

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

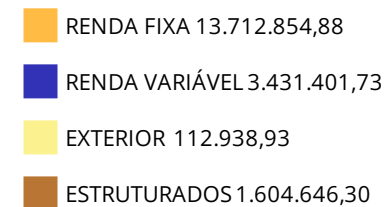
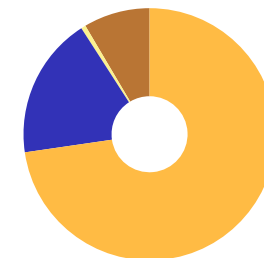
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.444.216,21	7,66%	942	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	974.413,96	5,17%	783	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	321.577,76	1,70%	280	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.007.810,48	5,34%	370	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	336.134,98	1,78%	180	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	496.806,64	2,63%	83	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	307.513,94	1,63%	773	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	73.578,71	0,39%	927	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	574.162,09	3,04%	1.186	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FX...	D+0	Não há	574.459,84	3,05%	352	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	504.133,01	2,67%	30	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.230.529,19	6,52%	980	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	560.900,34	2,97%	218	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.562.619,22	8,28%	1.126	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.267.945,24	6,72%	230	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	214.338,70	1,14%	416	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.245.398,92	11,90%	208	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.003.557,42	5,32%	1.505	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	438.994,73	2,33%	2.724	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BRANCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	550.777,43	2,92%	26	0,28%	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
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	466.362,04	2,47%	1.074	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	D+3 du	Não há	142.916,47	0,76%	12.084	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	592.430,32	3,14%	5.984	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	236.363,32	1,25%	83	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	112.938,93	0,60%	491	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	280.584,31	1,49%	182	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	804.535,09	4,27%	117	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	90.671,70	0,48%	6.968	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	428.855,20	2,27%	3.078	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIO...	Não se ...	Não se aplica	16.315,65	0,09%	2.067	0,02%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			18.861.841,84				

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

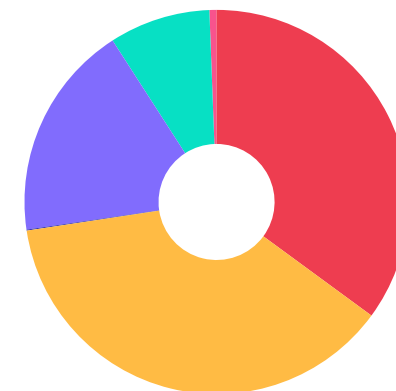
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,39%	81,95%	15.457.279,39
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	6.614.807,62	35,07%	20,39%	23,00%	81,95%	8.842.471,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	7.081.731,61	37,55%	20,79%	23,00%	60,00%	4.235.373,49
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	3.772.368,37
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	943.092,09
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	943.092,09
Desenquadrado - RF	0,00%	16.315,65	0,09%	0,00%	0,00%	0,00%	-16.315,65
Total Renda Fixa	100,00%	13.712.854,88	72,70%	41,18%	70,89%	253,90%	



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%	3.431.401,73	18,19%	0,89%	18,11%	20,00%	340.966,64
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.604.646,30	8,51%	3,75%	5,00%	10,00%	281.537,88
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	5.036.048,03	26,70%	4,64%	23,11%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	112.938,93	0,60%	0,00%	5,00%	10,00%	1.773.245,25
Total Exterior	10,00%	112.938,93	0,60%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.825.203,62	46,79	-
CAIXA DTVM	6.483.649,89	34,37	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	2.985.895,25	15,83	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	550.777,43	2,92	0,00
BV ASSET	16.315,65	0,09	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 ' a '	0,00	0,00	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	6.614.807,62	35,07	20,39	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.081.731,61	37,55	20,79	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.431.401,73	18,19	0,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	112.938,93	0,60	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.604.646,30	8,51	3,75	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
IPCA + 5,50% ao ano (Benchmark)	0,37%	5,62%	2,08%	5,62%	8,81%	28,44%	-	-
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR - BBVH11	-30,58%	-29,80%	-29,06%	-29,80%	-44,65%	-59,30%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
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%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	6,59%	3,15%	6,59%	13,58%	21,47%	0,11%	0,00%
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 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,39%	11,31%	7,20%	11,31%	13,23%	17,29%	2,17%	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%

