



CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2023

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


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria n° 23.580/2021


Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	2.601.338,52	1,11%	657	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	23.102.380,83	9,89%	773	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.366.560,84	0,58%	1.128	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	39.579.090,83	16,94%	360	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	211.415,78	0,09%	41	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	6.003.735,48	2,57%	368	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	13.484.251,99	5,77%	287	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	543.544,14	0,23%	785	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.560.696,35	4,52%	928	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.191.859,04	3,93%	124	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	403.070,11	0,17%	206	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	28.763.404,35	12,31%	145	2,88%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.047.300,52	1,73%	348	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG FI RENDA FIXA	D+0	Não há	18.242.496,18	7,81%	2.432	4,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	21.238.806,53	9,09%	1.421	18,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	2.834.335,67	1,21%	460	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	136.139,39	0,06%	61	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNP PARIBAS MÁTCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	D+0	Não há	7.040.144,15	3,01%	119.904	0,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	589.906,34	0,25%	500	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	658.676,56	0,28%	7.513	0,28%	Artigo 8º, Inciso I

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.599/2021

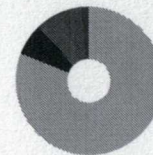
Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	855.947,55	0,37%	539	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.016.466,61	0,86%	124	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.597.262,38	2,40%	39	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
MAG FI AÇÕES	D+3	Não há	2.436.014,98	1,04%	28	9,97%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	340.085,37	0,15%	142	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.705.718,98	1,16%	48	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	D+7	Não há	903.540,54	0,39%	44	0,73%	Artigo 8º, Inciso I
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	D+4 du	Não há	3.263.130,77	1,40%	83	3,51%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	3.624.998,85	1,55%	9.472	0,58%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	6.065.533,80	2,60%	5.705	0,74%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	500.236,99	0,21%	438	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.931.912,34	4,68%	23.960	1,36%	Artigo 10º, Inciso I
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	15.721,86	0,01%	112	0,61%	Artigo 10º, Inciso II
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	3.805.559,67	1,63%		6,45%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			233.661.284,29				


Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Abril / 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%	8,00%	30,00%	70.098.385,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	106.644.873,80	45,64%	15,00%	22,00%	70,00%	56.918.025,20
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	23.366.128,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	75.529.413,36	32,32%	20,00%	30,00%	60,00%	64.667.357,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	35.049.192,64
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	46.732.256,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.683.064,21
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	7.040.144,15	3,01%	3,00%	5,00%	5,00%	4.642.920,06
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.683.064,21
Total Renda Fixa	100,00%	189.214.431,31	80,98%	38,00%	66,00%	220,00%	

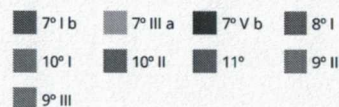
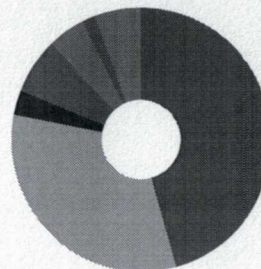


- RENDA FIXA 189.214.431,31
- RENDA VARIÁVEL 16.103.619,31
- EXTERIOR 13.453.900,41
- ESTRUTURADOS 10.947.634,20
- FUNDO IMOBILIÁRIO 3.805.559,67

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	16.103.619,31	6,89%	0,00%	14,00%	30,00%	53.994.765,98
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	23.366.128,43
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.931.912,34	4,68%	5,00%	7,00%	10,00%	12.434.216,09
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	15.721,86	0,01%	0,01%	3,00%	5,00%	11.667.342,35
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.673.225,69
Artigo 11º	5,00%	3.805.559,67	1,63%	0,01%	1,00%	5,00%	7.877.504,54
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	30.856.813,18	13,21%	5,02%	25,00%	62,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	2.336.612,84
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	12.953.663,42	5,54%	4,49%	5,99%	10,00%	10.412.465,01
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	500.236,99	0,21%	0,10%	2,01%	10,00%	22.865.891,44
Total Exterior	10,00%	13.453.900,41	5,76%	4,59%	8,00%	21,00%	

