

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	328.763,02	0,47%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.320.020,33	1,91%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	Não se ...	Não se aplica	48.585,70	0,07%	20	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	102.009,07	0,15%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	8.194,95	0,01%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.734.436,39	2,51%	21.398	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.632.298,62	2,36%	184	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	198.916,69	0,29%	83	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.273.048,53	3,28%	2.815	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	D+4	Não há	561.902,79	0,81%	7	1,64%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	D+3	Não há	586.091,47	0,85%	353	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	422.827,93	0,61%	10.463	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.726.546,38	2,49%	136	0,87%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.726.932,41	2,50%	21	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	1.270.437,19	1,84%	31	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	431.865,45	0,62%	57	0,08%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	511.832,28	0,74%	22.263	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	881.153,76	1,27%	155	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	484.467,81	0,70%	491	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.848.379,85	2,67%	95	1,43%	Artigo 10º, Inciso I

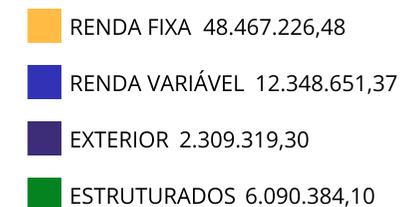
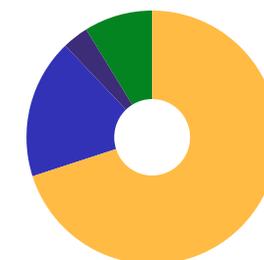


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.247.112,27	1,80%	50.212	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.503.335,88	2,17%	5.716	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	865.125,54	1,25%	6.968	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	626.430,56	0,91%	653	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	215.212,97	0,31%		0,23%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			69.215.581,25				

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

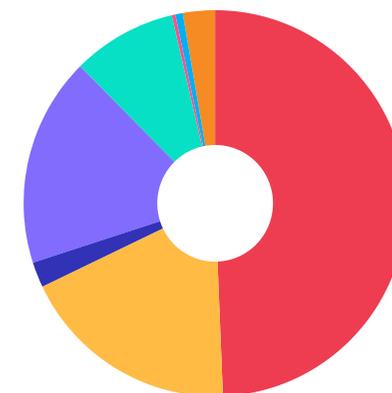
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	13.843.116,25
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	34.158.557,23	49,35%	15,00%	54,00%	90,00%	28.135.465,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	12.829.859,20	18,54%	4,00%	10,00%	60,00%	28.699.489,55
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.460.779,06
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.478.810,05	2,14%	0,00%	2,50%	5,00%	1.981.969,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	2.076.467,44
Total Renda Fixa	100,00%	48.467.226,48	70,02%	19,00%	69,50%	183,00%	



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%	12.133.438,40	17,53%	0,00%	18,00%	30,00%	8.631.235,98
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	6.090.384,10	8,80%	0,00%	6,00%	10,00%	831.174,03
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.460.779,06
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.460.779,06
Desenquadrado - RV	0,00%	215.212,97	0,31%	0,00%	0,00%	0,00%	-215.212,97
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	18.439.035,47	26,64%	0,00%	27,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	431.865,45	0,62%	0,00%	0,50%	10,00%	6.489.692,68
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.877.453,85	2,71%	0,00%	3,00%	10,00%	5.044.104,28
Total Exterior	10,00%	2.309.319,30	3,34%	0,00%	3,50%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