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
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%
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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,16%	6,50%	3,32%	6,50%	13,62%	24,11%	0,03%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,05%	6,38%	3,09%	6,38%	13,28%	22,83%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,56%	1,44%	5,56%	8,39%	-	0,47%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,93%	-	-	-	-	-	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
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	12,52%	-5,21%	20,00%	-5,21%	-13,76%	-	13,53%	0,31%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	6,57%	3,17%	6,57%	13,52%	21,80%	0,47%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,81%	5,35%	4,29%	5,35%	14,58%	18,67%	1,60%	0,04%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,22%	6,56%	3,37%	6,56%	13,54%	24,64%	0,21%	0,01%
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,75%	3,91%	15,52%	3,91%	5,48%	-28,99%	7,86%	0,24%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8,89%	8,06%	17,13%	8,06%	15,45%	-16,81%	7,53%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,18%	4,06%	12,50%	4,06%	9,82%	-8,47%	7,42%	0,15%
IBX (Benchmark)	8,87%	6,59%	14,96%	6,59%	17,60%	-9,50%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	8,60%	5,36%	14,09%	5,36%	16,60%	-12,21%	7,40%	0,17%
IDIV (Benchmark)	8,78%	9,30%	13,95%	9,30%	17,73%	12,91%	-	-

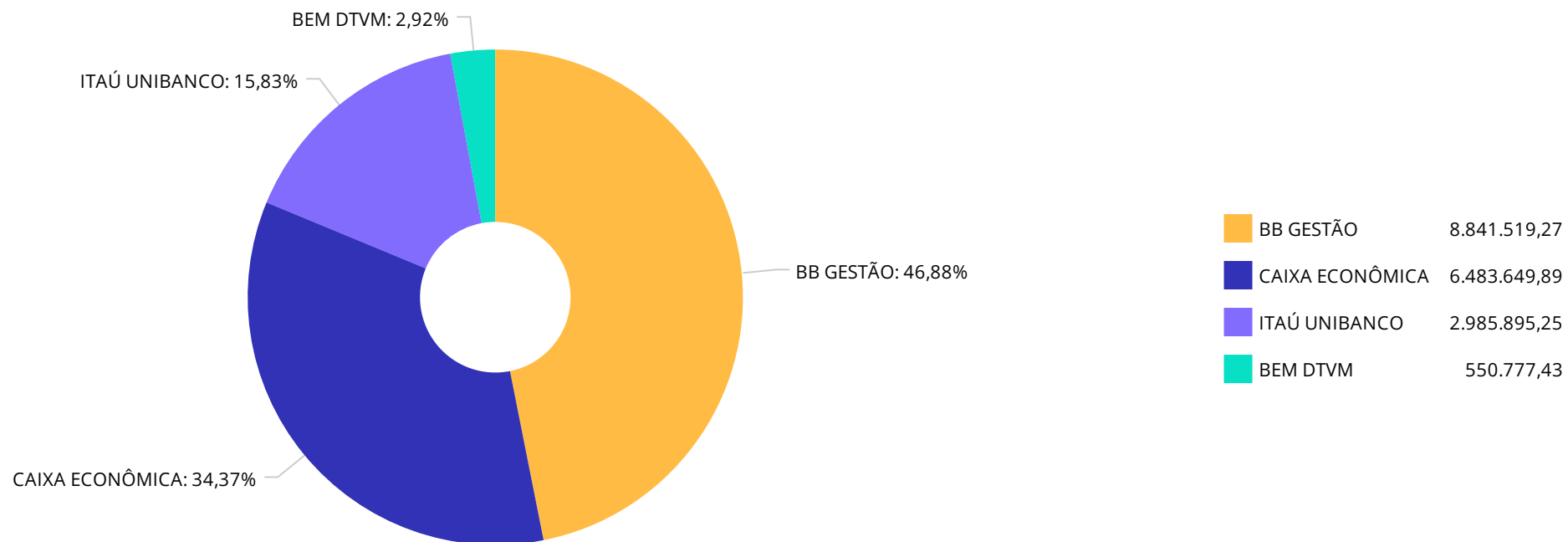
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	10,47%	20,01%	22,57%	20,01%	27,96%	4,10%	7,64%	0,18%
MSCI ACWI (Benchmark)	-0,09%	4,18%	0,15%	4,18%	5,27%	-8,63%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,00%	20,17%	10,43%	20,17%	28,33%	20,97%	5,04%	0,20%
SMLL (Benchmark)	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	8,03%	13,04%	24,57%	13,04%	18,85%	-28,83%	10,00%	0,27%