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	106.644.873,80	45,64	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	54.290.606,83	23,23	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	7.040.144,15	3,01	3,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	16.103.619,31	6,89	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso II	12.953.663,42	5,54	4,49	10,00
Artigo 9º, Inciso III	500.236,99	0,21	0,10	10,00
Artigo 10º, Inciso I	10.931.912,34	4,68	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	15.721,86	0,01	0,01	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 11º	3.805.559,67	1,63	0,01	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00



Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

Enquadramento por Gestores - base (Abril / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	73.267.592,39	31,36	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	45.180.448,46	19,34	0,43
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	33.666.652,42	14,41	0,00
CAIXA DTVM	26.604.959,09	11,39	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	18.227.867,90	7,80	0,00
WESTERN ASSET	10.931.912,34	4,68	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	7.698.820,71	3,29	0,01
GUEPARDO INVESTIMENTOS	5.597.262,38	2,40	0,15
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.805.559,67	1,63	-
XP ASSET MANAGEMENT	3.624.998,85	1,55	-
TARPON INVESTIMENTOS	2.705.718,98	1,16	0,04
VINCI PARTNERS	903.540,54	0,39	0,00
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	589.906,34	0,25	0,02
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	500.236,99	0,21	-
META ASSET MANAGEMENT	340.085,37	0,15	0,17
PÁTRIA INVESTIMENTOS	15.721,86	0,01	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)



Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83%	4,11%	3,02%	6,27%	12,99%	19,04%	0,14%	0,42%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,90%	5,33%	3,87%	5,96%	9,67%	20,04%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	4,13%	2,99%	6,36%	11,85%	25,27%	0,00%	0,86%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	5,26%	3,83%	5,83%	9,44%	19,39%	0,60%	2,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	5,25%	3,82%	5,85%	9,56%	19,64%	0,60%	2,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,88%	5,22%	3,81%	5,81%	9,28%	18,96%	0,61%	2,41%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,89%	5,24%	3,81%	5,85%	9,44%	19,53%	0,60%	2,42%

IMA-B (Benchmark)	2,02%	6,08%	6,08%	5,03%	8,78%	13,88%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,01%	5,93%	5,97%	4,87%	8,31%	13,24%	1,70%	3,92%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,94%	5,73%	5,77%	4,54%	7,99%	12,66%	1,88%	3,93%

CDI (Benchmark)	0,92%	4,20%	3,04%	6,44%	13,37%	21,40%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	4,85%	4,18%	5,54%	11,42%	16,42%	0,87%	1,71%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	4,13%	2,97%	6,46%	13,74%	22,51%	0,02%	0,35%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	3,93%	2,85%	6,21%	13,39%	22,18%	0,04%	0,38%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,91%	4,20%	3,02%	6,54%	13,87%	23,43%	0,01%	0,34%
MAG FI RENDA FIXA	0,81%	3,83%	2,72%	6,09%	13,05%	22,09%	0,08%	0,39%


Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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
IPCA (Benchmark)	0,61%	2,72%	2,18%	3,78%	4,18%	16,82%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,87%	4,15%	3,08%	5,43%	11,67%	14,62%	0,20%	1,39%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,93%	4,22%	3,25%	5,36%	10,85%	17,36%	0,38%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,51%	4,59%	3,16%	5,43%	8,59%	-	0,55%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	4,63%	3,08%	6,40%	9,72%	20,80%	0,17%	2,34%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	4,61%	3,07%	3,17%	2,93%	-	0,17%	5,07%



Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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
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%	19,26%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FIC AÇÕES	2,77%	-4,97%	-7,25%	-14,93%	-11,48%	-18,21%	10,03%	21,50%
MAG FIC AÇÕES	2,69%	-4,49%	-7,53%	-11,79%	-4,18%	-18,13%	9,77%	18,93%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,81%	-0,09%	0,84%	-11,64%	8,15%	16,18%	10,25%	26,28%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	4,57%	0,07%	-2,23%	-14,46%	6,84%	15,81%	9,24%	25,82%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2,63%	-0,37%	-4,15%	-7,73%	-0,28%	-0,04%	6,34%	16,48%

IBX (Benchmark)	1,93%	-5,48%	-8,69%	-10,82%	-4,80%	-14,46%	-	-
META VALOR FIC AÇÕES	-0,89%	-11,72%	-15,84%	-21,43%	-16,23%	-31,54%	12,48%	24,84%

