

# **RELATORIO DE INVESTIMENTOS**

**MARÇO 2023**

**1 Trimestre**



## SUMÁRIO

1. Apresentação .....	3
2. Parecer do Comitê de Investimentos .....	3
3. Aprovação do Conselho de Administração .....	3

## **1. APRESENTAÇÃO**

---

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

## **2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**

---

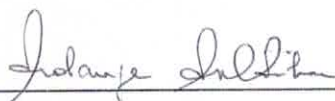
O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês mar/2023 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

## **3. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO**

---


O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de março de 2023, em reunião realizada em 19 de abril de 2023.

Solange Siqueira Duarte Silva



---

Mauracy Moraes de Oliveira



---



CRÉDITO  
& MERCADO

# Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023

*[Handwritten signature]*

*[Handwritten mark]*



Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cofistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			172.673.101,49	40,21%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	14.841.605,76	3,46%	766	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.601.067,42	1,30%	520	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRE-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	545.828,30	0,13%	1.124	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	20.452.297,15	4,76%	360	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.420.155,22	1,26%	794	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDXA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RÊ...	D+0	Não há	3.177.461,67	0,74%	935	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	45.225.410,05	10,53%	935	1,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.236.204,71	0,75%	81	0,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.251.437,58	2,39%	343	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.807.471,82	1,35%	120	0,79%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	34.125.177,48	7,95%	401	0,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.755.265,13	0,64%	211	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.442.904,79	2,66%	356	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info		85.874.931,50	20,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.635.130,85	0,61%	12.712	0,40%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.632.328,49	0,61%	500	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.867.388,62	0,43%	2.329	1,74%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	560.854,84	0,13%	3.244	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	282.534,86	0,07%	6.349	0,05%	Artigo 10º, Inciso I

*[Handwritten signature]*



**CRÉDITO  
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cofistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>							
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			429.408.557,73				
PL Total			4.837,64				Artigo 6º
			429.413.395,37				

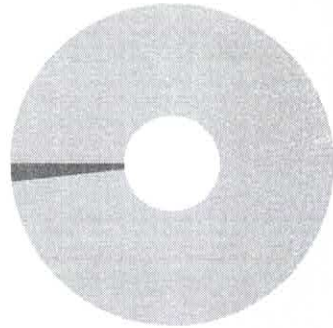
*[Handwritten signature]*

2



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, Alinea 'a'	100,00%	172.673.101,49	40,21%	20,00%	37,00%	60,00%	84.972.033,15
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	100,00%	50.038.415,52	11,65%	5,00%	10,00%	60,00%	207.606.719,12
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	42.940.855,77
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	112.843.871,56	26,28%	0,00%	18,00%	60,00%	144.801.263,08
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	8.588.171,15
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	85.874.931,50	20,00%	20,00%	20,00%	20,00%	6.780,05
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	21.470.427,89
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>421.430.320,07</b>	<b>98,14%</b>	<b>45,00%</b>	<b>86,00%</b>	<b>217,00%</b>	



RENDA FIXA 421.430.320,07

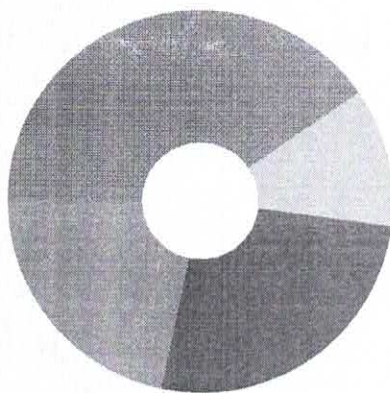
EXTERIOR 7.134.847,70

ESTRUTURADOS 843.389,70



**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%	0,00	0,00%	0,00%	8,00%	30,00%	128.822.567,32
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	42.940.855,77
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	843.389,70	0,20%	0,00%	2,00%	10,00%	42.097.466,07
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	21.470.427,89
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	21.470.427,89
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>843.389,70</b>	<b>0,20%</b>	<b>0,00%</b>	<b>11,50%</b>	<b>60,00%</b>	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	42.940.855,77
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.134.847,96	1,66%	0,00%	2,00%	10,00%	35.806.007,81
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>7.134.847,96</b>	<b>1,66%</b>	<b>0,00%</b>	<b>2,50%</b>	<b>20,00%</b>	

