

Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			137.881.160,84	31,67%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.977.668,46	2,98%	30	7,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	22.825.899,30	5,24%	20	10,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	30.675.215,67	7,05%	657	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.568.436,90	1,51%	473	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	2.251.930,74	0,52%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	9.016.874,30	2,07%	105	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	10.182.227,51	2,34%	292	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.178.065,70	2,11%	105	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	27.509.324,20	6,32%	785	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	8.559.766,61	1,97%	1.191	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	11.058.180,62	2,54%	296	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	22.295.250,12	5,12%	125	13,95%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA ...	D+0	Não há	10.383.347,82	2,39%	1.799	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.590.168,39	2,20%	216	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	16.600.293,80	3,81%	1.111	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.868.779,17	0,43%	226	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.005.926,11	0,23%	3.232	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	9.702.066,17	2,23%	163	0,77%	Artigo 8º, Inciso I
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.557.720,30	0,36%	41	14,93%	Artigo 8º, Inciso I

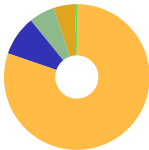


Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	6.875.399,19	1,58%	606	2,23%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.515.515,21	0,35%	30.832	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.409.749,94	0,78%	22.604	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	7.620.712,90	1,75%	185	1,31%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.631.527,29	0,37%	159	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.582.922,90	0,59%	124	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.697.653,83	0,62%	1.509	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	4.965.103,00	1,14%	57	0,95%	Artigo 9º, Inciso II
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	960.946,46	0,22%	67	0,18%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	1.638.766,52	0,38%	50	1,33%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	1.223.652,68	0,28%	158	0,72%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	1.459.182,56	0,34%	229	0,50%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	14.671.770,56	3,37%	498	0,74%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	10.067.828,37	2,31%	121	1,52%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.388.701,44	1,24%	7.407	0,33%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.367.292,11	1,23%	10	11,14%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.578.500,00	0,36%		1,59%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		36.463,07	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			435.343.527,69				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			36.463,07	Artigo 6º			
PL Total			435.379.990,76				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Abril / 2023)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	137.881.160,84	31,67%	20,00%	29,50%	81,95%	218.882.860,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	150.803.590,01	34,64%	17,70%	23,60%	81,95%	205.960.430,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	75,00%	60.737.839,30	13,95%	0,00%	14,50%	75,00%	265.769.806,47
Total Renda Fixa	100,00%	349.422.590,15	80,26%	37,70%	67,60%	238,90%	

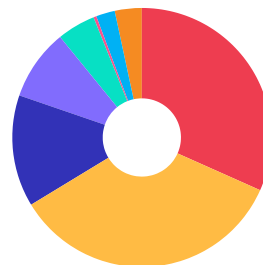


- RENTA FIXA 349.422.590,15
- RENTA VARIÁVEL 38.599.193,84
- EXTERIOR 24.919.421,78
- ESTRUTURADOS 20.823.821,92
- FUNDO IMOBILIÁRIO 1.578.500,00

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

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	45,00%	38.599.193,84	8,87%	10,00%	13,40%	45,00%	157.305.393,62
Artigo 8º, Inciso II	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	21.767.176,38
Artigo 10º, Inciso I	15,00%	20.823.821,92	4,78%	1,50%	5,50%	15,00%	44.477.707,23
Artigo 10º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	10,00%	43.534.352,77
Artigo 11º	15,00%	1.578.500,00	0,36%	0,00%	1,00%	15,00%	63.723.029,15
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	45,00%	61.001.515,76	14,01%	11,50%	22,40%	90,00%	



