

2023

Relatório

Mensal e 1º trimestre de 2023

Março

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	74.491.957,54	13,75%	5.899.893.732,27	1,26%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.423.450,28	1,56%	6.987.136.740,28	0,12%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	20.404.231,62	3,77%	5.627.693.313,74	0,36%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.153.356,18	0,21%	743.468.373,62	0,16%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.363.244,04	4,50%	6.754.991.755,09	0,36%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.383.066,54	5,79%	3.913.191.398,70	0,80%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	419.908,56	0,08%	185.566.045,02	0,23%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.423.637,18	2,66%	660.687.270,74	2,18%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	595.539,53	0,11%	207.489.815,84	0,29%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	138.992.797,89	25,66%	3.204.967.185,63	4,34%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.736.283,73	1,98%	4.218.734.456,39	0,25%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	538.259,31	0,10%	479.498.618,64	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.566.802,20	0,66%	236.853.474,89	1,51%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	96.954.105,45	17,90%	3.501.227.547,95	2,77%	7º I b
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.069.786,05	0,57%	324.880.312,20	0,94%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	72.608,50	0,01%	5.074.930.034,52	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.315.440,82	0,61%	6.990.840.946,14	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.632.815,67	1,04%	8.067.452.652,34	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	517.701,94	0,10%	3.202.346.406,07	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	345.608,08	0,06%	7.183.936.024,67	0,00%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	10.237.081,58	1,89%	14.298.760.943,23	0,07%	7º III a
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	14.343.497,87	2,65%	737.950.499,46	1,94%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.455.281,15	0,27%	1.255.329.579,27	0,12%	7º III a
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.927.291,94	0,54%	284.355.835,81	1,03%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.085.112,79	1,31%	2.908.858.412,17	0,24%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	3.467.161,05	0,64%	502.863.575,11	0,69%	7º III a
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.010.697,53	1,29%	397.734.233,78	1,76%	7º V b

Investimentos

\$ 541.614.947,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 541.614.947,23

Governança (Pró Gestão)

Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.104.522,00	0,20%	235.378.280,14	0,47%	7º V b
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.439.785,62	0,64%	309.607.968,47	1,11%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.209.278,57	0,78%	816.966.228,89	0,52%	8º I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.453.764,99	0,82%	796.888.791,42	0,56%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.369.049,95	0,44%	215.135.718,36	1,10%	8º I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.181.197,08	0,22%	506.329.839,46	0,23%	8º I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	8.736.814,36	1,61%	658.756.412,99	1,33%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.360.263,46	1,91%	2.012.391.655,50	0,51%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.550.366,54	0,66%	126.014.881,91	2,82%	10º I
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	7.488.759,98	1,38%	412.353.746,12	1,82%	10º I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.199.446,81	0,41%	319.902.124,32	0,69%	10º I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.097.547,17	0,39%	3.054.112.839,62	0,07%	10º I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.463.429,78	0,45%	695.238.143,27	0,35%	10º I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.283.875,90	0,24%	624.995.529,15	0,21%	10º I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	750.120,00	0,14%	98.500.757,60	0,76%	11º

Investimentos

\$ 541.614.947,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 541.614.947,23

Governança (Pró Gestão)

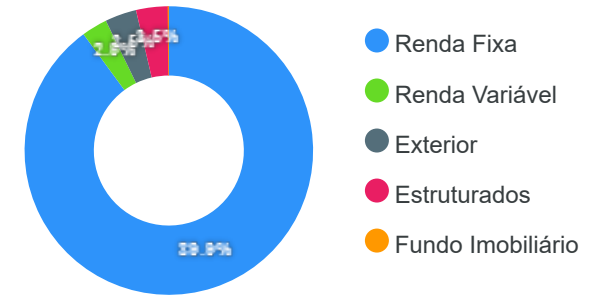
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	81,13%	18,87%
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	7,30%	52,70%
7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	1,50%	3,50%
8° I - Fundos de Ações	30,00%	2,89%	27,11%
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,53%	6,47%
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	3,52%	6,48%
11° - Fundos Imobiliários	5,00%	0,14%	4,86%

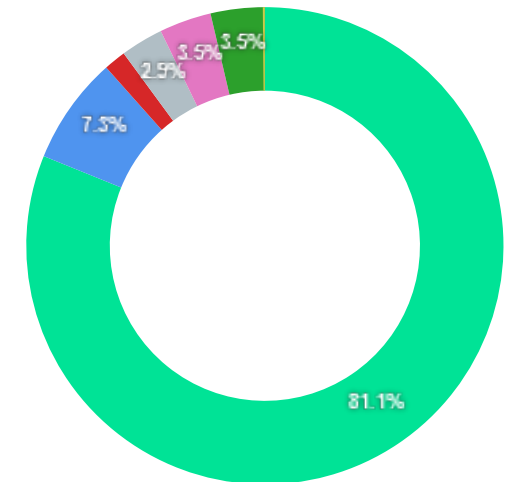
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos



