

# Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023





| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência   | Saldo        | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                     |
|---|---------|------------|--------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                    |         |            | 5.713.759,19 | 10,02%             |          | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'   |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3     | Não há     | 1.013.809,84 | 1,78%              | 661      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1     | Não há     | 750.440,43   | 1,32%              | 766      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC... | D+0     | 16/05/2023 | 4.482.441,59 | 7,86%              | 360      | 0,11%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | D+0     | 2024-08-15 | 8.693.166,01 | 15,24%             | 348      | 0,27%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0     | Não há     | 1.385.712,09 | 2,43%              | 935      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há     | 62.814,40    | 0,11%              | 1.184    | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0     | Não há     | 4.174.106,25 | 7,32%              | 293      | 0,43%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO               | D+1     | Não há     | 2.048.262,21 | 3,59%              | 203      | 0,34%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                | D+1     | Não há     | 3.743.696,97 | 6,56%              | 120      | 0,51%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP       | D+0     | Não há     | 5.853.138,45 | 10,26%             | 1.000    | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1     | Não há     | 2.848.844,33 | 5,00%              | 211      | 0,14%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                            | D+33    | Não há     | 950.249,05   | 1,67%              | 1.588    | 0,12%            | Artigo 8º, Inciso I               |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                     | D+4     | Não há     | 910.338,78   | 1,60%              | 2.969    | 0,34%            | Artigo 8º, Inciso I               |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES                        | D+4     | Não há     | 1.372.619,36 | 2,41%              | 149      | 0,34%            | Artigo 8º, Inciso I               |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES     | D+15    | Não há     | 4.293.976,99 | 7,53%              | 187      | 0,77%            | Artigo 8º, Inciso I               |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                     | D+4     | Não há     | 429.861,25   | 0,75%              | 6.356    | 0,08%            | Artigo 8º, Inciso I               |
| BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I                | D+4     | Não há     | 3.030.999,99 | 5,31%              | 158      | 0,24%            | Artigo 9º, Inciso III             |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP            | D+4     | Não há     | 887.517,91   | 1,56%              | 6.247    | 0,05%            | Artigo 10º, Inciso I              |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L... | D+15    | Não há     | 3.958.509,69 | 6,94%              | 124      | 0,57%            | Artigo 10º, Inciso I              |



CRÉDITO  
& MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

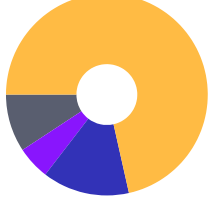
INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2023

| Produto / Fundo                                    | Resgate | Carência | Saldo                | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento        |
|--|---------|----------|----------------------|--------------------|----------|------------------|----------------------|
| CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP                    | D+1 du  | Não há   | 428.490,85           | 0,75%              | 940      | 0,61%            | Artigo 10º, Inciso I |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b> |         |          | <b>57.032.755,63</b> |                    |          |                  |                      |



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

| Artigos - Renda Fixa              | Resolução<br>Pró Gestão - Nivel 1 | Carteira \$          | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2023 |               |                | GAP<br>Superior |
|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|-----------------|
|                                   |                                   |                      |               | Inf                           | Alvo          | Sup            |                 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'   | 100,00%                           | 5.713.759,19         | 10,02%        | 9,00%                         | 14,00%        | 87,87%         | 44.400.923,18   |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   | 100,00%                           | 20.562.490,61        | 36,05%        | 22,01%                        | 32,00%        | 87,87%         | 29.552.191,76   |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 65,00%                            | 14.493.941,96        | 25,41%        | 23,53%                        | 25,00%        | 65,00%         | 22.577.349,20   |
| Artigo 7º, Inciso IV              | 20,00%                            | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 20,00%         | 11.406.551,13   |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'   | 5,00%                             | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 2.851.637,78    |
| <b>Total Renda Fixa</b>           | <b>100,00%</b>                    | <b>40.770.191,76</b> | <b>71,49%</b> | <b>54,54%</b>                 | <b>72,00%</b> | <b>265,74%</b> |                 |



