

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

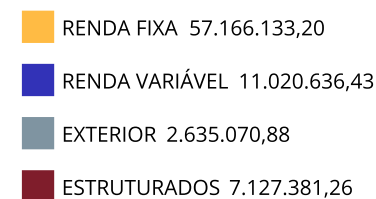
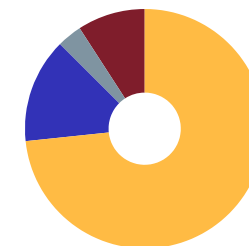
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	5.033.227,12	6,46%	664	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	637.504,13	0,82%	942	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.881.337,21	3,70%	783	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.156.217,92	2,77%	572	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.047.168,16	2,63%	515	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	3.530.280,02	4,53%	280	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	2.100.314,64	2,69%	83	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.536.231,67	13,52%	773	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.417.534,38	5,67%	901	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.610.366,70	5,91%	927	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.186.531,69	1,52%	352	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	627.053,91	0,80%	2.978	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.055.994,65	6,49%	980	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	4.208.013,82	5,40%	1.126	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	84.329,49	0,11%	148	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.849.159,68	2,37%	162	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.207.148,01	5,40%	360	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	159.103,14	0,20%	352	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.838.616,86	2,36%	208	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.920.038,43	6,31%	1.505	0,56%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.179.749,77	1,51%	21.398	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BRASESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.893.659,23	2,43%	145	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.021.213,92	1,31%	17.026	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.199.141,57	1,54%	10.463	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	806.833,51	1,04%	136	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	889.376,59	1,14%	155	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BRASESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	860.129,81	1,10%	71	0,73%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	885.564,48	1,14%	2.070	0,89%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	596.326,55	0,77%	95	0,46%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.844.299,95	3,65%	5.716	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.686.754,76	4,73%	5.795	0,65%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			77.949.221,77				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.177.247,72	Artigo 6º			
PL Total			81.126.469,49				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Junho / 2023)

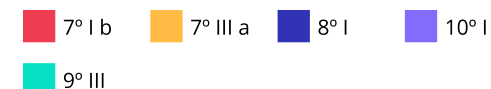
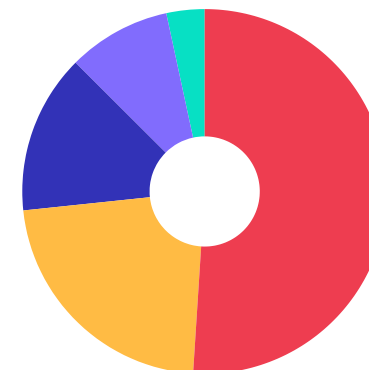
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	18,10%	87,31%	68.057.465,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	39.763.767,55	51,01%	21,83%	29,10%	87,31%	28.293.697,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	17.402.365,65	22,33%	22,89%	30,53%	60,00%	29.367.167,41
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.589.844,35
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.897.461,09
Total Renda Fixa	100,00%	57.166.133,20	73,34%	44,72%	82,73%	259,62%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	11.020.636,43	14,14%	7,00%	10,00%	20,00%	4.569.207,92
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	7.127.381,26	9,14%	0,95%	1,27%	10,00%	667.540,92
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	18.148.017,69	23,28%	7,95%	11,27%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.635.070,88	3,38%	3,00%	5,00%	10,00%	5.159.851,30
Total Exterior	10,00%	2.635.070,88	3,38%	3,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.135.234,37	42,51	-
CAIXA DTVM	29.541.136,93	37,90	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	8.894.426,22	11,41	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.351.235,25	4,30	-
ITAÚ UNIBANCO	1.199.141,57	1,54	0,00
ITAÚ DTVM	1.021.213,92	1,31	0,00
META ASSET MANAGEMENT	806.833,51	1,04	0,40