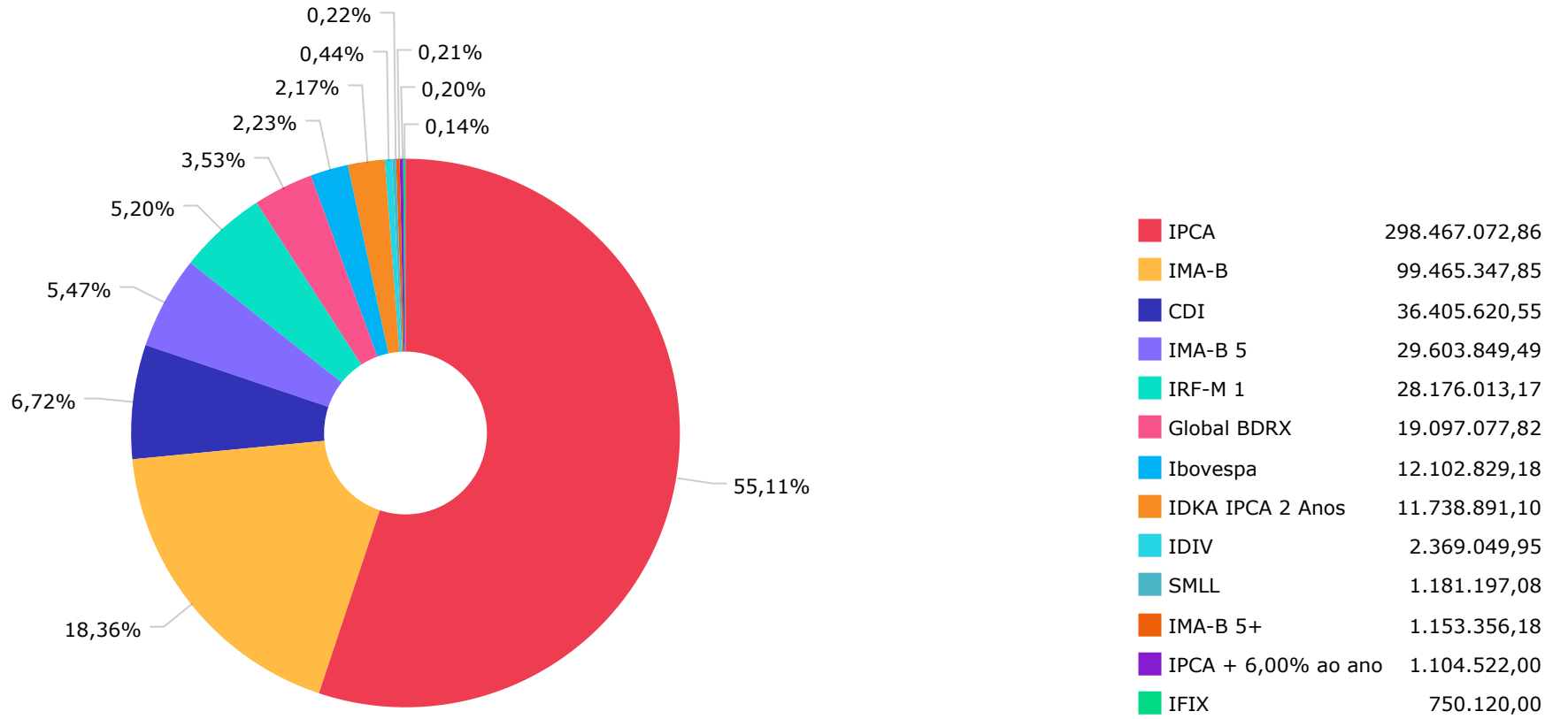
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	541.614.947,23
7º I b - FI 100% Títulos TN	81,13%	0,00%	65,00%	100,00%	102.214.346,12
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	541.614.947,23
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.080.747,36
7º III a - FI Referenciados RF	7,30%	0,00%	15,00%	60,00%	285.453.541,96
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	324.968.968,34
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	108.322.989,45
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	27.080.747,36
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	1,50%	0,00%	2,00%	5,00%	18.965.527,83
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	27.080.747,36

