

Relatório Analítico dos Investimentos

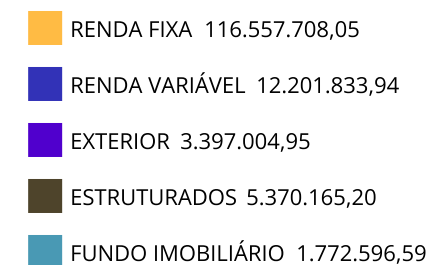
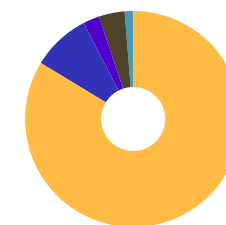
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	678.286,55	0,49%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	868.752,94	0,62%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.016.564,53	0,73%	3.044	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.923.101,29	1,38%	21.398	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	974.039,92	0,70%	267	2,72%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.997.095,55	2,15%	145	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	2.943.900,23	2,11%	270	0,92%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.347.132,42	1,68%	2.068	0,73%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.145.250,15	0,82%	17.299	0,25%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.251.754,80	1,62%	491	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.370.165,18	3,86%	50.212	0,21%	Artigo 10º, Inciso I
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.772.596,59	1,27%		4,69%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			139.299.308,73				

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

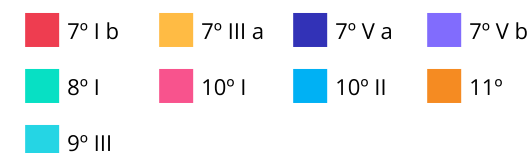
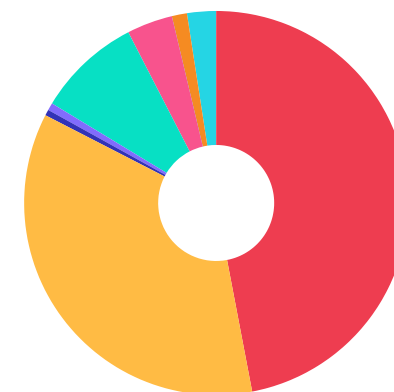
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,02%	81,95%	114.155.783,50
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	65.466.177,02	47,00%	20,49%	25,32%	81,95%	48.689.606,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	49.530.277,91	35,56%	20,89%	27,85%	60,00%	34.049.307,33
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	27.859.861,75
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	692.500,18	0,50%	0,60%	0,80%	5,00%	6.272.465,26
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	868.752,94	0,62%	0,73%	4,20%	5,00%	6.096.212,50
Total Renda Fixa	100,00%	116.557.708,05	83,67%	42,71%	75,19%	253,90%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	12.201.833,94	8,76%	5,89%	11,81%	20,00%	15.658.027,81
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.370.165,19	3,86%	3,75%	5,00%	10,00%	8.559.765,68
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,01
Artigo 11º	5,00%	1.772.596,59	1,27%	0,00%	2,00%	5,00%	5.192.368,85
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	19.344.595,73	13,89%	9,64%	18,81%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.397.004,95	2,44%	0,00%	5,00%	10,00%	10.532.925,92
Total Exterior	10,00%	3.397.004,95	2,44%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	60.482.380,90	43,42	0,01
CAIXA DTVM	39.534.825,14	28,38	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.307.743,01	21,04	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.943.900,23	2,11	-
SOMMA INVESTIMENTOS	2.347.132,42	1,68	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.772.596,59	1,27	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.016.564,53	0,73	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	868.752,94	0,62	5,58
PETRA CAPITAL	678.286,55	0,49	0,04
RJI CORRETORA DE VALORES	183.237,87	0,13	0,33
GENIAL GESTÃO LTDA	163.888,54	0,12	-
ÍNDIGO DTVM	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	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	49.530.277,91	35,56	20,89	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	692.500,18	0,50	0,60	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	868.752,94	0,62	0,73	5,00
Artigo 8º, Inciso I	12.201.833,94	8,76	5,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	3.397.004,95	2,44	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.370.165,19	3,86	3,75	10,00
Artigo 11º	1.772.596,59	1,27	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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,36%	8,32%	4,01%	8,32%	17,50%	32,14%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-20,16%	-53,80%	-29,49%	-53,80%	-37,00%	235,68%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
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%
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%
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%	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,03%	6,94%	2,52%	6,94%	9,94%	20,35%	0,90%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,23%	-5,57%	-0,65%	-5,57%	-20,54%	-28,03%	0,89%	0,14%
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%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,41%	2,66%	1,28%	2,66%	4,16%	6,19%	0,01%	0,01%
IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-