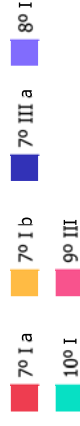
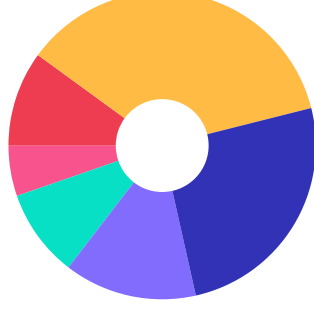
RENDA FIXA 40.770.191,76  
RENDA VARIÁVEL 7.957.045,43  
EXTERIOR 3.030.999,99  
ESTRUTURADOS 5.274.518,45

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



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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário    | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$          | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2023 |               |               | GAP Superior  |
|---|--------------------------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
|   |                                |                      |               | Inf                           | Alvo          | Sup           |               |
| Artigo 8º, Inciso I                                     | 35,00%                         | 7.957.045,43         | 13,95%        | 9,00%                         | 17,00%        | 35,00%        | 12.004.419,04 |
| Artigo 8º, Inciso II                                    | 35,00%                         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%         | 2.851.637,78  |
| Artigo 10º, Inciso I                                    | 10,00%                         | 5.274.518,45         | 9,25%         | 2,07%                         | 5,00%         | 10,00%        | 428.757,11    |
| <b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b> | <b>35,00%</b>                  | <b>13.231.563,88</b> | <b>23,20%</b> | <b>11,07%</b>                 | <b>22,00%</b> | <b>50,00%</b> |               |



| Artigos - Exterior    | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$         | Carteira     | Estratégia de Alocação - Limite - 2023 |              |               | GAP Superior |
|-----------------------|--------------------------------|---------------------|--------------|--|--------------|---------------|--------------|
|                       |                                |                     |              | Inferior                               | Alvo         | Superior      |              |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00%                         | 3.030.999,99        | 5,31%        | 3,75%                                  | 5,00%        | 10,00%        | 2.672.275,57 |
| <b>Total Exterior</b> | <b>10,00%</b>                  | <b>3.030.999,99</b> | <b>5,31%</b> | <b>3,75%</b>                           | <b>5,00%</b> | <b>10,00%</b> |              |



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

| Gestão                            | Valor         | % SI Carteira | % SI/PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM                        | 25.217.824,85 | 44,22         | -              |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM        | 21.879.707,90 | 38,36         | -              |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PUBL... | 5.713.759,19  | 10,02         | -              |
| ITAU ASSET MANAGEMENT             | 2.848.844,33  | 5,00          | -              |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT         | 1.372.619,36  | 2,41          | 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'   | 5.713.759,19                  | 10,02      | 9,00                | 87,87               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   | 20.562.490,61                 | 36,05      | 22,01               | 87,87               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 14.493.941,96                 | 25,41      | 23,53               | 65,00               |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I               | 7.957.045,43                  | 13,95      | 9,00                | 35,00               |
| Artigo 8º, Inciso II              | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 9º, Inciso III             | 3.030.999,99                  | 5,31       | 3,75                | 10,00               |
| Artigo 10º, Inciso I              | 5.274.518,45                  | 9,25       | 2,07                | 10,00               |