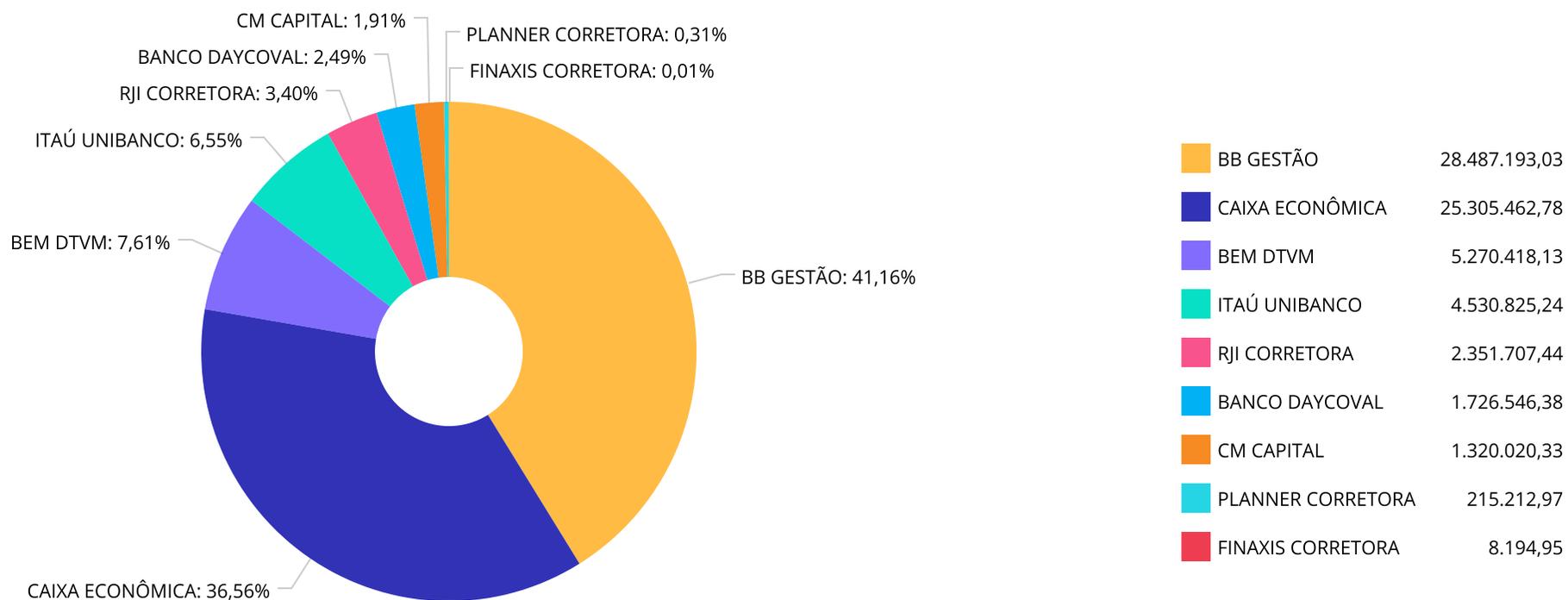
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	28.487.193,03	41,16	-
CAIXA DTVM	21.467.028,87	31,01	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.838.433,91	5,55	0,02
TRÍGONO CAPITAL	2.997.369,60	4,33	0,06
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.891.795,87	4,18	1,13
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.333.572,49	3,37	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.273.048,53	3,28	0,12
ITAÚ UNIBANCO	2.197.252,75	3,17	0,00
META ASSET MANAGEMENT	1.726.546,38	2,49	0,85
RJI CORRETORA DE VALORES	402.583,18	0,58	0,72
PLURAL	377.348,72	0,55	-
CADENCE GESTORA	215.212,97	0,31	-
PETRA CAPITAL	8.194,95	0,01	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

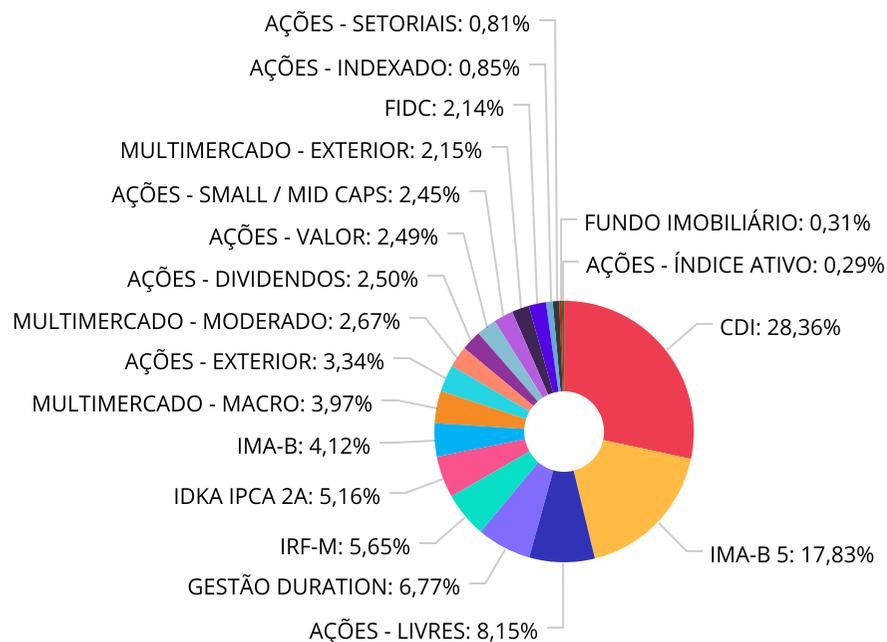
Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	34.158.557,23	49,35	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	12.829.859,20	18,54	4,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.478.810,05	2,14	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	12.133.438,40	17,53	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	431.865,45	0,62	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	1.877.453,85	2,71	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	6.090.384,10	8,80	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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)