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 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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,37%	11,21%	7,03%	11,21%	13,18%	17,03%	2,17%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,10%	9,56%	5,47%	9,56%	16,61%	18,51%	0,90%	0,03%
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%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,72%	4,17%	2,05%	4,17%	8,24%	9,78%	0,06%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,50%	-7,99%	-7,49%	-7,99%	0,83%	-59,45%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12%	6,42%	3,25%	6,42%	13,55%	23,98%	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%
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%	-
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%
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%

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 MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,83%	5,26%	2,64%	5,26%	10,16%	17,57%	0,64%	0,02%
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	8,01%	5,57%	14,39%	5,57%	19,10%	-11,84%	6,95%	0,19%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8,96%	5,17%	14,28%	5,17%	12,53%	-7,54%	7,42%	0,17%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,96%	1,86%	14,48%	1,86%	12,06%	-17,44%	7,92%	0,18%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	8,13%	12,14%	19,64%	12,14%	23,39%	4,80%	7,11%	0,17%
IDIV (Benchmark)	8,78%	9,30%	13,95%	9,30%	17,73%	12,91%	-	-
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,75%	8,86%	13,83%	8,86%	16,88%	10,69%	7,49%	0,15%
IFIX (Benchmark)	4,71%	10,05%	14,28%	10,05%	12,87%	14,54%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1,15%	10,93%	4,05%	10,93%	20,70%	45,14%	0,26%	0,03%

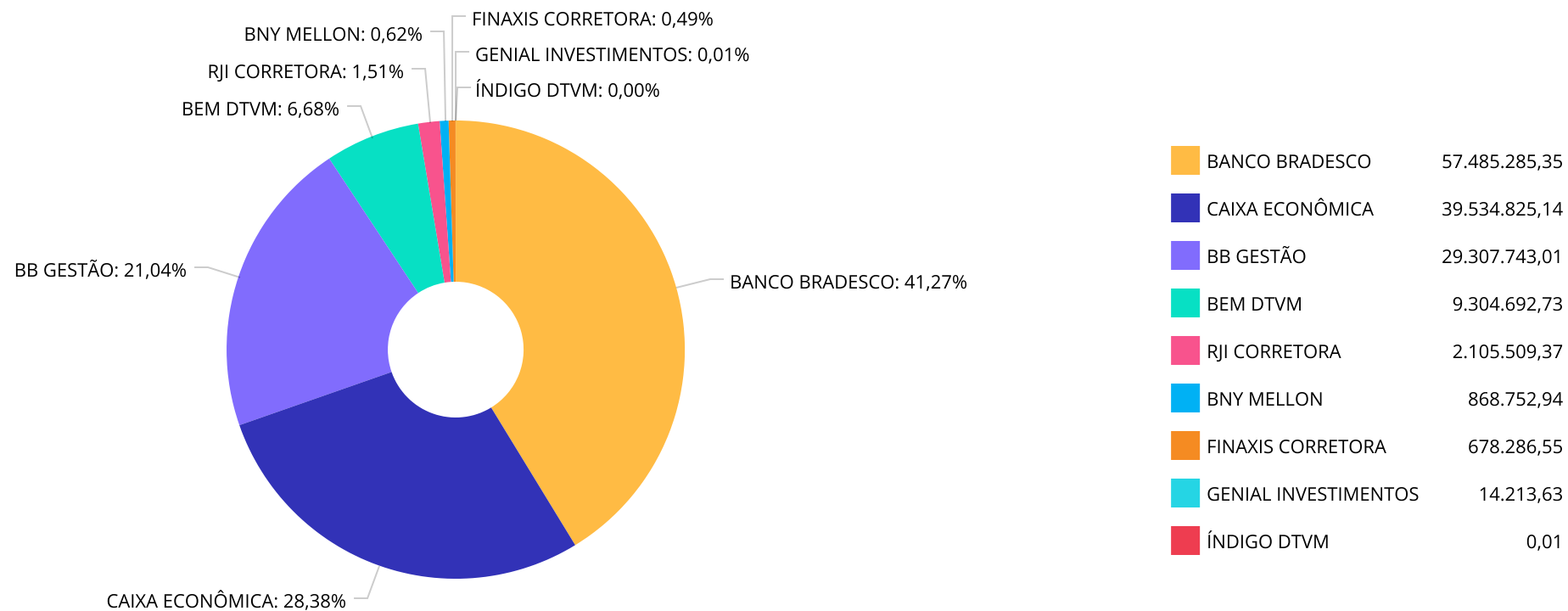
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	0,60%	7,08%	2,77%	7,08%	11,89%	35,84%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8,96%	9,59%	15,93%	9,59%	13,67%	-20,21%	9,11%	0,20%

