

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2023

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	12.325.123,36	11,53%	661	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	7.970.370,80	7,46%	360	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	20.726.665,34	19,39%	348	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	8.215.688,37	7,69%	287	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.181.202,07	3,91%	794	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	365.925,25	0,34%	293	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	24.148.596,24	22,60%	1.132	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	6.488.831,72	6,07%	13.362	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.087.680,88	6,63%	935	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.957.812,65	4,64%	211	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	834.348,34	0,78%	1.588	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.682.995,12	1,57%	23.239	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	954.966,41	0,89%	11.054	0,36%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	684.498,81	0,64%	554	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	331.383,21	0,31%	12.712	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	5.902.685,89	5,52%	96	4,68%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	10.527,13	0,01%	181	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			106.869.301,59				



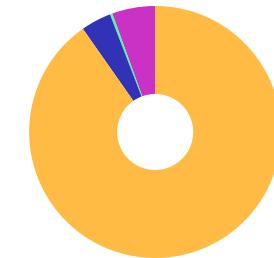
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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 ' b '	100,00%	84.422.403,15	79,00%	20,49%	44,67%	100,00%	22.446.898,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	12.045.493,53	11,27%	20,89%	26,88%	60,00%	52.076.087,42
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	21.373.860,32
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	5.343.465,08
Total Renda Fixa	100,00%	96.467.896,68	90,27%	41,38%	76,55%	185,00%	



- █ RENDA FIXA 96.467.896,68
- █ RENDA VARIÁVEL 4.156.808,68
- █ EXTERIOR 331.383,21
- █ ESTRUTURADOS 5.913.213,02



**CRÉDITO
& MERCADO**

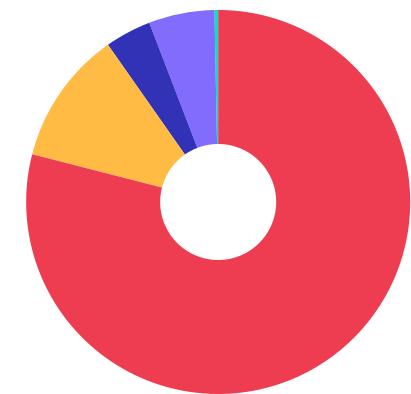
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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%	4.156.808,68	3,89%	0,00%	17,45%	20,00%	17.217.051,64
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.913.213,02	5,53%	0,00%	5,00%	10,00%	4.773.717,14
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.070.021,70	9,42%	0,00%	22,45%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	10.686.930,16
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	331.383,21	0,31%	0,00%	0,00%	10,00%	10.355.546,95
Total Exterior	10,00%	331.383,21	0,31%	0,00%	0,00%	20,00%	



█ 7º I b █ 7º III a █ 8º I █ 10º I
█ 9º III



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	57.826.746,48	54,11	-
SICREDI	30.637.427,96	28,67	0,03
CAIXA DTVM	12.762.815,69	11,94	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	4.957.812,65	4,64	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	684.498,81	0,64	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	84.422.403,15	79,00	20,49	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	12.045.493,53	11,27	20,89	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	4.156.808,68	3,89	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	331.383,21	0,31	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.913.213,02	5,53	0,00	10,00



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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
IRF-M (Benchmark)	2,15%	3,89%	3,89%	5,70%	11,55%	13,99%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,12%	3,88%	3,88%	5,70%	11,40%	13,64%	1,33%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1,14%	3,21%	3,21%	6,47%	13,09%	20,36%	0,02%	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,15%	3,23%	3,23%	6,50%	13,16%	20,50%	0,02%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	3,64%	3,64%	7,77%	11,11%	20,82%	0,19%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,08%	2,99%	2,99%	6,03%	12,15%	18,06%	0,01%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	4,06%	4,06%	6,88%	9,39%	-	0,90%	0,03%
IPCA (Benchmark)	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,43%	4,12%	4,12%	3,57%	9,39%	16,97%	1,62%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	3,25%	3,25%	5,55%	11,71%	14,38%	0,19%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88%	3,54%	3,54%	5,27%	10,69%	15,78%	0,88%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	3,63%	3,63%	4,49%	4,23%	-	0,19%	0,05%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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%

