

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

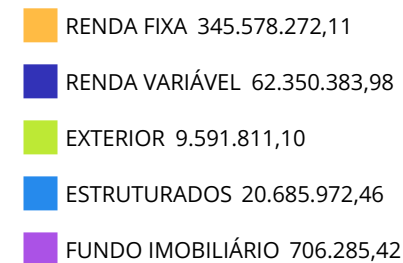
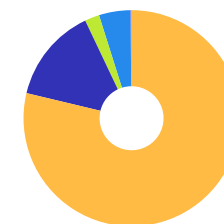
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	578.199,15	0,13%	664	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	7.534.699,85	1,72%	942	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	21.684.383,36	4,94%	783	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.535.637,27	1,26%	515	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.664.026,11	1,97%	105	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	22.186.743,88	5,05%	301	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.558.460,55	2,18%	773	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.219.969,18	3,70%	901	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	20.963.114,39	4,78%	927	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.049.009,55	2,29%	723	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.546.666,23	1,26%	352	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	22.159.219,46	5,05%	980	0,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	38.582.220,67	8,79%	164	1,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.780.578,52	1,54%	360	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	70.693.155,62	16,11%	416	1,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	7.843.882,61	1,79%	208	0,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não possui	16.146.715,47	3,68%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0		42.403.799,70	9,66%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	5.289.045,59	1,21%	758	1,66%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	400.362,22	0,09%	3.732	0,14%	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 AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.991.324,81	1,37%	1.505	0,68%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	29.679,61	0,01%	441	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	6.803.440,97	1,55%	5.984	1,01%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	10.607.457,95	2,42%	2.815	0,81%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.289.948,10	1,43%	2.068	1,96%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	13.172.076,17	3,00%	21	2,31%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	13.767.048,56	3,14%	31	1,47%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	2.920.719,81	0,67%	102	0,25%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	3.364.827,85	0,77%	57	0,65%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	D+6 du	Não há	288.482,63	0,07%	9	1,66%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD ...	D+6 du	Não há	323.907,85	0,07%	13	1,97%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.693.872,96	0,61%	405	0,37%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	5.922.183,59	1,35%	2.264	1,21%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.481.209,95	1,02%	5.716	0,29%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.582.454,96	1,27%	10	11,13%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	4.700.123,96	1,07%	81	0,82%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	706.285,42	0,16%		0,96%	Artigo 11º
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.447.790,54	2,84%	303	0,26%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			438.912.725,07				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	3,00%	30,00%	131.673.817,52
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	128.520.909,52	29,28%	30,00%	39,15%	90,00%	266.500.543,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	146.059.056,88	33,28%	15,00%	29,00%	60,00%	117.288.578,16
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	58.550.515,17	13,34%	0,00%	5,00%	20,00%	29.232.029,84
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.945.636,25
Desenquadrado - RF	0,00%	12.447.790,54	2,84%	0,00%	0,00%	0,00%	-12.447.790,54
Total Renda Fixa	100,00%	345.578.272,11	78,74%	45,00%	76,15%	205,00%	



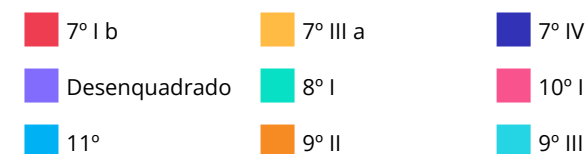
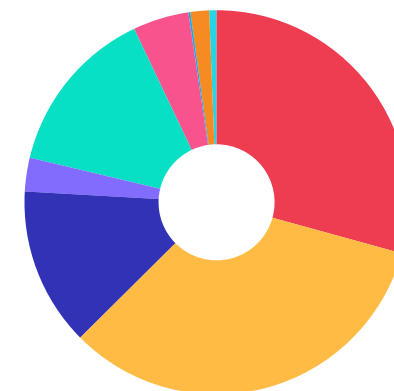
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	62.350.383,98	14,21%	10,00%	16,00%	35,00%	91.269.069,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	20.685.972,46	4,71%	3,00%	5,00%	10,00%	23.205.300,05
Artigo 11º	5,00%	706.285,42	0,16%	0,00%	0,50%	2,00%	8.071.969,08
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	83.742.641,86	19,08%	13,00%	21,50%	47,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	6.897.938,14	1,57%	0,00%	1,70%	5,00%	15.047.698,11
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.693.872,96	0,61%	0,00%	0,65%	5,00%	19.251.763,29
Total Exterior	10,00%	9.591.811,10	2,19%	0,00%	2,35%	10,00%	



