

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

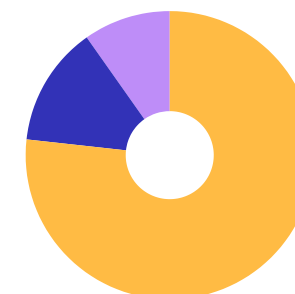
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			11.952.811,41	12,64%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.859.021,28	4,08%	664	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	13.855.013,68	14,65%	942	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.306.871,65	13,02%	783	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	201.869,66	0,21%	572	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.812.017,25	5,09%	1.136	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	8.169.459,93	8,64%	773	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.589.228,01	2,74%	723	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	256.685,97	0,27%	1.186	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	30.276,00	0,03%	16.763	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	39.775,49	0,04%	980	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.283.969,45	1,36%	1.126	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.210.531,92	13,97%	416	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.969.811,44	4,20%	1.505	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.719.350,61	2,88%	21.398	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	860.569,82	0,91%	10.685	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.977.473,80	3,15%	1.074	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.366.306,45	1,44%	21	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	847.924,67	0,90%	31	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.685.091,55	1,78%	182	0,52%	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
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	841.707,18	0,89%	117	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.719.531,15	7,11%	5.795	1,18%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			94.555.298,37				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			292.136,43	Artigo 6º			
PL Total			94.847.434,80				

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%	11.952.811,41	12,64%	5,00%	15,80%	81,95%	65.535.255,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	46.080.443,43	48,73%	30,00%	42,20%	81,95%	31.407.623,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	14.534.276,86	15,37%	7,00%	7,50%	60,00%	42.198.902,16
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	18.911.059,67
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.727.764,92
Total Renda Fixa	100,00%	72.567.531,70	76,75%	42,00%	70,50%	248,90%	



RENDA FIXA 72.567.531,70

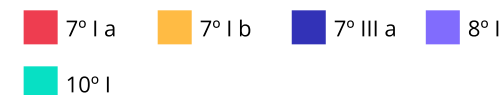
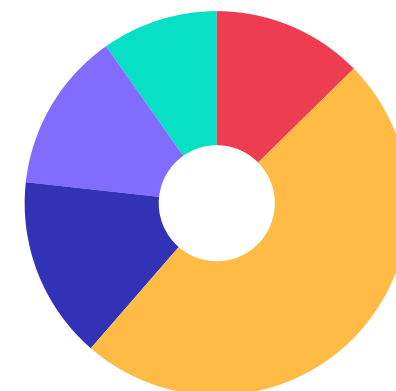
RENDA VARIÁVEL 12.741.436,79

ESTRUTURADOS 9.246.329,88

Enquadramento e Política de Investimento (REDA 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%	12.741.436,79	13,48%	14,00%	14,50%	20,00%	6.169.622,88
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	9.246.329,88	9,78%	8,00%	9,00%	10,00%	209.199,96
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	21.987.766,67	23,25%	22,00%	23,50%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	9.455.529,84
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



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'	11.952.811,41	12,64	5,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	46.080.443,43	48,73	30,00	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	14.534.276,86	15,37	7,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	12.741.436,79	13,48	14,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	9.246.329,88	9,78	8,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.593.361,88	48,22	-
CAIXA DTVM	34.794.893,96	36,80	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	11.952.811,41	12,64	-
TRÍGONO CAPITAL	2.214.231,12	2,34	0,05

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)

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)	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%
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%	-	-
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	0,04%
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%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	0,02%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,85%	5,11%	2,48%	5,11%	10,63%	17,47%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,16%	6,50%	3,32%	6,50%	13,62%	24,11%	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
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%

