

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			3.169.047,66	13,36%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	791.726,13	3,34%	664	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.025.613,25	4,32%	942	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	62.578,89	0,26%	783	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	95.145,62	0,40%	1.136	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	60.696,64	0,26%	515	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.348.583,04	9,90%	773	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.547.899,17	6,53%	901	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.018.432,24	4,29%	927	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	397.671,12	1,68%	1.186	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.127,58	0,00%	352	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.856.180,31	12,04%	1.126	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.671.767,37	11,27%	1.004	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CDB - BANCO DAYCOVAL	S/Info	Não Há	280.201,20	1,18%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não possui	477.135,57	2,01%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	1.060.844,53	4,47%	115	0,46%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	353.917,97	1,49%	1.074	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	396.158,35	1,67%	12.084	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.320.485,02	5,57%	443	0,92%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL TOP SELEÇÃO FIC AÇÕES	D+32	Não há	368.035,46	1,55%	92	3,31%	Artigo 8º, Inciso I

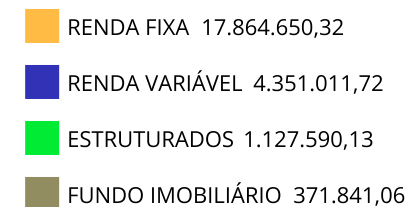
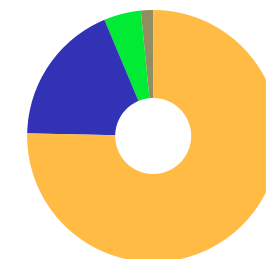


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	815.352,38	3,44%	136	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	255.528,84	1,08%	4.441	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
TARUÁ FIC AÇÕES	D+32	Não há	216.030,84	0,91%	121	1,05%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	625.502,86	2,64%	31	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.009.921,07	4,26%	5.795	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	117.669,06	0,50%	3.117	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	Não se ...	Não se aplica	37.604,80	0,16%		0,00%	Artigo 11º
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	58.856,26	0,25%		0,08%	Artigo 11º
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	275.380,00	1,16%		0,22%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			23.715.093,23				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			7.416,25				Artigo 6º
PL Total			23.722.509,48				

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

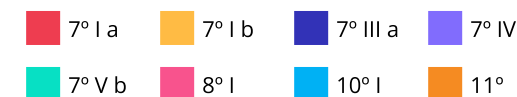
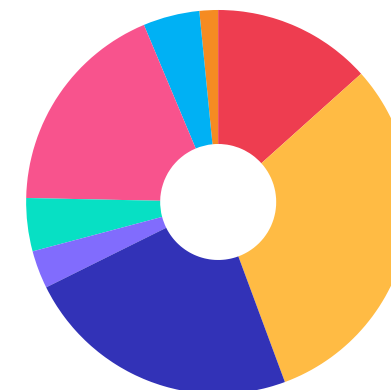
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	3.169.047,66	13,36%	11,00%	15,21%	81,95%	16.265.471,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	7.349.473,68	30,99%	20,31%	21,13%	81,95%	12.085.045,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	5.527.947,68	23,31%	12,71%	27,62%	60,00%	8.701.108,26
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	757.336,77	3,19%	1,26%	1,68%	20,00%	3.985.681,88
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	1.060.844,53	4,47%	4,50%	5,00%	5,00%	124.910,13
Total Renda Fixa	100,00%	17.864.650,32	75,33%	49,78%	70,64%	248,90%	



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%	4.351.011,72	18,35%	1,89%	16,46%	20,00%	392.006,93
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.127.590,13	4,75%	3,75%	5,00%	10,00%	1.243.919,19
Artigo 11º	5,00%	371.841,06	1,57%	1,43%	1,90%	5,00%	813.913,60
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	5.850.442,91	24,67%	7,07%	23,36%	35,00%	