■ 7º I a ■ 7º I b ■ 7º III a ■ 8º I
■ 10º I ■ 11º ■ 9º II ■ 9º III

Enquadramento por Gestores - base (Abril / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	137.881.160,84	31,67	-
CAIXA DTVM	120.915.181,57	27,77	-
BANESTES DTVM	89.332.120,56	20,52	1,14
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	73.822.590,91	16,96	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.367.292,11	1,23	0,37
GENIAL INVESTIMENTOS	2.862.419,20	0,66	-
OCCAM BRASIL	2.697.653,83	0,62	0,02
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.459.182,56	0,34	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.005.926,11	0,23	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 '	137.881.160,84	31,67	20,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	150.803.590,01	34,64	17,70	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60.737.839,30	13,95	0,00	75,00
Artigo 8º, Inciso I	38.599.193,84	8,87	10,50	45,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	10.247.651,22	2,35	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	14.671.770,56	3,37	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	20.823.821,92	4,78	1,50	15,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 11º	1.578.500,00	0,36	0,00	15,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	1,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,86%	4,23%	3,10%	6,45%	13,31%	19,69%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,84%	4,20%	3,04%	6,37%	13,09%	19,17%	0,14%	0,00%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	4,20%	3,00%	6,40%	13,20%	19,46%	0,12%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,90%	5,33%	3,87%	5,96%	9,67%	20,04%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,51%	1,57%	0,18%	2,38%	2,53%	5,03%	0,55%	0,05%

IMA-B (Benchmark)	2,02%	6,08%	6,08%	5,03%	8,78%	13,88%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,05%	5,98%	6,08%	4,78%	8,52%	13,28%	1,78%	0,04%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,00%	5,96%	6,02%	4,94%	8,77%	10,14%	1,71%	0,04%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,88%	3,10%	2,81%	2,17%	0,89%	1,41%	2,07%	0,06%

IRF-M (Benchmark)	1,10%	5,03%	4,16%	5,88%	12,91%	14,29%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	4,92%	4,07%	5,69%	12,59%	13,62%	1,18%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	5,00%	4,08%	5,85%	12,80%	13,98%	1,18%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,92%	4,20%	3,04%	6,44%	13,37%	21,40%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	4,09%	2,93%	6,33%	13,37%	21,75%	0,01%	0,00%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,69%	1,81%	1,43%	4,00%	11,14%	19,94%	0,14%	0,01%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	0,70%	3,18%	2,31%	4,87%	10,04%	15,11%	0,01%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,75%	1,90%	1,66%	3,60%	10,03%	16,49%	0,16%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,61%	2,72%	2,18%	3,78%	4,18%	16,82%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,51%	4,58%	3,15%	5,41%	9,33%	21,13%	0,55%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,51%	1,57%	0,18%	2,38%	2,34%	5,09%	0,55%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,87%	4,15%	3,08%	5,43%	11,67%	14,62%	0,20%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	4,85%	4,18%	5,54%	11,42%	16,42%	0,87%	0,02%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
--------------------------	---	---	---	---	---	---	---	---

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	1,09%	6,39%	4,39%	-	-	-	7,00%	-

CDI (Benchmark)	0,92%	4,20%	3,04%	6,44%	13,37%	21,40%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,65%	1,67%	0,54%	2,09%	10,73%	16,09%	1,84%	0,04%

Global BDRX (Benchmark)	-0,49%	8,20%	3,67%	10,98%	3,71%	-9,36%	-	-
-------------------------	--------	-------	-------	--------	-------	--------	---	---

Ibovespa (Benchmark)	2,50%	-4,83%	-7,93%	-10,00%	-3,19%	-12,16%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,05%	-4,44%	-7,38%	-13,45%	-5,94%	-14,91%	9,82%	0,19%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1,69%	-4,80%	-7,87%	-9,40%	-4,25%	-15,53%	9,53%	0,18%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,05%	-9,18%	-13,19%	-18,99%	-11,41%	-40,48%	9,51%	0,22%
OCCAM FIC AÇÕES	1,14%	-5,49%	-8,02%	-12,84%	-3,22%	-14,42%	8,42%	0,18%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,74%	-6,37%	-10,36%	-12,42%	-9,39%	-13,59%	9,61%	0,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,68%	-6,19%	-12,07%	-17,19%	-12,06%	-33,62%	9,92%	0,24%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2,89%	-2,46%	-5,58%	-8,56%	-4,35%	-7,16%	8,47%	0,18%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-2,24%	-11,02%	-12,59%	-16,10%	-9,51%	-22,24%	7,89%	0,18%

