

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

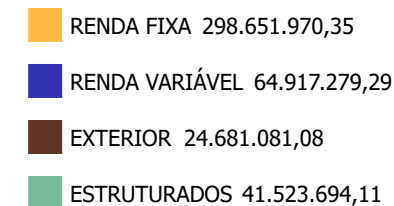
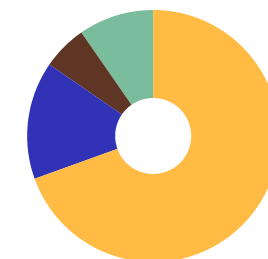
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	30.154.993,48	7,02%	473	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.225.754,98	0,52%	333	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	332.755,79	0,08%	935	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	44.895.997,37	10,45%	1.184	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	15.270.848,93	3,55%	3.251	13,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	5.303.207,39	1,23%	75	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+0	Não há	23.264.207,42	5,41%	160	0,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	66.174,40	0,02%	935	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	17.029.116,38	3,96%	1.088	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	81.425.419,59	18,95%	1.000	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.309.650,79	0,77%	401	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	44.919.171,41	10,45%	465	1,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0		10.153.399,76	2,36%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1	Não há	11.551.960,28	2,69%	5.863	1,45%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	8.749.312,38	2,04%	1.114	3,40%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.797.380,30	1,58%	3.383	0,58%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.542.664,89	0,82%	23.239	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.669.876,25	1,55%	501	4,10%	Artigo 8º, Inciso I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	5.461.805,99	1,27%	687	0,98%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.973.520,46	1,86%	40	0,77%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	5.035.304,21	1,17%	1.566	0,59%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	12.699.794,43	2,95%	2.242	4,43%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.990.738,29	1,63%	48	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.444.709,25	1,27%	179	3,84%	Artigo 8º, Inciso I
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	4.301.485,22	1,00%	2.120	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	901.912,64	0,21%	58	0,17%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	2.214.743,71	0,52%	52	1,82%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	6.253.016,54	1,45%	7.225	1,09%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.831.739,36	2,05%	454	1,09%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	6.479.668,83	1,51%	76.563	0,46%	Artigo 9º, Inciso III
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	7.011.842,17	1,63%	28.161	0,98%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	8.054.555,13	1,87%	2.224	1,62%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+32	Não há	5.248.904,86	1,22%	86	3,78%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	5.180.800,34	1,21%	21	2,43%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	16.027.591,61	3,73%	845	1,48%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			429.774.024,83				