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%	2.371.509,32
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	11.081.702,44	46,73	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.891.940,84	20,63	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	3.169.047,66	13,36	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.688.520,48	7,12	0,02
META ASSET MANAGEMENT	815.352,38	3,44	0,40
TRÍGONO CAPITAL	625.502,86	2,64	0,01
BANCO BTG PACTUAL	477.135,57	2,01	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	255.528,84	1,08	0,00
TARUÁ CAPITAL	216.030,84	0,91	-
SICREDI	117.669,06	0,50	0,00
ZION INVEST	58.856,26	0,25	-
BV ASSET	37.604,80	0,16	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 '	3.169.047,66	13,36	11,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	7.349.473,68	30,99	20,31	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	5.527.947,68	23,31	12,71	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	1.060.844,53	4,47	4,50	5,00
Artigo 8º, Inciso I	4.351.011,72	18,35	1,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.127.590,13	4,75	3,75	10,00
Artigo 11º	371.841,06	1,57	1,43	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
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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,41%	5,86%	2,19%	5,86%	9,33%	29,66%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,03%	6,93%	2,52%	6,93%	10,48%	19,14%	0,89%	0,02%
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%
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%
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%	-	-
CDB - BANCO DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
TARUÁ FIC AÇÕES	8,88%	8,70%	18,45%	8,70%	23,20%	-16,42%	10,29%	0,22%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	6,44%	3,16%	6,44%	13,54%	23,74%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
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%

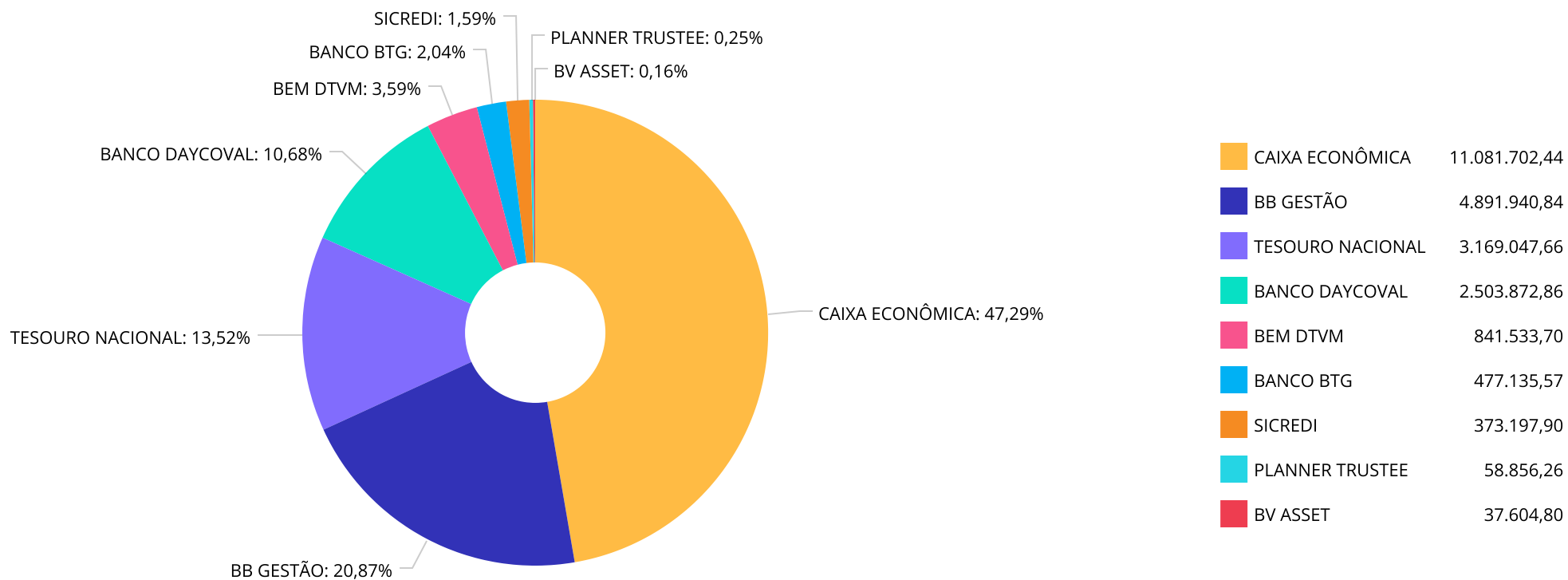
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	12,52%	-5,21%	20,00%	-5,21%	-13,76%	-	13,53%	0,31%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
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%	-	-
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	8,09%	8,08%	15,82%	8,08%	19,68%	-4,53%	6,70%	0,17%
TARUÁ FIC AÇÕES	8,88%	8,70%	18,45%	8,70%	23,20%	-16,42%	10,29%	0,22%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,83%	5,75%	13,75%	5,75%	20,97%	2,64%	4,12%	0,22%
DAYCOVAL TOP SELEÇÃO FIC AÇÕES	6,99%	-2,98%	8,20%	-2,98%	10,14%	-30,07%	8,45%	0,23%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8,65%	3,42%	12,04%	3,42%	16,88%	-15,20%	7,79%	0,18%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8,89%	8,06%	17,13%	8,06%	15,45%	-16,81%	7,53%	0,21%
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%
IFIX (Benchmark)	4,71%	10,05%	14,28%	10,05%	12,87%	14,54%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	15,49%	24,89%	25,87%	24,89%	24,34%	-6,08%	11,74%	0,22%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	7,29%	-26,95%	-8,44%	-26,95%	-50,48%	154,32%	14,96%	0,31%

