



CRÉDITO
& MERCADO

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	8.975.632,56	14,13%	942	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	271.849,11	0,43%	515	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	2.019.268,70	3,18%	280	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.767.677,90	4,36%	95	2,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	2.146.513,76	3,38%	180	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.254.836,69	16,14%	927	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	104.082,18	0,16%	252	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	182.239,14	0,29%	1.186	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.134.979,46	1,79%	218	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	176.803,77	0,28%	352	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.083,17	0,00%	980	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	11.568.722,16	18,21%	1.126	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	4.578.262,59	7,21%	230	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	171.445,30	0,27%	352	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.050.769,36	17,40%	1.004	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.583.396,40	2,49%	208	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO H IBOVESPA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC A...	D+5	Não há	1.461.324,04	2,30%	9	3,31%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.041.761,65	1,64%	17.026	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	774.880,25	1,22%	83	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.230.846,14	1,94%	136	0,62%	Artigo 8º, Inciso I

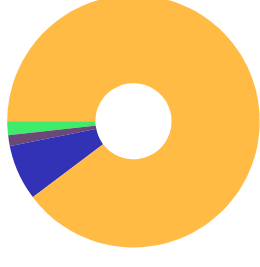


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	884.319,17	1,39%	11.624	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.138.518,09	1,79%	6.968	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			63.520.211,59				

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

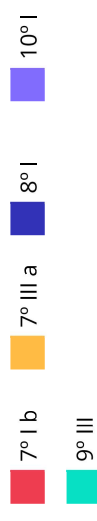
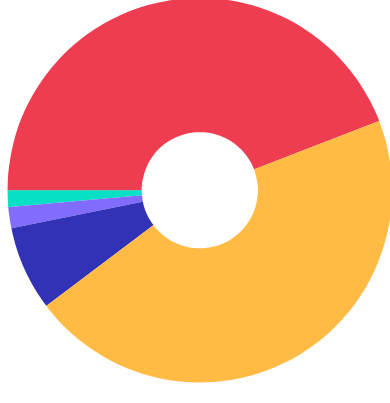
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	63.520.211,59
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	28.033.883,27	44,13%	0,00%	45,00%	100,00%	35.486.328,32
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	63.520.211,59
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.176.010,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	28.954.678,98	45,58%	0,00%	30,00%	60,00%	9.157.447,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	38.112.126,95
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	12.704.042,32
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.176.010,58
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.176.010,58
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.176.010,58
Total Renda Fixa	100,00%	56.988.562,25	89,72%	0,00%	83,00%	460,00%	



RENDA FIXA 56.988.562,25
 RENDA VARIÁVEL 4.508.812,08
 EXTERIOR 884.319,17
 ESTRUTURADOS 1.138.518,09

**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%	4.508.812,08	7,10%	0,00%	10,00%	30,00%	14.547.251,40
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	12.704.042,32
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.138.518,09	1,79%	0,00%	1,00%	10,00%	5.213.503,07
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.176.010,58
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.176.010,58
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.176.010,58
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	5.647.330,17	8,89%	0,00%	13,00%	75,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	6.352.021,16
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	6.352.021,16
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	884.319,17	1,39%	0,00%	1,00%	10,00%	5.467.701,99
Total Exterior	10,00%	884.319,17	1,39%	0,00%	3,00%	30,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	30.938.450,34	48,71	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.721.874,87	37,35	-
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	2.767.677,90	4,36	0,02
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.358.276,65	3,71	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.461.324,04	2,30	0,00
META ASSET MANAGEMENT	1.230.846,14	1,94	0,61
ITAÚ DTVM	1.041.761,65	1,64	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	28.033.883,27	44,13	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	28.954.678,98	45,58	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	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 7º, Inciso V, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	4.508.812,08	7,10	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	884.319,17	1,39	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.138.518,09	1,79	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	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