IDIV (Benchmark)	3,89%	-0,36%	-5,90%	-1,19%	2,52%	6,38%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4,20%	-0,42%	-3,81%	-5,98%	0,00%	-3,03%	7,40%	0,16%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	3,52%	-0,31%	1,31%	-4,45%	1,61%	-0,10%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,01%	0,22%	-0,41%	-8,89%	-2,89%	-33,54%	15,34%	0,14%
MSCI ACWI (Benchmark)	-0,32%	3,70%	-0,93%	6,26%	1,87%	-13,63%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,97%	10,96%	4,16%	11,91%	10,34%	15,28%	5,74%	0,22%
SMLL (Benchmark)	1,91%	-7,78%	-10,40%	-20,60%	-19,88%	-36,55%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,75%	-3,81%	-6,30%	-14,83%	-12,16%	-25,51%	4,24%	0,21%

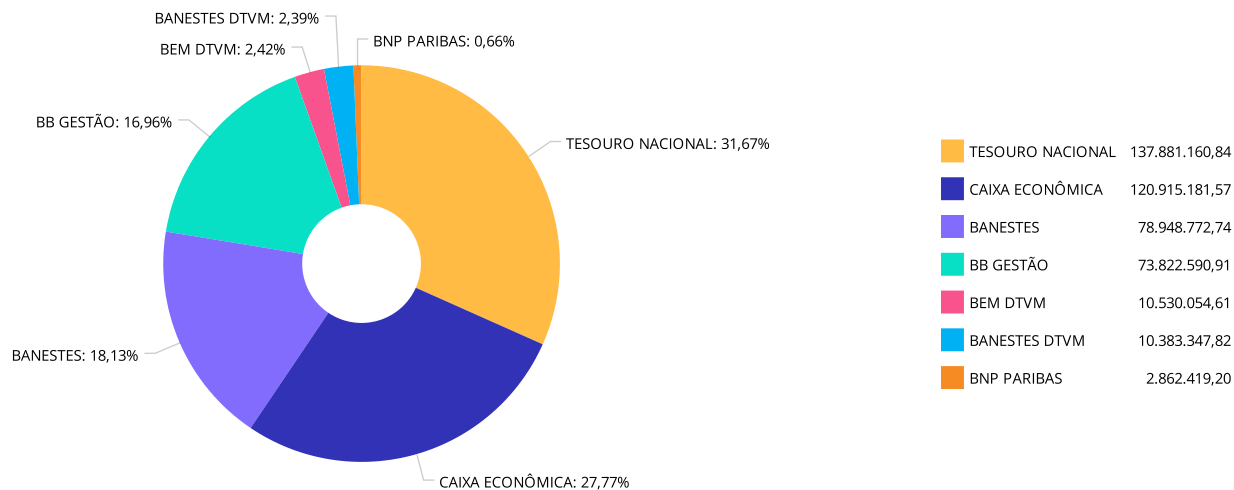
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,49%	8,20%	3,67%	10,98%	3,71%	-9,36%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,66%	7,74%	3,28%	9,66%	2,79%	-11,85%	7,82%	16,822%

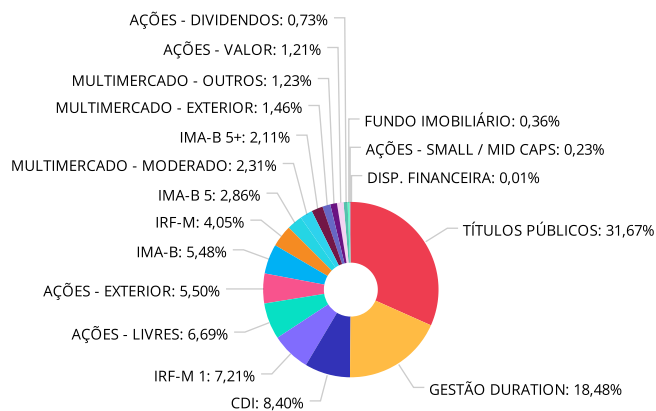
MSCI WORLD (Benchmark)	0,00%	4,43%	-0,14%	5,89%	3,12%	-10,69%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,66%	-0,57%	-1,51%	5,51%	-1,70%	-12,78%	7,70%	15,292%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-0,21%	0,25%	-0,84%	6,83%	0,85%	-11,27%	5,86%	12,070%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-6,90%	3,12%	-7,42%	-9,19%	-28,00%	-61,40%	10,77%	34,207%