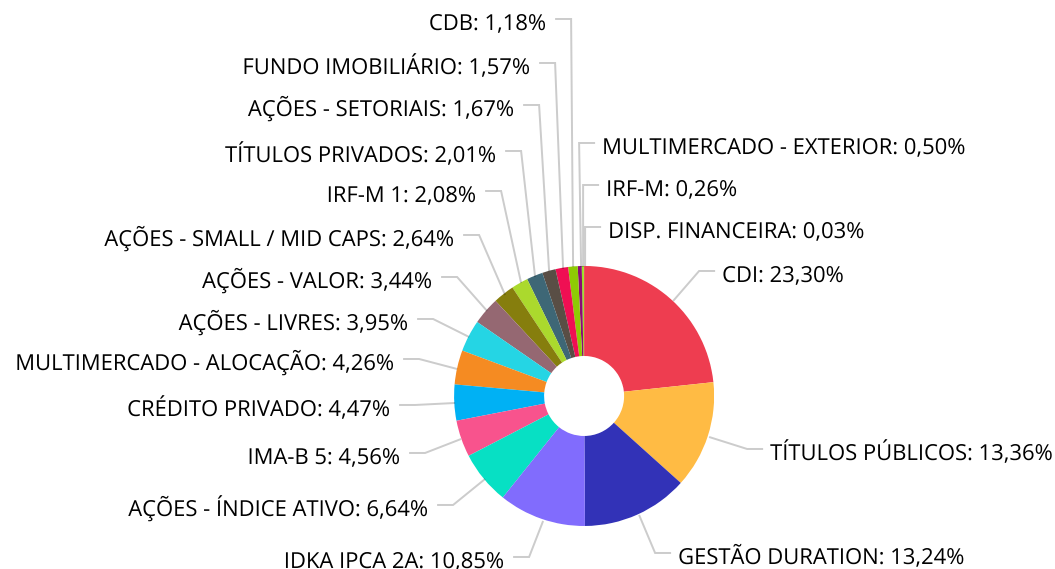
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	6,68%	15,74%	16,81%	15,74%	23,32%	-14,03%	5,07%	0,17%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	6,47%	15,91%	8,30%	15,91%	17,57%	3,56%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,06%	20,38%	10,51%	20,38%	28,85%	21,58%	5,05%	0,20%

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



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



■ CDI	5.527.947,68	■ TÍTULOS PÚBLICOS	3.169.047,66	■ GESTÃO DURATION	3.140.309,17	■ IDKA IPCA 2A	2.573.512,42
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.576.013,86	■ IMA-B 5	1.081.011,13	■ CRÉDITO PRIVADO	1.060.844,53	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.009.921,07
■ AÇÕES - LIVRES	937.984,27	■ AÇÕES - VALOR	815.352,38	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	625.502,86	■ IRF-M 1	492.816,74
■ TÍTULOS PRIVADOS	477.135,57	■ AÇÕES - SETORIAIS	396.158,35	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	371.841,06	■ CDB	280.201,20
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	117.669,06	■ IRF-M	61.824,22	■ DISP. FINANCEIRA	7.416,25		