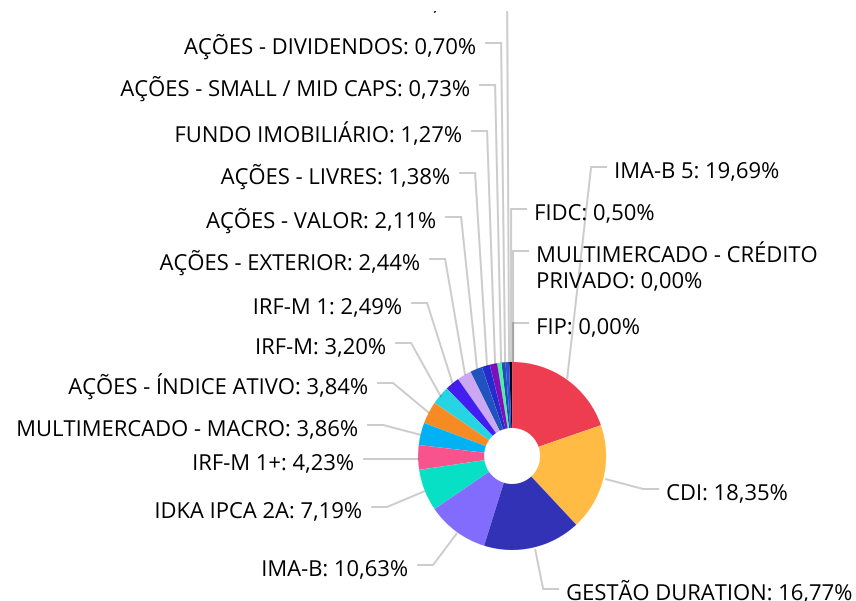
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	16,781%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,34%	28,45%	15,31%	28,45%	32,12%	-23,19%	7,84%	22,871%

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



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

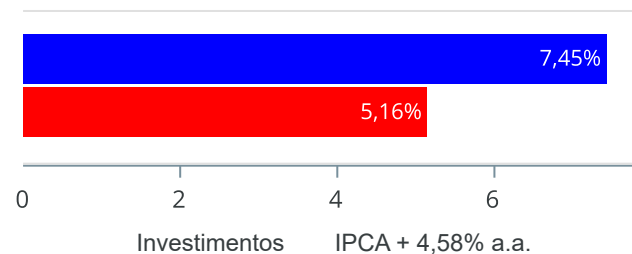


IMA-B 5	27.433.635,80	CDI	25.566.579,00	GESTÃO DURATION	23.361.269,29
IMA-B	14.808.599,27	IDKA IPCA 2A	10.010.172,37	IRF-M 1+	5.893.576,36
MULTIMERCADO - MACRO	5.370.165,18	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.344.227,97	IRF-M	4.459.226,56
IRF-M 1	3.463.396,28	AÇÕES - EXTERIOR	3.397.004,95	AÇÕES - VALOR	2.943.900,23
AÇÕES - LIVRES	1.923.101,29	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.772.596,59	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.016.564,53
AÇÕES - DIVIDENDOS	974.039,92	CRÉDITO PRIVADO	868.752,94	FIDC	692.500,18
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	0,01	FIP	0,01		

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	103.702.617,14	6.662.130,42	2.700.000,00	109.033.387,61	1.368.640,05	1.368.640,05	1,27%	1,27%	0,92%	0,92%	137,61%	2,39%
Fevereiro	109.033.387,61	0,00	0,00	109.049.471,45	16.083,84	1.384.723,89	0,01%	1,29%	1,16%	2,10%	61,31%	1,75%
Março	109.049.471,45	13.998.533,63	8.708.605,00	115.635.828,65	1.296.428,57	2.681.152,46	1,13%	2,43%	1,12%	3,24%	75,06%	1,92%
Abril	115.635.828,65	0,00	0,00	116.814.397,80	1.178.569,15	3.859.721,61	1,02%	3,48%	0,93%	4,21%	82,70%	1,48%
Mai	116.814.397,80	7.915.073,18	2.400.000,00	124.501.987,82	2.172.516,84	6.032.238,45	1,78%	5,32%	0,62%	4,86%	109,50%	1,41%
Junho	124.501.987,82	8.661.764,09	6.845.340,01	128.883.420,03	2.565.008,13	8.597.246,58	2,03%	7,45%	0,29%	5,16%	144,39%	1,58%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



