

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

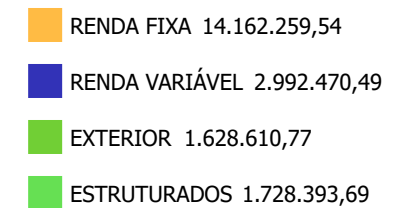
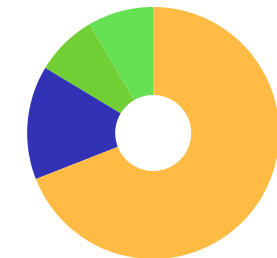
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.133.500,27	5,53%	960	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	127.525,33	0,62%	766	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	89.168,20	0,43%	520	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	622.002,06	3,03%	1.124	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	751.265,29	3,66%	473	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	967.436,49	4,72%	360	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	835.971,54	4,08%	146	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	186.507,73	0,91%	93	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.773.988,41	8,65%	348	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.807.030,45	8,81%	2.288	1,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	930.264,16	4,54%	76.872	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	44.141,41	0,22%	935	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.552.436,76	7,57%	1.088	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	642.851,24	3,13%	211	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	861.075,86	4,20%	210	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.107.166,51	5,40%	87	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	729.927,83	3,56%	45.675	0,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	147.565,46	0,72%	23.459	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	632.490,85	3,08%	1.588	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	441.246,83	2,15%	5.548	0,32%	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
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	669.733,66	3,27%	23.239	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	547.363,20	2,67%	494	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	36.079,07	0,18%	215	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	406.289,84	1,98%	77	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	111.701,58	0,54%	11.521	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	899.763,65	4,39%	158	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	341.179,10	1,66%	18.088	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	387.668,02	1,89%	2.329	0,36%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	147.507,36	0,72%	96	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	475.399,74	2,32%	181	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	835.229,14	4,07%	55.155	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	270.257,45	1,32%	698	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		524,13	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			20.511.734,49				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			524,13				Artigo 6º
PL Total			20.512.258,62				

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

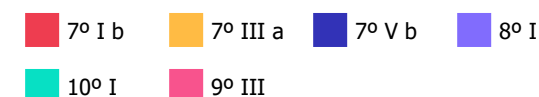
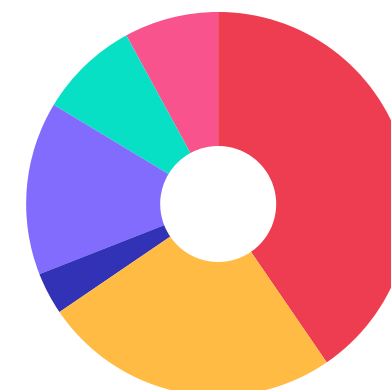
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	22,95%	81,95%	16.809.366,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	8.294.395,77	40,44%	20,48%	27,30%	81,95%	8.514.970,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	5.137.935,94	25,05%	12,00%	12,30%	60,00%	7.169.104,75
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	4.102.346,90
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	729.927,83	3,56%	0,00%	5,00%	5,00%	295.658,89
Total Renda Fixa	100,00%	14.162.259,54	69,04%	32,48%	67,55%	248,90%	



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%	2.992.470,49	14,59%	12,75%	18,25%	20,00%	1.109.876,41
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.728.393,69	8,43%	5,75%	8,20%	10,00%	322.779,76
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	4.720.864,18	23,02%	18,50%	26,45%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.628.610,77	7,94%	0,00%	5,00%	10,00%	422.562,68
Total Exterior	10,00%	1.628.610,77	7,94%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.604.323,44	66,32	-
ITAÚ UNIBANCO	3.180.238,33	15,50	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	3.084.321,48	15,04	0,03
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	642.851,24	3,13	-