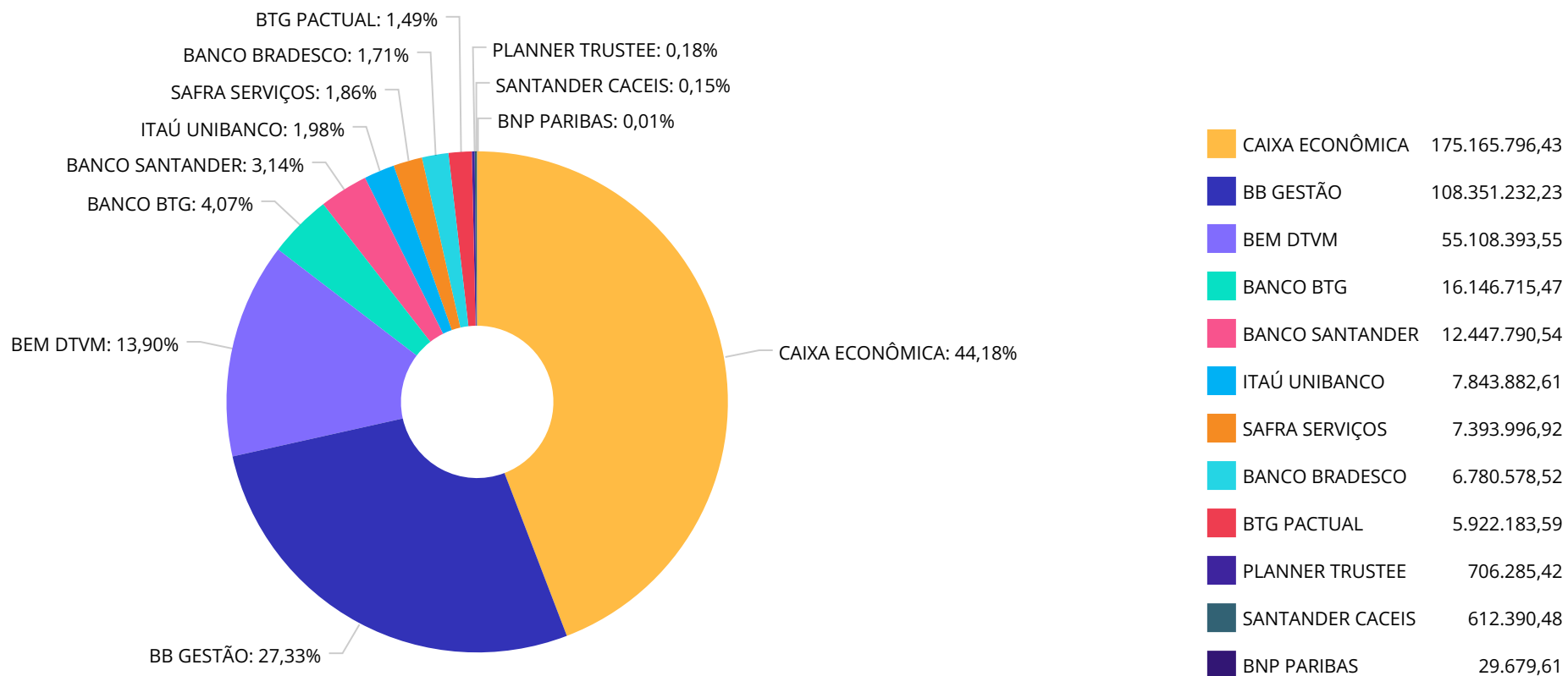
Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	175.165.796,43	39,91	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	108.351.232,23	24,69	-
TRÍGONO CAPITAL	26.939.124,73	6,14	0,56
BANCO BTG PACTUAL	16.146.715,47	3,68	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	12.447.790,54	2,84	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	10.607.457,95	2,42	0,56
ITAU ASSET MANAGEMENT	7.843.882,61	1,79	-
BANCO J. SAFRA S/A	7.393.996,92	1,68	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.780.578,52	1,54	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	6.289.948,10	1,43	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	5.922.183,59	1,35	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.582.454,96	1,27	0,34
4UM INVESTIMENTOS	5.289.045,59	1,21	0,17
ZION INVEST	706.285,42	0,16	-
MIRAE ASSET	612.390,48	0,14	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	400.362,22	0,09	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	29.679,61	0,01	0,00