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%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,40%	-7,50%	-7,50%	-9,34%	-17,88%	-12,70%	8,24%	0,19%

MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	0,74%	4,04%	4,04%	7,18%	-4,00%	-11,09%	-	-
--	-------	-------	-------	-------	--------	---------	---	---

SMALL (Benchmark)	-1,74%	-9,51%	-9,51%	-16,40%	-27,95%	-35,01%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-4,61%	-10,03%	-10,03%	-15,11%	-26,15%	-25,26%	9,45%	0,27%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-2,10%	-10,07%	-10,07%	-18,05%	-29,84%	-37,29%	11,80%	0,28%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	0,74%	4,04%	4,04%	7,18%	-4,00%	-11,09%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,00%	3,21%	-	8,91%	-5,03%	-10,77%	7,58%	0,17%

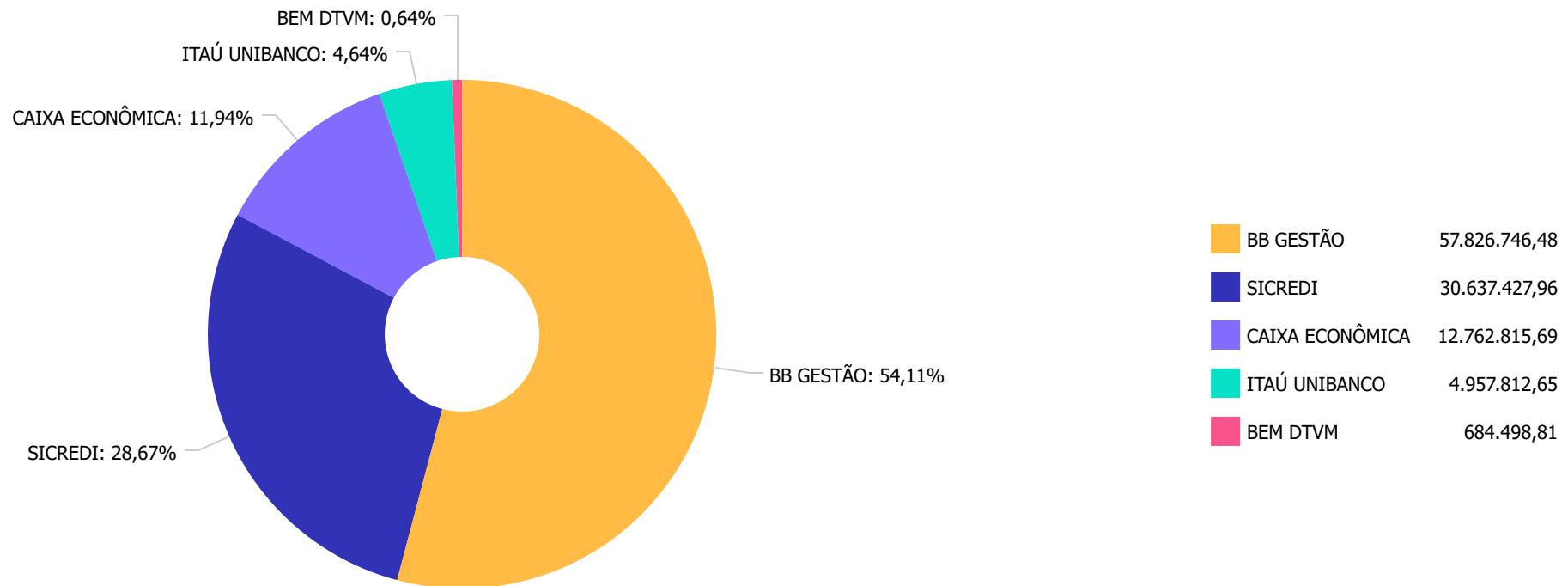


CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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