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 '	0,00	0,00	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	8.294.395,77	40,44	20,48	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	5.137.935,94	25,05	12,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	729.927,83	3,56	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	2.992.470,49	14,59	12,75	20,00
Artigo 9º, Inciso III	1.628.610,77	7,94	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.728.393,69	8,43	5,75	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%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38%	4,37%	4,37%	6,90%	9,91%	19,41%	1,08%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,23%	3,35%	3,35%	6,61%	13,19%	19,00%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20%	3,25%	3,25%	6,44%	12,84%	18,35%	0,25%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,52%	4,38%	4,38%	7,03%	10,38%	20,01%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,49%	4,32%	4,32%	6,87%	10,13%	19,36%	0,89%	0,03%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1,50%	4,20%	4,20%	6,64%	9,92%	18,25%	0,89%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,66%	3,98%	3,98%	4,22%	7,51%	12,36%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,60%	3,89%	3,89%	4,06%	7,26%	11,74%	1,58%	0,04%
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%
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%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,55%	2,86%	2,86%	5,91%	13,02%	-	0,73%	0,01%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,38%	3,31%	3,31%	6,05%	12,33%	22,28%	0,29%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,24%	3,36%	3,36%	6,45%	13,47%	-	0,39%	0,01%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,86%	1,54%	1,54%	5,04%	12,30%	22,47%	0,16%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	4,06%	4,06%	6,88%	9,39%	-	0,90%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,15%	5,13%	5,13%	6,32%	-	-	1,60%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	3,64%	3,64%	7,77%	11,11%	20,82%	0,19%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,43%	4,12%	4,12%	3,57%	9,39%	16,97%	1,62%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,77%	4,40%	4,40%	4,55%	-	-	2,06%	-

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
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,39%	3,30%	3,30%	6,16%	12,27%	19,48%	0,64%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,63%	3,65%	3,65%	6,41%	11,28%	17,78%	0,70%	0,01%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,16%	2,56%	2,56%	3,76%	9,39%	15,87%	0,60%	0,02%

Ibovespa (Benchmark)	-2,91%	-7,16%	-7,16%	-7,41%	-15,10%	-12,65%	-	-
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-3,51%	-7,86%	-7,86%	-8,57%	-16,68%	-15,53%	9,28%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,40%	-7,50%	-7,50%	-9,34%	-17,88%	-12,70%	8,24%	0,19%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-3,71%	-7,97%	-7,97%	-10,17%	-18,09%	-12,92%	8,31%	0,21%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,95%	-6,10%	-6,10%	-5,07%	-12,75%	-3,84%	7,70%	0,19%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-5,28%	-10,50%	-10,50%	-19,70%	-26,68%	-	10,19%	0,24%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-3,51%	-7,69%	-7,69%	-7,84%	-15,18%	-17,40%	8,95%	0,22%

S&P 500 (Benchmark)	3,51%	7,03%	7,03%	14,61%	-9,29%	3,43%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,57%	7,90%	7,90%	17,13%	-3,11%	14,68%	8,04%	0,22%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	4,03%	8,80%	8,80%	19,42%	-1,09%	19,12%	8,69%	0,24%

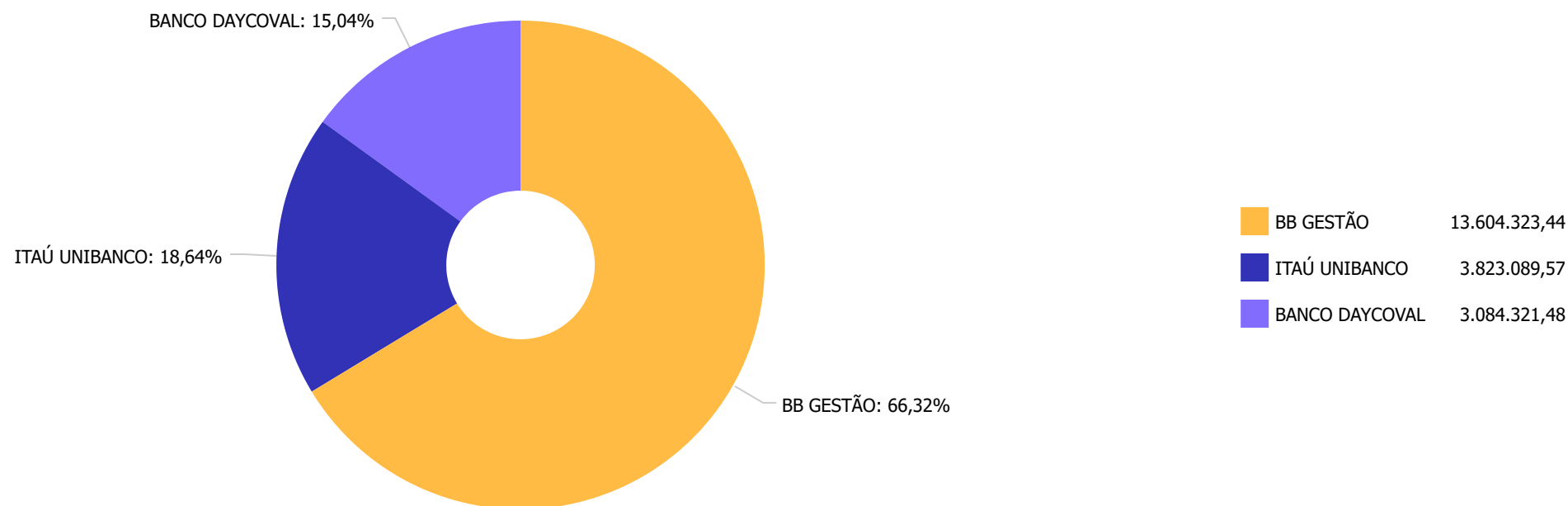
SMLL (Benchmark)	-1,74%	-9,51%	-9,51%	-16,40%	-27,95%	-35,01%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-2,39%	-8,74%	-8,74%	-14,80%	-23,37%	-26,75%	10,44%	0,24%