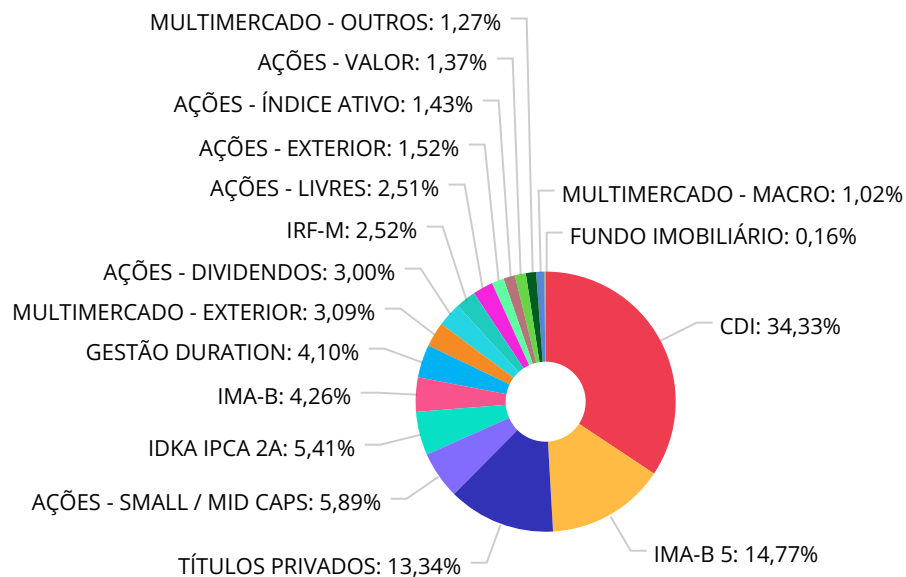
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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 '	128.520.909,52	29,28	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	146.059.056,88	33,28	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	62.350.383,98	14,21	10,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	6.897.938,14	1,57	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	2.693.872,96	0,61	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	20.685.972,46	4,71	3,00	10,00
Artigo 11º	706.285,42	0,16	0,00	2,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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



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

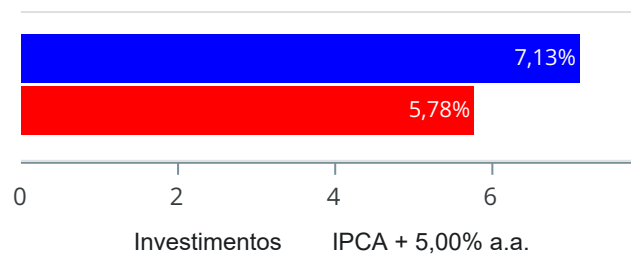


■ CDI	150.662.964,81	■ IMA-B 5	64.834.241,63	■ TÍTULOS PRIVADOS	58.550.515,17	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	25.859.535,12
■ IDKA IPCA 2A	23.754.669,03	■ IMA-B	18.713.035,66	■ GESTÃO DURATION	17.980.542,31	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	13.543.027,36
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	13.172.076,17	■ IRF-M	11.082.303,50	■ AÇÕES - LIVRES	11.037.499,78	■ AÇÕES - EXTERIOR	6.671.091,29
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.289.948,10	■ AÇÕES - VALOR	5.991.324,81	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.582.454,96	■ MULTIMERCADO - MACRO	4.481.209,95
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	706.285,42						

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	392.355.656,83	458.633,10	2.330.723,72	396.999.742,95	6.516.176,74	6.516.176,74	1,66%	1,66%	0,96%	0,96%	173,16%	2,55%
Fevereiro	396.999.742,95	6.812.733,03	3.327.223,55	399.934.272,51	-550.979,92	5.965.196,82	-0,14%	1,52%	1,19%	2,16%	70,33%	2,46%
Março	399.934.272,51	7.317.069,32	4.160.969,66	405.240.103,35	2.149.731,18	8.114.928,00	0,53%	2,06%	1,16%	3,35%	61,62%	2,40%
Abril	405.240.103,35	5.312.044,94	3.074.085,29	410.282.701,00	2.804.638,00	10.919.566,00	0,69%	2,76%	0,96%	4,34%	63,70%	2,03%
Mai	410.282.701,00	121.702.849,23	118.830.594,22	422.304.385,08	9.149.429,07	20.068.995,07	2,21%	5,04%	0,66%	5,03%	100,27%	2,43%
Junho	422.304.385,08	9.781.023,47	1.742.986,13	438.912.725,07	8.570.302,65	28.639.297,72	1,99%	7,13%	0,72%	5,78%	123,44%	1,92%