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	87,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	39.763.767,55	51,01	21,83	87,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	17.402.365,65	22,33	22,89	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	11.020.636,43	14,14	7,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	2.635.070,88	3,38	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	7.127.381,26	9,14	0,95	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	6,60%	2,14%	6,60%	9,23%	19,78%	0,83%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	0,03%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	6,03%	0,86%	6,03%	4,86%	-	1,44%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	7,00%	2,57%	7,00%	10,18%	21,01%	0,88%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	6,99%	2,56%	6,99%	10,05%	20,76%	0,90%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,10%	9,56%	5,47%	9,56%	16,61%	18,51%	0,90%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	9,44%	5,43%	9,44%	16,38%	18,13%	0,90%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,08%	6,48%	3,14%	6,48%	13,47%	23,38%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	6,44%	3,16%	6,44%	13,54%	23,74%	0,01%	0,00%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	1,04%	6,17%	3,00%	6,17%	12,86%	22,26%	0,02%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	6,53%	3,22%	6,53%	13,88%	24,53%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	5,64%	2,77%	5,64%	11,68%	19,63%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,01%	9,45%	5,68%	9,45%	14,37%	19,80%	1,19%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,64%	6,01%	5,71%	6,01%	14,89%	15,14%	2,12%	0,05%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,81%	6,66%	4,42%	6,66%	13,77%	16,42%	1,11%	0,03%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,94%	6,56%	2,81%	6,56%	12,47%	19,07%	0,61%	0,01%

Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,19%	6,43%	3,31%	6,43%	8,57%	-1,30%	5,69%	0,14%

Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	8,01%	5,57%	14,39%	5,57%	19,10%	-11,84%	6,95%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,27%	-1,57%	7,34%	-1,57%	13,35%	-15,61%	7,12%	0,19%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,18%	4,06%	12,50%	4,06%	9,82%	-8,47%	7,42%	0,15%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8,96%	5,17%	14,28%	5,17%	12,53%	-7,54%	7,42%	0,17%

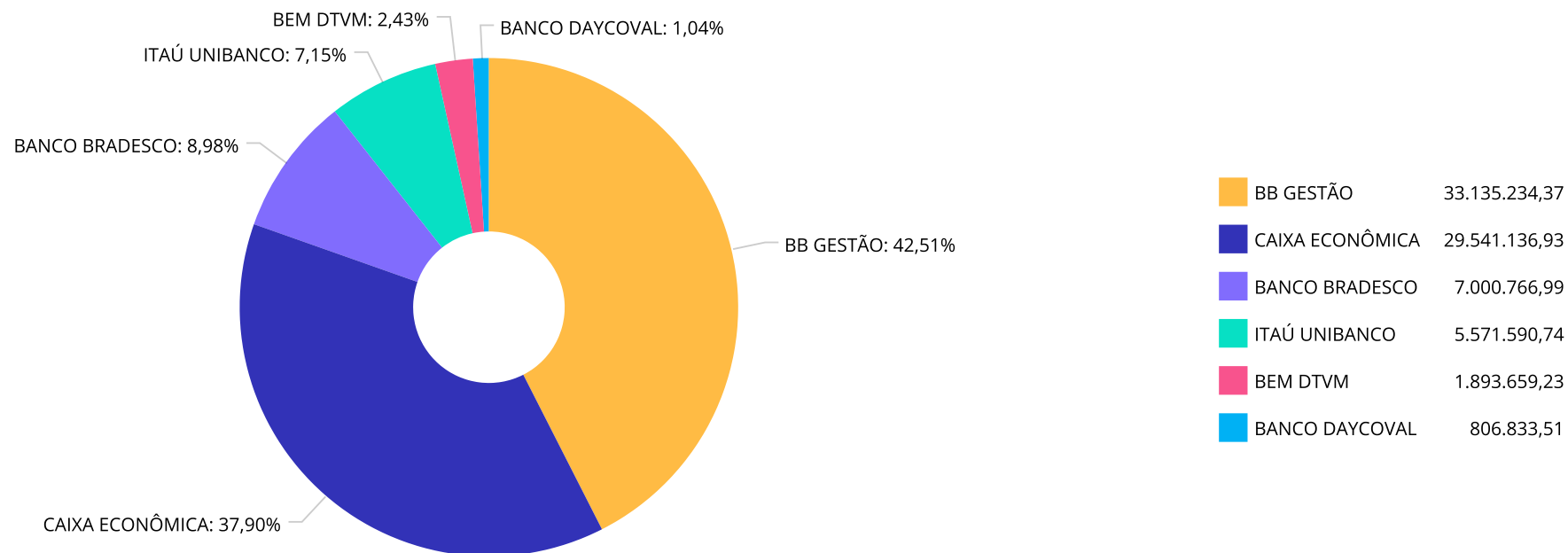
IBX (Benchmark)	8,87%	6,59%	14,96%	6,59%	17,60%	-9,50%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	5,76%	-2,17%	9,82%	-2,17%	7,47%	-26,36%	8,92%	0,22%