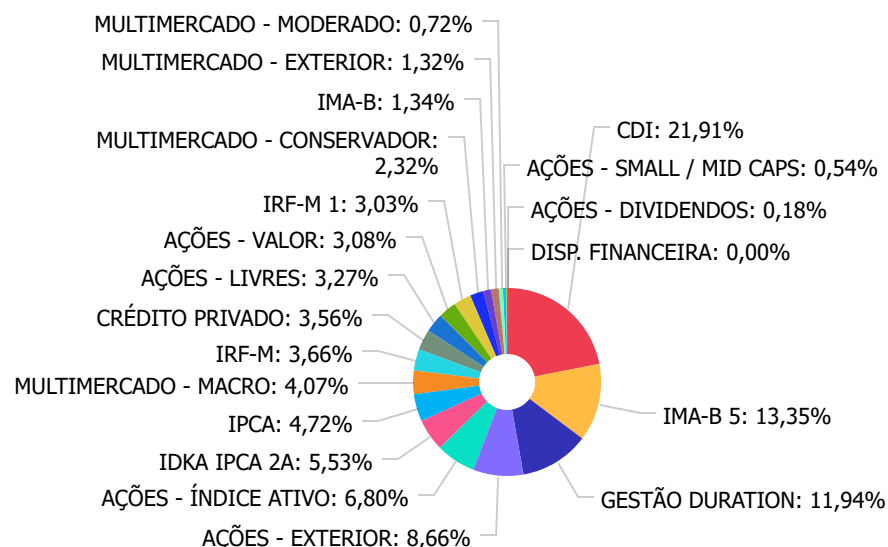
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,76%	-2,58%	-2,58%	3,99%	-5,29%	-8,70%	7,25%	14,143%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,49%	11,39%	11,39%	-0,28%	-12,41%	-28,58%	7,00%	25,662%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,09%	3,47%	3,47%	9,46%	-4,07%	-8,96%	7,58%	16,771%

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



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

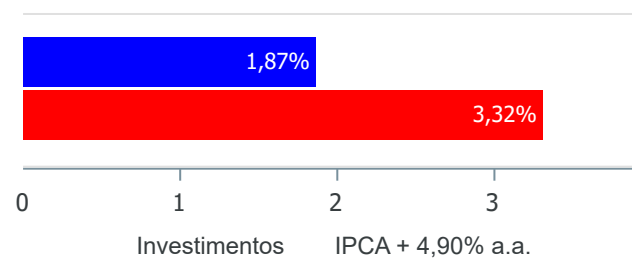


CDI	4.495.084,70	IMA-B 5	2.737.485,28	GESTÃO DURATION	2.449.881,69
AÇÕES - EXTERIOR	1.776.176,23	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.394.899,87	IDKA IPCA 2A	1.133.500,27
IPCA	967.436,49	MULTIMERCADO - MACRO	835.229,14	IRF-M	751.265,29
CRÉDITO PRIVADO	729.927,83	AÇÕES - LIVRES	669.733,66	AÇÕES - VALOR	632.490,85
IRF-M 1	622.002,06	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	475.399,74	IMA-B	275.675,93
MULTIMERCADO - EXTERIOR	270.257,45	MULTIMERCADO - MODERADO	147.507,36	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	111.701,58
AÇÕES - DIVIDENDOS	36.079,07	DISP. FINANCEIRA	524,13		