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



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

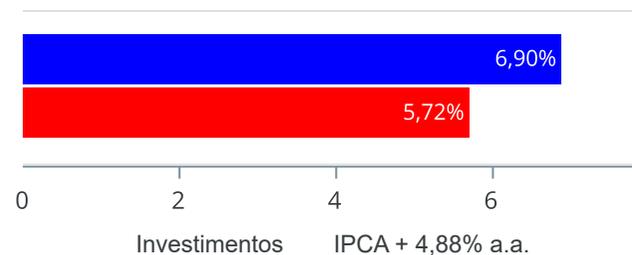


■ CDI	19.626.203,88	■ IMA-B 5	12.340.853,30	■ AÇÕES - LIVRES	5.639.783,54	■ GESTÃO DURATION	4.686.671,23
■ IRF-M	3.909.147,44	■ IDKA IPCA 2A	3.571.819,87	■ IMA-B	2.853.720,71	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.750.448,15
■ AÇÕES - EXTERIOR	2.309.319,30	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.848.379,85	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.726.932,41	■ AÇÕES - VALOR	1.726.546,38
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.693.265,12	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.491.556,10	■ FIDC	1.478.810,05	■ AÇÕES - INDEXADO	586.091,47
■ AÇÕES - SETORIAIS	561.902,79	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	215.212,97	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	198.916,69		

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	63.080.883,61	7.645.059,03	8.409.259,70	63.433.808,80	1.117.125,86	1.117.125,86	1,77%	1,77%	0,95%	0,95%	186,60%	3,03%
Fevereiro	63.433.808,80	6.748.190,39	6.107.126,78	63.714.242,22	-360.630,19	756.495,67	-0,56%	1,20%	1,18%	2,14%	55,88%	2,51%
Março	63.714.242,22	1.257.802,15	808.842,82	64.499.603,07	336.401,52	1.092.897,19	0,52%	1,73%	1,15%	3,32%	52,11%	2,44%
Abril	64.499.603,07	3.353.235,51	2.850.732,42	65.531.905,85	529.799,69	1.622.696,88	0,82%	2,56%	0,95%	4,30%	59,45%	2,28%
Mai	65.531.905,85	16.046.408,45	16.323.192,99	66.472.763,93	1.217.642,62	2.840.339,50	1,86%	4,46%	0,65%	4,98%	89,67%	2,43%
Junho	66.472.763,93	4.316.863,51	3.149.721,25	69.215.581,25	1.575.675,06	4.416.014,56	2,33%	6,90%	0,71%	5,72%	120,61%	2,12%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