SMLL (Benchmark)	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	6,63%	11,20%	21,84%	11,20%	17,60%	-20,87%	8,11%	0,23%

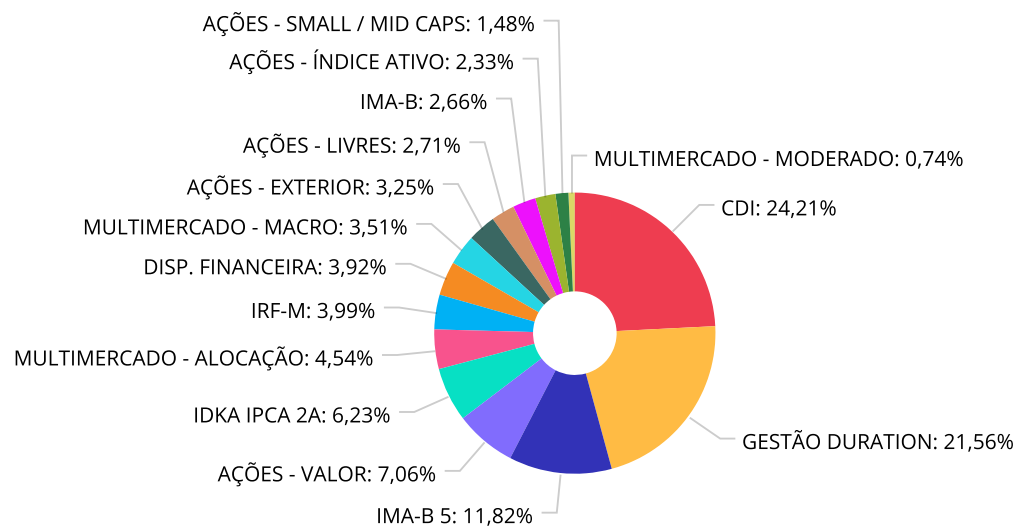
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,11%	-0,68%	1,94%	-0,68%	1,21%	-0,16%	5,44%	13,146%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,47%	7,68%	4,07%	7,68%	10,43%	-0,84%	6,71%	15,073%
BRADERCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,19%	6,42%	3,31%	6,42%	8,57%	-1,30%	5,69%	14,072%

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



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

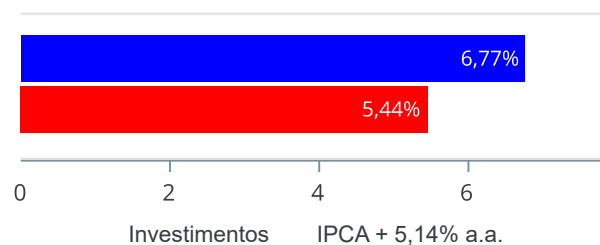


■ CDI	19.636.753,23	■ GESTÃO DURATION	17.492.405,14	■ IMA-B 5	9.592.018,55	■ AÇÕES - VALOR	5.726.871,94
■ IDKA IPCA 2A	5.055.038,51	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	3.686.754,76	■ IRF-M	3.233.699,85	■ DISP. FINANCEIRA	3.177.247,72
■ MULTIMERCADO - MACRO	2.844.299,95	■ AÇÕES - EXTERIOR	2.635.070,88	■ AÇÕES - LIVRES	2.200.963,69	■ IMA-B	2.156.217,92
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.893.659,23	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.199.141,57	■ MULTIMERCADO - MODERADO	596.326,55		