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

|   | Mês   | Ano   | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)                                | 1,58% | 4,71% | 4,71% | 7,06% | 10,21% | 20,24% | -       | -                |
| CAIXA-BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,39% | 4,37% | 4,37% | 6,83% | 9,61%  | 19,14% | 1,11%   | 0,03%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                  | 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%            |
| <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 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 2,60% | 3,84% | 3,84% | 4,02% | 7,07%  | 11,73% | 1,60%   | 0,04%            |
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                                    | 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%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                      | 1,17% | 3,25% | 3,25% | 6,55% | 13,28% | 20,54% | -       | -                |
| CAIXA-BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 1,15% | 3,08% | 3,08% | 6,43% | 13,24% | 21,06% | 0,03%   | 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%            |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 1,27% | 4,06% | 4,06% | 6,88% | 9,39%  | -      | 0,90%   | 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 |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IPCA (Benchmark)  | 0,71% | 2,09% | 2,09% | 3,76% | 4,65%  | 16,48% | -       | -                |
| CAIXA-BRASIL-ATIVA-FIC-RENDA-FIXA-LP                          | 1,30% | 3,32% | 3,32% | 5,35% | 11,58% | 15,37% | 0,33%   | 0,02%            |
| ITAU-INSTITUCIONAL-ALOCAÇÃO-DINÂMICA-FIC-RENDA-FIXA           | 2,43% | 4,12% | 4,12% | 3,57% | 9,39%  | 16,97% | 1,62%   | 0,03%            |
| BB-ALOCAÇÃO-ATIVA-RETORNO-TOTAL-FIC-RENDA-FIXA-PREVIDENCIÁRIO | 1,88% | 3,54% | 3,54% | 5,27% | 10,69% | 15,78% | 0,88%   | 0,02%            |



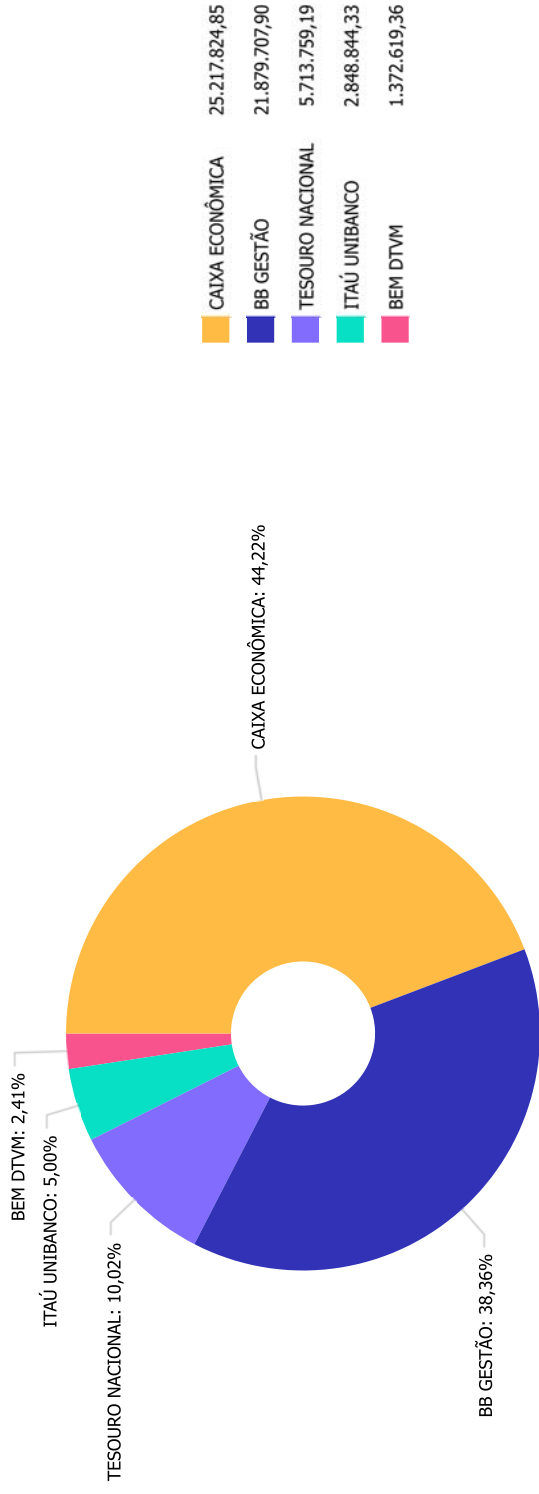
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA VARIÁVEL**