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

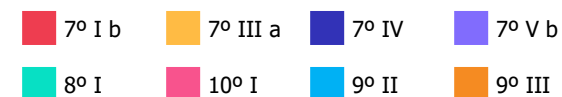
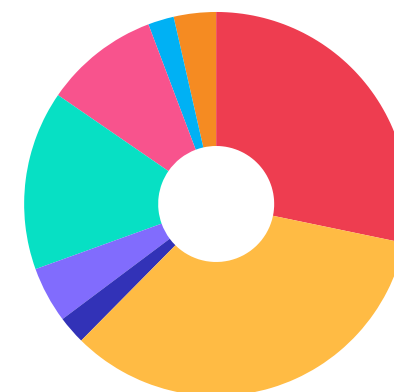
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	50,00%	214.887.012,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	121.447.765,36	28,26%	15,00%	20,00%	75,00%	200.882.753,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	42.977.402,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	146.749.532,57	34,15%	20,00%	30,50%	60,00%	111.114.882,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	8.595.480,50
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	10.153.399,76	2,36%	0,00%	3,00%	20,00%	75.801.405,21
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	20.301.272,66	4,72%	0,00%	5,00%	5,00%	1.187.428,58
Total Renda Fixa	100,00%	298.651.970,35	69,49%	35,00%	68,50%	222,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	64.917.279,29	15,10%	10,00%	15,00%	30,00%	64.014.928,16
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	42.977.402,48
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	41.523.694,11	9,66%	6,00%	10,00%	10,00%	1.453.708,37
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	106.440.973,40	24,77%	16,00%	26,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	9.369.672,89	2,18%	0,00%	2,00%	10,00%	33.607.729,59
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	15.311.408,19	3,56%	0,00%	3,50%	10,00%	27.665.994,29
Total Exterior	10,00%	24.681.081,08	5,74%	0,00%	5,50%	20,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	132.189.578,52	30,76	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	51.694.861,79	12,03	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	44.919.171,41	10,45	0,01
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	23.264.207,42	5,41	-
SOMMA INVESTIMENTOS	21.449.106,81	4,99	-
ICATU VANGUARDA	20.519.753,79	4,77	0,04
SAFRA ASSET MANAGEMENT	16.027.591,61	3,73	0,01
TARPON INVESTIMENTOS	12.435.447,54	2,89	0,21
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	11.551.960,28	2,69	0,11
BANCO J. SAFRA S/A	8.831.739,36	2,05	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	8.054.555,13	1,87	0,01
GUEPARDO INVESTIMENTOS	7.973.520,46	1,86	0,23
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	7.011.842,17	1,63	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.797.380,30	1,58	0,02
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	6.669.876,25	1,55	0,01
WESTERN ASSET	6.479.668,83	1,51	-
XP ASSET MANAGEMENT	6.253.016,54	1,45	-
CLARITAS INVESTIMENTOS	5.461.805,99	1,27	0,06
ITAÚ UNIBANCO	5.303.207,39	1,23	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.180.800,34	1,21	0,34
OCCAM BRASIL	5.035.304,21	1,17	0,03
TRUXT INVESTIMENTOS	4.301.485,22	1,00	0,02
GENIAL INVESTIMENTOS	2.214.743,71	0,52	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	121.447.765,36	28,26	15,00	75,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	146.749.532,57	34,15	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20.301.272,66	4,72	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	64.917.279,29	15,10	10,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	9.369.672,89	2,18	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	15.311.408,19	3,56	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	41.523.694,11	9,66	6,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,23%	3,35%	3,35%	6,61%	13,19%	19,00%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,21%	3,33%	3,33%	6,53%	12,96%	18,52%	0,25%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,52%	4,38%	4,38%	7,03%	10,38%	20,01%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1,50%	4,33%	4,33%	6,92%	10,19%	19,57%	0,89%	0,03%
IRF-M (Benchmark)	2,15%	3,89%	3,89%	5,70%	11,55%	13,99%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,12%	3,80%	3,80%	5,50%	11,28%	13,33%	1,33%	0,03%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	3,45%	3,82%	3,82%	3,23%	8,15%	5,77%	2,79%	0,07%
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,08%	2,99%	2,99%	6,03%	12,15%	18,06%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,16%	3,17%	3,17%	6,49%	13,25%	20,92%	0,02%	0,00%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,51%	0,47%	0,47%	4,02%	11,36%	20,57%	0,22%	0,02%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	3,21%	3,21%	6,53%	13,15%	20,87%	0,02%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	3,02%	3,02%	6,39%	13,33%	21,44%	0,03%	0,00%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,62%	0,05%	0,05%	3,54%	10,66%	19,81%	0,34%	0,02%

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
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,16%	3,08%	3,08%	6,38%	13,21%	21,04%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,15%	3,08%	3,08%	6,43%	13,24%	21,06%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,01%	2,79%	2,79%	5,62%	11,39%	17,07%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,57%	3,32%	3,32%	4,20%	-	-	1,11%	-

CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	4,00%	8,66%	8,66%	19,07%	-1,69%	17,78%	8,70%	0,24%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,97%	2,80%	2,80%	5,61%	13,61%	20,29%	0,20%	0,01%