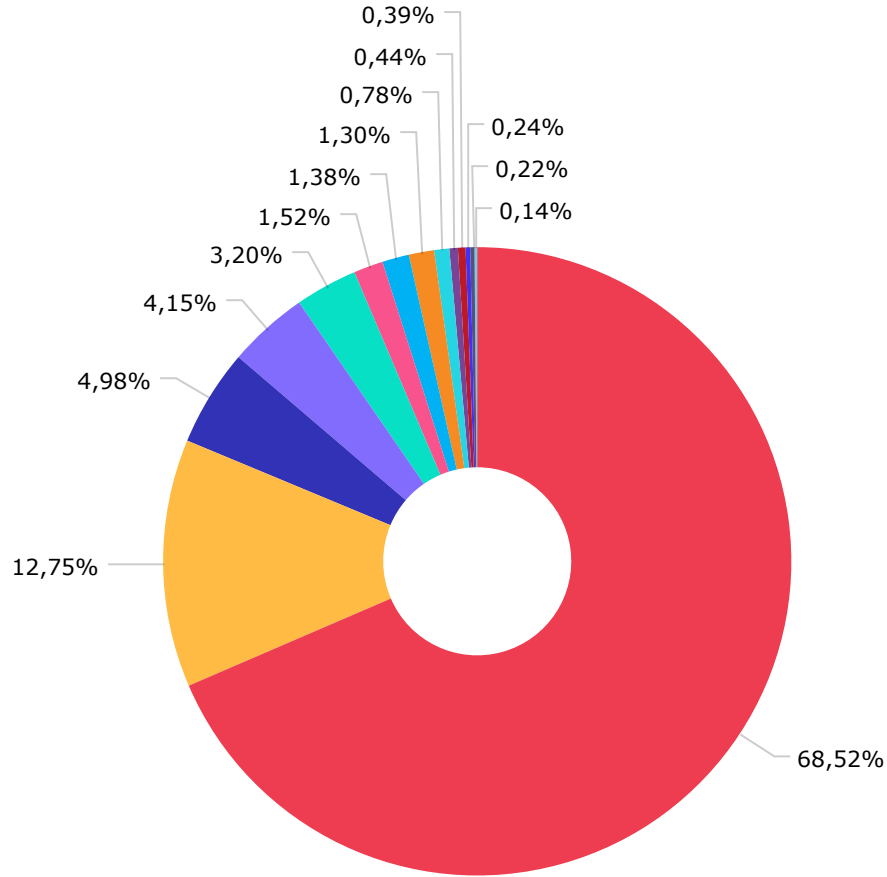
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	2,89%	0,00%	5,00%	30,00%	146.831.407,96
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	162.484.484,17
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	54.161.494,72
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	54.161.494,72
9º III - Ações - BDR Nível I	3,53%	0,00%	4,00%	10,00%	35.064.416,90
10º I - Fundos Multimercados	3,52%	0,00%	4,00%	10,00%	35.078.068,54
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.080.747,36
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.080.747,36
11º - Fundos Imobiliários	0,14%	0,00%	1,00%	5,00%	26.330.627,36
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.080.747,36

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54		
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13	3,02	3,02	6,38	13,33	21,44	0,03	0,06
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,16	3,17	3,17	6,49	13,25	20,92	0,02	0,05
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,39	3,30	3,30	6,16	12,27	19,48	0,64	1,34
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,63	3,65	3,65	6,41	11,28	17,78	0,70	1,47
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,81	1,02	1,02	3,09	9,84	15,99	1,66	3,49
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,16	2,56	2,56	3,76	9,39	15,87	0,60	1,25
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	0,93	0,93	0,93	3,41	7,64	13,39	1,26	2,66
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,49	0,28	0,28	1,83	5,56	11,59	2,21	4,65
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	2,99	8,73	8,73	13,01	-3,04	-8,03		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,19	8,45	8,45	12,27	-3,59	-10,72	8,10	17,07
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,00	3,21	3,21	8,91	-5,03	-10,77	7,58	15,96
IBOVESPA - BENCHMARK	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-3,19	-6,39	-6,39	-8,08	-13,90	-13,61	8,09	17,04
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,40	-7,50	-7,50	-9,34	-17,88	-12,70	8,24	17,36
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-4,98	-6,82	-6,82	-12,67	-19,47	-28,82	8,31	17,49
IDIV - BENCHMARK	-2,02	-4,08	-4,08	-1,06	-6,43	4,48		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,06	-4,28	-4,28	-1,50	-7,17	2,17	6,94	14,61
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	1,58	4,71	4,71	7,06	10,21	20,24		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38	4,37	4,37	6,90	9,90	19,40	1,08	2,28
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	2,34
IMA-B - BENCHMARK	2,66	3,98	3,98	4,22	7,51	12,36		