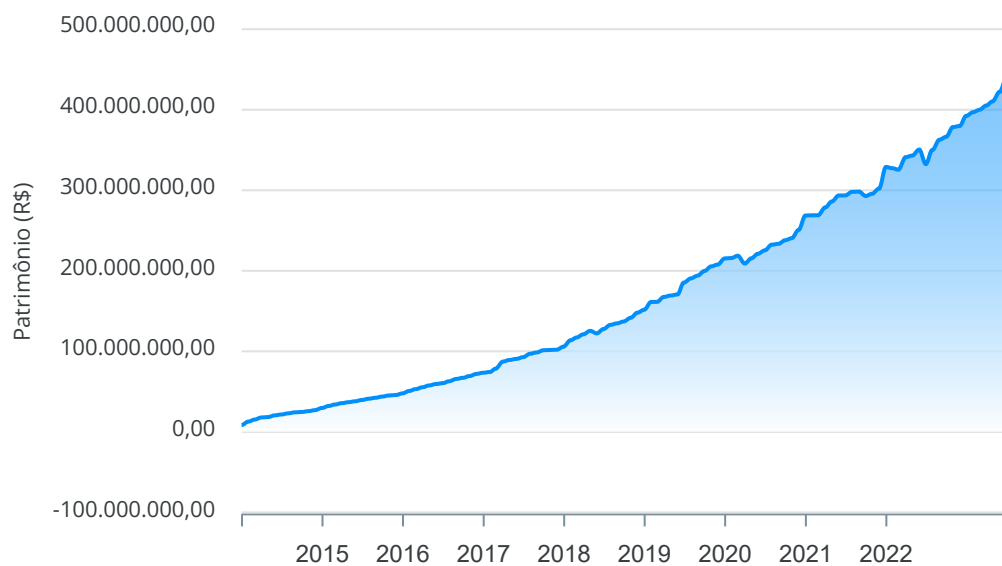
Investimentos x Meta de Rentabilidade



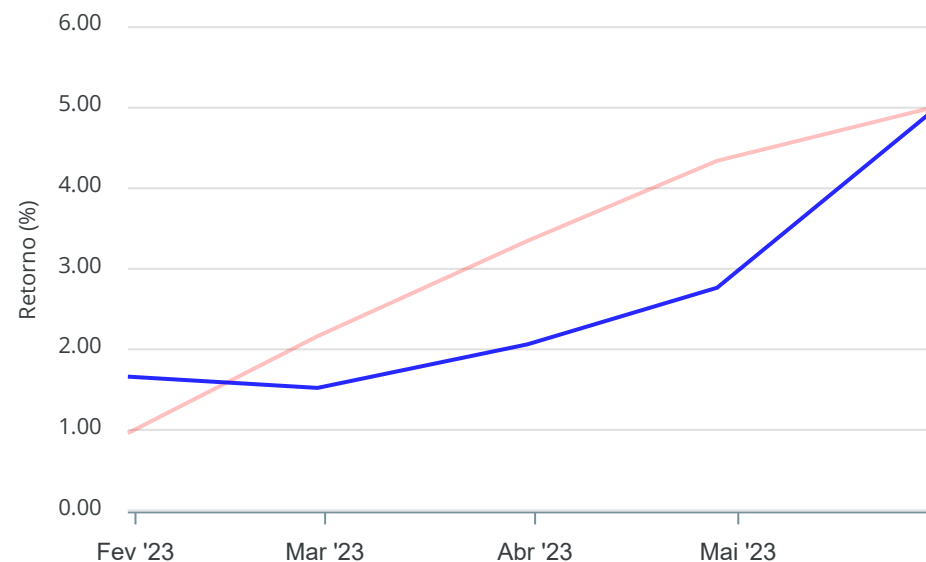
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.817.948,89	0,00	0,00	10.049.009,55	231.060,66	2,35%	2,35%	2,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	7.673.223,17	0,00	0,00	7.843.882,61	170.659,44	2,22%	2,22%	1,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.361.423,09	0,00	0,00	9.558.460,55	197.037,46	2,10%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.432.585,74	0,00	0,00	5.546.666,23	114.080,49	2,10%	2,10%	0,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.422.166,27	0,00	0,00	5.535.637,27	113.471,00	2,09%	2,09%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	567.952,48	0,00	0,00	578.199,15	10.246,67	1,80%	1,80%	0,95%
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.304.995,72	0,00	0,00	12.447.790,54	142.794,82	1,16%	1,16%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	69.703.373,27	183.000,00	0,00	70.693.155,62	806.782,35	1,15%	1,16%	0,03%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.704.651,42	0,00	0,00	6.780.578,52	75.927,10	1,13%	1,13%	0,02%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	38.155.092,64	0,00	0,00	38.582.220,67	427.128,03	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.052.498,82	0,00	0,00	16.219.969,18	167.470,36	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	20.749.076,84	0,00	0,00	20.963.114,39	214.037,55	1,03%	1,03%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	21.463.117,11	0,00	0,00	21.684.383,36	221.266,25	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.458.658,68	0,00	0,00	7.534.699,85	76.041,17	1,02%	1,02%	0,78%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.981.990,27	0,00	0,00	22.186.743,88	204.753,61	0,93%	0,93%	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.584.203,10	0,00	0,00	8.664.026,11	79.823,01	0,93%	0,93%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.133.516,18	9.598.023,47	1.742.986,13	22.159.219,46	170.665,94	0,72%	1,00%	0,01%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	42.157.669,59	0,00	0,00	42.403.799,70	246.130,11	0,58%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	16.059.393,94	0,00	0,00	16.146.715,47	87.321,53	0,54%	-	-
Total Renda Fixa	333.783.537,22	9.781.023,47	1.742.986,13	345.578.272,11	3.756.697,55	1,10%		0,44%