MSCI ACWI (Benchmark)	-0,32%	3,70%	-0,93%	6,26%	1,87%	-13,63%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,99%	2,45%	2,80%	10,03%	1,33%	-6,53%	7,53%	14,454%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-0,10%	2,89%	1,12%	11,50%	3,87%	-11,04%	6,06%	15,552%

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



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



TÍTULOS PÚBLICOS	137.881.160,84	GESTÃO DURATION	80.479.789,99	CDI	36.573.810,01	IRF-M 1	31.385.665,91
AÇÕES - LIVRES	29.123.443,41	AÇÕES - EXTERIOR	23.958.475,32	IMA-B	23.863.321,93	IRF-M	17.626.617,52
IMA-B 5	12.434.158,25	MULTIMERCADO - MODERADO	10.067.828,37	IMA-B 5+	9.178.065,70	MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.349.647,90
MULTIMERCADO - OUTROS	5.367.292,11	AÇÕES - VALOR	5.280.576,73	AÇÕES - DIVIDENDOS	3.189.247,59	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.578.500,00
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.005.926,11	DISP. FINANCEIRA	36.463,07				



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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	26/01/2023	1.860	3.898,63633039	4.115,981481	7.251.463,57	7.655.725,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/11/2022	1.820	3907,209923	4.139,92616	7.111.122,06	7.534.665,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	13/12/2022	975	3928,920938	4.139,92616	3.830.697,91	4.036.428,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	09/03/2022	730	3.882,81549107	4.261,401802	2.834.455,31	3.110.823,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/02/2022	2.475	4041,475328	4.396,735401	10.002.651,44	10.881.920,11	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/04/2022	1.560	4217,247417	4.434,652938	6.578.905,97	6.918.058,58	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/08/2022	3.155	4117,462757	4.299,483484	12.990.595,00	13.564.870,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/10/2022	912	4164,832110	4.338,028877	3.798.326,88	3.956.282,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/11/2022	925	3987,369527	4.233,989557	3.688.316,81	3.916.440,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	29/12/2021	665	4.198,229405	4.508,120218	2.791.822,55	2.997.899,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/02/2022	617	3968,953944	4.299,508106	2.448.844,58	2.652.796,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/02/2022	2.430	4.007,88968105	4.358,366465	9.739.171,92	10.590.830,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/02/2022	202	3968,953944	4.299,508106	801.728,70	868.500,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	602	4175,438692	4.395,147297	2.513.614,09	2.645.878,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	878	4175,438692	4.395,147297	3.666.035,17	3.858.939,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	100	4175,438692	4.395,147297	417.543,87	439.514,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	140	4164,883793	4.295,026943	583.083,73	601.303,77	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	35	4164,883793	4.295,026943	145.770,93	150.325,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	308	4113,258152	4.185,098914	1.266.883,51	1.289.010,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	500	4113,258152	4.185,098914	2.056.629,08	2.092.549,45	Curva



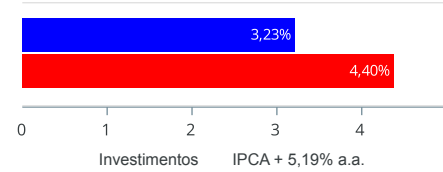
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Abril / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	22	4113,258152	4.185,098914	90.491,68	92.072,17	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/08/2022	2.490	4058,501854	4.237,366844	10.105.669,62	10.551.043,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/02/2022	50	3.962,3416127	4.299,508106	198.117,08	214.975,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/01/2023	965	3.871,06011031	4.023,436428	3.735.573,01	3.882.616,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	26/01/2023	1.000	3.898,63633039	4.029,56725	3.898.636,33	4.029.567,25	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/02/2023	1.045	3.873,12438372	3.992,975185	4.047.414,98	4.172.659,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	27/02/2023	480	3.924,50779100	4.025,475932	1.883.763,74	1.932.228,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	26/01/2023	1.860	3.898,636330	4.029,56725	7.251.463,57	7.494.995,08	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/02/2022	365	3.962,34161274	4.299,508106	1.446.254,69	1.569.320,45	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	03/03/2023	690	3.894,30651500	3.984,911553	2.687.071,50	2.749.588,97	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	03/03/2023	200	3.894,30651500	3.984,911553	778.861,30	796.982,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/04/2023	970	4.137,24356400	4.155,03162	4.013.126,26	4.030.380,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	15/12/2021	707	4.267,647108	4.726,642596	3.017.226,51	3.341.736,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	06/05/2022	611	4076,821575	4.357,369283	2.490.937,98	2.662.352,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	03/06/2022	830	4087,350009	4.321,860576	3.392.500,51	3.587.144,27	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	22/08/2022	488	4099,695852	4.281,747597	2.000.651,58	2.089.492,82	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	13/09/2022	975	4.029,55247710	4.393,419669	3.928.813,67	4.283.584,17	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	06/05/2022	177	4.076,82157506	4.357,369283	721.597,42	771.254,36	Curva