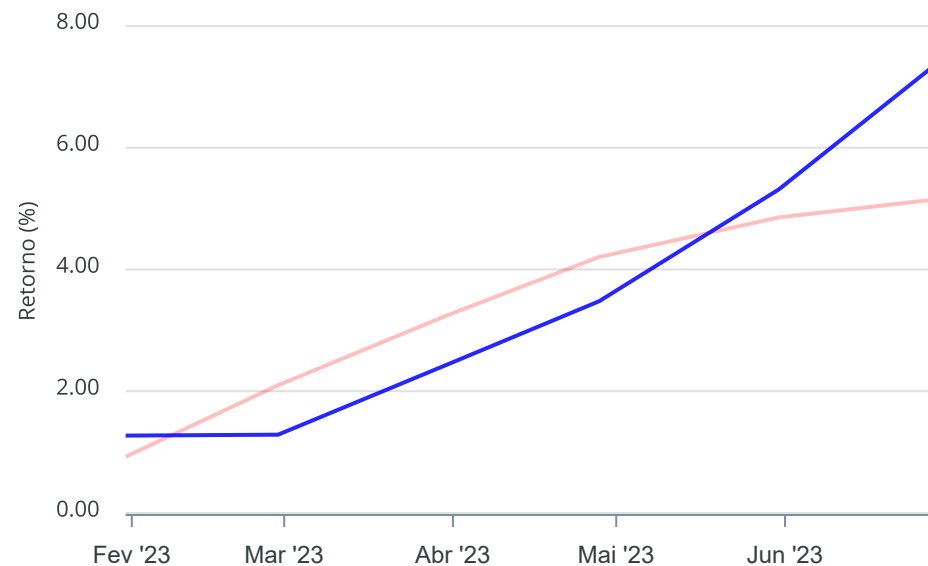
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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 ...	1.597.008,92	0,00	0,00	1.634.593,75	37.584,83	2,35%	2,35%	2,12%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	8.829.331,82	2.585.780,50	0,00	11.658.534,97	243.422,65	2,13%	2,37%	2,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.367.511,87	0,00	0,00	4.459.226,56	91.714,69	2,10%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.275.313,06	2.500.000,00	0,00	5.893.576,36	118.263,30	2,05%	2,63%	1,37%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.547.749,37	0,00	0,00	4.639.089,54	91.340,17	2,01%	2,01%	1,19%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.507.524,63	0,00	2.500.000,00	6.160.606,44	153.081,81	1,80%	2,10%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	14.812.724,37	0,00	2.500.000,00	12.561.573,31	248.848,94	1,68%	1,80%	0,95%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.423.750,50	0,00	0,00	3.463.396,28	39.645,78	1,16%	1,16%	0,11%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.993.872,33	0,00	0,00	20.220.293,80	226.421,47	1,13%	1,13%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.947.638,74	0,00	0,00	1.969.362,46	21.723,72	1,12%	1,12%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.349.621,86	0,00	0,00	2.375.292,22	25.670,36	1,09%	1,09%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.551.729,90	0,00	25.000,00	6.594.912,58	68.182,68	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.034.828,01	0,00	0,00	7.107.395,91	72.567,90	1,03%	1,03%	0,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.515.470,55	15.470,55	1,03%	2,37%	2,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.380.792,54	0,00	0,00	3.415.259,79	34.467,25	1,02%	1,02%	0,78%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	20.757.019,69	1.075.983,59	2.055.340,01	19.993.327,12	215.663,85	0,99%	1,03%	0,90%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	862.532,94	0,00	0,00	868.752,94	6.220,00	0,72%	0,72%	0,06%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	182.524,21	0,00	0,00	183.237,87	713,66	0,39%	0,41%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.001.630,52	1.630,52	0,16%	0,94%	0,47%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	150.010,56	0,00	0,00	149.674,90	-335,66	-0,22%	-0,23%	0,89%