Ibovespa (Benchmark)	-2,91%	-7,16%	-7,16%	-7,41%	-15,10%	-12,65%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-3,71%	-7,97%	-7,97%	-10,17%	-18,09%	-12,92%	8,31%	0,21%
OCCAM FIC AÇÕES	-2,80%	-6,55%	-6,55%	-8,01%	-12,63%	-12,41%	7,52%	0,20%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-4,91%	-11,02%	-11,02%	-12,44%	-19,61%	-21,23%	8,96%	0,23%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-4,46%	-6,21%	-6,21%	-10,28%	-16,52%	-15,63%	9,40%	0,21%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,38%	-10,64%	-10,64%	-12,35%	-17,33%	-20,36%	10,26%	0,25%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	-6,29%	-8,81%	-8,81%	-15,06%	-18,32%	-2,55%	15,53%	0,28%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-4,07%	-4,30%	-4,30%	-9,08%	-4,37%	22,71%	11,35%	0,26%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,04%	-5,58%	-5,58%	-10,49%	-7,99%	9,54%	10,41%	0,28%

IBX (Benchmark)	-3,07%	-7,27%	-7,27%	-7,64%	-16,05%	-13,70%	-	-
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	-5,78%	-8,25%	-8,25%	-11,89%	-15,01%	-7,94%	10,36%	0,23%

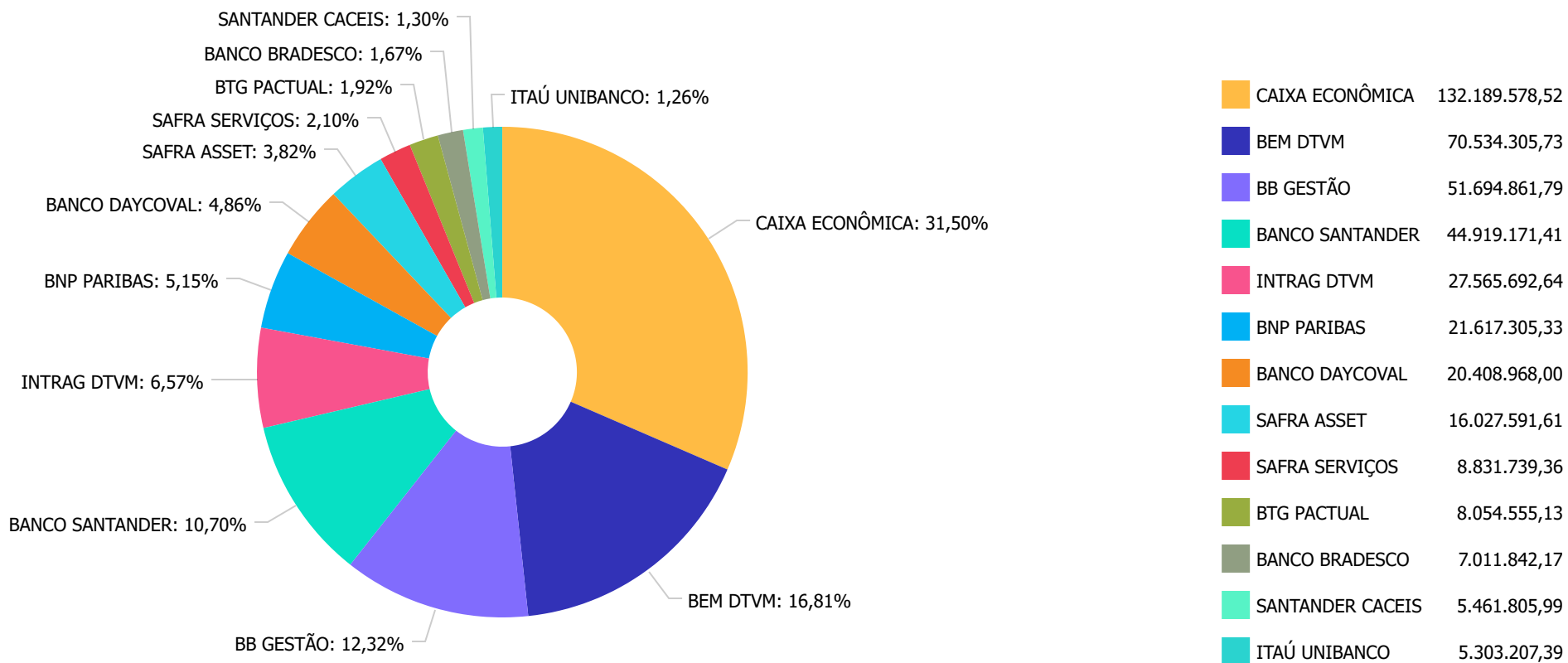
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	1,52%	4,38%	4,38%	7,03%	10,38%	20,01%	-	-
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1,58%	4,54%	4,54%	10,49%	11,61%	14,47%	2,28%	0,13%
S&P 500 (Benchmark)	3,51%	7,03%	7,03%	14,61%	-9,29%	3,43%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	4,14%	8,86%	8,86%	19,71%	3,14%	25,17%	8,66%	0,23%
SMLL (Benchmark)	-1,74%	-9,51%	-9,51%	-16,40%	-27,95%	-35,01%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,68%	-5,47%	-5,47%	-8,85%	-18,78%	-21,71%	4,79%	0,21%