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	402.887.789,48	32.202.341,49	32.876.834,31	408.088.099,37	5.874.802,71	5.874.802,71	1,46%	1,46%	0,98%	0,98%	149,55%	3,32%
Fevereiro	408.088.099,37	15.002.337,74	7.694.217,47	415.561.942,63	165.722,99	6.040.525,70	0,04%	1,50%	1,21%	2,19%	68,37%	3,39%
Março	415.561.942,63	10.362.437,29	10.943.519,96	418.524.435,25	3.543.575,29	9.584.100,99	0,85%	2,36%	1,18%	3,39%	69,66%	2,82%
Abril	418.524.435,25	27.134.167,72	14.433.320,70	434.865.946,73	3.640.664,46	13.224.765,45	0,84%	3,23%	0,97%	4,40%	73,35%	2,59%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

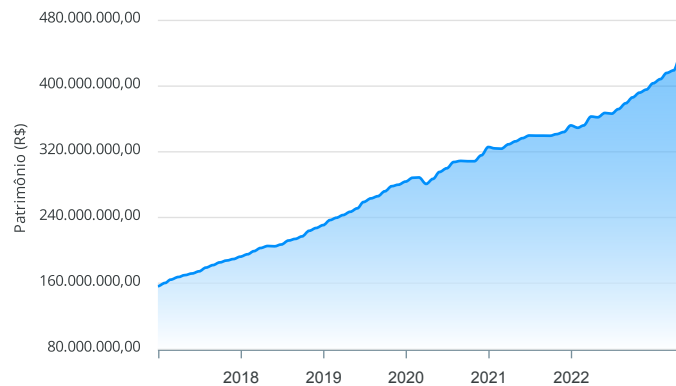


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

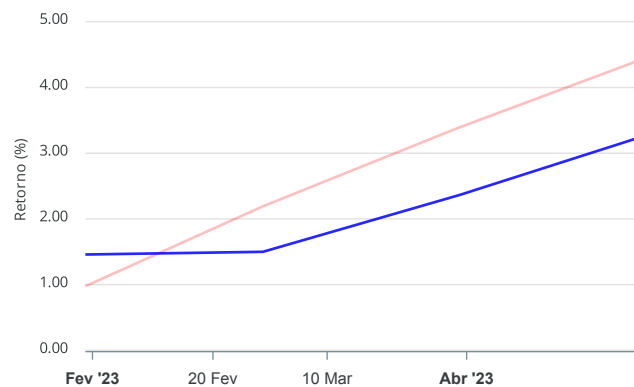
ANO

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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril/2023**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.831.201,61	0,00	0,00	1.868.779,17	37.577,56	2,05%	2,05%	1,78%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.723.047,41	0,00	0,00	12.977.668,46	254.621,05	2,00%	2,00%	1,71%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.008.901,20	0,00	0,00	9.178.065,70	169.164,50	1,88%	1,88%	2,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	30.290.378,88	0,00	0,00	30.675.215,67	384.836,79	1,27%	1,27%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.940.094,55	0,00	0,00	11.058.180,62	118.086,07	1,08%	1,08%	1,18%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.498.555,00	0,00	0,00	6.568.436,90	69.881,90	1,08%	1,08%	1,18%
TÍTULOS PÚBLICOS	132.594.465,12	4.013.126,25	0,00	137.881.160,84	1.273.569,47	0,93%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	17.120.270,16	0,00	670.817,26	16.600.293,80	150.840,90	0,88%	0,89%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	27.271.242,60	0,00	0,00	27.509.324,20	238.081,60	0,87%	0,87%	0,20%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.633.840,34	0,00	0,00	22.825.899,30	192.058,96	0,85%	0,85%	0,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.488.675,67	0,00	0,00	8.559.766,61	71.090,94	0,84%	0,84%	0,14%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	22.129.447,52	0,00	0,00	22.295.250,12	165.802,60	0,75%	0,75%	0,16%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.524.898,43	0,00	0,00	9.590.168,39	65.269,96	0,69%	0,69%	0,14%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.130.312,20	0,00	0,00	10.182.227,51	51.915,31	0,51%	0,51%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.240.456,25	0,00	0,00	2.251.930,74	11.474,49	0,51%	0,51%	0,55%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.970.988,50	0,00	0,00	9.016.874,30	45.885,80	0,51%	0,51%	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	30.113,35	0,00	30.207,00	0,00	93,65	0,31%	0,89%	0,60%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	1.085.385,12	23.172.098,74	13.924.527,88	10.383.347,82	50.391,84	0,21%	0,69%	0,01%