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	19.046.548,36	506.461,88	178.155,44	19.714.622,82	339.768,02	339.768,02	1,75%	1,75%	0,95%	0,95%	184,46%	3,15%
Fevereiro	19.714.622,82	2.126.544,03	1.726.103,29	20.002.081,67	-112.981,89	226.786,13	-0,56%	1,18%	1,19%	2,15%	55,06%	2,70%
Março	20.002.081,67	1.030.935,18	659.324,17	20.511.734,49	138.041,81	364.827,94	0,68%	1,87%	1,15%	3,32%	56,21%	2,54%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	181.474,22	0,00	0,00	186.507,73	5.033,51	2,77%	2,77%	2,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	86.906,92	0,00	0,00	89.168,20	2.261,28	2,60%	2,60%	1,58%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	627.574,67	0,00	0,00	642.851,24	15.276,57	2,43%	2,43%	1,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	818.408,08	0,00	0,00	835.971,54	17.563,46	2,15%	2,15%	1,60%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	644.271,77	92.091,55	0,00	751.265,29	14.901,97	2,02%	2,12%	1,33%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.780.396,71	0,00	0,00	1.807.030,45	26.633,74	1,50%	1,50%	0,89%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	125.655,86	0,00	0,00	127.525,33	1.869,47	1,49%	1,49%	0,89%
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	849.365,37	0,00	0,00	861.075,86	11.710,49	1,38%	1,38%	0,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.751.678,74	0,00	0,00	1.773.988,41	22.309,67	1,27%	1,27%	0,90%
ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.093.571,07	0,00	0,00	1.107.166,51	13.595,44	1,24%	1,24%	0,39%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	614.640,57	0,00	0,00	622.002,06	7.361,49	1,20%	1,20%	0,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.688.187,08	5.928,88	161.259,71	1.552.436,76	19.580,51	1,16%	1,16%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	715.311,97	405.347,23	0,00	1.133.500,27	12.841,07	1,15%	1,38%	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	823.465,14	134.166,00	0,00	967.436,49	9.805,35	1,02%	1,18%	0,19%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	723.696,93	0,00	0,00	729.927,83	6.230,90	0,86%	0,86%	0,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	402.679,58	0,00	405.347,23	0,00	2.667,65	0,66%	1,88%	0,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	114.204,38	22.055,75	92.717,23	44.141,41	598,51	0,44%	1,08%	0,01%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	555.160,64	371.345,77	0,00	930.264,16	3.757,75	0,41%	0,55%	0,73%
Total Renda Fixa	13.596.649,70	1.030.935,18	659.324,17	14.162.259,54	193.998,83	1,39%		0,73%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIC AÇÕES	142.477,52	0,00	0,00	147.565,46	5.087,94	3,57%	3,57%	8,04%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	114.431,31	0,00	0,00	111.701,58	-2.729,73	-2,39%	-2,39%	10,44%
ITAÚ DIVIDENDOS FIC AÇÕES	37.174,14	0,00	0,00	36.079,07	-1.095,07	-2,95%	-2,95%	7,70%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	654.774,81	0,00	0,00	632.490,85	-22.283,96	-3,40%	-3,40%	8,24%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	457.282,29	0,00	0,00	441.246,83	-16.035,46	-3,51%	-3,51%	9,28%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	567.258,15	0,00	0,00	547.363,20	-19.894,95	-3,51%	-3,51%	8,95%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	695.517,20	0,00	0,00	669.733,66	-25.783,54	-3,71%	-3,71%	8,31%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	428.950,89	0,00	0,00	406.289,84	-22.661,05	-5,28%	-5,28%	10,19%
Total Renda Variável	3.097.866,31	0,00	0,00	2.992.470,49	-105.395,82	-3,40%		8,87%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	323.411,56	0,00	0,00	341.179,10	17.767,54	5,49%	5,49%	7,00%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	259.792,10	0,00	0,00	270.257,45	10.465,35	4,03%	4,03%	8,69%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	145.141,58	0,00	0,00	147.507,36	2.365,78	1,63%	1,63%	0,70%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	468.864,69	0,00	0,00	475.399,74	6.535,05	1,39%	1,39%	0,64%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	825.669,13	0,00	0,00	835.229,14	9.560,01	1,16%	1,16%	0,60%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	890.067,45	0,00	0,00	899.763,65	9.696,20	1,09%	1,09%	7,58%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	394.619,15	0,00	0,00	387.668,02	-6.951,13	-1,76%	-1,76%	7,25%
Total Exterior	3.307.565,66	0,00	0,00	3.357.004,46	49.438,80	1,49%		4,55%

