	0,00	0,00	544.679,46	11.319,82	2,12%	2,12%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	70.677,54	0,00	0,00	71.736,09	1.058,55	1,50%	1,50%	0,89%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	936.192,19	0,00	0,00	950.120,56	13.928,37	1,49%	1,49%	0,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.395.233,32	0,00	0,00	1.414.522,86	19.289,54	1,38%	1,38%	1,08%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	22.694,87	0,00	0,00	22.997,61	302,74	1,33%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	779.509,63	0,00	0,00	788.960,06	9.450,43	1,21%	1,21%	0,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	549.987,84	0,00	0,00	556.622,30	6.634,46	1,21%	1,21%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	310.536,31	0,00	0,00	314.213,90	3.677,59	1,18%	1,18%	0,19%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	309.755,44	0,00	0,00	313.411,34	3.655,90	1,18%	1,18%	0,19%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	205.077,76	0,00	0,00	207.456,59	2.378,83	1,16%	1,16%	0,03%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.207.659,05	196.855,49	83.861,55	1.335.866,88	15.213,89	1,08%	1,15%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	813.216,41	847.514,44	113.850,73	1.560.406,56	13.526,44	0,81%	1,08%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.481.729,09	2.804.988,30	3.134.939,84	2.188.793,27	37.015,72	0,70%	1,16%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	2,65%	1,62%
Total Renda Fixa	12.430.843,55	3.849.358,23	3.332.652,12	13.154.384,33	206.834,67	1,60%		0,63%

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 INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	78.968,69	0,00	0,00	82.108,88	3.140,19	3,98%	3,98%	8,77%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	268.230,90	0,00	0,00	271.969,51	3.738,61	1,39%	1,39%	0,64%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	410.210,56	0,00	0,00	414.872,21	4.661,65	1,14%	1,14%	0,11%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	765.209,34	0,00	0,00	771.424,29	6.214,95	0,81%	0,81%	1,66%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	364.076,31	0,00	0,00	358.151,49	-5.924,82	-1,63%	-1,63%	6,89%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	484.456,32	0,00	0,00	475.592,77	-8.863,55	-1,83%	-1,83%	11,46%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	122.852,94	0,00	0,00	119.094,59	-3.758,35	-3,06%	-3,06%	18,34%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	923.468,00	0,00	0,00	892.039,60	-31.428,40	-3,40%	-3,40%	8,24%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	501.267,62	0,00	0,00	482.764,04	-18.503,58	-3,69%	-3,69%	8,67%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	415.751,74	0,00	0,00	398.151,61	-17.600,13	-4,23%	-4,23%	8,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	215.529,65	0,00	0,00	204.607,85	-10.921,80	-5,07%	-5,07%	9,94%
Total Renda Variável	4.550.022,07	0,00	0,00	4.470.776,84	-79.245,23	-1,74%		6,56%

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 FIAÇÕES BDR NÍVEL I	103.639,45	0,00	0,00	106.946,68	3.307,23	3,19%	3,19%	8,10%
Total Exterior	103.639,45	0,00	0,00	106.946,68	3.307,23	3,19%		8,10%

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.431.420,75	8.572.165,41	9.929.783,63	2.188.793,27	114.990,74	0,96%	3,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.267.856,56	0,00	0,00	2.361.377,33	93.520,77	4,12%	4,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.355.280,91	0,00	0,00	1.414.522,86	59.241,95	4,37%	4,37%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.585.665,76	465.265,79	758.591,13	1.335.866,88	43.526,46	2,12%	3,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	170.580,65	750.000,00	0,00	950.120,56	29.539,91	3,21%	4,32%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	304.549,81	1.844.526,59	614.687,35	1.560.406,56	26.017,51	1,21%	2,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	764.143,90	0,00	0,00	788.960,06	24.816,16	3,25%	3,25%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	524.355,66	0,00	0,00	544.679,46	20.323,80	3,88%	3,88%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	503.888,05	0,00	0,00	523.219,51	19.331,46	3,84%	3,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,01	545.000,00	0,00	556.622,30	11.622,29	2,13%	3,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	303.171,28	0,00	0,00	314.213,90	11.042,62	3,64%	3,64%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	302.429,93	0,00	0,00	313.411,34	10.981,41	3,63%	3,63%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	201.251,13	0,00	0,00	207.456,59	6.205,46	3,08%	3,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	68.762,78	0,00	0,00	71.736,09	2.973,31	4,32%	4,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	3,91%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	23.241,33	0,00	0,00	22.997,61	-243,72	-1,05%	-1,05%
Total Renda Fixa	11.806.598,52	12.176.957,79	11.303.062,11	13.154.384,33	473.890,13	3,74%	

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	402.444,44	0,00	0,00	414.872,21	12.427,77	3,09%	3,09%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	462.588,42	0,00	200.000,00	271.969,51	9.381,09	2,03%	3,30%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	763.666,51	0,00	0,00	771.424,29	7.757,78	1,02%	1,02%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	75.451,79	0,00	0,00	82.108,88	6.657,09	8,82%	8,82%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	365.805,19	0,00	0,00	358.151,49	-7.653,70	-2,09%	-2,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	227.475,24	0,00	0,00	204.607,85	-22.867,39	-10,05%	-10,05%
CAIXA ELETOBRAS FIAÇÕES	150.776,87	0,00	0,00	119.094,59	-31.682,28	-21,01%	-21,01%
BRANCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	522.781,83	0,00	0,00	482.764,04	-40.017,79	-7,65%	-7,65%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	88.598,84	350.000,00	0,00	398.151,61	-40.447,23	-9,22%	-7,75%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	524.073,46	0,00	0,00	475.592,77	-48.480,69	-9,25%	-9,25%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	563.895,27	400.000,00	0,00	892.039,60	-71.855,67	-7,45%	-7,50%
Total Renda Variável	4.147.557,86	750.000,00	200.000,00	4.470.776,84	-226.781,02	-4,83%	

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 FIAÇÕES BDR NÍVEL I	98.610,79	0,00	0,00	106.946,68	8.335,89	8,45%	8,45%
Total Exterior	98.610,79	0,00	0,00	106.946,68	8.335,89	8,45%	

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 E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. 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.