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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	364.211,76	0,00	0,00	400.362,22	36.150,46	9,93%	9,93%	8,64%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.538.420,02	0,00	0,00	5.991.324,81	452.904,79	8,18%	8,18%	7,42%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	9.807.171,80	0,00	0,00	10.607.457,95	800.286,15	8,16%	8,16%	7,14%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6.297.629,42	0,00	0,00	6.803.440,97	505.811,55	8,03%	8,03%	10,00%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	5.826.437,14	0,00	0,00	6.289.948,10	463.510,96	7,96%	7,96%	7,92%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	27.584,31	0,00	0,00	29.679,61	2.095,30	7,60%	7,60%	7,44%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.276.082,63	0,00	0,00	13.172.076,17	895.993,54	7,30%	7,30%	7,99%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	658.285,44	0,00	0,00	706.285,42	47.999,98	7,29%	7,29%	14,96%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5.530.933,33	0,00	0,00	5.922.183,59	391.250,26	7,07%	7,07%	5,06%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	4.395.906,68	0,00	0,00	4.700.123,96	304.217,28	6,92%	6,92%	5,02%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	4.983.874,95	0,00	0,00	5.289.045,59	305.170,64	6,12%	6,12%	10,07%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	13.258.873,66	0,00	0,00	13.767.048,56	508.174,90	3,83%	3,83%	4,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.401.407,83	0,00	0,00	4.481.209,95	79.802,12	1,81%	1,81%	1,11%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.498.809,90	0,00	0,00	5.582.454,96	83.645,06	1,52%	1,52%	2,71%
Total Renda Variável	78.865.628,87	0,00	0,00	83.742.641,86	4.877.012,99	6,18%		6,46%

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
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	286.534,85	0,00	0,00	288.482,63	1.947,78	0,68%	0,68%	10,66%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.695.440,38	0,00	0,00	2.693.872,96	-1.567,42	-0,06%	-0,06%	5,79%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	3.385.192,86	0,00	0,00	3.364.827,85	-20.365,01	-0,60%	-0,60%	7,04%
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD IN...	326.036,67	0,00	0,00	323.907,85	-2.128,82	-0,65%	-0,65%	9,35%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.962.014,23	0,00	0,00	2.920.719,81	-41.294,42	-1,39%	-1,39%	5,66%
Total Exterior	9.655.218,99	0,00	0,00	9.591.811,10	-63.407,89	-0,66%		6,46%