IFIX (Benchmark)	3,52%	-0,31%	1,31%	-4,45%	1,61%	-0,10%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-3,59%	-1,93%	-2,57%	-5,68%	-35,04%	206,56%	-	-

IPCA (Benchmark)	0,61%	2,72%	2,18%	3,78%	4,18%	16,82%	-	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	0,48%	2,92%	2,21%	3,39%	3,64%	107,11%	0,16%	3,05%

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,46%	8,59%	2,28%	7,68%	0,91%	-0,28%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,97%	10,92%	4,16%	11,90%	10,25%	15,02%	5,71%	21,82%


Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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
SMLL (Benchmark)	1,91%	-7,78%	-10,40%	-20,60%	-19,88%	-36,55%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FIAÇÕES	-0,80%	-10,74%	-13,64%	-22,33%	-19,13%	-28,94%	12,04%	25,40%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIAÇÕES	1,04%	-5,01%	-9,83%	-17,91%	-19,63%	-32,00%	11,99%	25,80%

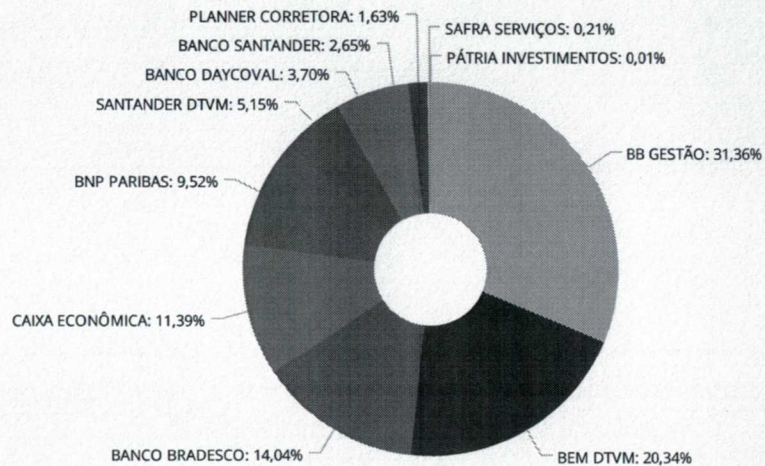

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,76%	5,71%	3,08%	7,37%	1,79%	-14,05%	7,78%	15,474%
MSCI WORLD (Benchmark)	0,00%	4,43%	-0,14%	5,89%	3,12%	-10,69%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-0,14%	0,77%	-1,13%	5,65%	1,27%	-19,01%	6,34%	14,163%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-1,71%	13,30%	2,07%	17,31%	0,07%	-39,14%	8,07%	25,040%
MSCI ACWI (Benchmark)	-0,32%	3,70%	-0,93%	6,26%	1,87%	-13,63%	-	-
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-3,17%	-1,53%	-3,89%	6,66%	-19,16%	-39,63%	7,84%	21,353%


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria n° 23.500/2021

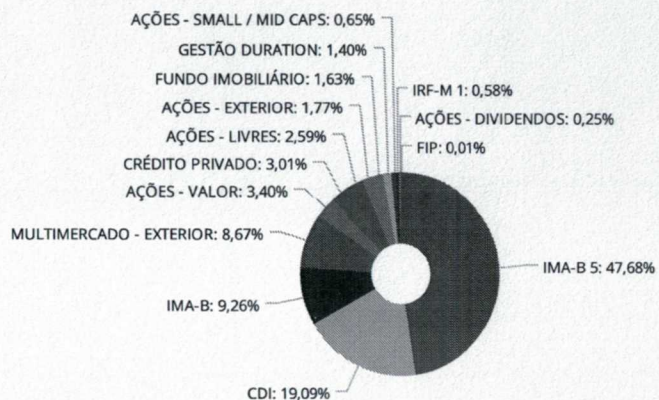
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Abril / 2023)



BB GESTÃO	73.267.592,39
BEM DTVM	47.529.842,89
BANCO BRADESCO	32.810.704,87
CAIXA ECONÔMICA	26.604.959,09
BNP PARIBAS	22.255.731,90
SANTANDER DTVM	12.026.194,71
BANCO DAYCOVAL	8.643.066,73
BANCO SANTANDER	6.201.673,19
PLANNER CORRETORA	3.805.559,67
SAFRA SERVIÇOS	500.236,99
PÁTRIA INVESTIMENTOS	15.721,86