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
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)	2,65%	11,41%	6,89%	11,41%	18,80%	17,59%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,63%	11,25%	6,86%	11,25%	18,26%	16,67%	1,37%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,30%	14,47%	10,61%	14,47%	15,72%	12,70%	3,08%	0,08%
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 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%
IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2,32%	10,80%	6,72%	10,80%	13,26%	17,85%	2,09%	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
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	9,44%	5,43%	9,44%	16,38%	18,13%	0,90%	0,03%
CDI (Benchmark)								
	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB 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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12%	6,42%	3,25%	6,42%	13,55%	23,98%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	5,64%	2,77%	5,64%	11,68%	19,63%	0,00%	0,00%
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 VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	0,04%
Não definido (Benchmark)								
	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
BRADESCO H IBOVESPA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC AÇÕES	9,09%	7,05%	19,02%	7,05%	13,19%	-22,56%	8,02%	0,22%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,27%	-1,57%	7,34%	-1,57%	13,35%	-15,61%	7,12%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,75%	3,91%	15,52%	3,91%	5,48%	-28,99%	7,86%	0,24%
IBX (Benchmark)	8,87%	6,59%	14,96%	6,59%	17,60%	-9,50%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	5,76%	-2,17%	9,82%	-2,17%	7,47%	-26,36%	8,92%	0,22%
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%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	0,56%	6,31%	2,18%	6,31%	7,04%	-4,52%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,38%	7,15%	3,82%	7,15%	9,33%	-2,81%	6,71%	0,15%

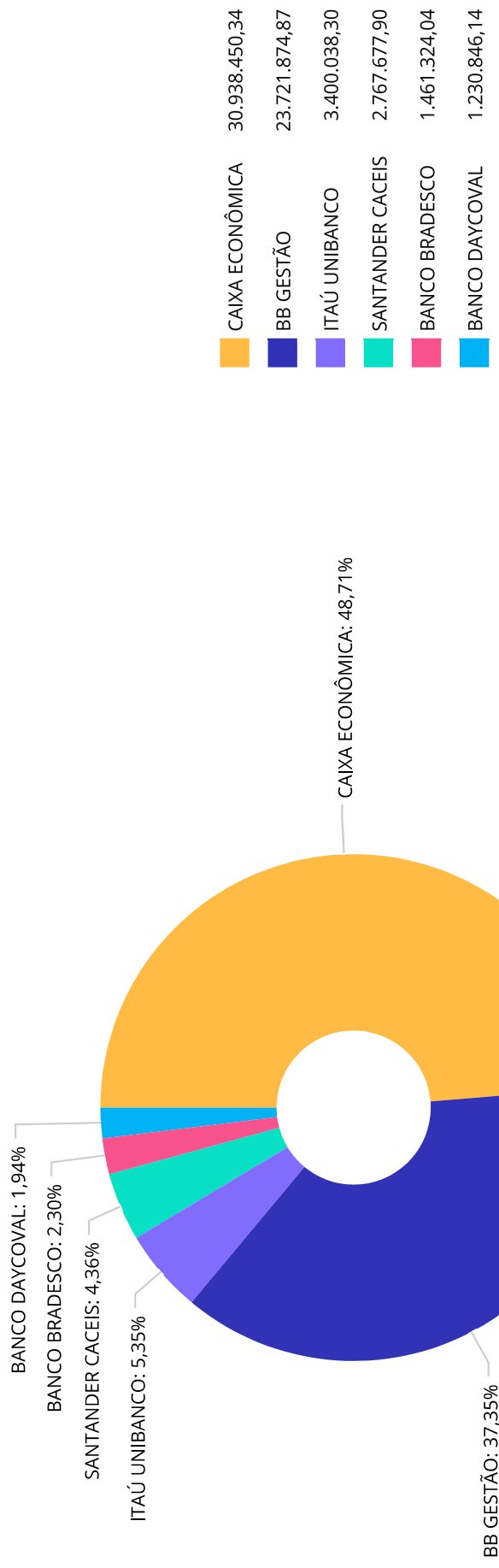


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	0,56%	6,31%	2,18%	6,31%	7,04%	-4,52%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,38%	7,15%	3,82%	7,15%	9,33%	-2,81%	6,71%	15,065%

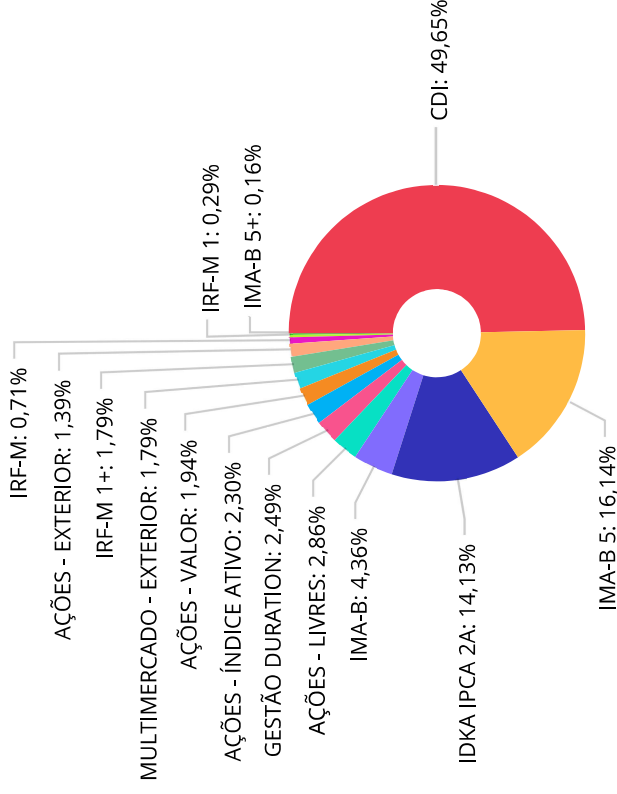


Distribuição dos ativos por Administradores - base (Junho / 2023)





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



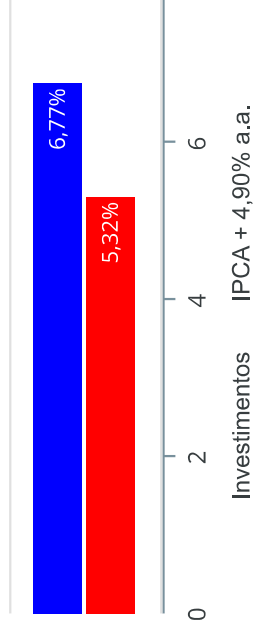
Sub-Segmento	Valor	Sub-Segmento	Valor
CDI	31.537.065,04	IMA-B 5	10.254.836,69
CDI	8.975.632,56	IMA-B	2.767.677,90
AÇÕES - LIVRES	1.816.641,90	GESTÃO DURATION	1.583.396,40
AÇÕES - LIVRES	1.461.324,04	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.230.846,14
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.138.518,09	IRF-M 1+	884.319,17
IRF-M 1	182.239,14	IMA-B 5+	104.082,18
IRF-M 1	884.319,17	AÇÕES - EXTERIOR	448.652,88



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	58.457.320,06	4.959.758,78	4.142.676,94	60.088.235,44	813.833,54	813.833,54	1,37%	1,37%	0,95%	0,95%	144,42%	1,75%
Fevereiro	60.088.235,44	3.156.993,42	3.581.122,54	59.836.674,09	172.567,77	986.401,31	0,29%	1,66%	1,19%	2,15%	77,50%	1,46%
Março	59.836.674,09	7.639.970,88	7.983.867,81	60.075.970,65	583.193,49	1.569.594,80	0,97%	2,65%	1,15%	3,32%	79,91%	1,37%
Abril	60.075.970,65	4.739.551,88	4.279.080,84	61.101.953,69	565.512,00	2.135.106,80	0,93%	3,61%	0,95%	4,31%	83,88%	1,21%
Mai	61.101.953,69	8.554.531,93	8.043.235,29	62.427.750,31	814.499,98	2.949.606,78	1,32%	4,98%	0,65%	4,99%	99,95%	1,16%
Junho	62.427.750,31	5.976.070,20	5.943.667,68	63.520.211,59	1.060.058,76	4.009.665,54	1,70%	6,77%	0,32%	5,32%	127,14%	1,20%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



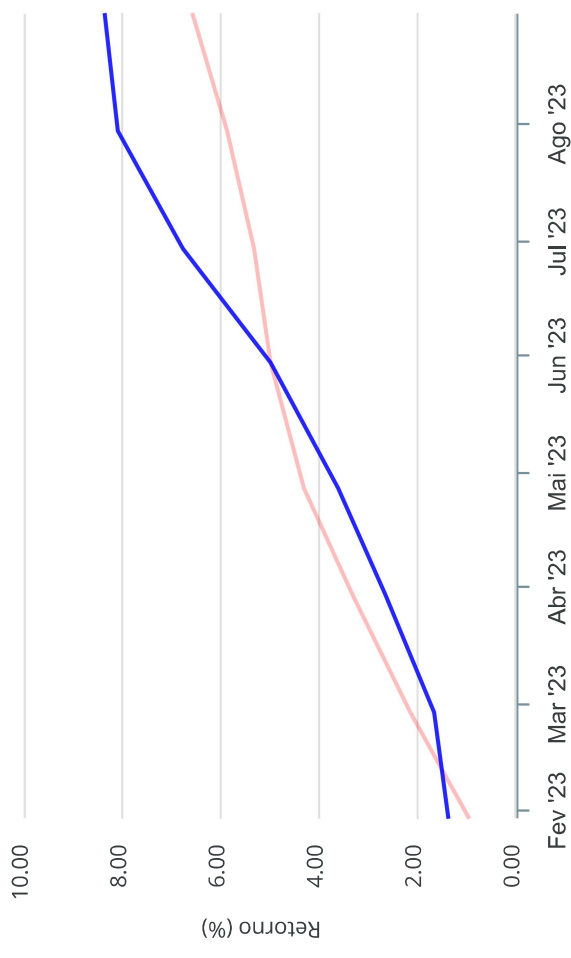


CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	100.760,74	0,00	0,00	104.082,18	3.321,44	3,30%	3,30%	3,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.105.865,54	0,00	0,00	1.134.979,46	29.113,92	2,63%	2,63%	1,37%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.705.037,33	0,00	0,00	2.767.677,90	62.640,57	2,32%	2,32%	2,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.548.946,43	0,00	0,00	1.583.396,40	34.449,97	2,22%	2,22%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	173.167,38	0,00	0,00	176.803,77	3.636,39	2,10%	2,10%	0,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	266.276,67	0,00	0,00	271.849,11	5.572,44	2,09%	2,09%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	180.153,04	0,00	0,00	182.239,14	2.086,10	1,16%	1,16%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.928.870,10	0,00	0,00	11.050.769,36	121.899,26	1,12%	1,12%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	11.532.588,04	0,00	88.937,85	11.568.722,16	125.071,97	1,08%	1,09%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	6.164.223,47	0,00	1.650.000,00	4.578.262,59	64.039,12	1,04%	1,05%	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.885.049,30	0,00	0,00	8.975.632,56	90.583,26	1,02%	1,02%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.000.454,98	0,00	0,00	2.019.268,70	18.813,72	0,94%	0,94%	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.126.546,32	0,00	0,00	2.146.513,76	19.967,44	0,94%	0,94%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.234.445,35	1.930.000,00	0,00	10.254.836,69	90.391,34	0,89%	1,03%	0,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	192.955,67	2.062.401,92	2.257.122,06	2.083,17	3.847,64	0,17%	1,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	133.952,16	1.983.668,28	1.947.607,77	171.445,30	1.432,63	0,07%	0,99%	0,00%
Total Renda Fixa	56.279.292,52	5.976.070,20	5.943.667,68	56.988.562,25	676.867,21	1,20%		0,50%



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
BRADESCO H IBOVESA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC AÇÕ...	1.339.541,46	0,00	0,00	1.461.324,04	121.782,58	9,09%	9,09%	8,02%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	719.171,32	0,00	0,00	774.880,25	55.708,93	7,75%	7,75%	7,86%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.063.992,16	0,00	0,00	1.138.518,09	74.525,93	7,00%	7,00%	5,04%
META VALOR FI AÇÕES	1.163.857,65	0,00	0,00	1.230.846,14	66.988,49	5,76%	5,76%	8,92%
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	989.646,59	0,00	0,00	1.041.761,65	52.115,06	5,27%	5,27%	7,12%
Total Renda Variável	5.276.209,18	0,00	0,00	5.647.330,17	371.120,99	7,03%		7,43%



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 GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	872.248,61	0,00	0,00	884.319,17	12.070,56	1,38%	1,38%	6,71%
Total Exterior	872.248,61	0,00	0,00	884.319,17	12.070,56	1,38%		6,71%



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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	12.085.067,33	0,00	888.937,85	11.568.722,16	372.592,68	3,08%	3,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.486.618,77	0,00	800.000,00	11.050.769,36	364.150,59	3,17%	3,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	8.111.046,53	1.930.000,00	0,00	10.254.836,69	213.790,16	2,13%	2,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.791.091,86	0,00	0,00	8.975.632,56	184.540,70	2,10%	2,10%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	5.497.459,70	550.000,00	1.650.000,00	4.578.262,59	180.802,89	2,99%	3,09%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.593.408,37	0,00	0,00	2.767.677,90	174.269,53	6,72%	6,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.495.024,97	0,00	0,00	1.583.396,40	88.371,43	5,91%	5,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.062.145,83	0,00	0,00	1.134.979,46	72.833,63	6,86%	6,86%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.092.514,80	0,00	2.125.744,12	0,00	33.229,32	1,59%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	2.125.000,00	0,00	2.146.513,76	21.513,76	1,01%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.019.268,70	19.268,70	0,96%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	257.837,34	0,00	0,00	271.849,11	14.011,77	5,43%	5,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	94.100,60	0,00	0,00	104.082,18	9.981,58	10,61%	10,61%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	290.685,95	6.320.151,80	6.449.171,74	171.445,30	9.779,29	0,15%	2,77%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	167.638,14	0,00	0,00	176.803,77	9.165,63	5,47%	5,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.972,71	6.345.002,21	6.352.130,10	2.083,17	7.238,35	0,11%	2,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	176.672,01	0,00	0,00	182.239,14	5.567,13	3,15%	3,15%
Total Renda Fixa	54.203.284,91	19.270.154,01	18.265.983,81	56.988.562,25	1.781.107,14	3,23%	



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
BRADESCO H IBOVESA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC AÇÓ...	1.227.791,97	0,00	0,00	1.461.324,04	233.532,07	19,02%	19,02%
META VALOR FI AÇÕES	1.120.781,29	0,00	0,00	1.230.846,14	110.064,85	9,82%	9,82%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.030.999,20	0,00	0,00	1.138.518,09	107.518,89	10,43%	10,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	670.774,91	0,00	0,00	774.880,25	104.105,34	15,52%	15,52%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	970.534,21	0,00	0,00	1.041.761,65	71.227,44	7,34%	7,34%
Total Renda Variável	5.020.881,58	0,00	0,00	5.647.330,17	626.448,59	12,48%	



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 GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	851.804,16	0,00	0,00	884.319,17	32.515,01	3,82%	3,82%
Total Exterior	851.804,16	0,00	0,00	884.319,17	32.515,01	3,82%	



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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	10.289.012,68	2.190.000,00	1.646.751,82	11.568.722,16	736.461,30	5,90%	6,44%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.277.582,20	1.450.000,00	2.400.000,00	11.050.769,36	723.187,16	5,68%	6,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	9.307.099,94	1.930.000,00	1.600.000,00	10.254.836,69	617.736,75	5,50%	7,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.422.910,15	0,00	0,00	8.975.632,56	552.722,41	6,56%	6,56%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	2.049.504,25	3.900.000,00	1.650.000,00	4.578.262,59	278.758,34	4,69%	6,38%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.497.830,50	0,00	0,00	2.767.677,90	269.847,40	10,80%	10,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.684.928,53	0,00	250.000,00	1.583.396,40	148.467,87	8,81%	10,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.020.247,37	0,00	0,00	1.134.979,46	114.732,09	11,25%	11,25%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.019.196,60	0,00	2.125.744,12	0,00	106.547,52	5,28%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	248.391,10	0,00	0,00	271.849,11	23.458,01	9,44%	9,44%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	2.125.000,00	0,00	2.146.513,76	21.513,76	1,01%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.019.268,70	19.268,70	0,96%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	161.383,00	0,00	0,00	176.803,77	15.420,77	9,56%	9,56%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.800.405,41	11.191.192,09	12.835.555,92	171.445,30	15.403,72	0,12%	5,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	90.922,82	0,00	0,00	104.082,18	13.159,36	14,47%	14,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	170.978,36	0,00	0,00	182.239,14	11.260,78	6,59%	6,59%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	984,50	10.240.685,00	10.250.146,18	2.083,17	10.559,85	0,10%	5,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.215.852,48	0,00	1.215.453,06	0,00	-399,42	-0,03%	11,24%
Total Renda Fixa	52.257.229,89	35.026.877,09	33.973.651,10	56.988.562,25	3.678.106,37	6,90%	



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	947.409,56	0,00	0,00	1.138.518,09	191.108,53	20,17%	20,17%
BRADESCO H IBOVESPA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC AÇÓ...	1.365.098,77	0,00	0,00	1.461.324,04	96.225,27	7,05%	7,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	745.742,07	0,00	0,00	774.880,25	29.138,18	3,91%	3,91%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.058.351,05	0,00	0,00	1.041.761,65	-16.589,40	-1,57%	-1,57%
META VALOR FI AÇÕES	1.258.194,40	0,00	0,00	1.230.846,14	-27.348,26	-2,17%	-2,17%
Total Renda Variável	5.374.795,85	0,00	0,00	5.647.330,17	272.534,32	5,07%	



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 GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	825.294,32	0,00	0,00	884.319,17	59.024,85	7,15%	7,15%
Total Exterior	825.294,32	0,00	0,00	884.319,17	59.024,85	7,15%	



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.