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

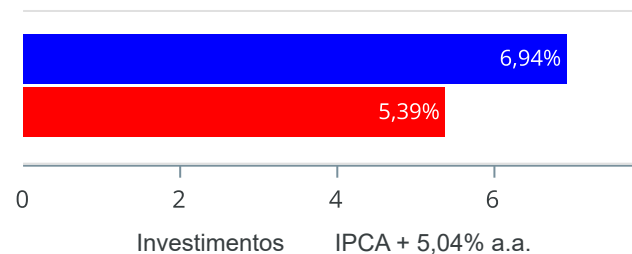
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	16/12/2022	118	4.027,194741	4.284,293039	475.208,98	505.546,58	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	06/05/2022	333	4209,710000	4.459,149933	1.401.833,43	1.484.896,93	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	16/05/2022	113	4152,810000	4.434,879497	469.267,53	501.141,38	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	02/09/2022	118	4108,850000	4.500,457537	484.844,30	531.053,99	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	21.160.591,24	1.594.756,10	2.289.081,39	20.742.705,88	276.439,93	276.439,93	1,31%	1,31%	0,96%	0,96%	135,73%	3,35%
Fevereiro	20.742.705,88	655.000,00	5.000,00	21.114.990,72	-277.715,16	-1.275,23	-1,30%	-0,01%	1,19%	2,17%	-0,40%	2,71%
Março	21.114.990,72	743.802,64	674.029,55	21.268.875,69	84.111,88	82.836,65	0,40%	0,39%	1,16%	3,36%	11,57%	3,03%
Abril	21.268.875,69	522.000,00	551.000,00	21.411.108,24	171.232,55	254.069,20	0,81%	1,20%	0,96%	4,35%	27,48%	3,01%
Mai	21.411.108,24	657.000,00	564.000,00	21.973.564,94	469.456,70	723.525,90	2,18%	3,41%	0,66%	5,04%	67,53%	2,92%
Junho	21.973.564,94	1.514.000,00	557.300,00	23.715.093,23	784.828,29	1.508.354,19	3,42%	6,94%	0,33%	5,39%	128,84%	2,49%