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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



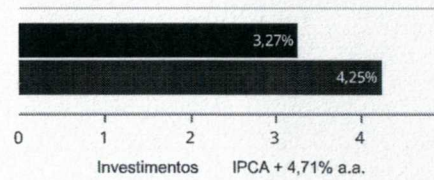
■ IMA-B 5	111.408.847,18	■ CDI	44.612.119,84	■ IMA-B	21.641.876,64	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.260.576,91
■ AÇÕES - VALOR	7.953.814,36	■ CRÉDITO PRIVADO	7.040.144,15	■ AÇÕES - LIVRES	6.045.274,50	■ AÇÕES - EXTERIOR	4.125.235,84
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	3.805.559,67	■ GESTÃO DURATION	3.281.022,05	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.514.624,11	■ IRF-M 1	1.366.560,84
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	589.906,34	■ FIP	15.721,86				

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 28.500/2021

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	223.796.588,87	12.539.062,06	12.362.323,08	227.589.514,36	3.616.186,51	3.616.186,51	1,61%	1,61%	0,93%	0,93%	172,73%	2,69%
Fevereiro	227.589.514,36	25.946.684,84	25.647.672,62	227.579.922,73	-308.603,85	3.307.582,66	-0,14%	1,48%	1,17%	2,12%	69,74%	2,27%
Março	227.579.922,73	34.347.476,63	32.777.536,62	230.825.157,11	1.675.294,37	4.982.877,03	0,73%	2,22%	1,13%	3,28%	67,74%	2,09%
Abril	230.825.157,11	61.881.489,12	61.419.086,00	233.661.284,29	2.373.724,06	7.356.601,09	1,03%	3,27%	0,94%	4,25%	76,93%	1,83%

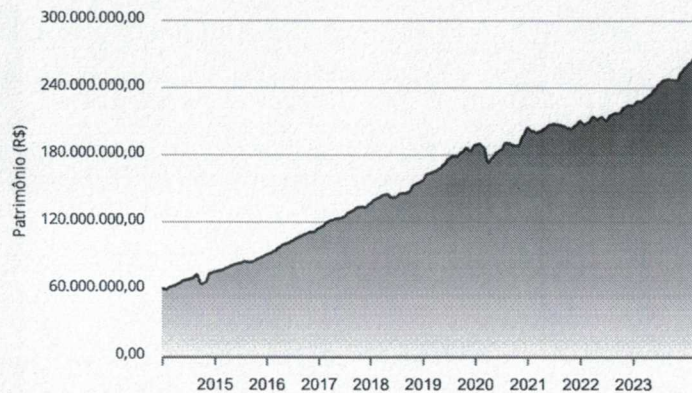
Investimentos x Meta de Rentabilidade



Rodrigo Barbosa Franco
Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

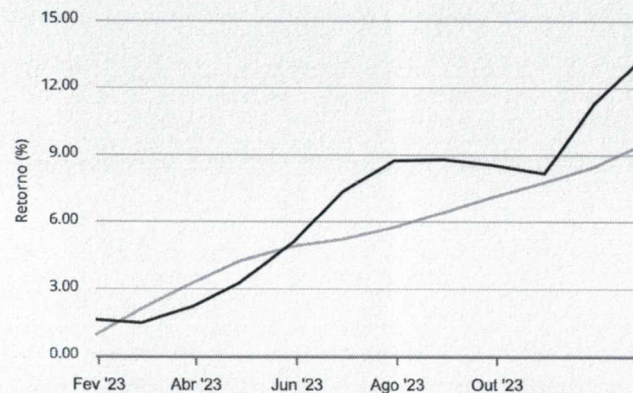
Gráficos Ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