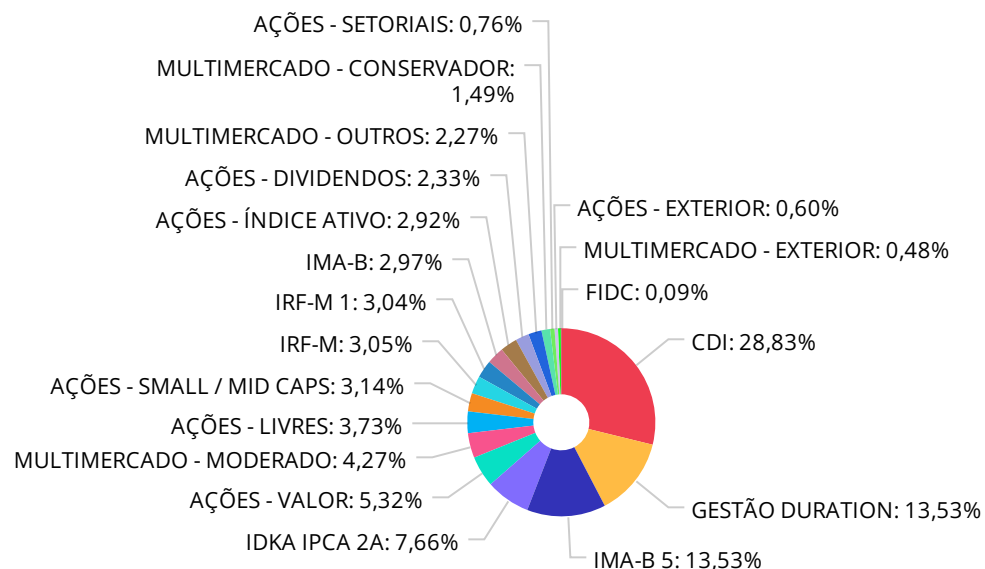
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	16,781%

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



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

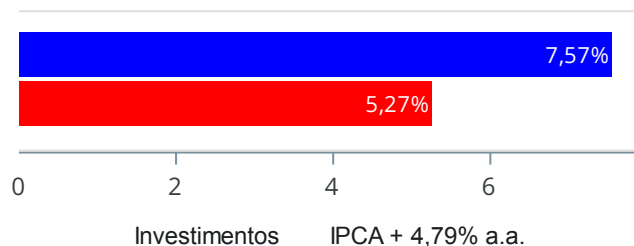


■ CDI	5.437.278,10	■ GESTÃO DURATION	2.552.912,86	■ IMA-B 5	2.552.609,79
■ IDKA IPCA 2A	1.444.216,21	■ AÇÕES - VALOR	1.003.557,42	■ MULTIMERCADO - MODERADO	804.535,09
■ AÇÕES - LIVRES	702.725,36	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	592.430,32	■ IRF-M	574.459,84
■ IRF-M 1	574.162,09	■ IMA-B	560.900,34	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	550.777,43
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	438.994,73	■ MULTIMERCADO - OUTROS	428.855,20	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	280.584,31
■ AÇÕES - SETORIAIS	142.916,47	■ AÇÕES - EXTERIOR	112.938,93	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	90.671,70
■ FIDC	16.315,65				