3

SP





Enquadramento por Gestores - base (Marco / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	172.673.101,49	40,21	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	89.301.339,53	20,80	-
CAIXA DTVM	52.005.984,38	12,11	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.487.642,29	3,14	0,00
ITAÚ UNIBANCO	13.310.293,41	3,10	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.755.265,13	0,64	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	172.673.101,49	40,21	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	50.038.415,52	11,65	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	112.843.871,56	26,28	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	7.134.847,96	1,66	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	843.389,70	0,20	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,52%	4,38%	4,38%	7,03%	10,38%	20,01%	-	-
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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,66%	3,98%	3,98%	4,22%	7,51%	12,36%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,60%	3,89%	3,89%	4,06%	7,26%	11,74%	1,58%	0,04%
BRASECO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,71%	3,99%	3,99%	4,03%	7,17%	11,44%	1,64%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	3,11%	3,11%	6,53%	13,53%	21,94%	0,06%	0,00%
BRASECO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	3,21%	3,21%	6,65%	13,70%	21,72%	0,03%	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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	3,64%	3,64%	7,77%	11,11%	20,82%	0,19%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,16%	3,08%	3,08%	6,38%	13,21%	21,04%	0,03%	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
IPCA (Benchmark)	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
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%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,30%	3,32%	3,32%	5,35%	11,58%	15,37%	0,33%	0,02%
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-



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

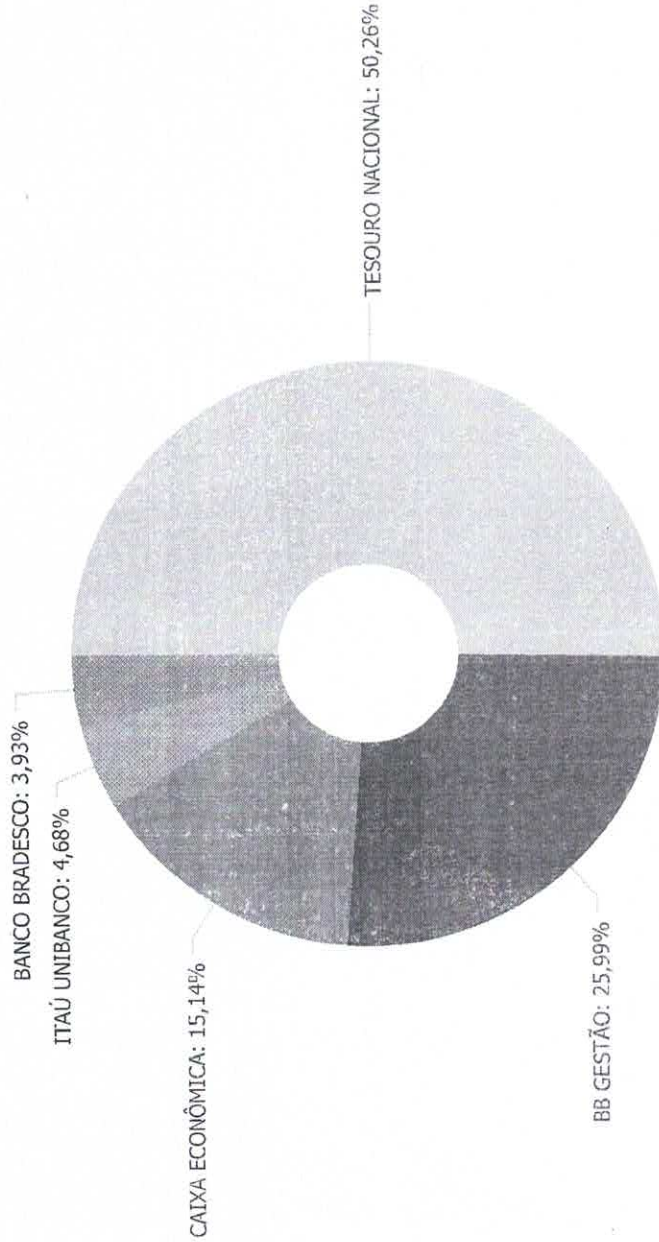
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1,14%	3,09%	3,09%	6,08%	13,30%	21,32%	0,11%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,49%	0,28%	0,28%	1,83%	5,56%	11,59%	2,21%	0,07%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	2,99%	8,73%	8,73%	13,01%	-3,04%	-8,03%	-	-
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	0,74%	4,04%	4,04%	7,18%	-4,00%	-11,09%	-	-