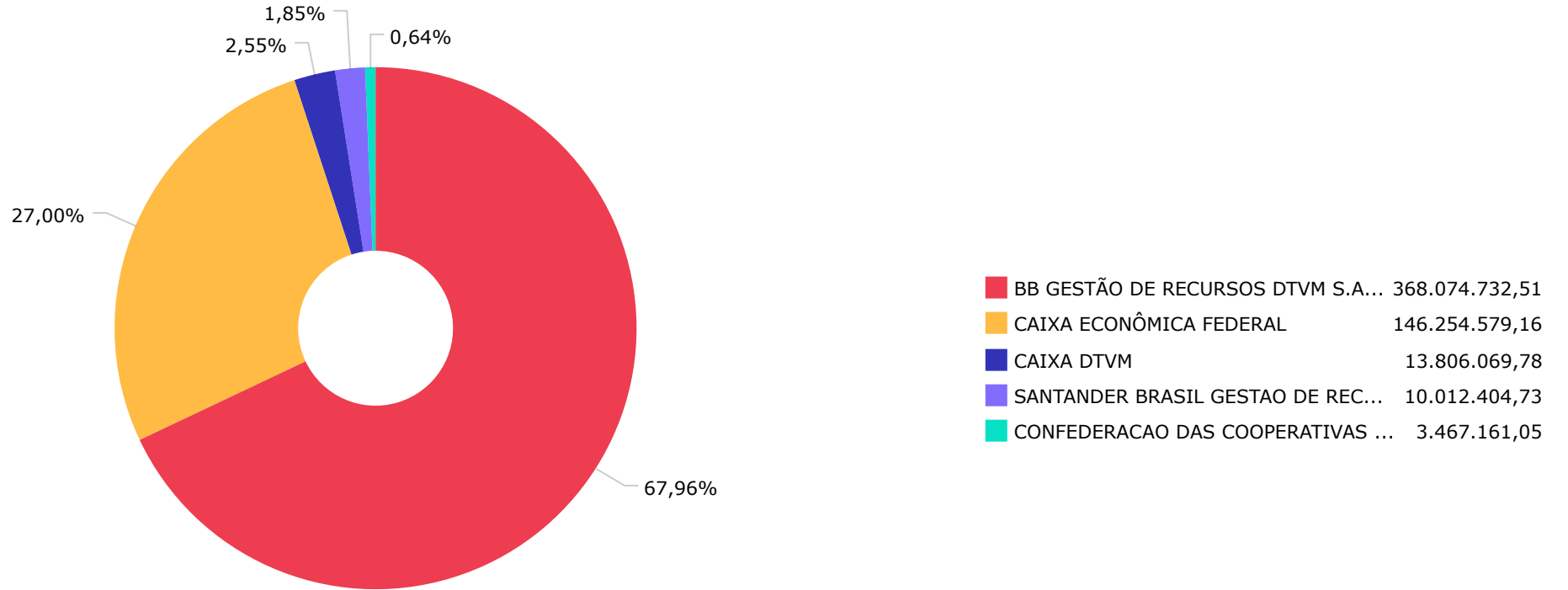
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,65	3,91	3,91	4,01	7,31	11,86	1,62	3,40
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,69	3,85	3,85	3,79	7,13	11,69	1,69	3,56
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,27	1,05	1,05	3,78	3,28	6,05	0,90	1,89
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,27	1,05	1,05	3,78	3,09	6,11	0,90	1,89
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,52	4,38	4,38	7,03	10,38	20,01		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50	4,32	4,32	6,89	10,27	19,62	0,89	1,86
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,49	4,32	4,32	6,87	10,13	19,36	0,89	1,86
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,50	0,74	0,74	3,35	5,55	17,15	0,10	0,22
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,73	3,61	3,61	1,83	5,03	5,39		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,63	3,50	3,50	1,65	4,65	4,68	2,37	5,00
IPCA - BENCHMARK	0,71	2,09	2,09	3,76	4,65	16,48		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21	3,25	3,25	5,55	11,71	14,38	0,19	0,39
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,30	3,31	3,31	5,35	11,58	15,37	0,33	0,69
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18	3,64	3,64	7,77	11,11	20,82	0,19	0,41
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27	4,04	4,04	6,85	10,74	21,40	0,89	1,88
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88	3,54	3,54	5,27	10,69	15,78	0,88	1,85
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,31	3,26	3,26	5,31	10,67	16,48	0,33	0,70
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27	4,05	4,05	6,85	10,40	20,72	0,89	1,88
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,42	4,22	4,22	6,83	9,87	19,57	0,83	1,75
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27	4,06	4,06	6,87	9,39		0,90	1,89
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18	3,63	3,63	4,49	4,23		0,19	0,41
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,15	5,13	5,13	6,32			1,60	3,37
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,15	5,12	5,12	3,45			1,60	3,36

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,23	3,35	3,35	6,61	13,19	19,00		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1,22	3,32	3,32	6,57	13,12	19,42	0,22	0,47
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,21	3,33	3,33	6,53	12,96	18,52	0,25	0,53
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20	3,25	3,25	6,44	12,84	18,35	0,25	0,53
SMLL - BENCHMARK	-1,74	-9,51	-9,51	-16,40	-27,95	-35,01		
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-1,83	-9,25	-9,25	-16,26	-28,20	-35,73	11,46	24,13
IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK	1,25	3,59	3,59	6,82	10,93	30,87		
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,49	4,30	4,30	6,77	10,77	18,31	0,88	1,84
IFIX - BENCHMARK	-1,69	-3,70	-3,70	-7,68	-0,68	-3,01		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,41	-0,78	-0,78	-10,61	-3,34	-37,17	9,28	19,55