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	15.748.217,86	3.020.333,62	3.365.388,50	15.637.150,23	233.987,25	233.987,25	1,49%	1,49%	0,94%	0,94%	157,82%	2,47%
Fevereiro	15.637.150,23	5.060.253,79	4.304.184,87	16.271.289,18	-121.929,97	112.057,28	-0,74%	0,73%	1,18%	2,13%	34,32%	2,32%
Março	16.271.289,18	3.001.843,79	3.218.801,39	16.171.701,81	117.370,23	229.427,51	0,72%	1,46%	1,14%	3,30%	44,23%	2,18%
Abril	16.171.701,81	4.597.311,25	3.921.479,95	17.035.386,42	187.853,31	417.280,82	1,12%	2,59%	0,95%	4,27%	60,58%	2,18%
Mai	17.035.386,42	3.706.926,65	3.572.930,06	17.523.315,29	353.932,28	771.213,10	2,06%	4,70%	0,64%	4,94%	95,20%	2,08%
Junho	17.523.315,29	2.059.051,97	2.430.526,78	17.631.312,65	479.472,17	1.250.685,27	2,74%	7,57%	0,31%	5,27%	143,70%	2,11%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



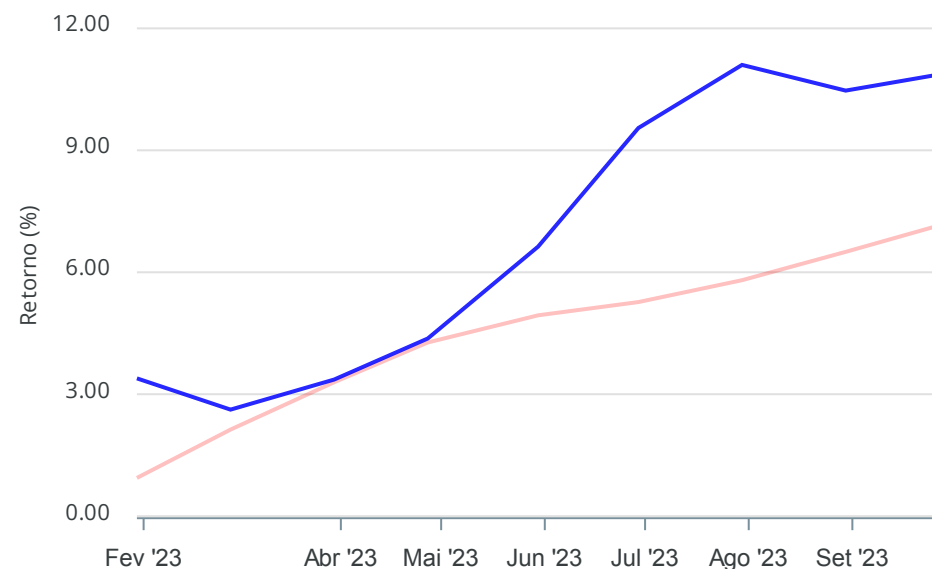
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	547.827,85	0,00	0,00	560.900,34	13.072,49	2,39%	2,39%	2,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.196.545,75	0,00	0,00	2.245.398,92	48.853,17	2,22%	2,22%	1,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	301.174,87	0,00	0,00	307.513,94	6.339,07	2,10%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	562.644,70	0,00	0,00	574.459,84	11.815,14	2,10%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	567.589,61	0,00	0,00	574.162,09	6.572,48	1,16%	1,16%	0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	211.887,10	0,00	0,00	214.338,70	2.451,60	1,16%	1,16%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	72.827,46	0,00	0,00	73.578,71	751,25	1,03%	1,03%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	964.471,09	0,00	0,00	974.413,96	9.942,87	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.429.640,99	0,00	0,00	1.444.216,21	14.575,22	1,02%	1,02%	0,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.332.149,38	718,85	115.237,84	1.230.529,19	12.898,80	0,97%	1,00%	0,01%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	492.129,08	0,00	0,00	496.806,64	4.677,56	0,95%	0,95%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	318.581,59	0,00	0,00	321.577,76	2.996,17	0,94%	0,94%	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	333.008,16	0,00	0,00	336.134,98	3.126,82	0,94%	0,94%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	998.512,91	0,00	0,00	1.007.810,48	9.297,57	0,93%	0,93%	0,47%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.734.113,06	252.333,99	735.903,10	1.267.945,24	17.401,29	0,88%	1,05%	0,00%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	504.133,01	4.133,01	0,83%	0,93%	0,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.924.641,91	1.306.717,98	1.694.623,68	1.562.619,22	25.883,01	0,80%	1,09%	0,01%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	23.249,64	0,00	0,00	16.315,65	-6.933,99	-29,82%	-	-
Total Renda Fixa	14.010.995,15	2.059.770,82	2.545.764,62	13.712.854,88	187.853,53	1,34%		0,65%