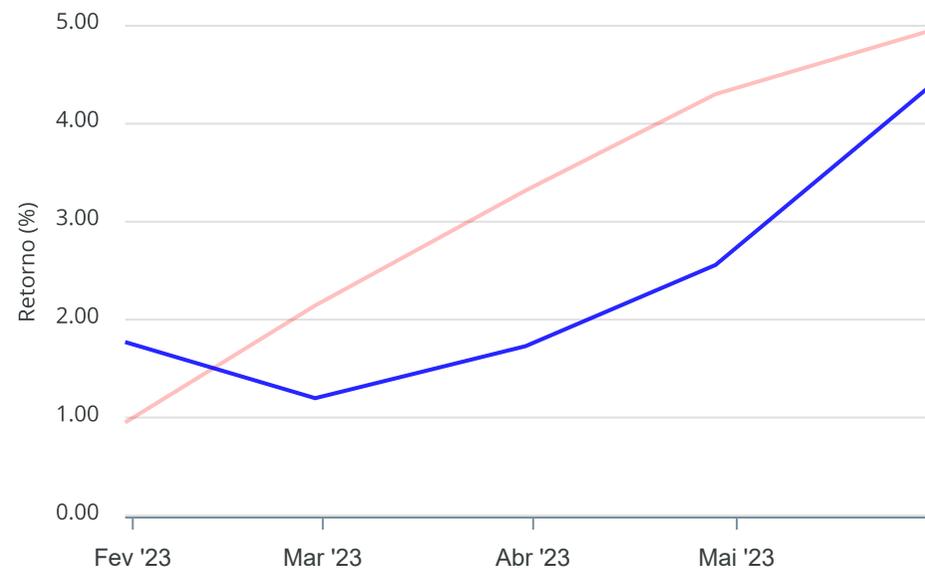
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.351.886,70	0,00	0,00	1.383.954,24	32.067,54	2,37%	2,37%	2,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.358.498,01	0,00	0,00	3.429.187,04	70.689,03	2,10%	2,10%	0,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	554.428,58	0,00	0,00	566.031,25	11.602,67	2,09%	2,09%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.102.195,53	1.179.344,27	0,00	3.343.116,19	61.576,39	1,88%	2,10%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.235.199,44	0,00	0,00	1.257.484,19	22.284,75	1,80%	1,80%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.087.584,27	0,00	0,00	1.105.269,88	17.685,61	1,63%	1,63%	1,64%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.931.778,12	0,00	0,00	6.000.410,57	68.632,45	1,16%	1,16%	0,03%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	4.394.662,65	0,00	0,00	4.443.858,80	49.196,15	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.550.329,80	0,00	0,00	2.576.936,53	26.606,73	1,04%	1,04%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.157.003,52	0,00	0,00	1.168.931,23	11.927,71	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	984.842,85	0,00	0,00	994.883,34	10.040,49	1,02%	1,02%	0,78%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.419.598,37	0,00	0,00	1.433.234,00	13.635,63	0,96%	0,96%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.767.991,91	0,00	0,00	1.784.776,36	16.784,45	0,95%	0,95%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.799.125,95	0,00	0,00	2.825.450,95	26.325,00	0,94%	0,94%	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.802.727,78	0,00	0,00	3.838.433,91	35.706,13	0,94%	0,94%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.060.860,46	0,00	0,00	6.117.295,63	56.435,17	0,93%	0,93%	0,47%
ITAU ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1.014.784,34	1.300.000,00	0,00	2.333.572,49	18.788,15	0,81%	0,93%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.478.935,40	837.519,24	3.149.721,25	184.477,16	17.743,77	0,54%	1,00%	0,01%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	400.934,47	0,00	0,00	402.583,18	1.648,71	0,41%	0,41%	0,01%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.465.214,08	0,00	0,00	1.469.766,47	4.552,39	0,31%	0,31%	0,28%



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
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.320.646,83	0,00	0,00	1.320.020,33	-626,50	-0,05%	-0,05%	0,30%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	329.514,67	0,00	0,00	328.763,02	-751,65	-0,23%	-0,23%	0,89%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	102.397,25	0,00	0,00	102.009,07	-388,18	-0,38%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.236,30	0,00	0,00	8.194,95	-41,35	-0,50%	-	-
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	48.844,05	0,00	0,00	48.585,70	-258,35	-0,53%	-	-
Total Renda Fixa	47.728.221,33	3.316.863,51	3.149.721,25	48.467.226,48	571.862,89	1,19%		0,61%