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	73.190.520,85	7.461.215,84	5.507.652,76	76.192.601,92	1.048.517,99	1.048.517,99	1,40%	1,40%	0,97%	0,97%	143,72%	2,63%
Fevereiro	76.192.601,92	8.834.892,36	10.582.580,42	74.124.597,61	-320.316,25	728.201,74	-0,42%	0,97%	1,20%	2,18%	44,37%	2,21%
Março	74.124.597,61	12.752.415,21	13.070.068,47	74.315.942,33	508.997,98	1.237.199,72	0,69%	1,66%	1,17%	3,38%	49,16%	1,98%
Abril	74.315.942,33	4.568.866,72	1.493.854,84	78.134.387,65	743.433,44	1.980.633,16	0,96%	2,64%	0,97%	4,39%	60,18%	1,98%
Maiο	78.134.387,65	11.703.023,40	12.505.883,25	78.657.819,66	1.326.291,86	3.306.925,02	1,70%	4,38%	0,67%	5,08%	86,17%	2,04%
Junho	78.657.819,66	4.138.816,51	6.645.812,07	77.949.221,77	1.798.397,67	5.105.322,69	2,29%	6,77%	0,34%	5,44%	124,42%	1,92%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

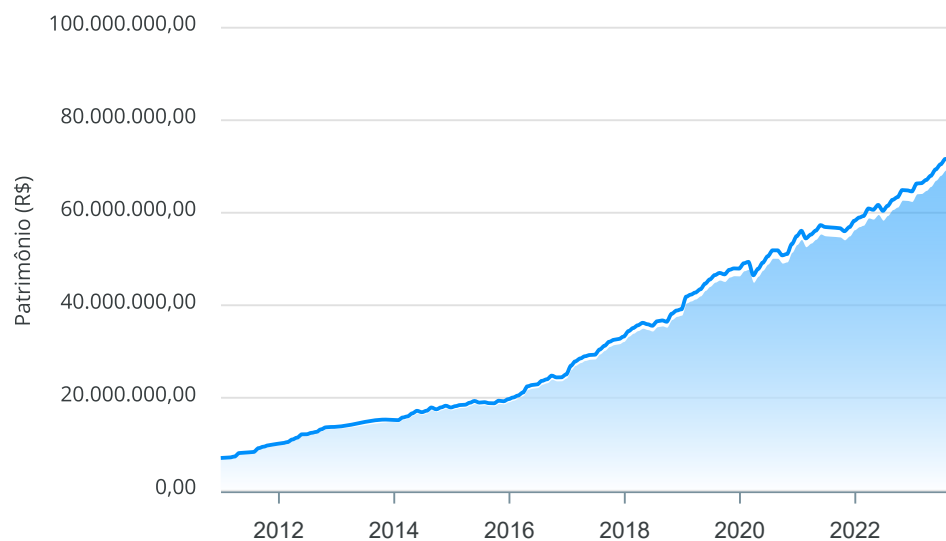


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

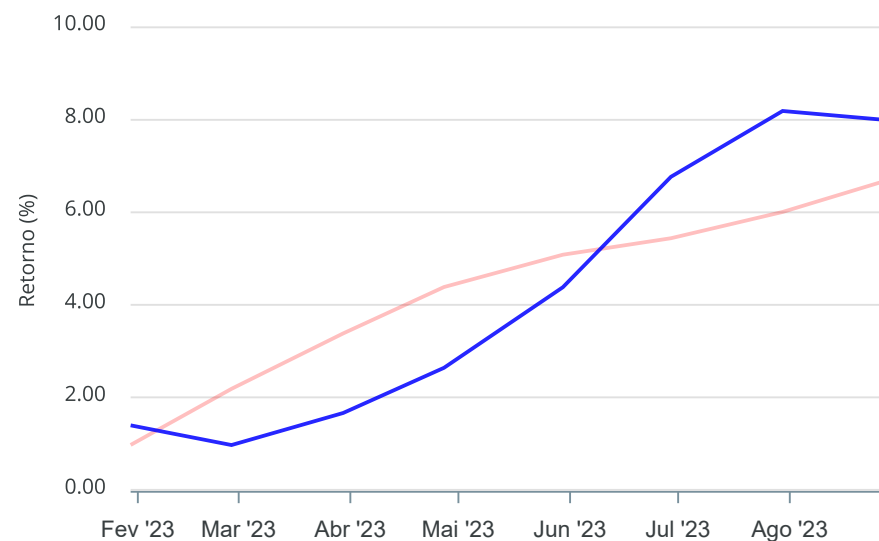
ANO

36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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 Junho/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.106.256,29	0,00	0,00	2.156.217,92	49.961,63	2,37%	2,37%	2,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.798.614,06	0,00	0,00	1.838.616,86	40.002,80	2,22%	2,22%	1,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.277.810,63	0,00	2.000.000,00	10.536.231,67	258.421,04	2,10%	2,10%	0,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.005.204,75	0,00	0,00	2.047.168,16	41.963,41	2,09%	2,09%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.101.194,41	62.212,97	0,00	1.186.531,69	23.124,31	1,99%	2,10%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.944.029,82	0,00	0,00	5.033.227,12	89.197,30	1,80%	1,80%	0,95%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.160.037,49	0,00	0,00	4.207.148,01	47.110,52	1,13%	1,13%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.162.536,77	0,00	0,00	4.208.013,82	45.477,05	1,09%	1,09%	0,01%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	620.349,13	0,00	0,00	627.053,91	6.704,78	1,08%	1,08%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.371.923,56	0,00	0,00	4.417.534,38	45.610,82	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.563.293,93	0,00	0,00	4.610.366,70	47.072,77	1,03%	1,03%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.851.936,20	0,00	0,00	2.881.337,21	29.401,01	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	631.070,35	0,00	0,00	637.504,13	6.433,78	1,02%	1,02%	0,78%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	157.568,18	0,00	22,00	159.103,14	1.556,96	0,99%	0,99%	0,00%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.080.539,64	0,00	0,00	2.100.314,64	19.775,00	0,95%	0,95%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	3.497.388,06	0,00	0,00	3.530.280,02	32.891,96	0,94%	0,94%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.126.886,39	2.897.139,94	13.408,38	5.055.994,65	45.376,70	0,90%	1,00%	0,01%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	2.789.652,65	1.179.463,60	2.150.000,00	1.849.159,68	30.043,43	0,76%	1,04%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.562.895,59	0,00	2.482.381,69	84.329,49	3.815,59	0,15%	2,01%	1,19%