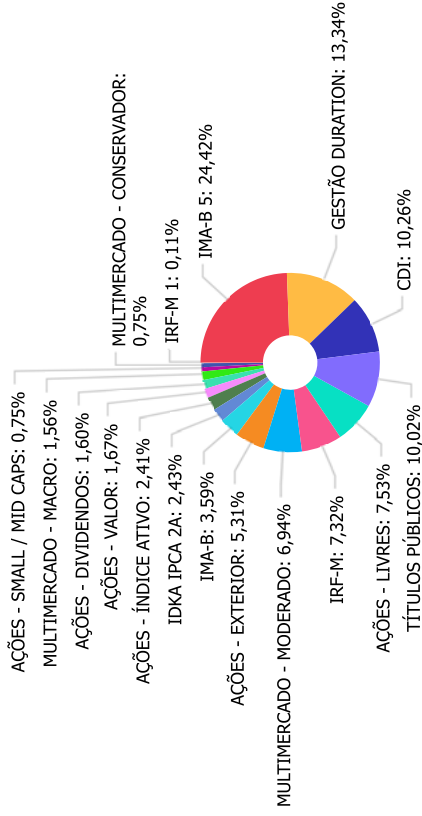
|   | Mês    | Ano    | 3M     | 6M      | 12M     | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| <b>CDI (Benchmark)</b>                            | 1,17%  | 3,25%  | 3,25%  | 6,55%   | 13,28%  | 20,54%  | -       | -                |
| CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP                   | 1,44%  | 4,96%  | 4,96%  | 8,97%   | 18,04%  | 22,22%  | 3,17%   | 0,03%            |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP          | 1,07%  | 2,15%  | 2,15%  | 3,87%   | 8,90%   | 14,16%  | 1,37%   | 0,04%            |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 0,81%  | 1,02%  | 1,02%  | 3,09%   | 9,84%   | 15,99%  | 1,66%   | 0,04%            |
| <b>Ibovespa (Benchmark)</b>                       | -2,91% | -7,16% | -7,16% | -7,41%  | -15,10% | -12,65% | -       | -                |
| CAIXA BRASILAÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES    | -2,53% | -5,20% | -5,20% | -6,00%  | -9,84%  | -0,94%  | 8,37%   | 0,18%            |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES                      | -4,02% | -7,71% | -7,71% | -8,57%  | -11,63% | -13,78% | 8,40%   | 0,22%            |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                          | -3,40% | -7,50% | -7,50% | -9,34%  | -17,88% | -12,70% | 8,24%   | 0,19%            |
| <b>IDIV (Benchmark)</b>                           | -2,02% | -4,08% | -4,08% | -1,06%  | -6,43%  | 4,48%   | -       | -                |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                   | -1,63% | -2,09% | -2,09% | -4,47%  | -11,54% | -3,87%  | 6,89%   | 0,19%            |
| <b>SMLL (Benchmark)</b>                           | -1,74% | -9,51% | -9,51% | -16,40% | -27,95% | -35,01% | -       | -                |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIC AÇÕES                  | -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% | -       | -                |
| BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1,09% | 3,47% | -     | 9,46%  | -4,07% | -8,96% | 7,58%   | 0,17%            |