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 (%)	(%) Instít	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.486.959,95	0,00	0,00	1.632.298,62	145.338,67	9,77%	9,77%	8,04%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	537.373,01	0,00	0,00	586.091,47	48.718,46	9,07%	9,07%	7,50%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	515.307,29	0,00	0,00	561.902,79	46.595,50	9,04%	9,04%	7,60%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.591.783,97	0,00	0,00	1.734.436,39	142.652,42	8,96%	8,96%	7,42%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.101.556,99	0,00	0,00	2.273.048,53	171.491,54	8,16%	8,16%	7,14%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	183.941,18	0,00	0,00	198.916,69	14.975,51	8,14%	8,14%	7,52%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	808.495,53	0,00	0,00	865.125,54	56.630,01	7,00%	7,00%	5,04%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	585.509,25	0,00	0,00	626.430,56	40.921,31	6,99%	6,99%	5,06%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	396.545,21	0,00	0,00	422.827,93	26.282,72	6,63%	6,63%	8,11%
META VALOR FI AÇÕES	1.632.579,53	0,00	0,00	1.726.546,38	93.966,85	5,76%	5,76%	8,92%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.135.263,19	500.000,00	0,00	1.726.932,41	91.669,22	5,61%	7,30%	7,99%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	736.226,91	500.000,00	0,00	1.270.437,19	34.210,28	2,77%	3,83%	4,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.476.564,22	0,00	0,00	1.503.335,88	26.771,66	1,81%	1,81%	1,11%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.831.172,79	0,00	0,00	1.848.379,85	17.207,06	0,94%	0,94%	0,61%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.236.836,34	0,00	0,00	1.247.112,27	10.275,93	0,83%	0,83%	0,64%
OSASCO PROPERTIES FII	215.326,13	0,00	0,00	215.212,97	-113,16	-0,05%	0,00%	-
Total Renda Variável	16.471.441,49	1.000.000,00	0,00	18.439.035,47	967.593,98	5,54%		5,56%

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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	488.015,30	0,00	0,00	511.832,28	23.816,98	4,88%	4,88%	5,19%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	868.395,95	0,00	0,00	881.153,76	12.757,81	1,47%	1,47%	6,71%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	482.210,63	0,00	0,00	484.467,81	2.257,18	0,47%	0,47%	6,60%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	434.479,23	0,00	0,00	431.865,45	-2.613,78	-0,60%	-0,60%	7,04%
Total Exterior	2.273.101,11	0,00	0,00	2.309.319,30	36.218,19	1,59%		6,41%

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	4.645.001,04	1.167.367,31	0,00	6.000.410,57	188.042,22	3,24%	3,32%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.270.399,17	0,00	0,00	3.429.187,04	158.787,87	4,86%	4,86%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	4.306.307,06	0,00	0,00	4.443.858,80	137.551,74	3,19%	3,19%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.035.072,42	1.179.344,27	0,00	3.343.116,19	128.699,50	4,00%	5,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.292.065,91	0,00	0,00	1.383.954,24	91.888,33	7,11%	7,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.034.669,86	2.000.000,00	0,00	6.117.295,63	82.625,77	1,37%	1,44%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.839.643,10	0,00	4.916.497,06	0,00	76.853,96	1,59%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.766.261,28	0,00	49.472,30	1.784.776,36	67.987,38	3,85%	3,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.191.791,07	0,00	2.000.000,00	1.257.484,19	65.693,12	2,06%	5,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.942.282,27	0,00	4.005.125,52	0,00	62.843,25	1,59%	3,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.523.051,48	0,00	0,00	2.576.936,53	53.885,05	2,14%	2,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.260.955,38	6.947.471,75	8.066.152,39	184.477,16	42.202,42	0,51%	2,90%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.808.761,59	0,00	3.838.433,91	29.672,32	0,78%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	536.856,60	0,00	0,00	566.031,25	29.174,65	5,43%	5,43%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.139.788,27	0,00	0,00	1.168.931,23	29.142,96	2,56%	2,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	987.387,57	0,00	1.014.038,75	0,00	26.651,18	2,70%	5,91%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.746.690,43	0,00	1.772.360,64	0,00	25.670,21	1,47%	2,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	2.800.000,00	0,00	2.825.450,95	25.450,95	0,91%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.083.026,74	0,00	1.105.269,88	22.243,14	2,05%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	974.428,36	0,00	0,00	994.883,34	20.454,98	2,10%	2,10%