Total Renda Fixa	58.809.187,90	4.138.816,51	6.645.812,07	57.166.133,20	863.940,86	1,47%		0,70%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.082.718,73	0,00	0,00	1.179.749,77	97.031,04	8,96%	8,96%	7,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.548.115,85	0,00	0,00	4.920.038,43	371.922,58	8,18%	8,18%	7,42%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.753.187,33	0,00	0,00	1.893.659,23	140.471,90	8,01%	8,01%	6,95%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	1.124.603,67	0,00	0,00	1.199.141,57	74.537,90	6,63%	6,63%	8,11%
META VALOR FI AÇÕES	762.921,80	0,00	0,00	806.833,51	43.911,71	5,76%	5,76%	8,92%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	970.126,78	0,00	0,00	1.021.213,92	51.087,14	5,27%	5,27%	7,12%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.592.036,16	0,00	0,00	3.686.754,76	94.718,60	2,64%	2,64%	2,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.793.648,20	0,00	0,00	2.844.299,95	50.651,75	1,81%	1,81%	1,11%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	590.775,18	0,00	0,00	596.326,55	5.551,37	0,94%	0,94%	0,61%
Total Renda Variável	17.218.133,70	0,00	0,00	18.148.017,69	929.883,99	5,40%		5,18%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	876.499,73	0,00	0,00	889.376,59	12.876,86	1,47%	1,47%	6,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	858.503,39	0,00	0,00	860.129,81	1.626,42	0,19%	0,19%	5,69%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	895.494,94	0,00	0,00	885.564,48	-9.930,46	-1,11%	-1,11%	5,44%
Total Exterior	2.630.498,06	0,00	0,00	2.635.070,88	4.572,82	0,17%		5,95%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.955.743,77	0,00	2.000.000,00	10.536.231,67	580.487,90	4,86%	4,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.791.719,46	0,00	0,00	5.033.227,12	241.507,66	5,04%	5,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.052.027,15	6.871.824,41	8.025.648,36	5.055.994,65	157.791,45	1,22%	2,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.013.054,76	0,00	0,00	2.156.217,92	143.163,16	7,11%	7,11%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.075.759,96	0,00	0,00	4.207.148,01	131.388,05	3,22%	3,22%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.078.992,75	0,00	0,00	4.208.013,82	129.021,07	3,16%	3,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.494.909,83	0,00	0,00	4.610.366,70	115.456,87	2,57%	2,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.736.001,24	0,00	0,00	1.838.616,86	102.615,62	5,91%	5,91%
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	1.027.348,68	7.976.669,25	7.253.000,00	1.849.159,68	98.141,75	1,09%	3,00%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.473.849,64	0,00	2.482.381,69	84.329,49	92.861,54	3,75%	5,68%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.325.161,49	0,00	0,00	4.417.534,38	92.372,89	2,14%	2,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.809.501,76	0,00	0,00	2.881.337,21	71.835,45	2,56%	2,56%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.066.033,27	62.212,97	0,00	1.186.531,69	58.285,45	5,17%	5,47%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.047.168,16	47.168,16	2,36%	5,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.500.000,00	0,00	3.530.280,02	30.280,02	0,87%	-