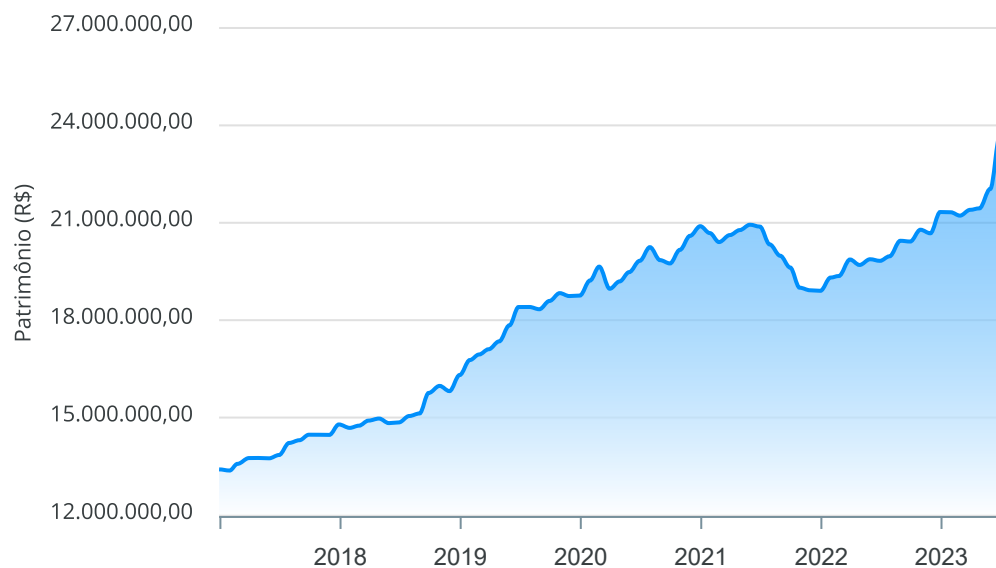
Investimentos x Meta de Rentabilidade



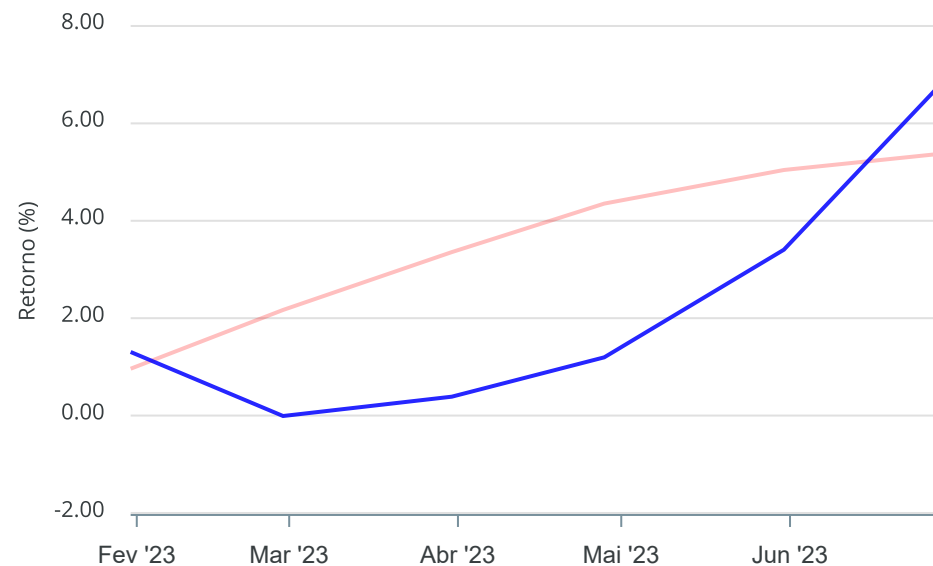
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	2.941.225,00	0,00	0,00	3.169.047,66	227.822,66	7,75%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.300.169,51	0,00	0,00	2.348.583,04	48.413,53	2,10%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.104,39	0,00	0,00	1.127,58	23,19	2,10%	2,10%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	777.695,40	0,00	0,00	791.726,13	14.030,73	1,80%	1,80%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	94.055,90	0,00	0,00	95.145,62	1.089,72	1,16%	1,16%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	393.118,97	0,00	0,00	397.671,12	4.552,15	1,16%	1,16%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.484.887,39	158.000,00	0,00	2.671.767,37	28.879,98	1,09%	1,12%	0,01%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.047,58	54.000,00	0,00	60.696,64	649,06	1,08%	2,09%	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.531.917,20	0,00	0,00	1.547.899,17	15.981,97	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.049.988,47	0,00	0,00	1.060.844,53	10.856,06	1,03%	1,03%	0,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.008.033,85	0,00	0,00	1.018.432,24	10.398,39	1,03%	1,03%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	61.940,34	0,00	0,00	62.578,89	638,55	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.015.262,63	0,00	0,00	1.025.613,25	10.350,62	1,02%	1,02%	0,78%
CDB - BANCO DAYCOVAL	277.703,28	0,00	0,00	280.201,20	2.497,92	0,90%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.089.955,35	1.302.000,00	557.300,00	2.856.180,31	21.524,96	0,63%	1,09%	0,01%
LETRA FINANCEIRA BTG	474.817,50	0,00	0,00	477.135,57	2.318,07	0,49%	-	-
Total Renda Fixa	16.507.922,76	1.514.000,00	557.300,00	17.864.650,32	400.027,56	2,29%		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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	238.455,00	0,00	0,00	275.380,00	36.925,00	15,49%	15,49%	11,74%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	352.087,99	0,00	0,00	396.158,35	44.070,36	12,52%	12,52%	13,53%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	325.034,08	0,00	0,00	353.917,97	28.883,89	8,89%	8,89%	7,53%
TARUÁ FIC AÇÕES	198.412,42	0,00	0,00	216.030,84	17.618,42	8,88%	8,88%	10,29%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.215.348,62	0,00	0,00	1.320.485,02	105.136,40	8,65%	8,65%	7,79%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	236.412,93	0,00	0,00	255.528,84	19.115,91	8,09%	8,09%	6,70%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	54.856,32	0,00	0,00	58.856,26	3.999,94	7,29%	7,29%	14,96%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	109.911,06	0,00	0,00	117.669,06	7.758,00	7,06%	7,06%	5,05%
DAYCOVAL TOP SELEÇÃO FIC AÇÕES	343.985,64	0,00	0,00	368.035,46	24.049,82	6,99%	6,99%	8,45%
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	35.248,80	0,00	0,00	37.604,80	2.356,00	6,68%	6,68%	5,07%
META VALOR FI AÇÕES	769.500,68	0,00	0,00	815.352,38	45.851,70	5,96%	5,76%	8,92%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕE...	602.414,05	0,00	0,00	625.502,86	23.088,81	3,83%	3,83%	4,12%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	983.974,59	0,00	0,00	1.009.921,07	25.946,48	2,64%	2,64%	2,12%
Total Renda Variável	5.465.642,18	0,00	0,00	5.850.442,91	384.800,73	7,04%		7,22%