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
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.550.217,61	186.000,00	0,00	1.807.030,45	70.812,84	4,08%	4,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.379.072,06	380.000,00	50.333,06	1.773.988,41	65.249,41	3,71%	4,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.566.672,66	376.300,32	446.585,04	1.552.436,76	56.048,82	2,88%	3,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	795.194,34	0,00	0,00	835.971,54	40.777,20	5,13%	5,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.071.132,39	0,00	0,00	1.107.166,51	36.034,12	3,36%	3,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	803.934,92	134.166,00	0,00	967.436,49	29.335,57	3,13%	3,64%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	120.182,36	985.347,23	0,00	1.133.500,27	27.970,68	2,53%	4,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	833.455,05	0,00	0,00	861.075,86	27.620,81	3,31%	3,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.207.678,71	96.040,45	580.000,00	751.265,29	27.546,13	2,11%	3,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	617.391,54	0,00	0,00	642.851,24	25.459,70	4,12%	4,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	602.420,72	0,00	0,00	622.002,06	19.581,34	3,25%	3,25%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	772.656,80	0,00	785.347,23	0,00	12.690,43	1,64%	3,54%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	273.763,62	644.852,75	0,00	930.264,16	11.647,79	1,27%	2,86%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	534.212,75	185.322,89	0,00	729.927,83	10.392,19	1,44%	1,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	183.726,23	0,00	5.174,98	186.507,73	7.956,48	4,33%	4,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	122.241,84	0,00	0,00	127.525,33	5.283,49	4,32%	4,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	85.828,32	0,00	0,00	89.168,20	3.339,88	3,89%	3,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	68.329,69	70.755,10	96.800,88	44.141,41	1.857,50	1,34%	2,99%
Total Renda Fixa	12.588.111,61	3.058.784,74	1.964.241,19	14.162.259,54	479.604,38	3,51%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	248.398,77	0,00	0,00	270.257,45	21.858,68	8,80%	8,80%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	814.397,67	0,00	0,00	835.229,14	20.831,47	2,56%	2,56%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	450.337,61	0,00	468.047,83	0,00	17.710,22	3,93%	-2,09%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	460.231,58	0,00	0,00	475.399,74	15.168,16	3,30%	3,30%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	131.274,12	5.814,04	0,00	147.565,46	10.477,30	7,64%	7,90%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	142.317,02	0,00	0,00	147.507,36	5.190,34	3,65%	3,65%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	132.522,92	0,00	131.293,88	0,00	-1.229,04	-0,93%	-10,07%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	38.421,91	0,00	0,00	36.079,07	-2.342,84	-6,10%	-6,10%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	122.398,72	0,00	0,00	111.701,58	-10.697,14	-8,74%	-8,74%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	478.877,12	0,00	0,00	441.246,83	-37.630,29	-7,86%	-7,86%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	453.952,69	0,00	0,00	406.289,84	-47.662,85	-10,50%	-10,50%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	683.798,37	0,00	0,00	632.490,85	-51.307,52	-7,50%	-7,50%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	0,00	599.342,31	0,00	547.363,20	-51.979,11	-8,67%	-7,69%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	727.733,54	0,00	0,00	669.733,66	-57.999,88	-7,97%	-7,97%
Total Renda Variável	4.884.662,04	605.156,35	599.341,71	4.720.864,18	-169.612,50	-3,47%	



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
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	306.292,51	0,00	0,00	341.179,10	34.886,59	11,39%	11,39%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	869.567,83	0,00	0,00	899.763,65	30.195,82	3,47%	3,47%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	397.914,37	0,00	0,00	387.668,02	-10.246,35	-2,58%	-2,58%
Total Exterior	1.573.774,71	0,00	0,00	1.628.610,77	54.836,06	3,48%	

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.