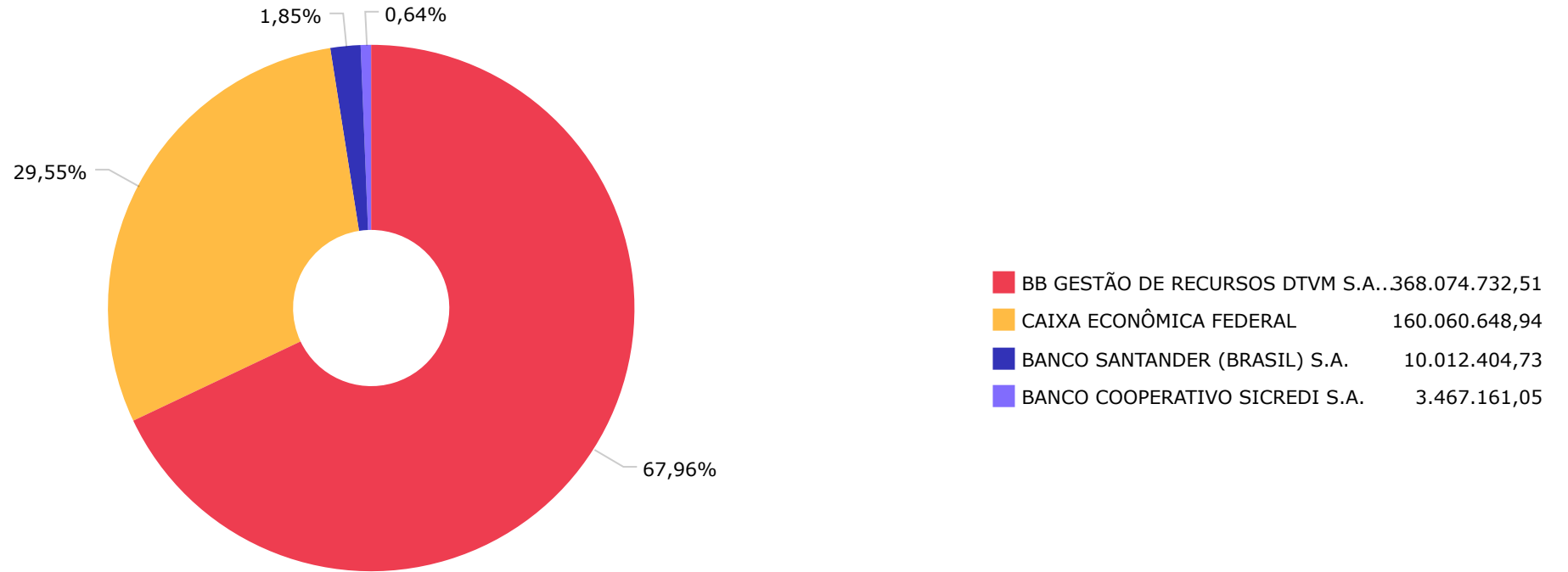




Renda Fixa Duração Livre Soberano	371.115.547,61
Renda Fixa Indexados	69.078.290,83
Ações Livre	26.990.628,43
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	22.458.717,40
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	17.322.194,37
Multimercados Livre	8.213.243,13
Multimercados Trading	7.488.759,98
Não classificado	7.056.496,81
Ações Valor/Crescimento	4.209.278,57
Ações Dividendos	2.369.049,95
Multimercados Macro	2.097.547,17
Multimercados Balanceados	1.283.875,90
Ações Small Caps	1.181.197,08
FII TVM Gestão Ativa	750.120,00