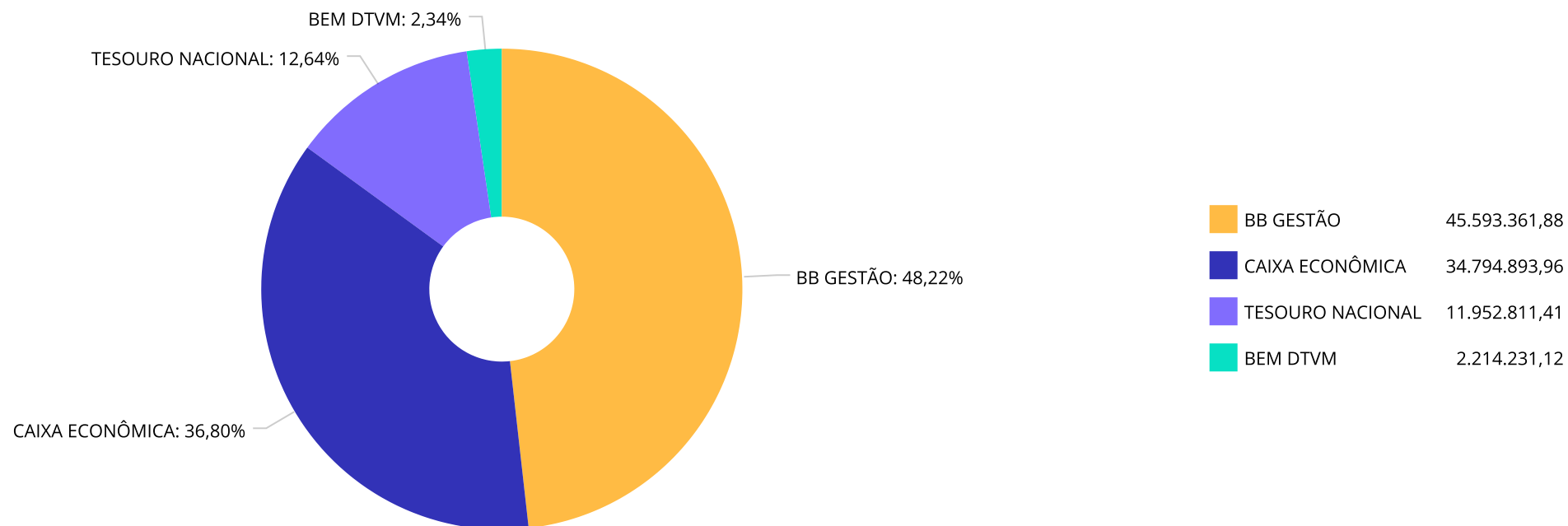
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	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%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,81%	5,35%	4,29%	5,35%	14,58%	18,67%	1,60%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,64%	6,01%	5,71%	6,01%	14,89%	15,14%	2,12%	0,05%

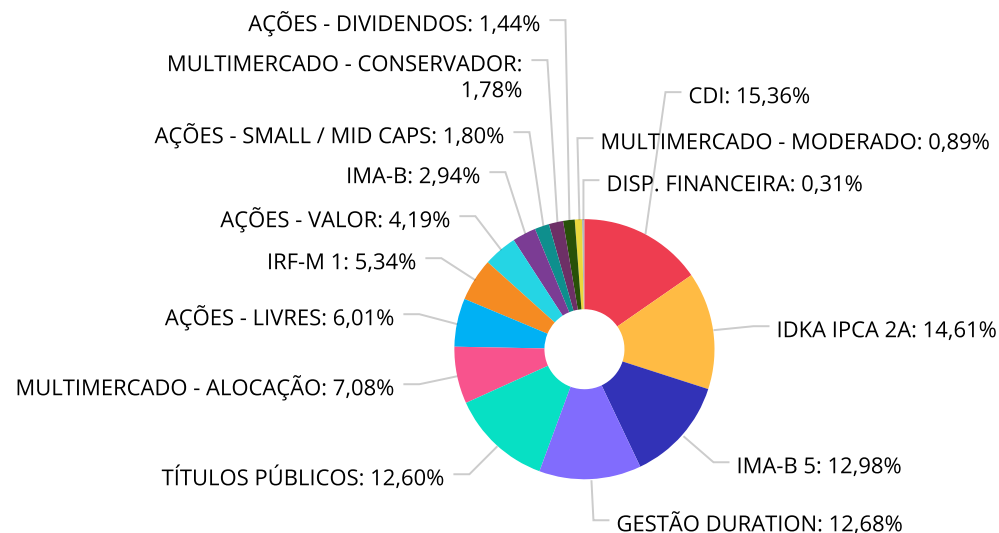
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,83%	5,75%	13,75%	5,75%	20,97%	2,64%	4,12%	0,22%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,30%	10,75%	15,08%	10,75%	30,39%	21,43%	7,99%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,18%	4,06%	12,50%	4,06%	9,82%	-8,47%	7,42%	0,15%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8,96%	5,17%	14,28%	5,17%	12,53%	-7,54%	7,42%	0,17%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8,89%	8,06%	17,13%	8,06%	15,45%	-16,81%	7,53%	0,21%