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
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.449.884,37	0,00	0,00	1.469.766,47	19.882,10	1,37%	1,37%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,00	2.314.038,75	0,00	2.333.572,49	19.533,74	0,84%	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.416.497,06	0,00	1.433.234,00	16.736,94	1,18%	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	397.483,76	0,00	0,00	402.583,18	5.099,42	1,28%	1,28%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.316.522,24	0,00	0,00	1.320.020,33	3.498,09	0,27%	0,27%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.857,93	0,00	0,00	8.194,95	-662,98	-7,48%	-7,48%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	49.409,73	0,00	0,00	48.585,70	-824,03	-1,67%	-1,67%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	103.028,88	0,00	0,00	102.009,07	-1.019,81	-0,99%	-0,99%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	330.900,60	0,00	0,00	328.763,02	-2.137,58	-0,65%	-0,65%
Total Renda Fixa	46.148.738,78	22.716.507,47	21.823.646,66	48.467.226,48	1.425.626,89	3,03%	

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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.924.433,83	0,00	0,00	2.273.048,53	348.614,70	18,12%	18,12%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.360.811,16	0,00	0,00	1.632.298,62	271.487,46	19,95%	19,95%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.517.773,43	0,00	0,00	1.734.436,39	216.662,96	14,28%	14,28%
META VALOR FI AÇÕES	2.044.949,41	0,00	500.000,00	1.726.546,38	181.596,97	8,88%	9,82%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.058.483,91	500.000,00	0,00	1.726.932,41	168.448,50	10,81%	15,08%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	672.039,95	500.000,00	0,00	1.270.437,19	98.397,24	8,40%	13,75%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	783.425,18	0,00	0,00	865.125,54	81.700,36	10,43%	10,43%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	505.167,28	0,00	0,00	586.091,47	80.924,19	16,02%	16,02%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	484.698,41	0,00	0,00	561.902,79	77.204,38	15,93%	15,93%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	347.024,80	0,00	0,00	422.827,93	75.803,13	21,84%	21,84%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.439.714,71	0,00	0,00	1.503.335,88	63.621,17	4,42%	4,42%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	567.638,83	0,00	0,00	626.430,56	58.791,73	10,36%	10,36%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.797.824,98	0,00	0,00	1.848.379,85	50.554,87	2,81%	2,81%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.215.096,14	0,00	0,00	1.247.112,27	32.016,13	2,63%	2,63%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	176.543,45	0,00	0,00	198.916,69	22.373,24	12,67%	12,67%
OSASCO PROPERTIES FII	215.624,91	0,00	0,00	215.212,97	-411,94	-0,19%	-0,14%
Total Renda Variável	16.111.250,38	1.000.000,00	500.000,00	18.439.035,47	1.827.785,09	11,00%	

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	846.685,59	0,00	0,00	881.153,76	34.468,17	4,07%	4,07%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	484.729,36	0,00	0,00	511.832,28	27.102,92	5,59%	5,59%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	458.763,20	0,00	0,00	484.467,81	25.704,61	5,60%	5,60%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	449.435,76	0,00	0,00	431.865,45	-17.570,31	-3,91%	-3,91%
Total Exterior	2.239.613,91	0,00	0,00	2.309.319,30	69.705,39	3,11%	

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	7.110.811,06	0,00	4.000.000,00	3.429.187,04	318.375,98	4,48%	8,26%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	5.742.274,83	0,00	6.000.410,57	258.135,74	4,50%	6,50%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.670.070,14	0,00	4.916.497,06	0,00	246.426,92	5,28%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.507.329,62	3.500.000,00	114.474,97	6.117.295,63	224.440,98	3,74%	5,56%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	4.220.877,06	0,00	4.443.858,80	222.981,74	5,28%	5,95%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.959.137,11	1.179.344,27	0,00	3.343.116,19	204.634,81	6,52%	9,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.803.736,14	0,00	4.005.125,52	0,00	201.389,38	5,29%	6,98%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.082.732,36	0,00	2.000.000,00	1.257.484,19	174.751,83	5,67%	8,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.417.440,13	0,00	0,00	2.576.936,53	159.496,40	6,60%	6,60%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.243.670,32	0,00	0,00	1.383.954,24	140.283,92	11,28%	11,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.700.000,00	49.472,30	1.784.776,36	134.248,66	7,90%	9,20%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.770.110,18	0,00	1.700.000,00	1.168.931,23	98.821,05	3,57%	6,99%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.625.619,33	10.602.738,74	13.139.996,11	184.477,16	96.115,20	0,73%	5,98%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.676.267,44	0,00	1.772.360,64	0,00	96.093,20	5,73%	6,94%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.413.332,26	0,00	1.500.000,00	994.883,34	81.551,08	3,38%	6,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	948.282,74	0,00	1.014.038,75	0,00	65.756,01	6,93%	10,28%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.013.984,80	0,00	500.000,00	566.031,25	52.046,45	5,13%	9,44%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.430.309,43	0,00	0,00	1.469.766,47	39.457,04	2,76%	2,76%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.808.761,59	0,00	3.838.433,91	29.672,32	0,78%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	2.800.000,00	0,00	2.825.450,95	25.450,95	0,91%	-