Distribuição por Administrador - PREVIDENCIÁRIO

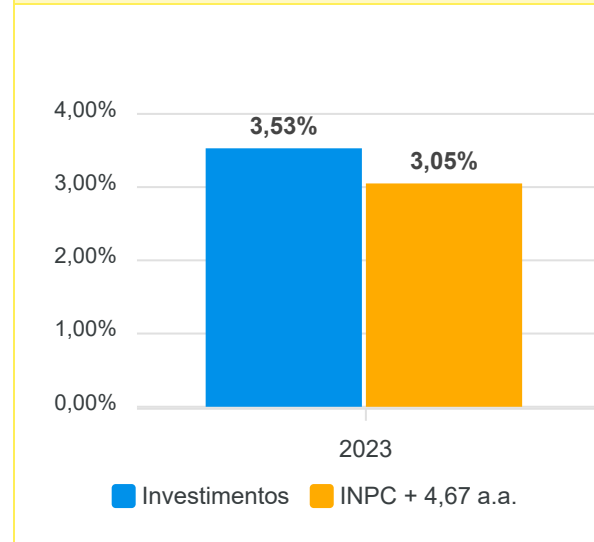


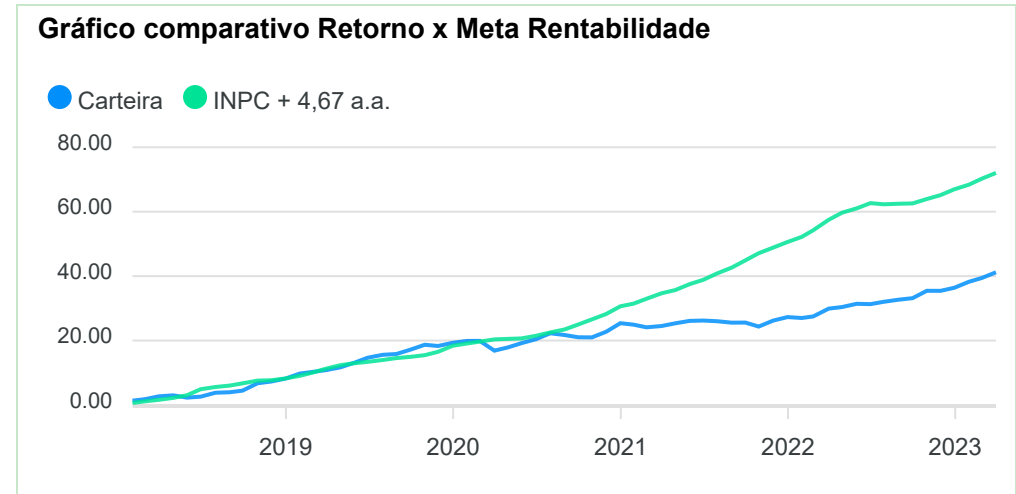
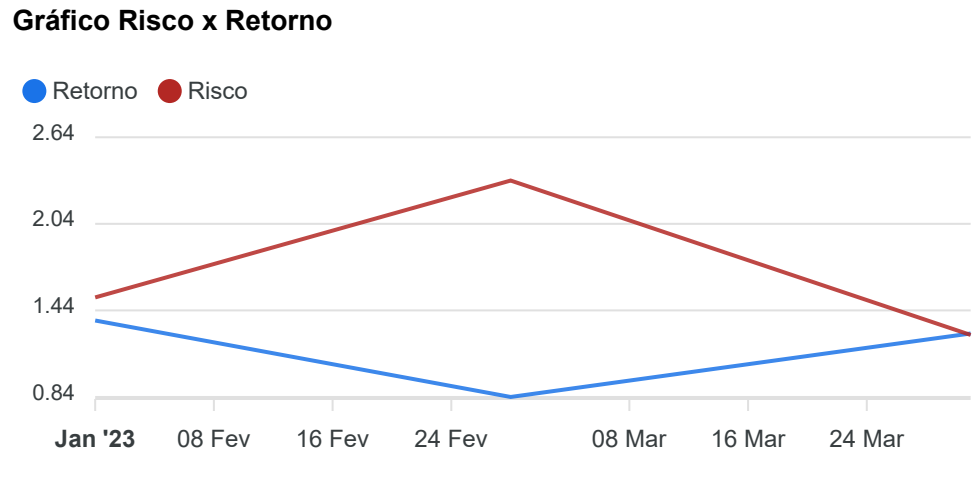
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	522.212.042,56	43.550.000,00	43.523.859,12	529.397.305,34	7.159.121,90	7.159.121,90	1,37% ▲	1,37%	0,86%	0,86%	159,30%	1,53%
Fevereiro	529.397.305,34	11.092.858,33	10.289.658,70	534.648.807,48	4.448.302,51	11.607.424,41	0,84% ▲	2,22%	1,10%	1,97%	112,69%	2,34%
Março	534.648.807,48	4.109.981,81	4.000.000,00	541.614.947,23	6.856.157,94	18.463.582,35	1,28% ▲	3,53%	1,06%	3,05%	115,74%	1,27%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	18.463.582,35	3,53%	3,05%

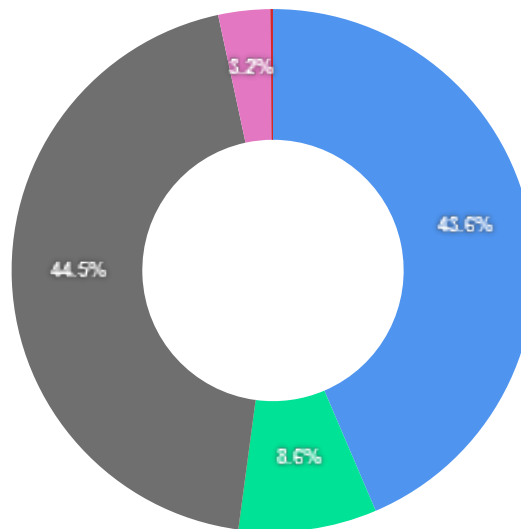
Gráfico Retorno e Meta Acumulado





Liquidez - 31/03/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	235.975.362,22	43,57
Até D+180	46.328.628,84	8,55
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	241.067.412,94	44,51
Até D+1800	17.493.423,23	3,23
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	750.120,00	0,14