SMLL (Benchmark)	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	9,13%	14,75%	27,59%	14,75%	19,53%	-29,89%	10,66%	0,28%

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



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



CDI	14.564.552,86	IDKA IPCA 2A	13.855.013,68	IMA-B 5	12.306.871,65
GESTÃO DURATION	12.028.481,21	TÍTULOS PÚBLICOS	11.952.811,41	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	6.719.531,15
AÇÕES - LIVRES	5.696.824,41	IRF-M 1	5.068.703,22	AÇÕES - VALOR	3.969.811,44
IMA-B	2.791.097,67	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.708.494,49	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.685.091,55
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.366.306,45	MULTIMERCADO - MODERADO	841.707,18	DISP. FINANCEIRA	292.136,43

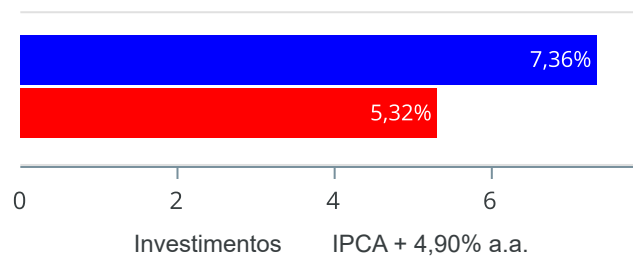
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2023)

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	31/05/2023	238	4127,598668	4.152,241569	982.368,48	988.233,49	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	26/08/2022	1.236	4.045,0527380	4.290,639168	4.999.685,18	5.303.230,01	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/04/2023	1.210	4132,126516	4.221,590976	4.999.873,08	5.108.125,08	Curva

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	88.961.312,60	38.156,12	782.435,33	89.503.405,39	1.286.372,00	1.286.372,00	1,45%	1,45%	0,95%	0,95%	152,09%	2,39%
Fevereiro	89.503.405,39	825.119,53	815.619,01	89.097.822,82	-415.083,09	871.288,91	-0,46%	0,98%	1,19%	2,15%	45,44%	2,00%
Março	89.097.822,82	1.021.407,32	834.710,28	89.919.132,68	634.612,82	1.505.901,73	0,71%	1,69%	1,15%	3,32%	50,96%	1,88%
Abril	89.919.132,68	13.452.743,78	13.446.922,16	90.719.015,59	794.061,29	2.299.963,02	0,88%	2,59%	0,95%	4,31%	60,14%	1,93%
Maio	90.719.015,59	1.894.245,52	1.863.442,46	92.654.127,96	1.904.309,31	4.204.272,33	2,10%	4,74%	0,65%	4,99%	95,15%	1,85%
Junho	92.654.127,96	630.440,71	1.042.186,87	94.555.298,37	2.312.916,57	6.517.188,90	2,50%	7,36%	0,32%	5,32%	138,29%	1,84%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



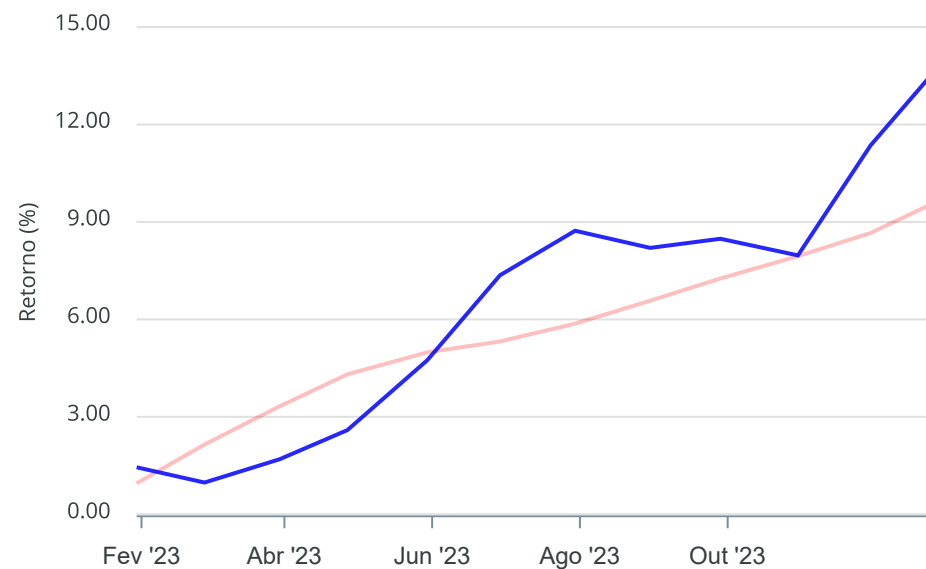
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