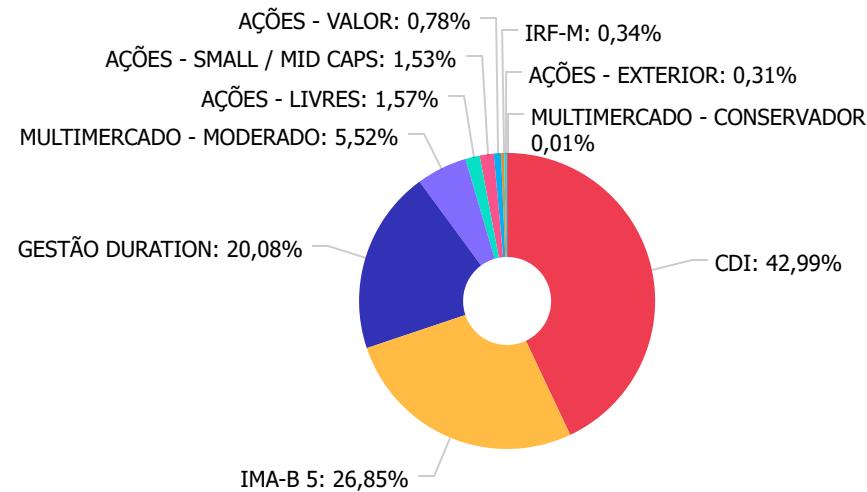


CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023



■ CDI	45.940.797,21	■ IMA-B 5	28.697.036,14	■ GESTÃO DURATION	21.464.138,08
■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.902.685,89	■ AÇÕES - LIVRES	1.682.995,12	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.639.465,22
■ AÇÕES - VALOR	834.348,34	■ IRF-M	365.925,25	■ AÇÕES - EXTERIOR	331.383,21
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	10.527,13				