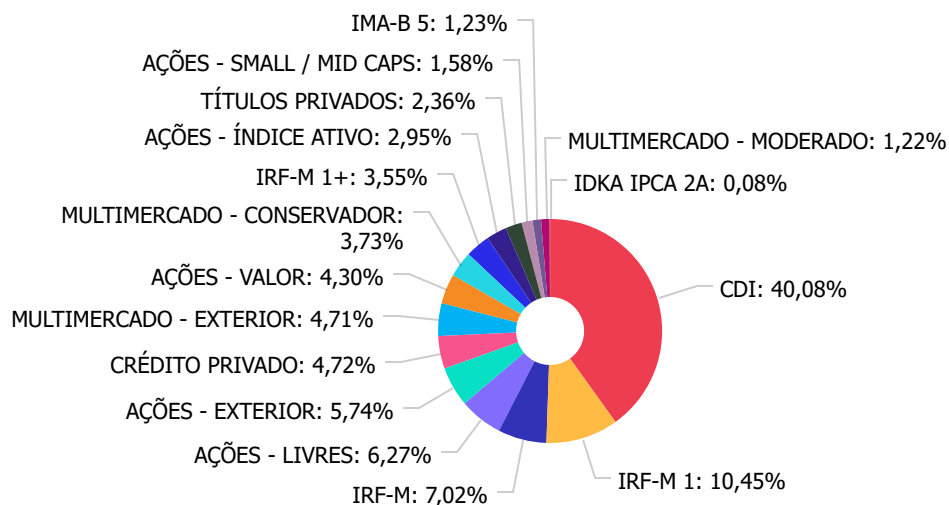
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,06%	4,91%	4,91%	9,03%	-6,55%	-12,42%	8,08%	17,269%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,90%	11,94%	11,94%	13,99%	-7,06%	-17,38%	9,11%	21,773%
MSCI WORLD (Benchmark)	0,32%	4,43%	4,43%	10,27%	-1,96%	-11,47%	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2,41%	15,26%	15,26%	17,34%	-7,32%	-36,51%	11,95%	26,657%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-0,39%	2,15%	2,15%	10,03%	0,11%	-10,08%	7,59%	15,062%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,30%	4,02%	4,02%	9,83%	-2,53%	-14,34%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2,05%	1,45%	1,45%	8,70%	1,70%	-6,45%	7,41%	14,480%