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	73.119.928,59	0,00	0,00	74.491.957,54	1.372.028,95	1,88% ▲	0,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.308.581,51	0,00	0,00	8.423.450,28	114.868,77	1,38% ▲	1,08%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	20.105.114,09	0,00	0,00	20.404.231,62	299.117,53	1,49% ▲	0,89%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.112.975,39	0,00	0,00	1.153.356,18	40.380,79	3,63% ▲	2,37%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.912.505,11	0,00	0,00	7.010.697,53	98.192,42	1,42% ▲	0,83%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.074.901,15	0,00	0,00	24.363.244,04	288.342,89	1,20% ▲	0,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	9.984.571,04	4.109.981,81	4.000.000,00	10.237.081,58	142.528,73	1,01% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.015.756,07	0,00	0,00	31.383.066,54	367.310,47	1,18% ▲	0,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	414.643,11	0,00	0,00	419.908,56	5.265,45	1,27% ▲	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.120.601,79	0,00	0,00	14.423.637,18	303.035,39	2,15% ▲	1,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	588.072,53	0,00	0,00	595.539,53	7.467,00	1,27% ▲	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	137.244.825,47	0,00	0,00	138.992.797,89	1.747.972,42	1,27% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.611.046,36	0,00	0,00	10.736.283,73	125.237,37	1,18% ▲	0,19%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	531.493,73	0,00	0,00	538.259,31	6.765,58	1,27% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.513.923,81	0,00	0,00	3.566.802,20	52.878,39	1,50% ▲	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	95.734.457,65	0,00	0,00	96.954.105,45	1.219.647,80	1,27% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.005.293,73	0,00	0,00	3.069.786,05	64.492,32	2,15% ▲	1,60%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	14.159.136,97	0,00	0,00	14.343.497,87	184.360,90	1,30% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	71.738,77	0,00	0,00	72.608,50	869,73	1,21% ▲	0,19%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.269.861,39	0,00	0,00	3.315.440,82	45.579,43	1,39% ▲	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.549.696,92	0,00	0,00	5.632.815,67	83.118,75	1,50% ▲	0,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	504.340,12	0,00	0,00	517.701,94	13.361,82	2,65% ▲	1,62%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.088.269,50	0,00	0,00	1.104.522,00	16.252,50	1,49% ▲	0,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	341.488,73	0,00	0,00	345.608,08	4.119,35	1,21% ▲	0,25%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.417.163,79	0,00	0,00	1.455.281,15	38.117,36	2,69% ▲	1,69%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.889.366,83	0,00	0,00	2.927.291,94	37.925,11	1,31% ▲	0,33%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.005.876,25	0,00	0,00	7.085.112,79	79.236,54	1,13% ▲	0,03%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	3.425.369,96	0,00	0,00	3.467.161,05	41.791,09	1,22% ▲	0,22%
	480.121.000,36	4.109.981,81	4.000.000,00	487.031.247,02	6.800.264,85	1,42%	0,78%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	3.553.175,97	0,00	0,00	3.439.785,62	-113.390,35	-3,19% ▼	8,09%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.357.580,14	0,00	0,00	4.209.278,57	-148.301,57	-3,40% ▼	8,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.687.395,32	0,00	0,00	4.453.764,99	-233.630,33	-4,98% ▼	8,31%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.418.878,11	0,00	0,00	2.369.049,95	-49.828,16	-2,06% ▼	6,94%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	1.203.210,87	0,00	0,00	1.181.197,08	-22.013,79	-1,83% ▼	11,46%
-	16.220.240,41	0,00	0,00	15.653.076,21	-567.164,20	-3,50%	8,27%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.493.424,33	0,00	0,00	3.550.366,54	56.942,21	1,63% ▲	0,70%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	7.419.993,52	0,00	0,00	7.488.759,98	68.766,46	0,93% ▲	1,26%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.169.212,26	0,00	0,00	2.199.446,81	30.234,55	1,39% ▲	0,64%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.073.538,70	0,00	0,00	2.097.547,17	24.008,47	1,16% ▲	0,60%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.443.583,24	0,00	0,00	2.463.429,78	19.846,54	0,81% ▲	1,66%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.277.630,30	0,00	0,00	1.283.875,90	6.245,60	0,49% ▲	2,21%
-	18.877.382,35	0,00	0,00	19.083.426,18	206.043,83	1,09%	1,13%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	739.680,00	0,00	0,00	750.120,00	10.440,00	1,41% ▲	9,28%
-	739.680,00	0,00	0,00	750.120,00	10.440,00	1,41%	9,28%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	8.650.622,32	0,00	0,00	8.736.814,36	86.192,04	1,00% ▲	7,58%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.039.882,04	0,00	0,00	10.360.263,46	320.381,42	3,19% ▲	8,10%
	18.690.504,36	0,00	0,00	19.097.077,82	406.573,46	2,18%	3,47%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	71.946.679,11	0,00	0,00	74.491.957,54	2.545.278,43	3,54% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.070.665,85	0,00	0,00	8.423.450,28	352.784,43	4,37% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.558.865,08	0,00	0,00	20.404.231,62	845.366,54	4,32% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.114.364,07	0,00	0,00	1.153.356,18	38.992,11	3,50% ▲
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.726.778,02	0,00	0,00	7.010.697,53	283.919,51	4,22% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.596.261,08	0,00	0,00	24.363.244,04	766.982,96	3,25% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	35.845.117,76	11.768.932,35	37.900.000,00	10.237.081,58	523.031,47	1,10% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.280.151,48	0,00	0,00	31.383.066,54	1.102.915,06	3,64% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	415.428,08	0,00	12.134,52	419.908,56	16.615,00	4,00% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	13.973.007,79	0,00	14.423.637,18	450.629,39	3,22% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	589.222,44	0,00	17.255,50	595.539,53	23.572,59	4,00% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	117.546.115,45	20.000.000,00	3.943.617,77	138.992.797,89	5.390.300,21	3,92% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.360.102,37	0,00	0,00	10.736.283,73	376.181,36	3,63% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	532.654,66	0,00	15.760,55	538.259,31	21.365,20	4,01% ▲
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.540.459,73	0,00	103.907,85	3.566.802,20	130.250,32	3,68% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	86.013.094,60	10.000.000,00	2.846.982,51	96.954.105,45	3.787.993,36	3,95% ▲
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.010.900,00	0,00	3.069.786,05	58.886,05	1,96% ▲
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	13.883.279,08	0,00	0,00	14.343.497,87	460.218,79	3,31% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	70.324,65	0,00	0,00	72.608,50	2.283,85	3,25% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.227.060,02	0,00	2.067.673,00	3.315.440,82	156.053,80	2,99% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.399.347,34	0,00	0,00	5.632.815,67	233.468,33	4,32% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.921.277,78	0,00	7.956.186,12	0,00	34.908,34	0,44% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	498.241,31	0,00	0,00	517.701,94	19.460,63	3,91% ▲
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.059.027,50	0,00	0,00	1.104.522,00	45.494,50	4,30% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	334.470,08	0,00	0,00	345.608,08	11.138,00	3,33% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.401.307,70	0,00	0,00	1.455.281,15	53.973,45	3,85% ▲