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 MATRIZ FI RENDA FIXA	68.044.967,60	32.219.649,61	31.850.649,61	70.693.155,62	2.279.188,02	2,27%	3,32%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	37.387.976,73	0,00	0,00	38.582.220,67	1.194.243,94	3,19%	3,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.386.139,26	0,00	0,00	10.049.009,55	662.870,29	7,06%	7,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	21.143.763,73	0,00	0,00	21.684.383,36	540.619,63	2,56%	2,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	20.438.137,67	0,00	0,00	20.963.114,39	524.976,72	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.351.996,45	0,00	31.849.868,92	0,00	497.872,47	1,59%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.115.857,81	0,00	0,00	9.558.460,55	442.602,74	4,86%	4,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	7.406.105,24	0,00	0,00	7.843.882,61	437.777,37	5,91%	5,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	26.064.653,65	0,00	26.480.145,82	0,00	415.492,17	1,59%	3,22%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	0,00	42.000.000,00	0,00	42.403.799,70	403.799,70	0,96%	-
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.053.426,38	0,00	0,00	12.447.790,54	394.364,16	3,27%	3,27%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	8.664.553,06	46.576.268,03	33.467.001,29	22.159.219,46	385.399,66	0,70%	2,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.880.801,37	0,00	0,00	16.219.969,18	339.167,81	2,14%	2,14%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.871.948,53	0,00	0,00	22.186.743,88	314.795,35	1,44%	1,44%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.259.123,25	0,00	0,00	5.546.666,23	287.542,98	5,47%	5,47%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.250.316,86	0,00	0,00	5.535.637,27	285.320,41	5,43%	5,43%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.568.822,97	0,00	0,00	6.780.578,52	211.755,55	3,22%	3,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.379.785,01	0,00	0,00	7.534.699,85	154.914,84	2,10%	2,10%
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	16.000.000,00	0,00	16.146.715,47	146.715,47	0,92%	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.541.455,78	0,00	0,00	8.664.026,11	122.570,33	1,44%	1,44%

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	550.455,61	0,00	0,00	578.199,15	27.743,54	5,04%	5,04%
Total Renda Fixa	322.360.286,96	136.795.917,64	123.647.665,64	345.578.272,11	10.069.733,15	3,00%	

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
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.445.835,68	0,00	0,00	13.172.076,17	1.726.240,49	15,08%	15,08%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	12.102.916,41	0,00	0,00	13.767.048,56	1.664.132,15	13,75%	13,75%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8.980.604,96	0,00	0,00	10.607.457,95	1.626.852,99	18,12%	18,12%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.461.684,22	0,00	0,00	6.803.440,97	1.341.756,75	24,57%	24,57%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	4.051.788,19	0,00	0,00	5.289.045,59	1.237.257,40	30,54%	30,54%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	5.494.586,65	0,00	0,00	6.289.948,10	795.361,45	14,48%	14,48%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.325.553,81	0,00	0,00	5.991.324,81	665.771,00	12,50%	12,50%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5.355.329,36	0,00	0,00	5.922.183,59	566.854,23	10,58%	10,58%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	4.263.715,16	0,00	0,00	4.700.123,96	436.408,80	10,24%	10,24%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.302.491,02	0,00	0,00	5.582.454,96	279.963,94	5,28%	5,28%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.291.565,23	0,00	0,00	4.481.209,95	189.644,72	4,42%	4,42%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	349.477,08	0,00	0,00	400.362,22	50.885,14	14,56%	14,56%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	26.050,33	0,00	0,00	29.679,61	3.629,28	13,93%	13,93%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	771.428,25	0,00	0,00	706.285,42	-65.142,83	-8,44%	-8,44%
Total Renda Variável	73.223.026,35	0,00	0,00	83.742.641,86	10.519.615,51	14,37%	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.630.067,25	0,00	0,00	2.693.872,96	63.805,71	2,43%	2,43%
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD IN...	305.310,25	0,00	0,00	323.907,85	18.597,60	6,09%	6,09%
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	283.838,77	0,00	0,00	288.482,63	4.643,86	1,64%	1,64%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.935.848,91	0,00	0,00	2.920.719,81	-15.129,10	-0,52%	-0,52%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	3.501.724,86	0,00	0,00	3.364.827,85	-136.897,01	-3,91%	-3,91%
Total Exterior	9.656.790,04	0,00	0,00	9.591.811,10	-64.978,94	-0,67%	