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

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
TÍTULOS PÚBLICOS	11.607.722,71	0,00	0,00	11.952.811,41	345.088,70	2,97%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	197.192,15	0,00	0,00	201.869,66	4.677,51	2,37%	2,37%	2,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.529.692,92	0,00	0,00	2.589.228,01	59.535,09	2,35%	2,35%	2,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.024.325,23	0,00	1.038.944,57	8.169.459,93	184.079,27	2,04%	2,10%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.790.632,89	0,00	0,00	3.859.021,28	68.388,39	1,80%	1,80%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.756.904,72	0,00	0,00	4.812.017,25	55.112,53	1,16%	1,16%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	253.747,67	0,00	0,00	256.685,97	2.938,30	1,16%	1,16%	0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	12.485.536,40	577.271,65	0,00	13.210.531,92	147.723,87	1,13%	1,16%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.270.093,28	0,00	0,00	1.283.969,45	13.876,17	1,09%	1,09%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.144.435,90	36.978,29	0,00	12.306.871,65	125.457,46	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.715.169,06	0,00	0,00	13.855.013,68	139.844,62	1,02%	1,02%	0,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	40.925,66	512,52	2.057,20	39.775,49	394,51	0,95%	1,00%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	15.656,25	15.678,25	1.185,10	30.276,00	126,60	0,40%	0,85%	0,00%
Total Renda Fixa	71.832.034,84	630.440,71	1.042.186,87	72.567.531,70	1.147.243,02	1,60%		0,66%

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 SMALL CAPS FIC AÇÕES	788.558,05	0,00	0,00	860.569,82	72.011,77	9,13%	9,13%	10,66%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.495.691,81	0,00	0,00	2.719.350,61	223.658,80	8,96%	8,96%	7,42%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.734.476,84	0,00	0,00	2.977.473,80	242.996,96	8,89%	8,89%	7,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.669.719,78	0,00	0,00	3.969.811,44	300.091,66	8,18%	8,18%	7,42%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.273.367,28	0,00	0,00	1.366.306,45	92.939,17	7,30%	7,30%	7,99%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	816.625,73	0,00	0,00	847.924,67	31.298,94	3,83%	3,83%	4,12%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.546.895,70	0,00	0,00	6.719.531,15	172.635,45	2,64%	2,64%	2,12%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	826.723,92	0,00	0,00	841.707,18	14.983,26	1,81%	1,81%	1,60%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.670.034,01	0,00	0,00	1.685.091,55	15.057,54	0,90%	0,90%	0,47%
Total Renda Variável	20.822.093,12	0,00	0,00	21.987.766,67	1.165.673,55	5,60%		5,10%