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	2.801.887,00	0,00	0,00	3.169.047,66	367.160,66	13,10%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.239.832,35	0,00	0,00	2.348.583,04	108.750,69	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.278.355,64	314.000,00	0,00	2.671.767,37	79.411,73	3,06%	3,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.793.145,88	1.668.000,00	1.672.300,00	2.856.180,31	67.334,43	1,51%	3,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	753.737,00	0,00	0,00	791.726,13	37.989,13	5,04%	5,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.362.463,00	155.000,00	0,00	1.547.899,17	30.436,17	2,01%	2,14%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.034.756,45	0,00	0,00	1.060.844,53	26.088,08	2,52%	2,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	992.927,77	0,00	0,00	1.018.432,24	25.504,47	2,57%	2,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	507.876,88	502.000,00	0,00	1.025.613,25	15.736,37	1,56%	2,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	385.522,85	0,00	0,00	397.671,12	12.148,27	3,15%	3,15%
LETRA FINANCEIRA BTG	465.002,54	0,00	0,00	477.135,57	12.133,03	2,61%	-
CDB - BANCO DAYCOVAL	271.139,97	0,00	0,00	280.201,20	9.061,23	3,34%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	92.248,46	0,00	0,00	95.145,62	2.897,16	3,14%	3,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	61.018,72	0,00	0,00	62.578,89	1.560,17	2,56%	2,56%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.855,91	54.000,00	0,00	60.696,64	840,73	1,40%	5,43%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.069,13	0,00	0,00	1.127,58	58,45	5,47%	5,47%
Total Renda Fixa	16.046.839,55	2.693.000,00	1.672.300,00	17.864.650,32	797.110,77	4,67%	



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
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	1.178.598,33	0,00	0,00	1.320.485,02	141.886,69	12,04%	12,04%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	549.893,37	0,00	0,00	625.502,86	75.609,49	13,75%	13,75%
META VALOR FI AÇÕES	741.020,16	0,00	0,00	815.352,38	74.332,22	10,03%	9,82%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	330.125,10	0,00	0,00	396.158,35	66.033,25	20,00%	20,00%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	218.785,00	0,00	0,00	275.380,00	56.595,00	25,87%	25,87%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	955.338,26	0,00	0,00	1.009.921,07	54.582,81	5,71%	5,71%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	302.153,67	0,00	0,00	353.917,97	51.764,30	17,13%	17,13%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	220.634,16	0,00	0,00	255.528,84	34.894,68	15,82%	15,82%
TARUÁ FIC AÇÕES	182.378,13	0,00	0,00	216.030,84	33.652,71	18,45%	18,45%
DAYCOVAL TOP SELEÇÃO FIC AÇÕES	340.151,94	0,00	0,00	368.035,46	27.883,52	8,20%	8,20%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	106.479,67	0,00	0,00	117.669,06	11.189,39	10,51%	10,51%
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	32.193,60	0,00	0,00	37.604,80	5.411,20	16,81%	16,81%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	64.284,75	0,00	0,00	58.856,26	-5.428,49	-8,44%	-8,44%
Total Renda Variável	5.222.036,14	0,00	0,00	5.850.442,91	628.406,77	12,03%	