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	607.953,84	0,00	0,00	627.053,91	19.100,07	3,14%	3,14%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.082.435,12	0,00	0,00	2.100.314,64	17.879,52	0,86%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	867.595,51	0,00	884.498,11	0,00	16.902,60	1,95%	3,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	624.396,92	0,00	0,00	637.504,13	13.107,21	2,10%	2,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	154.831,75	0,00	22,00	159.103,14	4.293,39	2,77%	2,77%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	55.237.316,90	20.410.706,63	20.645.550,16	57.166.133,20	2.163.659,83	2,86%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.373.311,45	0,00	0,00	4.920.038,43	546.726,98	12,50%	12,50%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.655.397,61	0,00	0,00	1.893.659,23	238.261,62	14,39%	14,39%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	984.163,62	0,00	0,00	1.199.141,57	214.977,95	21,84%	21,84%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.487.498,13	0,00	0,00	3.686.754,76	199.256,63	5,71%	5,71%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.032.377,35	0,00	0,00	1.179.749,77	147.372,42	14,28%	14,28%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.723.929,22	0,00	0,00	2.844.299,95	120.370,73	4,42%	4,42%
META VALOR FI AÇÕES	734.684,76	0,00	0,00	806.833,51	72.148,75	9,82%	9,82%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	951.391,37	0,00	0,00	1.021.213,92	69.822,55	7,34%	7,34%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	580.016,47	0,00	0,00	596.326,55	16.310,08	2,81%	2,81%
Total Renda Variável	16.522.769,98	0,00	0,00	18.148.017,69	1.625.247,71	9,84%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	854.586,77	0,00	0,00	889.376,59	34.789,82	4,07%	4,07%
BRADERCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	832.599,68	0,00	0,00	860.129,81	27.530,13	3,31%	3,31%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	868.669,00	0,00	0,00	885.564,48	16.895,48	1,94%	1,94%
Total Exterior	2.555.855,45	0,00	0,00	2.635.070,88	79.215,43	3,10%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.525.388,32	54.642,86	2.000.000,00	10.536.231,67	956.200,49	8,26%	8,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.627.993,59	0,00	0,00	5.033.227,12	405.233,53	8,76%	8,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	12.065.181,05	11.412.287,66	18.823.890,02	5.055.994,65	402.415,96	1,71%	5,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.308.605,31	0,00	0,00	4.610.366,70	301.761,39	7,00%	7,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.144.094,69	22,00	0,00	4.417.534,38	273.417,69	6,60%	6,60%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.937.653,83	0,00	0,00	2.156.217,92	218.564,09	11,28%	11,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.208.013,82	208.013,82	5,20%	6,44%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	8.075.759,96	4.075.759,96	4.207.148,01	207.148,01	2,57%	6,53%