| Sub-Segmento               | Valor        |
|----------------------------|--------------|
| IMA-B 5                    | 5.853.138,45 |
| TÍTULOS PÚBLICOS           | 4.174.106,25 |
| MULTIMERCADO - MODERADO    | 2.048.262,21 |
| IDKA IPCA 2A               | 950.249,05   |
| AÇÕES - DIVIDENDOS         | 429.861,25   |
| MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 62.814,40    |
| IRF-M 1                    |              |
| IMA-B                      | 7.606.351,14 |
| CDI                        | 4.293.976,99 |
| IRF-M                      | 3.030.999,99 |
| IMA-B                      | 1.372.619,36 |
| AÇÕES - VALOR              | 887.517,91   |
| AÇÕES - SMALL / MID CAPS   |              |
| IRF-M 1                    |              |
| GESTÃO DURATION            | 7.606.351,14 |
| AÇÕES - LIVRES             | 4.293.976,99 |
| IRF-M                      | 3.030.999,99 |
| IMA-B                      | 1.372.619,36 |
| AÇÕES - VALOR              | 887.517,91   |
| AÇÕES - SMALL / MID CAPS   |              |
| IRF-M 1                    |              |
| MULTIMERCADO - MODERADO    | 2.048.262,21 |
| IDKA IPCA 2A               | 950.249,05   |
| AÇÕES - DIVIDENDOS         | 429.861,25   |
| MULTIMERCADO - MACRO       |              |
| IRF-M                      |              |
| IMA-B                      |              |
| CDI                        |              |
| GESTÃO DURATION            |              |
| AÇÕES - LIVRES             |              |
| IRF-M                      |              |
| IMA-B                      |              |
| AÇÕES - VALOR              |              |
| AÇÕES - SMALL / MID CAPS   |              |
| IRF-M 1                    |              |
| MULTIMERCADO - CONSERVADOR |              |
| IRF-M 1                    |              |



CRÉDITO  
& MERCADO

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

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

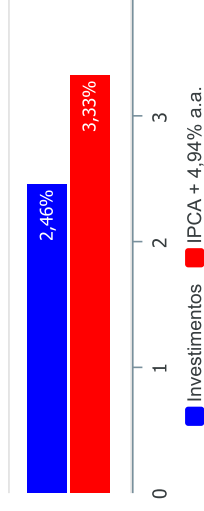
| Títulos Públicos                           | Vencimento | Compra     | Qtde | P.U. Compra  | P.U. Atual   | \$ Pago    | \$ Atual     | Marcação |
|--|------------|------------|------|--------------|--------------|------------|--------------|----------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 11/08/2004 | 500  | 1.487,344824 | 4.097,908266 | 743.672,41 | 2.048.954,13 | Mercado  |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 02/12/2004 | 270  | 1.494,58526  | 4.097,908266 | 403.538,02 | 1.106.435,23 | Mercado  |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 02/03/2009 | 630  | 1.104,73659  | 4.060,904497 | 695.984,05 | 2.558.369,83 | Mercado  |



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

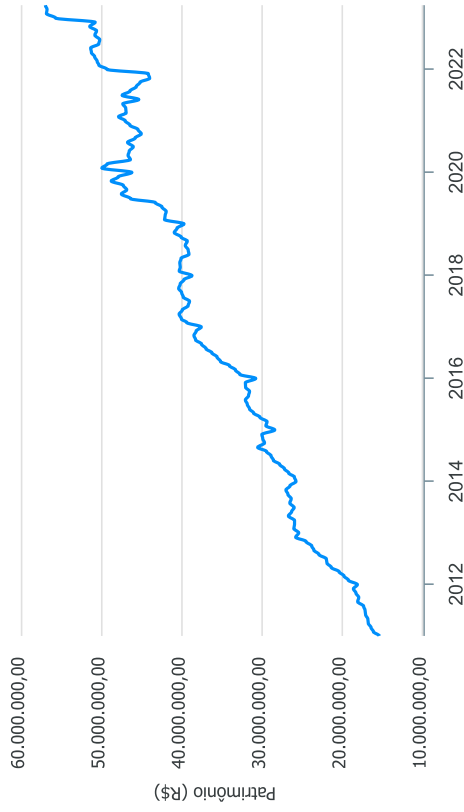
| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo no Mês  | Retorno    | Retorno Acum. | Retorno Mês | Retorno Acum. | Meta Mês | Meta Acum. | Gap Acum. | VaR   |
|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|---------------|-------------|---------------|----------|------------|-----------|-------|
| Janeiro   | 55.775.197,74  | 357.989,05   | 0,00         | 56.902.473,09 | 769.286,30 | 769.286,30    | 1,37%       | 1,37%         | 0,95%    | 0,95%      | 143,64%   | 3,07% |
| Fevereiro | 56.902.473,09  | 3.866.620,81 | 4.048.910,15 | 56.823.127,12 | 102.943,37 | 872.229,67    | 0,18%       | 1,55%         | 1,19%    | 2,15%      | 72,16%    | 2,58% |
| Março     | 56.823.127,12  | 1.432.328,52 | 1.730.000,00 | 57.032.755,63 | 507.299,99 | 1.379.529,66  | 0,89%       | 2,46%         | 1,15%    | 3,33%      | 73,84%    | 2,44% |