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	5.169.044,57	5.982.241,56	0,00	11.952.811,41	801.525,28	7,19%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.417.337,52	0,00	2.697.284,53	8.169.459,93	449.406,94	4,31%	4,86%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	10.643.770,63	2.171.394,84	0,00	13.210.531,92	395.366,45	3,09%	3,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	16.028.277,64	0,00	12.458.227,44	3.859.021,28	288.971,08	1,80%	5,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.275.897,99	4.755.718,46	0,00	12.306.871,65	275.255,20	2,29%	2,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	10.587.518,63	3.000.000,00	0,00	13.855.013,68	267.495,05	1,97%	2,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.418.432,86	0,00	0,00	2.589.228,01	170.795,15	7,06%	7,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.858.787,24	0,00	197.000,00	4.812.017,25	150.230,01	3,09%	3,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.028.971,53	0,00	800.000,00	1.283.969,45	54.997,92	2,71%	3,16%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	188.466,43	0,00	0,00	201.869,66	13.403,23	7,11%	7,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	248.844,60	0,00	0,00	256.685,97	7.841,37	3,15%	3,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	179.482,83	52.396,90	194.159,72	39.775,49	2.055,48	0,89%	2,90%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	20.050,81	15.678,25	5.879,80	30.276,00	426,74	1,19%	2,48%
Total Renda Fixa	70.064.883,28	15.977.430,01	16.352.551,49	72.567.531,70	2.877.769,90	3,34%	

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.528.676,06	0,00	0,00	3.969.811,44	441.135,38	12,50%	12,50%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.541.986,47	0,00	0,00	2.977.473,80	435.487,33	17,13%	17,13%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.356.363,22	0,00	0,00	6.719.531,15	363.167,93	5,71%	5,71%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.379.653,77	0,00	0,00	2.719.350,61	339.696,84	14,28%	14,28%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	674.472,16	0,00	0,00	860.569,82	186.097,66	27,59%	27,59%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.187.247,85	0,00	0,00	1.366.306,45	179.058,60	15,08%	15,08%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	745.429,30	0,00	0,00	847.924,67	102.495,37	13,75%	13,75%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.633.354,02	0,00	0,00	1.685.091,55	51.737,53	3,17%	3,17%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	807.066,55	0,00	0,00	841.707,18	34.640,63	4,29%	4,29%
Total Renda Variável	19.854.249,40	0,00	0,00	21.987.766,67	2.133.517,27	10,75%	

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	5.131.926,93	5.982.241,56	0,00	11.952.811,41	838.642,92	0,08%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	15.480.615,43	0,00	12.458.227,44	3.859.021,28	836.633,29	14,62%	8,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.446.105,51	0,00	5.100.265,40	8.169.459,93	823.619,82	13,14%	8,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	10.144.100,36	3.000.000,00	0,00	13.855.013,68	710.913,32	11,66%	6,56%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	8.667.479,79	3.863.714,57	0,00	13.210.531,92	679.337,56	13,15%	6,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.974.450,68	4.755.718,46	0,00	12.306.871,65	576.702,51	11,73%	6,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.705.827,02	0,00	197.000,00	4.812.017,25	303.190,23	12,89%	6,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.327.522,94	0,00	0,00	2.589.228,01	261.705,07	15,89%	11,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.877.308,46	90.852,74	800.000,00	1.283.969,45	115.808,25	12,73%	6,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	181.407,24	0,00	0,00	201.869,66	20.462,42	15,48%	11,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	240.825,02	0,00	0,00	256.685,97	15.860,95	13,03%	6,59%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	114.871,43	137.641,85	218.922,47	39.775,49	6.184,68	9,19%	5,98%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	8.539,90	31.943,80	10.900,80	30.276,00	693,10	8,08%	5,11%
Total Renda Fixa	62.750.599,46	7.950.496,13	29.197,83	72.306.320,06	1.634.422,30	2,31%	

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.338.494,44	0,00	0,00	6.719.531,15	381.036,71	14,50%	6,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.755.489,16	0,00	0,00	2.977.473,80	221.984,64	17,14%	8,06%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.814.921,49	0,00	0,00	3.969.811,44	154.889,95	13,18%	4,06%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.585.735,16	0,00	0,00	2.719.350,61	133.615,45	18,93%	5,17%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.233.736,23	0,00	0,00	1.366.306,45	132.570,22	16,70%	10,75%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	749.956,13	0,00	0,00	860.569,82	110.613,69	17,23%	14,75%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.581.240,05	0,00	0,00	1.685.091,55	103.851,50	13,20%	6,57%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	801.808,91	0,00	0,00	847.924,67	46.115,76	10,96%	5,75%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	798.950,32	0,00	0,00	841.707,18	42.756,86	12,77%	5,35%
Total Renda Variável	21.070.872,72	0,00	0,00	21.869.295,40	798.422,68	3,79%	

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.