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



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

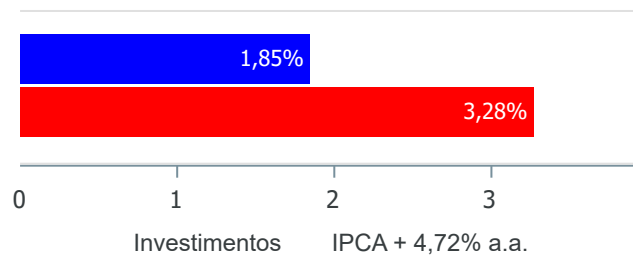


■ CDI	172.239.494,97	■ IRF-M 1	44.895.997,37	■ IRF-M	30.154.993,48
■ AÇÕES - LIVRES	26.949.473,90	■ AÇÕES - EXTERIOR	24.681.081,08	■ CRÉDITO PRIVADO	20.301.272,66
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.247.197,64	■ AÇÕES - VALOR	18.470.630,66	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	16.027.591,61
■ IRF-M 1+	15.270.848,93	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	12.699.794,43	■ TÍTULOS PRIVADOS	10.153.399,76
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	6.797.380,30	■ IMA-B 5	5.303.207,39	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.248.904,86
■ IDKA IPCA 2A	332.755,79				

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	412.396.291,87	15.444.363,04	10.882.802,49	424.062.538,44	7.104.686,02	7.104.686,02	1,70%	1,70%	0,94%	0,94%	182,13%	2,84%
Fevereiro	424.062.538,44	14.238.389,30	11.728.733,81	424.360.562,78	-2.211.631,15	4.893.054,87	-0,52%	1,18%	1,17%	2,12%	55,52%	2,45%
Março	424.360.562,78	37.577.193,22	34.989.554,38	429.774.024,83	2.825.823,21	7.718.878,08	0,66%	1,85%	1,13%	3,28%	56,32%	2,65%

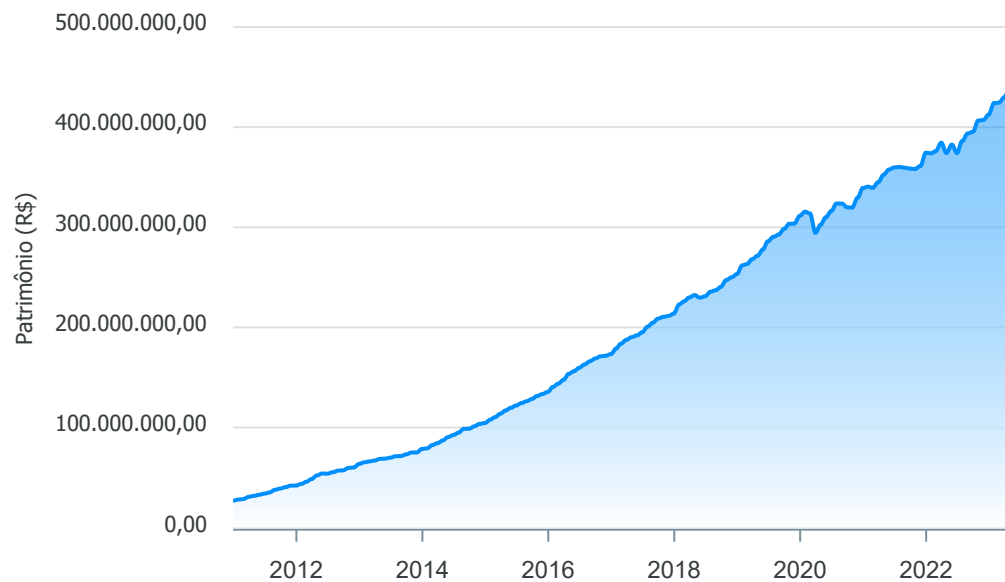
Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	14.761.451,54	0,00	0,00	15.270.848,93	509.397,39	3,45%	3,45%	2,79%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	10.000.000,00	0,00	0,00	10.153.399,76	153.399,76	1,53%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	5.224.918,53	0,00	0,00	5.303.207,39	78.288,86	1,50%	1,50%	0,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	328.181,19	0,00	0,00	332.755,79	4.574,60	1,39%	1,39%	1,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	16.833.406,17	0,00	0,00	17.029.116,38	195.710,21	1,16%	1,16%	0,02%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	22.997.105,71	0,00	0,00	23.264.207,42	267.101,71	1,16%	1,16%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.271.700,20	0,00	0,00	3.309.650,79	37.950,59	1,16%	1,16%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	80.499.006,69	0,00	0,00	81.425.419,59	926.412,90	1,15%	1,15%	0,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	44.416.816,73	0,00	0,00	44.919.171,41	502.354,68	1,13%	1,13%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	74.084.920,41	0,00	30.000.000,00	44.895.997,37	811.076,96	1,09%	1,21%	0,25%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	68.350,26	0,00	2.882,65	66.174,40	706,79	1,03%	1,08%	0,01%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.480.717,90	0,00	0,00	11.551.960,28	71.242,38	0,62%	0,62%	0,34%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	30.000.000,00	0,00	30.154.993,48	154.993,48	0,52%	2,12%	1,33%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	8.705.003,68	0,00	0,00	8.749.312,38	44.308,70	0,51%	0,51%	0,22%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	2.613.766,44	4.577.193,22	4.986.671,73	2.225.754,98	21.467,05	0,30%	1,01%	0,00%
Total Renda Fixa	295.285.345,45	34.577.193,22	34.989.554,38	298.651.970,35	3.778.986,06	1,28%		0,38%