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	2.836.643,30	15.392.457,66	16.577.453,10	1.849.159,68	197.511,82	1,08%	6,17%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.693.101,45	0,00	0,00	2.881.337,21	188.235,76	6,99%	6,99%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.388.574,12	2.473.849,64	4.956.231,33	84.329,49	178.137,06	3,66%	9,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.667.248,07	0,00	0,00	1.838.616,86	171.368,79	10,28%	10,28%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.980.951,48	0,00	0,00	2.100.314,64	119.363,16	6,03%	6,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.026.256,03	62.212,97	0,00	1.186.531,69	98.062,69	9,01%	9,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	837.105,05	0,00	884.498,11	0,00	47.393,06	5,66%	6,98%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.047.168,16	47.168,16	2,36%	9,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	598.246,41	0,00	0,00	637.504,13	39.257,72	6,56%	6,56%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	588.917,28	0,00	0,00	627.053,91	38.136,63	6,48%	6,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.500.000,00	0,00	3.530.280,02	30.280,02	0,87%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	150.633,34	0,00	22,00	159.103,14	8.491,80	5,64%	5,64%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	53.376.593,32	46.971.232,75	47.317.854,52	57.166.133,20	4.136.161,65	4,12%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.477.694,21	0,00	0,00	3.686.754,76	209.060,55	6,01%	6,01%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.728.073,52	0,00	0,00	4.920.038,43	191.964,91	4,06%	4,06%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.666.657,94	0,00	0,00	2.844.299,95	177.642,01	6,66%	6,66%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	1.078.412,43	0,00	0,00	1.199.141,57	120.729,14	11,20%	11,20%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.793.720,84	1.655.397,61	1.655.397,61	1.893.659,23	99.938,39	2,90%	5,57%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.121.782,69	0,00	0,00	1.179.749,77	57.967,08	5,17%	5,17%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	559.607,44	0,00	0,00	596.326,55	36.719,11	6,56%	6,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.037.476,11	0,00	0,00	1.021.213,92	-16.262,19	-1,57%	-1,57%
META VALOR FI AÇÕES	824.760,60	0,00	0,00	806.833,51	-17.927,09	-2,17%	-2,17%
Total Renda Variável	17.288.185,78	1.655.397,61	1.655.397,61	18.148.017,69	859.831,91	4,54%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	825.907,07	0,00	0,00	889.376,59	63.469,52	7,68%	7,68%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	808.206,10	832.599,68	832.599,68	860.129,81	51.923,71	3,16%	6,42%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	891.628,58	0,00	0,00	885.564,48	-6.064,10	-0,68%	-0,68%
Total Exterior	2.525.741,75	832.599,68	832.599,68	2.635.070,88	109.329,13	3,26%	

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 substanciadas 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.