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.835.006,46	0,00	0,00	2.927.291,94	92.285,48	3,26% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.796.957,85	0,00	2.950.000,00	7.085.112,79	238.154,94	2,43% ▲
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	3.355.760,77	0,00	0,00	3.467.161,05	111.400,28	3,32% ▲
	467.918.020,32	58.752.840,14	57.813.517,82	487.031.247,02	18.173.904,38	3,88%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	3.674.397,15	0,00	0,00	3.439.785,62	-234.611,53	-6,39% ▼
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.550.734,33	0,00	0,00	4.209.278,57	-341.455,76	-7,50% ▼
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.779.827,93	0,00	0,00	4.453.764,99	-326.062,94	-6,82% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.474.858,88	0,00	0,00	2.369.049,95	-105.808,93	-4,28% ▼
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	1.301.605,25	0,00	0,00	1.181.197,08	-120.408,17	-9,25% ▼
	16.781.423,54	0,00	0,00	15.653.076,21	-1.128.347,33	-6,72%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.425.439,84	0,00	0,00	3.550.366,54	124.926,70	3,65% ▲
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	7.420.084,68	0,00	0,00	7.488.759,98	68.675,30	0,93% ▲
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.129.271,03	0,00	0,00	2.199.446,81	70.175,78	3,30% ▲
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.045.232,18	0,00	0,00	2.097.547,17	52.314,99	2,56% ▲
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.438.656,43	0,00	0,00	2.463.429,78	24.773,35	1,02% ▲
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.280.266,72	0,00	0,00	1.283.875,90	3.609,18	0,28% ▲
	18.738.950,88	0,00	0,00	19.083.426,18	344.475,30	1,84%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	756.000,00	0,00	0,00	750.120,00	-5.880,00	-0,78% ▼
	756.000,00	0,00	0,00	750.120,00	-5.880,00	-0,78%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	8.464.907,27	0,00	0,00	8.736.814,36	271.907,09	3,21% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.552.740,55	0,00	0,00	10.360.263,46	807.522,91	8,45% ▲
	18.017.647,82	0,00	0,00	19.097.077,82	1.079.430,00	5,99%

Cenário Econômico

O mês de março foi mais um mês de forte volatilidade no mercado. O segmento de renda fixa seguiu o bom desempenho dos meses anteriores de 2023, principalmente pelo desempenho dos fundos IMA's que foram beneficiados pelo fechamento da curva de juros. Além disso, a rentabilidade dos fundos atrelados ao CDI, também apresentaram resultados positivos, mas ligeiramente inferior à meta atuarial média do mês. Os títulos públicos, levados ao vencimento, seguem apresentando bons resultados. Já a renda variável local, mais uma vez fechou no negativo, mesmo com a boa recuperação nos últimos dias do mês. E para concluir, os investimentos no exterior, tiveram um bom resultado com recuperação dos principais índices globais. No geral as carteiras de investimentos fecharam com resultados positivos.

Com manutenção do quadro inflacionário, e da Taxa Selic elevada por um tempo mais longo que o esperado, os fundos atrelados ao CDI seguem como um investimento "confortável", por ter projeção e expectativa de "ficar próximo a meta atuarial". Quanto a renda variável local, nossa expectativa é de seguir com forte volatilidade; a entrada nos níveis atuais pode ser interessante, principalmente se estivermos olhando para um horizonte de médio e longo prazo.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Como já dissemos, a volatilidade voltou forte no mês de março a exemplo do que foi no ano passado. O segmento de renda fixa manteve no período o bom desempenho em 2023, principalmente pelo desempenho dos fundos IMA que foram beneficiados pelo fechamento da curva de juros. Além disso, os fundos atrelados ao CDI, também apresentaram resultados positivos. Os títulos públicos, levados ao vencimento, seguem apresentando bons resultados. Já a renda variável local, mais uma vez fechou no negativo, mesmo com a boa recuperação nos últimos dias do mês. E para concluir, os investimentos no exterior, tiveram um bom resultado com recuperação dos principais índices globais.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 10 de abril de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP