

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

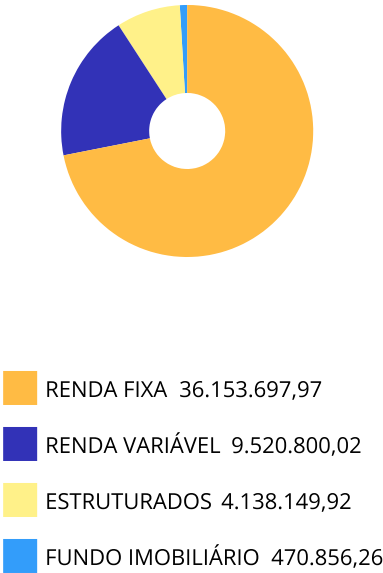
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			5.449.573,36	10,84%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	399.466,45	0,79%	942	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.769.621,88	3,52%	1.136	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	660.753,25	1,31%	773	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.515.909,36	8,98%	901	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.883.481,61	7,72%	927	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	80.903,63	0,16%	723	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.160,97	0,01%	980	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.851.740,20	5,67%	148	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.278.618,23	4,53%	360	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.333.848,13	2,65%	230	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	3.753.750,44	7,47%	352	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	690.192,53	1,37%	208	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.093.922,94	6,15%	379	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	510.005,10	1,01%	233	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA GENIAL	S/Info		2.100.069,96	4,18%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.775.679,93	5,52%	33	2,21%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	1.002.354,76	1,99%	39	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	784.833,55	1,56%	1.505	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	535.554,89	1,07%	2.724	0,16%	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
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.292.033,74	4,56%	145	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	621.542,62	1,24%	184	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.083.828,97	4,14%	83	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	982.430,73	1,95%	72	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	634.537,88	1,26%	21	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	583.682,88	1,16%	31	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.477.019,06	2,94%	182	0,46%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.477.541,78	2,94%	20	1,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.183.589,08	2,35%	117	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	470.856,26	0,94%		0,64%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			50.283.504,17				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	5.449.573,36	10,84%	0,00%	15,00%	81,95%	35.757.758,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	11.310.136,18	22,49%	19,45%	21,85%	81,95%	29.897.195,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	65,00%	14.518.238,54	28,87%	19,86%	25,65%	65,00%	18.166.039,17
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	2.100.069,96	4,18%	0,00%	2,50%	20,00%	7.956.630,87
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	5,00%	2.775.679,93	5,52%	0,00%	0,00%	5,00%	-261.504,72
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.514.175,21
Total Renda Fixa	100,00%	36.153.697,97	71,90%	39,31%	65,00%	258,90%	



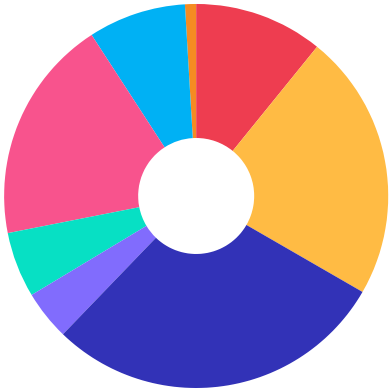
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	9.520.800,02	18,93%	1,89%	20,88%	35,00%	8.078.426,44
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.138.149,92	8,23%	3,75%	5,00%	10,00%	890.200,50
Artigo 11º	5,00%	470.856,26	0,94%	1,59%	2,12%	5,00%	2.043.318,95
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	14.129.806,20	28,10%	7,23%	28,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	5.028.350,42
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	5.028.350,42
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	



7º I a 7º I b 7º III a 7º IV
7º V a 8º I 10º I 11º

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	16.033.778,12	31,89	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.899.933,95	17,70	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	5.449.573,36	10,84	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.972.656,80	9,89	-
ITAÚ UNIBANCO	4.076.353,67	8,11	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.284.026,60	6,53	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.775.679,93	5,52	1,09
TRÍGONO CAPITAL	1.218.220,76	2,42	0,03
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.002.354,76	1,99	0,00
ZION INVEST	470.856,26	0,94	-

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'	5.449.573,36	10,84	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	11.310.136,18	22,49	19,45	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	14.518.238,54	28,87	19,86	65,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	2.775.679,93	5,52	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	9.520.800,02	18,93	1,89	35,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	4.138.149,92	8,23	3,75	10,00
Artigo 11º	470.856,26	0,94	1,59	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	6,60%	2,14%	6,60%	9,23%	19,78%	0,83%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,48%	6,35%	2,42%	6,35%	10,35%	32,11%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,05%	-2,62%	0,27%	-2,62%	-11,08%	-19,17%	0,30%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	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%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35%	11,24%	7,06%	11,24%	13,32%	17,31%	2,12%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,30%	7,10%	3,67%	7,10%	13,07%	25,65%	0,28%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	6,46%	3,25%	6,46%	13,73%	24,70%	0,03%	0,00%

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	6,53%	3,22%	6,53%	13,88%	24,53%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	5,64%	2,77%	5,64%	11,68%	19,63%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,01%	9,45%	5,68%	9,45%	14,37%	19,80%	1,19%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	6,57%	3,17%	6,57%	13,52%	21,80%	0,47%	0,01%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,16%	6,67%	3,42%	6,67%	14,18%	20,86%	0,29%	0,00%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,81%	5,35%	4,29%	5,35%	14,58%	18,67%	1,60%	0,04%

Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	7,83%	3,22%	15,32%	3,22%	3,54%	-	7,95%	0,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,75%	3,91%	15,52%	3,91%	5,48%	-28,99%	7,86%	0,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,18%	4,06%	12,50%	4,06%	9,82%	-8,47%	7,42%	0,15%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	8,01%	5,57%	14,39%	5,57%	19,10%	-11,84%	6,95%	0,19%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,77%	13,72%	19,95%	13,72%	20,91%	2,63%	8,04%	0,18%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,30%	10,75%	15,08%	10,75%	30,39%	21,43%	7,99%	0,21%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,83%	5,75%	13,75%	5,75%	20,97%	2,64%	4,12%	0,22%

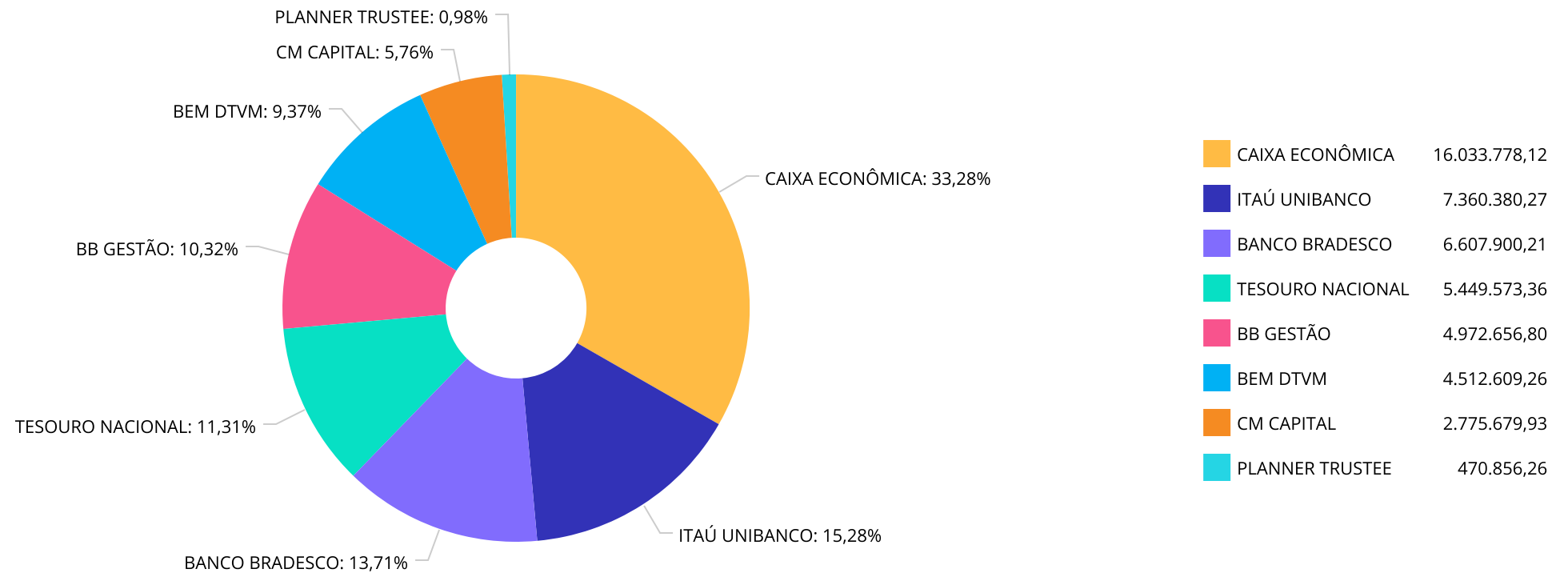
IDIV (Benchmark)	8,78%	9,30%	13,95%	9,30%	17,73%	12,91%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	10,47%	20,01%	22,57%	20,01%	27,96%	4,10%	7,64%	0,18%

IFIX (Benchmark)	4,71%	10,05%	14,28%	10,05%	12,87%	14,54%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	7,29%	-26,95%	-8,44%	-26,95%	-50,48%	154,32%	14,96%	0,31%

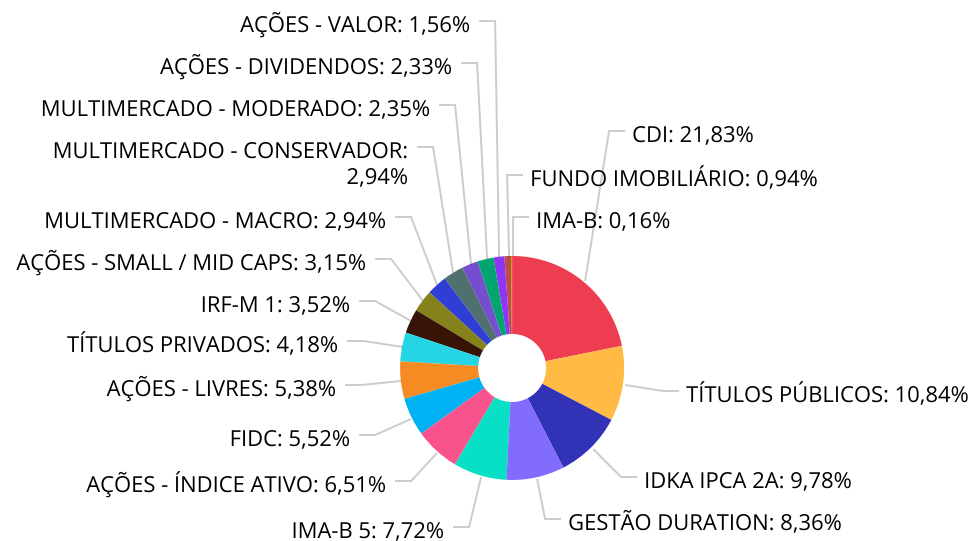
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,74%	9,35%	15,69%	9,35%	13,42%	-19,86%	8,83%	0,19%

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



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



CDI	10.976.305,81	TÍTULOS PÚBLICOS	5.449.573,36	IDKA IPCA 2A	4.915.375,81
GESTÃO DURATION	4.202.685,98	IMA-B 5	3.883.481,61	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.274.464,47
FIDC	2.775.679,93	AÇÕES - LIVRES	2.705.371,59	TÍTULOS PRIVADOS	2.100.069,96
IRF-M 1	1.769.621,88	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.586.037,64	MULTIMERCADO - MACRO	1.477.541,78
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.477.019,06	MULTIMERCADO - MODERADO	1.183.589,08	AÇÕES - DIVIDENDOS	1.170.092,77
AÇÕES - VALOR	784.833,55	FUNDO IMOBILIÁRIO	470.856,26	IMA-B	80.903,63

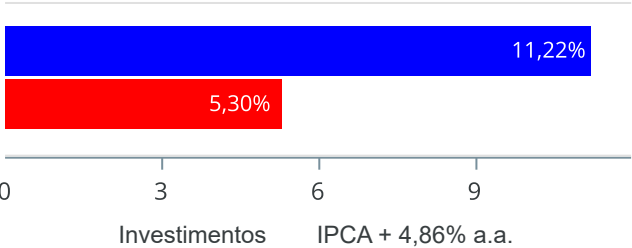
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	12/05/2023	574	4.136,3335730	4.159,000320	2.374.255,47	2.387.266,18	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/05/2023	242	4.123,050181	4.149,741079	997.778,14	1.004.237,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	30/01/2023	486	4.115,226337	4.284,293039	2.000.000,00	2.082.166,42	Mercado

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	45.217.257,78	1.515.056,25	3.233.034,28	46.125.000,41	2.625.720,66	2.625.720,66	5,81%	5,81%	0,95%	0,95%	612,96%	2,89%
Fevereiro	46.125.000,41	3.995.378,21	2.487.982,92	47.236.647,99	-395.747,71	2.229.972,95	-0,83%	4,93%	1,18%	2,14%	230,17%	2,80%
Março	47.236.647,99	1.554.282,52	2.646.531,45	46.285.799,35	141.400,29	2.371.373,24	0,30%	5,24%	1,15%	3,31%	158,24%	2,48%
Abril	46.285.799,35	1.711.855,53	249.003,78	48.059.891,67	311.240,57	2.682.613,81	0,65%	5,93%	0,95%	4,30%	137,99%	2,25%
Mai	48.059.891,67	7.802.289,26	8.206.595,44	48.924.628,89	1.269.043,40	3.951.657,21	2,64%	8,72%	0,65%	4,97%	175,56%	2,34%
Junho	48.924.628,89	1.800.708,08	1.571.117,88	50.283.504,17	1.129.285,08	5.080.942,29	2,30%	11,22%	0,32%	5,30%	211,70%	2,23%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO

36M

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	79.043,39	0,00	0,00	80.903,63	1.860,24	2,35%	2,35%	2,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	675.175,99	0,00	0,00	690.192,53	15.016,54	2,22%	2,22%	1,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	647.132,53	0,00	0,00	660.753,25	13.620,72	2,10%	2,10%	0,90%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.795.591,58	0,00	0,00	2.851.740,20	56.148,62	2,01%	2,01%	1,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	503.470,98	0,00	0,00	510.005,10	6.534,12	1,30%	1,30%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.058.220,06	0,00	0,00	3.093.922,94	35.702,88	1,17%	1,17%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.749.354,22	0,00	0,00	1.769.621,88	20.267,66	1,16%	1,16%	0,10%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.253.102,87	0,00	0,00	2.278.618,23	25.515,36	1,13%	1,13%	0,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.319.959,10	0,00	0,00	1.333.848,13	13.889,03	1,05%	1,05%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.469.282,82	0,00	0,00	4.515.909,36	46.626,54	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.843.830,49	0,00	0,00	3.883.481,61	39.651,12	1,03%	1,03%	0,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	395.434,99	0,00	0,00	399.466,45	4.031,46	1,02%	1,02%	0,78%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.420.467,12	0,00	0,00	5.449.573,36	29.106,24	0,54%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	3.502.383,78	1.794.573,12	1.571.117,88	3.753.750,44	27.911,42	0,53%	0,99%	0,00%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	2.090.431,24	0,00	0,00	2.100.069,96	9.638,72	0,46%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	6.134,96	0,00	6.160,97	26,01	0,42%	1,00%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.776.997,30	0,00	0,00	2.775.679,93	-1.317,37	-0,05%	-0,05%	0,30%
Total Renda Fixa	35.579.878,46	1.800.708,08	1.571.117,88	36.153.697,97	344.229,31	0,96%		0,49%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	484.811,07	0,00	0,00	535.554,89	50.743,82	10,47%	10,47%	7,64%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	566.200,92	0,00	0,00	621.542,62	55.341,70	9,77%	9,77%	8,04%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	921.777,86	0,00	0,00	1.002.354,76	80.576,90	8,74%	8,74%	8,83%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	725.505,29	0,00	0,00	784.833,55	59.328,26	8,18%	8,18%	7,42%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.122.010,35	0,00	0,00	2.292.033,74	170.023,39	8,01%	8,01%	6,95%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	911.107,51	0,00	0,00	982.430,73	71.323,22	7,83%	7,83%	7,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.934.014,99	0,00	0,00	2.083.828,97	149.813,98	7,75%	7,75%	7,86%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	591.375,22	0,00	0,00	634.537,88	43.162,66	7,30%	7,30%	7,99%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	438.856,32	0,00	0,00	470.856,26	31.999,94	7,29%	7,29%	14,96%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	562.137,74	0,00	0,00	583.682,88	21.545,14	3,83%	3,83%	4,12%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.162.519,98	0,00	0,00	1.183.589,08	21.069,10	1,81%	1,81%	1,60%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.460.612,39	0,00	0,00	1.477.541,78	16.929,39	1,16%	1,16%	0,29%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.463.820,79	0,00	0,00	1.477.019,06	13.198,27	0,90%	0,90%	0,47%
Total Renda Variável	13.344.750,43	0,00	0,00	14.129.806,20	785.055,77	5,88%		5,76%

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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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
TÍTULOS PÚBLICOS	1.992.474,07	3.031.337,71	0,00	5.449.573,36	425.761,58	8,47%	-
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.698.460,77	0,00	0,00	2.851.740,20	153.279,43	5,68%	5,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.977.450,24	0,00	1.000.000,00	3.093.922,94	116.472,70	2,93%	3,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.786.228,04	0,00	0,00	3.883.481,61	97.253,57	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.422.683,90	2.380.000,00	2.380.000,00	4.515.909,36	93.225,46	1,37%	2,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.545.969,99	5.397.380,20	4.266.717,11	3.753.750,44	77.117,36	0,97%	2,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.909.727,58	0,00	1.293.384,35	690.192,53	73.849,30	3,87%	5,91%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.207.457,62	0,00	0,00	2.278.618,23	71.160,61	3,22%	3,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.715.737,38	0,00	0,00	1.769.621,88	53.884,50	3,14%	3,14%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	2.047.823,58	0,00	0,00	2.100.069,96	52.246,38	2,55%	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.293.904,01	0,00	0,00	1.333.848,13	39.944,12	3,09%	3,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	630.157,19	0,00	0,00	660.753,25	30.596,06	4,86%	4,86%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.070.042,46	0,00	1.086.615,64	0,00	16.573,18	1,55%	2,63%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	0,00	500.000,00	0,00	510.005,10	10.005,10	2,00%	3,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	391.253,35	0,00	0,00	399.466,45	8.213,10	2,10%	2,10%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.768.324,29	0,00	0,00	2.775.679,93	7.355,64	0,27%	0,27%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	75.566,93	0,00	0,00	80.903,63	5.336,70	7,06%	7,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	6.134,96	0,00	6.160,97	26,01	0,42%	2,90%
Total Renda Fixa	33.533.261,40	11.314.852,87	10.026.717,10	36.153.697,97	1.332.300,80	3,83%	