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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	681.708,57	0,00	0,00	678.286,55	-3.422,02	-0,50%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	17.797,32	0,00	0,00	14.213,63	-3.583,69	-20,14%	-	-
Total Renda Fixa	113.270.991,21	8.661.764,09	7.080.340,01	116.557.708,05	1.705.292,76	1,48%		0,87%

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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	932.951,73	0,00	0,00	1.016.564,53	83.612,80	8,96%	8,96%	9,11%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.764.931,71	0,00	0,00	1.923.101,29	158.169,58	8,96%	8,96%	7,42%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	895.665,42	0,00	0,00	974.039,92	78.374,50	8,75%	8,75%	7,49%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.722.690,75	0,00	0,00	2.943.900,23	221.209,48	8,12%	8,12%	7,11%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.774.770,60	0,00	0,00	2.997.095,55	222.324,95	8,01%	8,01%	6,95%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2.174.170,48	0,00	0,00	2.347.132,42	172.961,94	7,96%	7,96%	7,92%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.325.916,21	0,00	0,00	5.370.165,18	44.248,97	0,83%	0,83%	0,64%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	1,15%	0,26%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.775.092,94	0,00	0,00	1.772.596,59	-2.496,35	-0,14%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	18.366.189,86	0,00	0,00	19.344.595,73	978.405,87	5,33%		4,89%



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 TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.097.577,25	0,00	0,00	1.145.250,15	47.672,90	4,34%	4,34%	7,84%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.241.263,65	0,00	0,00	2.251.754,80	10.491,15	0,47%	0,47%	6,60%
Total Exterior	3.338.840,90	0,00	0,00	3.397.004,95	58.164,05	1,74%		7,02%

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	14.356.389,85	0,00	2.500.000,00	12.561.573,31	705.183,46	4,91%	5,04%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.588.819,71	0,00	0,00	20.220.293,80	631.474,09	3,22%	3,22%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	8.444.672,50	2.585.780,50	0,00	11.658.534,97	628.081,97	5,69%	7,03%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	15.208.883,97	8.991.056,77	4.649.340,01	19.993.327,12	442.726,39	1,83%	2,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.284.358,50	0,00	2.500.000,00	6.160.606,44	376.247,94	4,54%	4,86%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.389.741,09	0,00	0,00	4.639.089,54	249.348,45	5,68%	5,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.145.825,60	2.500.000,00	0,00	5.893.576,36	247.750,76	4,39%	6,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.228.057,19	0,00	0,00	4.459.226,56	231.169,37	5,47%	5,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.929.406,26	0,00	0,00	7.107.395,91	177.989,65	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.481.652,64	0,00	25.000,00	6.594.912,58	138.259,94	2,13%	2,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.526.769,83	0,00	0,00	1.634.593,75	107.823,92	7,06%	7,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.357.594,76	0,00	0,00	3.463.396,28	105.801,52	3,15%	3,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.302.463,87	0,00	0,00	2.375.292,22	72.828,35	3,16%	3,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.345.041,41	0,00	0,00	3.415.259,79	70.218,38	2,10%	2,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.907.411,67	0,00	0,00	1.969.362,46	61.950,79	3,25%	3,25%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	851.072,13	0,00	0,00	868.752,94	17.680,81	2,08%	2,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.515.470,55	15.470,55	1,03%	7,11%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	180.925,41	0,00	0,00	183.237,87	2.312,46	1,28%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.001.630,52	1.630,52	0,16%	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	150.626,89	0,00	0,00	149.674,90	-951,99	-0,63%	-0,65%



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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	20.156,24	0,00	0,00	14.213,63	-5.942,61	-29,48%	-29,49%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	733.160,63	0,00	0,00	678.286,55	-54.874,08	-7,48%	-7,48%
Total Renda Fixa	105.433.030,15	16.576.837,27	9.674.340,01	116.557.708,05	4.222.180,64	3,76%	