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
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	127.017,83	0,00	0,00	142.916,47	15.898,64	12,52%	12,52%	13,53%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	397.399,98	0,00	0,00	438.994,73	41.594,75	10,47%	10,47%	7,64%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	428.301,40	0,00	0,00	466.362,04	38.060,64	8,89%	8,89%	7,53%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	507.183,33	0,00	0,00	550.777,43	43.594,10	8,60%	8,60%	7,40%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	927.695,07	0,00	0,00	1.003.557,42	75.862,35	8,18%	8,18%	7,42%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	548.385,24	0,00	0,00	592.430,32	44.045,08	8,03%	8,03%	10,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	219.370,31	0,00	0,00	236.363,32	16.993,01	7,75%	7,75%	7,86%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	84.736,45	0,00	0,00	90.671,70	5.935,25	7,00%	7,00%	5,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	790.213,54	0,00	0,00	804.535,09	14.321,55	1,81%	1,81%	1,60%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	423.676,55	0,00	0,00	428.855,20	5.178,65	1,22%	1,22%	0,21%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	278.077,08	0,00	0,00	280.584,31	2.507,23	0,90%	0,90%	0,47%
Total Renda Variável	4.732.056,78	0,00	0,00	5.036.048,03	303.991,25	6,42%		5,97%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	112.412,74	0,00	0,00	112.938,93	526,19	0,47%	0,47%	6,60%
Total Exterior	112.412,74	0,00	0,00	112.938,93	526,19	0,47%		6,60%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.361.377,33	0,00	250.000,00	2.245.398,92	134.021,59	5,68%	5,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.188.793,27	6.923.213,30	7.632.042,97	1.562.619,22	82.655,62	0,91%	3,16%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.335.866,88	788.291,37	905.123,07	1.267.945,24	48.910,06	2,30%	3,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.560.406,56	5.299,00	375.082,15	1.230.529,19	39.905,78	2,55%	2,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	523.219,51	0,00	0,00	560.900,34	37.680,83	7,20%	7,20%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	544.679,46	0,00	0,00	574.459,84	29.780,38	5,47%	5,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.414.522,86	0,00	0,00	1.444.216,21	29.693,35	2,10%	2,10%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	950.120,56	0,00	0,00	974.413,96	24.293,40	2,56%	2,56%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	788.960,06	0,00	500.000,00	307.513,94	18.553,88	2,35%	4,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	556.622,30	0,00	0,00	574.162,09	17.539,79	3,15%	3,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.007.810,48	7.810,48	0,78%	1,44%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	207.456,59	0,00	0,00	214.338,70	6.882,11	3,32%	3,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	314.213,90	0,00	319.382,42	0,00	5.168,52	1,64%	3,22%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	313.411,34	0,00	318.388,33	0,00	4.976,99	1,59%	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	504.133,01	4.133,01	0,83%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	333.104,13	0,00	336.134,98	3.030,85	0,91%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	318.681,07	0,00	321.577,76	2.896,69	0,91%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	71.736,09	0,00	0,00	73.578,71	1.842,62	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	496.806,64	-3.193,36	-0,64%	0,86%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	22.997,61	0,00	0,00	16.315,65	-6.681,96	-29,06%	-29,05%



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	13.154.384,32	10.368.588,87	10.300.018,94	13.712.854,88	489.900,63	3,70%	