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 SELECTION FIC AÇÕES	2.003.648,34	0,00	0,00	2.292.033,74	288.385,40	14,39%	14,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.803.866,07	0,00	0,00	2.083.828,97	279.962,90	15,52%	15,52%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	866.393,77	0,00	0,00	1.002.354,76	135.960,99	15,69%	15,69%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	851.890,14	0,00	0,00	982.430,73	130.540,59	15,32%	15,32%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	518.166,29	0,00	0,00	621.542,62	103.376,33	19,95%	19,95%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	436.929,59	0,00	0,00	535.554,89	98.625,30	22,57%	22,57%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	697.620,88	0,00	0,00	784.833,55	87.212,67	12,50%	12,50%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	551.379,76	0,00	0,00	634.537,88	83.158,12	15,08%	15,08%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	513.128,51	0,00	0,00	583.682,88	70.554,37	13,75%	13,75%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.428.681,63	0,00	0,00	1.477.541,78	48.860,15	3,42%	3,42%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.134.878,23	0,00	0,00	1.183.589,08	48.710,85	4,29%	4,29%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.431.669,99	0,00	0,00	1.477.019,06	45.349,07	3,17%	3,17%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	514.284,75	0,00	0,00	470.856,26	-43.428,49	-8,44%	-8,44%
Total Renda Variável	12.752.537,95	0,00	0,00	14.129.806,20	1.377.268,25	10,80%	

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
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	3.031.337,71	57.914,70	5.449.573,36	2.476.150,35	81,69%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.237.556,64	2.380.000,00	2.380.000,00	4.515.909,36	278.352,72	4,21%	6,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.629.296,88	0,00	0,00	3.883.481,61	254.184,73	7,00%	7,00%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.605.442,73	0,00	0,00	2.851.740,20	246.297,47	9,45%	9,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.857.567,22	0,00	1.000.000,00	3.093.922,94	236.355,72	6,13%	6,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.522.281,70	0,00	3.993.384,35	690.192,53	161.295,18	3,57%	10,28%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.882.739,60	10.462.097,18	9.750.401,02	3.753.750,44	159.314,68	1,19%	5,64%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.138.889,50	0,00	0,00	2.278.618,23	139.728,73	6,53%	6,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.661.723,99	0,00	0,00	1.769.621,88	107.897,89	6,49%	6,49%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	0,00	2.000.000,00	0,00	2.100.069,96	100.069,96	5,00%	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.290.315,34	0,00	37.504,97	1.333.848,13	81.037,76	6,28%	6,38%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.026.900,53	0,00	1.086.615,64	0,00	59.715,11	5,82%	6,94%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	610.336,05	0,00	0,00	660.753,25	50.417,20	8,26%	8,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	374.867,18	0,00	0,00	399.466,45	24.599,27	6,56%	6,56%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.850.424,77	0,00	88.445,07	2.775.679,93	13.700,23	0,48%	-2,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	0,00	500.000,00	0,00	510.005,10	10.005,10	2,00%	7,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	72.726,33	0,00	0,00	80.903,63	8.177,30	11,24%	11,24%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	6.134,96	0,00	6.160,97	26,01	0,42%	5,98%
Total Renda Fixa	31.761.068,46	18.379.569,85	18.394.265,75	36.153.697,97	4.407.325,41	8,79%	

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
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.171.071,02	0,00	0,00	2.292.033,74	120.962,72	5,57%	5,57%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.385.167,37	0,00	0,00	1.477.541,78	92.374,41	6,67%	6,67%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.385.990,98	0,00	0,00	1.477.019,06	91.028,08	6,57%	6,57%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	446.266,76	0,00	0,00	535.554,89	89.288,13	20,01%	20,01%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	916.680,23	0,00	0,00	1.002.354,76	85.674,53	9,35%	9,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.005.469,77	0,00	0,00	2.083.828,97	78.359,20	3,91%	3,91%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	546.560,22	0,00	0,00	621.542,62	74.982,40	13,72%	13,72%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	572.969,83	0,00	0,00	634.537,88	61.568,05	10,75%	10,75%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.123.465,39	0,00	0,00	1.183.589,08	60.123,69	5,35%	5,35%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	551.938,34	0,00	0,00	583.682,88	31.744,54	5,75%	5,75%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	754.211,74	0,00	0,00	784.833,55	30.621,81	4,06%	4,06%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	951.827,45	0,00	0,00	982.430,73	30.603,28	3,22%	3,22%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	644.570,22	0,00	0,00	470.856,26	-173.713,96	-26,95%	-26,95%
Total Renda Variável	13.456.189,32	0,00	0,00	14.129.806,20	673.616,88	5,01%	

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 GESTÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.. 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.