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
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.460.644,03	0,00	0,00	2.943.900,23	483.256,20	19,64%	19,64%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.619.998,75	0,00	0,00	2.997.095,55	377.096,80	14,39%	14,39%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2.050.338,45	0,00	0,00	2.347.132,42	296.793,97	14,48%	14,48%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.682.870,61	0,00	0,00	1.923.101,29	240.230,68	14,28%	14,28%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	876.884,92	0,00	0,00	1.016.564,53	139.679,61	15,93%	15,93%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.232.301,17	0,00	0,00	5.370.165,18	137.864,01	2,63%	2,63%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	855.676,29	0,00	0,00	974.039,92	118.363,63	13,83%	13,83%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	4,05%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.781.208,61	0,00	0,00	1.772.596,59	-8.612,02	-0,48%	0,00%
Total Renda Variável	17.559.922,85	0,00	0,00	19.344.595,73	1.784.672,88	10,16%	



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 TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	993.167,27	0,00	0,00	1.145.250,15	152.082,88	15,31%	15,31%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.132.282,48	0,00	0,00	2.251.754,80	119.472,32	5,60%	5,60%
Total Exterior	3.125.449,75	0,00	0,00	3.397.004,95	271.555,20	8,69%	

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
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.893.504,24	6.662.130,42	8.700.000,00	20.220.293,80	1.364.659,14	4,95%	6,53%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	13.865.853,55	0,00	2.500.000,00	12.561.573,31	1.195.719,76	8,62%	8,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	6.185.511,67	4.545.203,02	0,00	11.658.534,97	927.820,28	8,65%	11,20%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	3.074.091,97	21.030.167,88	4.752.340,01	19.993.327,12	641.407,28	2,66%	6,94%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.023.779,97	0,00	2.500.000,00	6.160.606,44	636.826,47	7,94%	8,26%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.902.020,29	0,00	2.836.605,00	6.594.912,58	529.497,29	5,95%	6,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.260.929,70	0,00	637.811,00	7.107.395,91	484.277,21	6,67%	7,00%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.238.423,31	0,00	0,00	4.639.089,54	400.666,23	9,45%	9,45%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.070.294,35	0,00	0,00	4.459.226,56	388.932,21	9,56%	9,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.021.732,24	2.500.000,00	0,00	5.893.576,36	371.844,12	6,73%	11,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.249.388,64	0,00	0,00	3.463.396,28	214.007,64	6,59%	6,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.204.946,97	0,00	0,00	3.415.259,79	210.312,82	6,56%	6,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.469.377,91	0,00	0,00	1.634.593,75	165.215,84	11,24%	11,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.231.653,67	0,00	0,00	2.375.292,22	143.638,55	6,44%	6,44%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.850.507,05	0,00	0,00	1.969.362,46	118.855,41	6,42%	6,42%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	834.015,20	0,00	0,00	868.752,94	34.737,74	4,17%	4,17%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.515.470,55	15.470,55	1,03%	11,28%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	178.523,95	0,00	0,00	183.237,87	4.713,92	2,64%	2,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.001.630,52	1.630,52	0,16%	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	158.493,81	0,00	0,00	149.674,90	-8.818,91	-5,56%	-5,57%

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	30.764,31	0,00	0,00	14.213,63	-16.550,68	-53,80%	-53,80%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	737.185,10	0,00	0,00	678.286,55	-58.898,55	-7,99%	-7,99%
Total Renda Fixa	93.480.997,90	37.237.501,32	21.926.756,01	116.557.708,05	7.765.964,84	7,14%	

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
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.625.166,24	0,00	0,00	2.943.900,23	318.733,99	12,14%	12,14%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.101.802,17	0,00	0,00	5.370.165,18	268.363,01	5,26%	5,26%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.838.923,00	0,00	0,00	2.997.095,55	158.172,55	5,57%	5,57%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.828.609,59	0,00	0,00	1.923.101,29	94.491,70	5,17%	5,17%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	927.581,59	0,00	0,00	1.016.564,53	88.982,94	9,59%	9,59%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	894.766,22	0,00	0,00	974.039,92	79.273,70	8,86%	8,86%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2.304.179,71	0,00	0,00	2.347.132,42	42.952,71	1,86%	1,86%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	10,93%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.800.121,11	0,00	0,00	1.772.596,59	-27.524,52	-1,53%	0,00%
Total Renda Variável	18.321.149,65	0,00	0,00	19.344.595,73	1.023.446,08	5,59%	



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.966.083,33	0,00	0,00	2.251.754,80	285.671,47	14,53%	14,53%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	891.612,93	0,00	0,00	1.145.250,15	253.637,22	28,45%	28,45%
Total Exterior	2.857.696,26	0,00	0,00	3.397.004,95	539.308,69	18,87%	

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.