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
- SMLL
- IDIV

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	302.793,56	94.285,29	0,00	403.070,11	5.991,26	1,51%	2,01%	1,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.568.703,35	0,00	0,00	2.601.338,52	32.635,17	1,27%	1,27%	0,87%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.005.553,66	20.000.000,00	0,00	21.238.806,53	233.252,87	1,11%	1,94%	1,88%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.357.692,18	0,00	0,00	13.484.251,99	126.559,81	0,95%	0,95%	0,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	38.527.593,55	683.353,94	0,00	39.579.090,83	368.143,34	0,94%	0,95%	0,17%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CR...	6.966.270,28	10.738,49	0,00	7.040.144,15	63.135,38	0,90%	0,91%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	22.405.948,40	493.111,40	0,00	23.102.380,83	203.321,03	0,89%	0,89%	0,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	256.723,58	0,00	47.557,07	211.415,78	2.249,27	0,88%	0,90%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.430.106,71	0,00	75.229,10	1.366.560,84	11.683,23	0,82%	0,83%	0,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.476.907,35	3.000.000,00	0,00	10.560.696,35	83.789,00	0,80%	0,89%	0,60%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.521.673,94	3.600.000,00	0,00	9.191.859,04	70.185,10	0,77%	0,89%	0,60%
MAG FI RENDA FIXA	37.981.329,46	0,00	20.000.000,00	18.242.496,18	261.166,72	0,69%	0,81%	0,08%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	234.684,43	0,00	100.000,00	136.139,39	1.454,96	0,62%	0,93%	0,38%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	596.130,85	28.000.000,00	0,00	28.763.404,35	167.273,50	0,58%	0,88%	0,61%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	6.303.829,31	0,00	3.500.000,00	2.834.335,67	30.506,36	0,48%	0,88%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.533.380,74	0,00	3.000.000,00	543.544,14	10.163,40	0,29%	0,87%	0,20%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	31.967.289,06	0,00	28.000.000,00	4.047.300,52	80.011,46	0,25%	0,90%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	6.000.000,00	0,00	6.003.735,48	3.735,48	0,06%	0,51%	0,55%
Total Renda Fixa	180.436.610,41	61.881.489,12	54.722.786,17	189.350.570,70	1.755.257,34	0,94%		0,53%

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.289.770,28	0,00	0,00	5.597.262,38	307.492,10	5,81%	5,81%	10,25%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.587.523,06	0,00	0,00	2.705.718,98	118.195,92	4,57%	4,57%	9,24%
MAG FIC AÇÕES	2.938.482,01	0,00	589.607,17	2.436.014,98	87.140,14	2,97%	2,69%	9,77%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FIC AÇÕES	879.207,56	0,00	0,00	903.540,54	24.332,98	2,77%	2,77%	10,03%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIC AÇÕES	574.764,39	0,00	0,00	589.906,34	15.141,95	2,63%	2,63%	6,34%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.720.252,96	0,00	0,00	10.931.912,34	211.659,38	1,97%	1,97%	5,71%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	651.913,15	0,00	0,00	658.676,56	6.763,41	1,04%	1,04%	11,99%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	7.949.769,34	0,00	6.000.000,00	2.016.466,61	66.697,27	0,84%	3,05%	9,82%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	15.647,03	0,00	0,00	15.721,86	74,83	0,48%	0,48%	0,16%
BRANCO MID SMALL CAPS FIC AÇÕES	862.816,60	0,00	0,00	855.947,55	-6.869,05	-0,80%	-0,80%	12,04%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	3.947.182,99	0,00	106.692,66	3.805.559,67	-34.930,66	-0,88%	-3,59%	-
META VALOR FIC AÇÕES	343.140,89	0,00	0,00	340.085,37	-3.055,52	-0,89%	-0,89%	12,48%
Total Renda Variável	36.760.470,26	0,00	6.696.299,83	30.856.813,18	792.642,75	2,16%		8,27%

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 28.500/2021

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	496.453,27	0,00	0,00	500.236,99	3.783,72	0,76%	0,76%	7,78%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	6.073.803,68	0,00	0,00	6.065.533,80	-8.269,88	-0,14%	-0,14%	6,34%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	3.687.878,96	0,00	0,00	3.624.998,85	-62.880,11	-1,71%	-1,71%	8,07%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	3.369.940,53	0,00	0,00	3.263.130,77	-106.809,76	-3,17%	-3,17%	7,84%
Total Exterior	13.628.076,44	0,00	0,00	13.453.900,41	-174.176,03	-1,28%		7,22%


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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 CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.



Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.650/2021