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

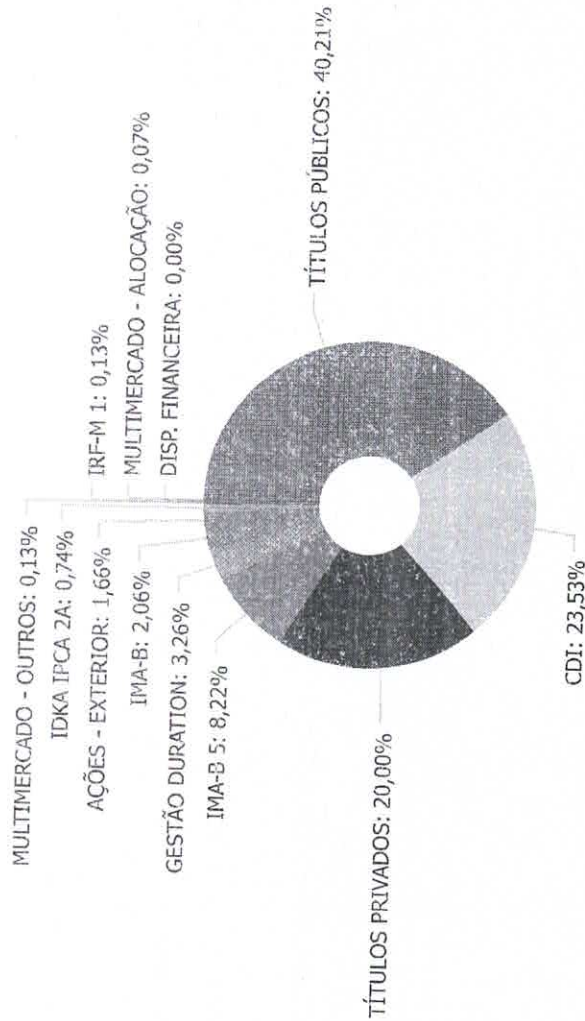
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	0,74%	4,04%	4,04%	7,18%	-4,00%	-11,09%	-	-
<b>BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	1,00%	3,21%	-	8,91%	-5,03%	-10,77%	7,58%	0,17%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	2,99%	8,73%	8,73%	13,01%	-3,04%	-8,03%	-	-
<b>ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-1,76%	-2,58%	-	3,99%	-5,29%	-8,70%	7,25%	0,14%
<b>CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	3,19%	8,45%	-	12,27%	-3,59%	-10,72%	8,10%	0,18%

*[Handwritten signature]*



Administrador	Valor
TESOURO NACIONAL	172.573.101,49
BB GESTÃO	89.301.339,53
CAIXA ECONÔMICA	52.005.984,38
ITAÚ UNIBANCO	16.065.558,54
BANCO BRADESCO	13.487.642,29

3



■ TÍTULOS PÚBLICOS	172.673.101,49	■ CDI	101.044.929,90	■ TÍTULOS PRIVADOS	85.874.931,50	■ IMA-B 5	35.293.902,91
■ GESTÃO DURATION	13.982.892,17	■ IMA-B	8.837.272,13	■ AÇÕES - EXTERIOR	7.134.847,96	■ IDKA IPCA 2A	3.177.461,67
■ MULTIMERCADO - OUTROS	560.854,84	■ IRF-M 1	545.828,30	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	282.534,86	■ DISP. FINANCEIRA	4.837,64



**CRÉDITO  
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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	30/06/2022	19.713	4058,06717400	4.102,495982	79.996.678,20	80.872.503,29	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.190,140140	49.999.526,70	51.270.554,75	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.040,076101	39.999.580,25	40.530.043,45	Curva