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
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.736.114,00	3.000.000,00	0,00	6.669.876,25	-66.237,75	-0,98%	-4,46%	9,40%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.057.497,38	0,00	0,00	7.973.520,46	-83.976,92	-1,04%	-1,04%	10,41%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.984.500,24	0,00	0,00	6.797.380,30	-187.119,94	-2,68%	-2,68%	4,79%
OCCAM FIC AÇÕES	5.180.247,33	0,00	0,00	5.035.304,21	-144.943,12	-2,80%	-2,80%	7,52%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.679.051,12	0,00	0,00	3.542.664,89	-136.386,23	-3,71%	-3,71%	8,31%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7.287.673,62	0,00	0,00	6.990.738,29	-296.935,33	-4,07%	-4,07%	11,35%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.498.419,87	0,00	0,00	4.301.485,22	-196.934,65	-4,38%	-4,38%	10,26%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	13.355.070,82	0,00	0,00	12.699.794,43	-655.276,39	-4,91%	-4,91%	8,96%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5.796.661,99	0,00	0,00	5.461.805,99	-334.856,00	-5,78%	-5,78%	10,36%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	5.809.949,87	0,00	0,00	5.444.709,25	-365.240,62	-6,29%	-6,29%	15,53%
Total Renda Variável	64.385.186,24	3.000.000,00	0,00	64.917.279,29	-2.467.906,95	-3,66%		9,61%