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
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	0,00	0,00	477.135,57	477.135,57	0,00%	-
TÍTULOS PÚBLICOS	2.746.334,21	0,00	0,00	3.169.047,66	422.713,45	15,39%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.708.251,96	0,00	550.000,00	2.348.583,04	190.331,08	7,03%	8,26%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.765.282,51	764.735,45	0,00	2.671.767,37	141.749,41	5,60%	6,42%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.388.581,76	3.237.500,00	1.905.278,30	2.856.180,31	135.376,85	2,93%	6,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.305.432,24	155.000,00	0,00	1.547.899,17	87.466,93	5,99%	6,60%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	992.135,55	0,00	0,00	1.060.844,53	68.708,98	6,93%	6,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	951.773,01	0,00	0,00	1.018.432,24	66.659,23	7,00%	7,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	727.982,93	0,00	0,00	791.726,13	63.743,20	8,76%	8,76%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	431.360,15	559.557,19	0,00	1.025.613,25	34.695,91	3,50%	6,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	373.098,53	0,00	0,00	397.671,12	24.572,59	6,59%	6,59%
CDB - BANCO DAYCOVAL	352.972,89	262.743,85	356.567,80	280.201,20	21.052,26	3,42%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	788.059,55	54.000,00	788.000,00	60.696,64	6.637,09	0,79%	9,44%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	105.738,08	0,00	16.500,00	95.145,62	5.907,54	5,59%	6,49%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	58.490,65	0,00	0,00	62.578,89	4.088,24	6,99%	6,99%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	871.239,07	0,00	875.064,84	0,00	3.825,77	0,44%	5,98%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	149.329,45	0,00	149.000,00	1.127,58	798,13	0,53%	9,56%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	0,00	453.022,25	0,00	0,00	-453.022,25	-100,00%	-
Total Renda Fixa	15.716.062,54	5.486.558,74	4.640.410,94	17.864.650,32	1.302.439,98	7,86%	

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	952.652,64	0,00	0,00	1.009.921,07	57.268,43	6,01%	6,01%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	220.500,00	0,00	0,00	275.380,00	54.880,00	24,89%	24,89%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.276.834,93	0,00	0,00	1.320.485,02	43.650,09	3,42%	3,42%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	591.483,87	0,00	0,00	625.502,86	34.018,99	5,75%	5,75%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	327.531,73	0,00	0,00	353.917,97	26.386,24	8,06%	8,06%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	97.744,90	0,00	0,00	117.669,06	19.924,16	20,38%	20,38%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	236.429,48	0,00	0,00	255.528,84	19.099,36	8,08%	8,08%
TARUÁ FIC AÇÕES	0,00	200.000,00	0,00	216.030,84	16.030,84	8,02%	8,69%
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	32.490,00	0,00	0,00	37.604,80	5.114,80	15,74%	15,74%
DAYCOVAL TOP SELEÇÃO FIC AÇÕES	379.328,31	0,00	0,00	368.035,46	-11.292,85	-2,98%	-2,98%
META VALOR FI AÇÕES	831.872,74	0,00	0,00	815.352,38	-16.520,36	-1,99%	-2,17%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	79.713,09	0,00	0,00	58.856,26	-20.856,83	-26,16%	-26,95%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	417.947,01	0,00	0,00	396.158,35	-21.788,66	-5,21%	-5,21%
Total Renda Variável	5.444.528,70	200.000,00	0,00	5.850.442,91	205.914,21	3,65%	

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.