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
- 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



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                 | 1.996.324,52         | 0,00                | 0,00                | 2.048.262,21         | 51.937,69         | 2,60%        | 2,60%      | 1,60%        |
| TÍTULOS PÚBLICOS                                      | 5.575.388,39         | 0,00                | 0,00                | 5.713.759,19         | 138.370,80        | 2,48%        | -          | -            |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 2.781.145,15         | 0,00                | 0,00                | 2.848.844,33         | 67.699,18         | 2,43%        | 2,43%      | 1,62%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 4.087.357,75         | 0,00                | 0,00                | 4.174.106,25         | 86.748,50         | 2,12%        | 2,12%      | 1,33%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 995.137,00           | 0,00                | 0,00                | 1.013.809,84         | 18.672,84         | 1,88%        | 1,88%      | 0,88%        |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 739.439,29           | 0,00                | 0,00                | 750.440,43           | 11.001,14         | 1,49%        | 1,49%      | 0,89%        |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 1.366.661,84         | 0,00                | 0,00                | 1.385.712,09         | 19.050,25         | 1,39%        | 1,39%      | 1,11%        |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                  | 3.695.578,21         | 0,00                | 0,00                | 3.743.696,97         | 48.118,76         | 1,30%        | 1,30%      | 0,33%        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | 8.583.840,32         | 0,00                | 0,00                | 8.693.166,01         | 109.325,69        | 1,27%        | 1,27%      | 0,90%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 62.065,70            | 0,00                | 0,00                | 62.814,40            | 748,70            | 1,21%        | 1,21%      | 0,25%        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ... | 4.429.978,66         | 0,00                | 0,00                | 4.482.441,59         | 52.462,93         | 1,18%        | 1,18%      | 0,19%        |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP         | 6.097.914,27         | 1.432.328,52        | 1.730.000,00        | 5.853.138,45         | 52.895,66         | 0,70%        | 1,15%      | 0,03%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>40.410.831,10</b> | <b>1.432.328,52</b> | <b>1.730.000,00</b> | <b>40.770.191,76</b> | <b>657.032,14</b> | <b>1,63%</b> |            | <b>0,76%</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 VALOR FIC AÇÕES                        | 902.892,88          | 0,00        | 0,00        | 950.249,05          | 47.356,17          | 5,24%         | -3,40%     | 8,24%        |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                 | 925.398,30          | 0,00        | 0,00        | 910.338,78          | -15.059,52         | -1,63%        | -1,63%     | 6,89%        |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                 | 437.872,51          | 0,00        | 0,00        | 429.861,25          | -8.011,26          | -1,83%        | -1,83%     | 11,46%       |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 4.405.359,08        | 0,00        | 0,00        | 4.293.976,99        | -111.382,09        | -2,53%        | -2,53%     | 8,37%        |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES                    | 1.430.042,28        | 0,00        | 0,00        | 1.372.619,36        | -57.422,92         | -4,02%        | -4,02%     | 8,40%        |
| <b>Total Renda Variável</b>                     | <b>8.101.565,05</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>7.957.045,43</b> | <b>-144.519,62</b> | <b>-1,78%</b> |            | <b>8,36%</b> |