Total Renda Fixa	333.512.273,91	27.185.224,99	14.625.552,14	349.422.590,15	3.350.643,39	0,97%		0,56%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril/2023**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.565.815,20	0,00	0,00	1.631.527,29	65.712,09	4,20%	4,20%	7,40%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.506.444,66	0,00	0,00	2.582.922,90	76.478,24	3,05%	3,05%	9,82%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	7.406.647,93	0,00	0,00	7.620.712,90	214.064,97	2,89%	2,89%	8,47%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.284.871,89	0,00	0,00	5.388.701,44	103.829,55	1,96%	1,96%	5,74%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.562.750,00	0,00	14.000,00	1.578.500,00	29.750,00	1,90%	1,01%	15,34%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	988.611,26	0,00	0,00	1.005.926,11	17.314,85	1,75%	1,75%	4,24%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.351.290,29	0,00	0,00	3.409.749,94	58.459,65	1,74%	1,74%	9,61%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	6.760.913,34	0,00	0,00	6.875.399,19	114.485,85	1,69%	1,69%	9,53%
OCCAM FIC AÇÕES	2.667.265,21	0,00	0,00	2.697.653,83	30.388,62	1,14%	1,14%	8,42%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.309.367,94	0,00	0,00	5.367.292,11	57.924,17	1,09%	1,09%	7,00%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.505.303,50	0,00	0,00	1.515.515,21	10.211,71	0,68%	0,68%	9,92%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	10.003.202,75	0,00	0,00	10.067.828,37	64.625,62	0,65%	0,65%	1,84%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	9.904.649,52	0,00	0,00	9.702.066,17	-202.583,35	-2,05%	-2,05%	9,51%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.593.472,94	0,00	0,00	1.557.720,30	-35.752,64	-2,24%	-2,24%	7,89%
Total Renda Variável	60.410.606,43	0,00	14.000,00	61.001.515,76	604.909,33	1,00%		7,51%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.622.711,40	0,00	0,00	1.638.766,52	16.055,12	0,99%	0,99%	7,53%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.460.644,74	0,00	0,00	1.459.182,56	-1.462,18	-0,10%	-0,10%	6,06%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	962.960,10	0,00	0,00	960.946,46	-2.013,64	-0,21%	-0,21%	5,86%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14.768.630,65	0,00	0,00	14.671.770,56	-96.860,09	-0,66%	-0,66%	7,82%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	5.100.903,40	0,00	0,00	4.965.103,00	-135.800,40	-2,66%	-2,66%	7,70%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	1.314.319,09	0,00	0,00	1.223.652,68	-90.666,41	-6,90%	-6,90%	10,77%
Total Exterior	25.230.169,38	0,00	0,00	24.919.421,78	-310.747,60	-1,23%		7,75%

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.