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 MATRIZ FI RENDA FIXA	64.781.757,89	33.507.649,61	31.890.949,61	70.693.155,62	4.294.697,73	4,37%	6,50%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	35.109.969,89	3.930.263,22	2.618.147,78	38.582.220,67	2.160.135,34	5,53%	5,95%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	30.253.475,14	0,00	31.849.868,92	0,00	1.596.393,78	5,28%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	20.267.757,68	0,00	0,00	21.684.383,36	1.416.625,68	6,99%	6,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.591.019,96	0,00	0,00	20.963.114,39	1.372.094,43	7,00%	7,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	25.148.646,95	0,00	26.480.145,82	0,00	1.331.498,87	5,29%	6,98%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.645.376,13	0,00	642.252,90	22.186.743,88	1.183.620,65	5,47%	2,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.033.310,30	0,00	0,00	10.049.009,55	1.015.699,25	11,24%	11,24%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.216.053,59	0,00	0,00	16.219.969,18	1.003.915,59	6,60%	6,60%
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.688.446,46	0,00	0,00	12.447.790,54	759.344,08	6,50%	6,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	7.112.791,39	0,00	0,00	7.843.882,61	731.091,22	10,28%	10,28%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.829.125,08	0,00	0,00	9.558.460,55	729.335,47	8,26%	8,26%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.419.849,23	55.946.440,26	39.735.118,72	22.159.219,46	528.048,69	0,86%	5,98%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.062.887,90	0,00	0,00	5.546.666,23	483.778,33	9,56%	9,56%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.057.964,05	0,00	0,00	5.535.637,27	477.673,22	9,44%	9,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.070.710,56	0,00	0,00	7.534.699,85	463.989,29	6,56%	6,56%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.452.517,45	0,00	250.098,82	8.664.026,11	461.607,48	5,46%	2,50%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.364.782,00	0,00	0,00	6.780.578,52	415.796,52	6,53%	6,53%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	0,00	42.000.000,00	0,00	42.403.799,70	403.799,70	0,96%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	16.000.000,00	0,00	16.146.715,47	146.715,47	0,92%	-

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	531.647,37	0,00	0,00	578.199,15	46.551,78	8,76%	8,76%
Total Renda Fixa	306.638.089,02	151.384.353,09	133.466.582,57	345.578.272,11	21.022.412,57	6,48%	

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
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.894.013,70	0,00	0,00	13.172.076,17	1.278.062,47	10,75%	10,75%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	9.484.670,86	0,00	0,00	10.607.457,95	1.122.787,09	11,84%	11,84%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	4.919.624,94	0,00	0,00	5.922.183,59	1.002.558,65	20,38%	20,38%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6.018.434,15	0,00	0,00	6.803.440,97	785.006,82	13,04%	13,04%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	3.922.220,50	0,00	0,00	4.700.123,96	777.903,46	19,83%	19,83%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	13.018.305,27	0,00	0,00	13.767.048,56	748.743,29	5,75%	5,75%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	4.662.579,96	0,00	0,00	5.289.045,59	626.465,63	13,44%	13,44%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.038.457,48	0,00	0,00	5.582.454,96	543.997,48	10,80%	10,80%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.201.379,22	0,00	0,00	4.481.209,95	279.830,73	6,66%	6,66%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.757.561,57	0,00	0,00	5.991.324,81	233.763,24	4,06%	4,06%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6.174.841,56	0,00	0,00	6.289.948,10	115.106,54	1,86%	1,86%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	378.483,29	0,00	0,00	400.362,22	21.878,93	5,78%	5,78%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	27.773,80	0,00	0,00	29.679,61	1.905,81	6,86%	6,86%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	966.856,74	0,00	0,00	706.285,42	-260.571,32	-26,95%	-26,95%
Total Renda Variável	76.465.203,04	0,00	0,00	83.742.641,86	7.277.438,82	9,52%	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.506.934,73	0,00	0,00	2.693.872,96	186.938,23	7,46%	7,46%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.800.498,65	0,00	0,00	2.920.719,81	120.221,16	4,29%	4,29%
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD IN...	257.471,26	0,00	0,00	323.907,85	66.436,59	25,80%	25,80%
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	259.298,09	0,00	0,00	288.482,63	29.184,54	11,26%	11,26%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	3.428.162,04	0,00	0,00	3.364.827,85	-63.334,19	-1,85%	-1,85%
Total Exterior	9.252.364,77	0,00	0,00	9.591.811,10	339.446,33	3,67%	

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 & MERCADO. 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.