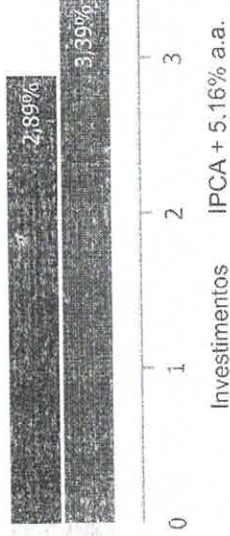




Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

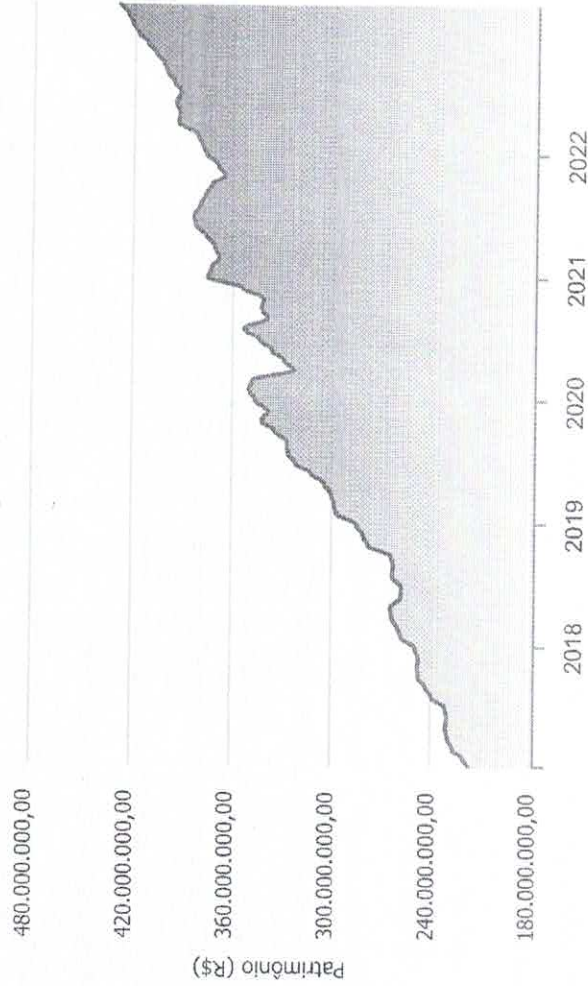
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Reformo Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	415.684.852,33	516.807,90	2.125.592,86	419.457.860,72	5.381.793,35	5.381.793,35	1,29%	1,29%	0,97%	0,97%	133,12%	2,36%
Fevereiro	419.457.860,72	6.973.832,76	6.244.425,99	422.199.303,38	2.012.035,89	7.393.829,24	0,48%	1,78%	1,20%	2,19%	81,37%	1,97%
Março	422.199.303,38	100.645.059,58	100.069.417,00	427.389.027,57	4.614.081,61	12.007.910,85	1,09%	2,89%	1,17%	3,39%	85,35%	0,59%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





Evolução do Patrimônio



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
- SMILL
- IDIV

*[Handwritten signature]*



**FUNDOS DE RENDA FIXA**

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

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.150.884,36	0,00	0,00	3.236.204,71	85.320,35	2,71%	2,71%	1,64%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.291.883,09	0,00	1.314.638,19	0,00	22.755,10	1,76%	2,69%	1,69%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.708.764,50	2.795.922,83	0,00	5.601.067,42	96.380,09	1,75%	2,60%	1,58%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA ...	1.457.450,78	0,00	1.482.784,91	0,00	25.334,13	1,74%	2,65%	1,62%
LETRA FINANCEIRA BTG	84.473.360,30	0,00	0,00	85.874.931,50	1.401.571,20	1,66%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	130.193.969,79	39.999.580,24	0,00	172.673.101,49	2.479.551,46	1,46%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC REND...	3.133.779,12	0,00	0,00	3.177.461,67	43.682,55	1,39%	1,39%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	11.373.957,97	0,00	11.512.842,30	0,00	138.884,33	1,22%	1,50%	0,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.355.230,75	0,00	0,00	5.420.155,22	64.924,47	1,21%	1,21%	0,19%
BB IFR-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	539.368,33	0,00	0,00	545.828,30	6.459,97	1,20%	1,20%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	20.212.921,47	0,00	0,00	20.452.297,15	239.375,68	1,18%	1,18%	0,19%
BRADERCO PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.133.276,12	0,00	0,00	10.251.437,58	118.161,46	1,17%	1,17%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FIC RENDA FIXA	33.733.876,24	0,00	0,00	34.125.177,48	391.301,24	1,16%	1,16%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.315.790,41	0,00	0,00	11.442.904,79	127.114,38	1,12%	1,12%	0,06%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.730.673,60	0,00	5.000.000,00	5.807.471,82	76.798,22	0,72%	1,30%	0,33%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.252.724,82	11.509.504,93	0,00	14.841.605,76	79.376,01	0,54%	1,49%	0,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	18.846.238,80	46.340.051,58	20.243.427,55	45.225.410,05	282.547,22	0,43%	1,08%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	37.757.796,84	0,00	35.000.000,00	2.755.265,13	-2.531,71	-0,01%	2,43%	1,62%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>389.661.947,29</b>	<b>100.645.059,58</b>	<b>74.553.692,95</b>	<b>421.430.320,07</b>	<b>5.677.006,15</b>	<b>1,37%</b>		<b>0,28%</b>