**CRÉDITO
& MERCADO**

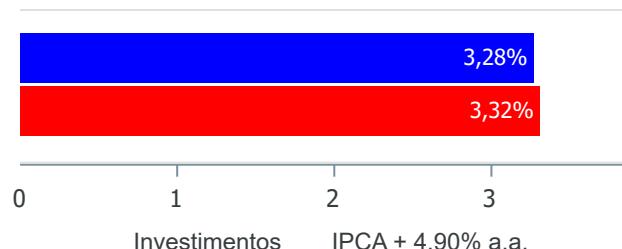
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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	98.039.230,18	2.406.360,19	1.940.898,22	100.103.042,85	1.598.350,70	1.598.350,70	1,62%	1,62%	0,95%	0,95%	170,67%	1,98%
Fevereiro	100.103.042,85	11.212.191,47	12.105.856,06	99.703.773,18	494.394,92	2.092.745,62	0,49%	2,12%	1,19%	2,15%	98,95%	1,03%
Março	99.703.773,18	14.401.177,14	8.436.100,96	106.869.301,59	1.200.452,23	3.293.197,85	1,14%	3,28%	1,15%	3,32%	98,86%	0,82%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA...	4.839.996,50	0,00	0,00	4.957.812,65	117.816,15	2,43%	2,43%	1,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	358.320,39	0,00	0,00	365.925,25	7.604,86	2,12%	2,12%	1,33%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	12.098.113,27	0,00	0,00	12.325.123,36	227.010,09	1,88%	1,88%	0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	20.466.006,94	0,00	0,00	20.726.665,34	260.658,40	1,27%	1,27%	0,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.321.296,07	0,00	191.405,94	4.181.202,07	51.311,94	1,19%	1,21%	0,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.867.168,87	10.000,00	0,00	7.970.370,80	93.201,93	1,18%	1,18%	0,19%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.119.853,43	0,00	0,00	8.215.688,37	95.834,94	1,18%	1,18%	0,19%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	6.415.826,63	0,00	0,00	6.488.831,72	73.005,09	1,14%	1,14%	0,02%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	12.619.968,62	11.292.786,83	0,00	24.148.596,24	235.840,79	0,99%	1,15%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	11.755.978,63	3.098.240,31	7.852.578,13	7.087.680,88	86.040,07	0,58%	1,08%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	390.237,61	150,00	392.116,89	0,00	1.729,28	0,44%	0,93%	0,00%
Total Renda Fixa	89.252.766,96	14.401.177,14	8.436.100,96	96.467.896,68	1.250.053,54	1,31%		0,44%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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 SMALL CAPS FIC AÇÕES	975.405,57	0,00	0,00	954.966,41	-20.439,16	-2,10%	-2,10%	11,80%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	863.744,15	0,00	0,00	834.348,34	-29.395,81	-3,40%	-3,40%	8,24%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.747.787,41	0,00	0,00	1.682.995,12	-64.792,29	-3,71%	-3,71%	8,31%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	717.556,44	0,00	0,00	684.498,81	-33.057,63	-4,61%	-4,61%	9,45%
Total Renda Variável	4.304.493,57	0,00	0,00	4.156.808,68	-147.684,89	-3,43%		9,28%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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 AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	328.113,99	0,00	0,00	331.383,21	3.269,22	1,00%	1,00%	7,58%
Total Exterior	328.113,99	0,00	0,00	331.383,21	3.269,22	1,00%		7,58%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	19.993.097,98	497.872,94	573.753,73	20.726.665,34	809.448,15	3,95%	4,06%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	12.365.786,26	11.292.786,83	0,00	24.148.596,24	490.023,15	2,07%	3,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.903.992,39	0,00	0,00	12.325.123,36	421.130,97	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.927.824,45	0,00	0,00	8.215.688,37	287.863,92	3,63%	3,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.669.616,48	3.086.874,07	0,00	7.970.370,80	213.880,25	2,76%	3,64%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	5.754.318,93	537.297,49	0,00	6.488.831,72	197.215,30	3,13%	3,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.761.461,77	0,00	0,00	4.957.812,65	196.350,88	4,12%	4,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	4.447.554,71	11.774.530,74	9.325.705,09	7.087.680,88	191.300,52	1,18%	2,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.236.114,44	0,00	191.405,94	4.181.202,07	136.493,57	3,22%	3,25%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	352.271,36	0,00	0,00	365.925,25	13.653,89	3,88%	3,88%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	95.778,38	830.366,73	929.436,38	0,00	3.291,27	0,36%	2,56%
Total Renda Fixa	76.507.817,15	28.019.728,80	11.020.301,14	96.467.896,68	2.960.651,87	3,17%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	6.886.119,10	0,00	7.210.148,69	0,00	324.029,59	4,71%	7,90%
BB alocação FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	5.694.988,17	0,00	0,00	5.902.685,89	207.697,72	3,65%	3,65%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	249.634,02	0,00	255.922,66	0,00	6.288,64	2,52%	-2,69%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	10.191,25	0,00	0,00	10.527,13	335,88	3,30%	3,30%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	186.583,58	0,00	184.676,37	0,00	-1.907,21	-1,02%	-21,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	332.278,13	0,00	327.191,27	0,00	-5.086,86	-1,53%	-7,75%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.312.039,37	0,00	407.741,04	834.348,34	-69.949,99	-5,33%	-7,50%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	760.790,55	0,00	0,00	684.498,81	-76.291,74	-10,03%	-10,03%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.061.842,06	0,00	0,00	954.966,41	-106.875,65	-10,07%	-10,07%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.828.744,89	0,00	0,00	1.682.995,12	-145.749,77	-7,97%	-7,97%
Total Renda Variável	18.323.211,12	0,00	8.385.680,03	10.070.021,70	132.490,61	0,72%	



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

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 AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.208.201,91	0,00	3.076.874,07	331.383,21	200.055,37	6,24%	3,21%
Total Exterior	3.208.201,91	0,00	3.076.874,07	331.383,21	200.055,37	6,24%	



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.