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    |
|--------------------------------------|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|---------------|------------|--------------|
| BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 3.083.604,65        | 0,00        | 0,00        | 3.030.999,99        | -52.604,66        | -1,71%        | 1,09%      | 7,58%        |
| <b>Total Exterior</b>                | <b>3.083.604,65</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>3.030.999,99</b> | <b>-52.604,66</b> | <b>-1,71%</b> |            | <b>7,58%</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 (%)  | (%) Instít |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|---------------------|--------------|------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | 8.472.916,63         | 121.570,52          | 243.152,29          | 8.693.166,01         | 341.831,15          | 3,98%        | 4,06%      |
| TÍTULOS PÚBLICOS                                      | 5.605.681,73         | 0,00                | 91.757,86           | 5.713.759,19         | 199.835,32          | 3,56%        | -          |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 5.990.026,07         | 0,00                | 2.000.000,00        | 4.174.106,25         | 184.080,18          | 3,07%        | 3,88%      |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ... | 4.324.912,31         | 0,00                | 0,00                | 4.482.441,59         | 157.529,28          | 3,64%        | 3,64%      |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP         | 3.638.354,96         | 5.535.367,86        | 3.444.000,00        | 5.853.138,45         | 123.415,63          | 1,35%        | 3,08%      |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                  | 3.623.578,45         | 0,00                | 0,00                | 3.743.696,97         | 120.118,52          | 3,31%        | 3,31%      |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 2.736.017,75         | 0,00                | 0,00                | 2.848.844,33         | 112.826,58          | 4,12%        | 4,12%      |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                 | 1.972.584,81         | 0,00                | 0,00                | 2.048.262,21         | 75.677,40           | 3,84%        | 3,84%      |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 1.327.708,16         | 0,00                | 0,00                | 1.385.712,09         | 58.003,93           | 4,37%        | 4,37%      |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 979.169,48           | 0,00                | 0,00                | 1.013.809,84         | 34.640,36           | 3,54%        | 3,54%      |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 719.348,97           | 0,00                | 0,00                | 750.440,43           | 31.091,46           | 4,32%        | 4,32%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 60.790,06            | 0,00                | 0,00                | 62.814,40            | 2.024,34            | 3,33%        | 3,33%      |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>39.451.089,38</b> | <b>5.656.938,38</b> | <b>5.778.910,15</b> | <b>40.770.191,76</b> | <b>1.441.074,15</b> | <b>3,19%</b> |            |



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 (%)   | (%) Institt |
|---|----------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------------|---------------|-------------|
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                          | 843.682,11           | 0,00        | 0,00        | 950.249,05           | 106.566,94         | 12,63%        | -7,50%      |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 3.916.552,98         | 0,00        | 0,00        | 3.958.509,69         | 41.956,71          | 1,07%         | 1,02%       |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP          | 867.164,50           | 0,00        | 0,00        | 887.517,91           | 20.353,41          | 2,35%         | 2,15%       |
| CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP                   | 408.243,92           | 0,00        | 0,00        | 428.490,85           | 20.246,93          | 4,96%         | 4,96%       |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                   | 929.792,70           | 0,00        | 0,00        | 910.338,78           | -19.453,92         | -2,09%        | -2,09%      |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                   | 473.680,19           | 0,00        | 0,00        | 429.861,25           | -43.818,94         | -9,25%        | -9,25%      |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES                      | 1.487.313,94         | 0,00        | 0,00        | 1.372.619,36         | -114.694,58        | -7,71%        | -7,71%      |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES   | 4.529.273,79         | 0,00        | 0,00        | 4.293.976,99         | -235.296,80        | -5,20%        | -5,20%      |
| <b>Total Renda Variável</b>                       | <b>13.455.704,13</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>13.231.563,88</b> | <b>-224.140,25</b> | <b>-1,67%</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 |
|--------------------------------------|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|--------------|-------------|
| BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.868.404,23        | 0,00        | 0,00        | 3.030.999,99        | 162.595,76        | 5,67%        | 3,47%       |
| <b>Total Exterior</b>                | <b>2.868.404,23</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>3.030.999,99</b> | <b>162.595,76</b> | <b>5,67%</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.