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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	20.624.095,98	0,00	19.806.012,55	0,00	-818.083,43	-3,97%	-3,19%	8,09%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	6.102.916,83	0,00	5.798.618,96	0,00	-304.297,87	-4,99%	-3,60%	8,67%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>26.727.012,81</b>	<b>0,00</b>	<b>25.604.631,51</b>	<b>0,00</b>	<b>-1.122.381,30</b>	<b>-4,20%</b>		<b>0,00%</b>

*[Handwritten signature]*



**FUNDOS EXTERIOR**

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

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.550.926,20	0,00	0,00	2.632.328,49	81.402,29	3,19%	3,19%	8,10%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.609.134,27	0,00	0,00	2.635.130,85	25.996,58	1,00%	1,00%	7,68%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.900.872,09	0,00	0,00	1.867.388,62	-33.483,47	-1,76%	-1,76%	7,25%
<b>Total Exterior</b>	<b>7.060.932,56</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>7.134.847,96</b>	<b>73.915,40</b>	<b>1,05%</b>		<b>7,69%</b>



**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	131.154.367,36	39.999.580,24	3.807.236,25	172.673.101,49	5.326.390,14	3,11%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	82.473.700,26	0,00	0,00	85.874.931,50	3.401.231,24	4,12%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	33.104.421,89	0,00	0,00	34.125.177,48	1.020.755,59	3,08%	3,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	19.733.529,07	0,00	0,00	20.452.297,15	718.768,08	3,64%	3,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	37.145.131,52	0,00	35.000.000,00	2.755.265,13	610.133,61	1,64%	4,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	15.478.070,47	54.080.861,29	24.915.416,22	45.225.410,05	581.894,51	0,84%	2,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.065.820,45	0,00	11.512.842,30	0,00	447.021,85	4,04%	4,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.098.007,96	0,00	0,00	11.442.904,79	344.896,83	3,11%	3,11%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.933.007,10	0,00	0,00	10.251.437,58	318.430,48	3,21%	3,21%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.521.611,36	0,00	5.000.000,00	5.807.471,82	285.860,46	2,72%	3,31%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.249.668,15	0,00	0,00	5.420.155,22	170.487,07	3,25%	3,25%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.164.349,41	11.509.504,93	0,00	14.841.605,76	167.751,42	1,14%	4,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.044.457,64	0,00	0,00	3.177.461,67	133.004,03	4,37%	4,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.675.146,04	2.795.922,83	0,00	5.601.067,42	129.998,55	2,38%	3,89%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.111.960,13	0,00	0,00	3.236.204,71	124.244,58	3,99%	3,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.439.826,32	0,00	1.482.784,91	0,00	42.958,59	2,98%	3,91%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.277.428,72	0,00	1.314.638,19	0,00	37.209,47	2,91%	3,85%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	528.644,99	0,00	0,00	545.828,30	17.183,31	3,25%	3,25%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>382.199.148,84</b>	<b>108.385.869,29</b>	<b>83.032.917,87</b>	<b>421.430.320,07</b>	<b>13.878.219,81</b>	<b>3,41%</b>	



**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

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

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saído Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA JUROS E MOEDAS FIMULTIMERCADO LP	544.054,07	0,00	0,00	560.854,84	16.800,77	3,09%	3,09%
CAIXA RV 30 FIMULTIMERCADO LP	281.740,61	0,00	0,00	282.534,86	794,25	0,28%	0,28%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.342.672,16	0,00	5.798.618,96	0,00	-544.053,20	-8,58%	-7,25%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIC AÇÕES	21.327.713,60	0,00	19.806.012,55	0,00	-1.521.701,05	-7,13%	-6,39%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>28.496.180,44</b>	<b>0,00</b>	<b>25.604.631,51</b>	<b>843.389,70</b>	<b>-2.048.159,23</b>	<b>-7,19%</b>	



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 (%)	(%) Insttit
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.427.153,63	0,00	0,00	2.632.328,49	205.174,86	8,45%	8,45%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.553.120,33	0,00	0,00	2.635.130,85	82.010,52	3,21%	3,21%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.916.745,10	0,00	0,00	1.867.388,62	-49.356,48	-2,58%	-2,58%
<b>Total Exterior</b>	<b>6.897.019,06</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>7.134.847,96</b>	<b>237.828,90</b>	<b>3,45%</b>	





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.