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
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	475.592,77	0,00	0,00	592.430,32	116.837,55	24,57%	24,57%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	892.039,60	0,00	0,00	1.003.557,42	111.517,82	12,50%	12,50%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	358.151,49	0,00	0,00	438.994,73	80.843,24	22,57%	22,57%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	398.151,61	0,00	0,00	466.362,04	68.210,43	17,13%	17,13%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	482.764,04	0,00	0,00	550.777,43	68.013,39	14,09%	14,09%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	771.424,29	0,00	0,00	804.535,09	33.110,80	4,29%	4,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	204.607,85	0,00	0,00	236.363,32	31.755,47	15,52%	15,52%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	119.094,59	0,00	0,00	142.916,47	23.821,88	20,00%	20,00%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	414.872,21	0,00	0,00	428.855,20	13.982,99	3,37%	3,37%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	271.969,51	0,00	0,00	280.584,31	8.614,80	3,17%	3,17%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	82.108,88	0,00	0,00	90.671,70	8.562,82	10,43%	10,43%
Total Renda Variável	4.470.776,84	0,00	0,00	5.036.048,03	565.271,19	12,64%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	106.946,68	0,00	0,00	112.938,93	5.992,25	5,60%	5,60%
Total Exterior	106.946,68	0,00	0,00	112.938,93	5.992,25	5,60%	

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.267.856,56	0,00	250.000,00	2.245.398,92	227.542,36	10,03%	10,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.431.420,75	15.495.378,71	17.561.826,60	1.562.619,22	197.646,36	1,04%	6,44%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.585.665,76	1.253.557,16	1.663.714,20	1.267.945,24	92.436,52	3,26%	6,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.355.280,91	0,00	0,00	1.444.216,21	88.935,30	6,56%	6,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	304.549,81	1.849.825,59	989.769,50	1.230.529,19	65.923,29	3,06%	5,98%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	503.888,05	0,00	0,00	560.900,34	57.012,29	11,31%	11,31%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	170.580,65	750.000,00	0,00	974.413,96	53.833,31	5,85%	6,99%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	524.355,66	0,00	0,00	574.459,84	50.104,18	9,56%	9,56%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	764.143,90	0,00	500.000,00	307.513,94	43.370,04	5,68%	8,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,01	545.000,00	0,00	574.162,09	29.162,08	5,35%	6,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	303.171,28	0,00	319.382,42	0,00	16.211,14	5,35%	6,98%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	302.429,93	0,00	318.388,33	0,00	15.958,40	5,28%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	201.251,13	0,00	0,00	214.338,70	13.087,57	6,50%	6,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.007.810,48	7.810,48	0,78%	5,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	68.762,78	0,00	0,00	73.578,71	4.815,93	7,00%	7,00%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	504.133,01	4.133,01	0,83%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	333.104,13	0,00	336.134,98	3.030,85	0,91%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	318.681,07	0,00	321.577,76	2.896,69	0,91%	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,01	0,00	0,00	0,00	-0,01	-100,00%	11,24%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	496.806,64	-3.193,36	-0,64%	6,03%

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 VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	23.241,33	0,00	0,00	16.315,65	-6.925,68	-29,80%	-29,80%
Total Renda Fixa	11.806.598,52	22.545.546,66	21.603.081,05	13.712.854,88	963.790,75	7,56%	

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
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	365.805,19	0,00	0,00	438.994,73	73.189,54	20,01%	20,01%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	524.073,46	0,00	0,00	592.430,32	68.356,86	13,04%	13,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	763.666,51	0,00	0,00	804.535,09	40.868,58	5,35%	5,35%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	563.895,27	400.000,00	0,00	1.003.557,42	39.662,15	4,11%	4,06%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	522.781,83	0,00	0,00	550.777,43	27.995,60	5,36%	5,36%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	88.598,84	350.000,00	0,00	466.362,04	27.763,20	6,33%	8,06%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	402.444,44	0,00	0,00	428.855,20	26.410,76	6,56%	6,56%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	462.588,42	0,00	200.000,00	280.584,31	17.995,89	3,89%	6,57%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	75.451,79	0,00	0,00	90.671,70	15.219,91	20,17%	20,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	227.475,24	0,00	0,00	236.363,32	8.888,08	3,91%	3,91%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	150.776,87	0,00	0,00	142.916,47	-7.860,40	-5,21%	-5,21%
Total Renda Variável	4.147.557,86	750.000,00	200.000,00	5.036.048,03	338.490,17	7,21%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	98.610,79	0,00	0,00	112.938,93	14.328,14	14,53%	14,53%
Total Exterior	98.610,79	0,00	0,00	112.938,93	14.328,14	14,53%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

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

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

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