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 TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.083.026,74	0,00	1.105.269,88	22.243,14	2,05%	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,00	2.314.038,75	0,00	2.333.572,49	19.533,74	0,84%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.036.000,30	0,00	2.053.983,31	0,00	17.983,01	0,88%	6,49%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.416.497,06	0,00	1.433.234,00	16.736,94	1,18%	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	392.147,47	0,00	0,00	402.583,18	10.435,71	2,66%	2,66%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.355.566,47	0,00	42.061,51	1.320.020,33	6.515,37	0,48%	-2,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	314.063,00	0,00	318.975,18	0,00	4.912,18	1,56%	6,44%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.906,55	0,00	0,00	8.194,95	-711,60	-7,99%	-7,99%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	103.094,80	0,00	0,00	102.009,07	-1.085,73	-1,05%	-1,05%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	56.482,78	0,00	6.297,04	48.585,70	-1.600,04	-2,83%	-13,98%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	348.149,07	0,00	15.593,57	328.763,02	-3.792,48	-1,09%	-5,57%
Total Renda Fixa	44.287.243,50	38.367.559,04	37.148.875,96	48.467.226,48	2.961.299,90	6,51%	

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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.032.448,99	0,00	0,00	2.273.048,53	240.599,54	11,84%	11,84%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.435.379,44	0,00	0,00	1.632.298,62	196.919,18	13,72%	13,72%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	719.907,92	0,00	0,00	865.125,54	145.217,62	20,17%	20,17%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.099.930,36	500.000,00	0,00	1.726.932,41	127.002,05	7,94%	10,75%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.734.564,94	0,00	0,00	1.848.379,85	113.814,91	6,56%	6,56%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	521.727,65	0,00	0,00	626.430,56	104.702,91	20,07%	20,07%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.409.444,37	0,00	0,00	1.503.335,88	93.891,51	6,66%	6,66%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.649.214,76	0,00	0,00	1.734.436,39	85.221,63	5,17%	5,17%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.184.790,39	0,00	0,00	1.247.112,27	62.321,88	5,26%	5,26%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	722.868,85	500.000,00	0,00	1.270.437,19	47.568,34	3,89%	5,75%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	543.420,20	0,00	0,00	586.091,47	42.671,27	7,85%	7,85%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	380.257,77	0,00	0,00	422.827,93	42.570,16	11,20%	11,20%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	523.827,89	0,00	0,00	561.902,79	38.074,90	7,27%	7,27%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	188.601,43	0,00	0,00	198.916,69	10.315,26	5,47%	5,47%
OSASCO PROPERTIES FII	216.105,14	0,00	0,00	215.212,97	-892,17	-0,41%	-84,71%
META VALOR FI AÇÕES	2.295.669,94	0,00	500.000,00	1.726.546,38	-69.123,56	-3,01%	-2,17%
Total Renda Variável	16.658.160,04	1.000.000,00	500.000,00	18.439.035,47	1.280.875,43	7,47%	

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	818.271,05	0,00	0,00	881.153,76	62.882,71	7,68%	7,68%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	423.005,24	0,00	0,00	484.467,81	61.462,57	14,53%	14,53%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	454.209,58	0,00	0,00	511.832,28	57.622,70	12,69%	12,69%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	439.994,20	0,00	0,00	431.865,45	-8.128,75	-1,85%	-1,85%
Total Exterior	2.135.480,07	0,00	0,00	2.309.319,30	173.839,23	8,14%	

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.