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
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.236.661,21	0,00	0,00	6.479.668,83	243.007,62	3,90%	3,90%	9,11%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	6.105.892,99	0,00	0,00	6.253.016,54	147.123,55	2,41%	2,41%	11,95%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.653.099,36	0,00	0,00	8.831.739,36	178.640,00	2,06%	2,06%	8,08%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.170.178,23	0,00	0,00	2.214.743,71	44.565,48	2,05%	2,05%	7,41%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	905.481,70	0,00	0,00	901.912,64	-3.569,06	-0,39%	-0,39%	7,59%
Total Exterior	24.071.313,49	0,00	0,00	24.681.081,08	609.767,59	2,53%		9,25%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	80.397.820,14	0,00	38.000.000,00	44.895.997,37	2.498.177,23	3,11%	3,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	78.996.220,84	0,00	0,00	81.425.419,59	2.429.198,75	3,08%	3,08%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	43.603.540,38	0,00	0,00	44.919.171,41	1.315.631,03	3,02%	3,02%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	18.057.835,92	4.500.000,00	0,00	23.264.207,42	706.371,50	3,13%	3,21%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	14.708.628,84	0,00	0,00	15.270.848,93	562.220,09	3,82%	3,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	12.037.112,78	4.500.000,00	0,00	17.029.116,38	492.003,60	2,98%	3,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	5.083.046,99	0,00	0,00	5.303.207,39	220.160,40	4,33%	4,33%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	30.000.000,00	0,00	30.154.993,48	154.993,48	0,52%	3,80%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	0,00	10.000.000,00	0,00	10.153.399,76	153.399,76	1,53%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.210.652,19	0,00	0,00	3.309.650,79	98.998,60	3,08%	3,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	6.499.815,88	10.758.653,66	15.097.194,90	2.225.754,98	64.480,34	0,37%	2,79%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	8.708.302,50	0,00	0,00	8.749.312,38	41.009,88	0,47%	0,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	318.827,11	0,00	0,00	332.755,79	13.928,68	4,37%	4,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	58.507,85	4.501.291,90	4.503.895,78	66.174,40	10.270,43	0,23%	2,99%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.546.432,69	0,00	0,00	11.551.960,28	5.527,59	0,05%	0,05%
Total Renda Fixa	283.226.744,11	64.259.945,56	57.601.090,68	298.651.970,35	8.766.371,36	3,02%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.399.244,31	0,00	0,00	8.054.555,13	655.310,82	8,86%	8,86%
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	6.453.243,23	0,00	0,00	7.011.842,17	558.598,94	8,66%	8,66%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	15.591.801,03	0,00	0,00	16.027.591,61	435.790,58	2,79%	2,79%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5.020.852,90	0,00	0,00	5.248.904,86	228.051,96	4,54%	4,54%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	5.014.331,67	0,00	0,00	5.180.800,34	166.468,67	3,32%	3,32%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.805.746,35	3.000.000,00	0,00	6.669.876,25	-135.870,10	-2,00%	-6,21%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.849.464,69	0,00	0,00	3.542.664,89	-306.799,80	-7,97%	-7,97%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7.305.113,75	0,00	0,00	6.990.738,29	-314.375,46	-4,30%	-4,30%
OCCAM FIC AÇÕES	5.388.343,46	0,00	0,00	5.035.304,21	-353.039,25	-6,55%	-6,55%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.190.367,58	0,00	0,00	6.797.380,30	-392.987,28	-5,47%	-5,47%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.444.287,28	0,00	0,00	7.973.520,46	-470.766,82	-5,57%	-5,57%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5.952.937,72	0,00	0,00	5.461.805,99	-491.131,73	-8,25%	-8,25%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.813.478,48	0,00	0,00	4.301.485,22	-511.993,26	-10,64%	-10,64%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	5.970.436,52	0,00	0,00	5.444.709,25	-525.727,27	-8,81%	-8,81%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	14.272.086,97	0,00	0,00	12.699.794,43	-1.572.292,54	-11,02%	-11,02%
Total Renda Variável	106.471.735,94	3.000.000,00	0,00	106.440.973,40	-3.030.762,54	-2,77%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	5.425.085,75	0,00	0,00	6.253.016,54	827.930,79	15,26%	15,26%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.788.327,05	0,00	0,00	6.479.668,83	691.341,78	11,94%	11,94%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.418.261,61	0,00	0,00	8.831.739,36	413.477,75	4,91%	4,91%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.183.171,79	0,00	0,00	2.214.743,71	31.571,92	1,45%	1,45%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	882.965,62	0,00	0,00	901.912,64	18.947,02	2,15%	2,15%
Total Exterior	22.697.811,82	0,00	0,00	24.681.081,08	1.983.269,26	8,74%	

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.

