



CRÉDITO  
& MERCADO

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2023



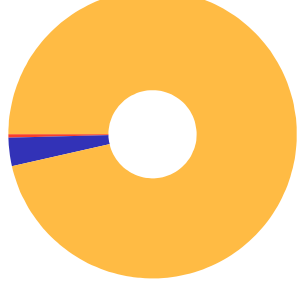
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	9.619.553,08	12,73%	664	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.015.380,69	7,96%	942	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.717.089,38	8,89%	783	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.563.349,12	7,36%	572	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	658.855,92	0,87%	1.136	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.305.564,04	1,73%	61	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	2.170.226,36	2,87%	120	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.450.313,96	13,83%	773	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.056.660,81	4,04%	901	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.794.744,39	8,99%	927	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.075.513,65	8,04%	723	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	2.107.261,11	2,79%	61.343	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	6.443.175,80	8,52%	1.126	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.926.283,83	7,84%	1.004	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC-AÇÕES	D+3	Não há	308.368,10	0,41%	29.477	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC-AÇÕES	D+3	Não há	1.746.999,74	2,31%	21.398	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	344.654,79	0,46%	5.984	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	282.972,88	0,37%	11.624	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>75.586.967,65</b>				



**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%	25,00%	50,00%	37.793.483,83
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	58.427.251,40	77,30%	21,25%	27,75%	95,60%	13.833.889,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	14.476.720,74	19,15%	20,95%	27,94%	60,00%	30.875.459,85
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.117.393,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.779.348,38
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>72.903.972,14</b>	<b>96,45%</b>	<b>42,20%</b>	<b>85,69%</b>	<b>230,60%</b>	



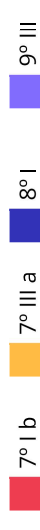
RENDA FIXA 72.903.972,14  
RENDA VARIÁVEL 2.400.022,63  
EXTERIOR 282.972,88



**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%	2.400.022,63	3,18%	3,59%	5,00%	20,00%	12.717.370,90
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,31%	10,00%	7.558.696,77
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>2.400.022,63</b>	<b>3,18%</b>	<b>3,59%</b>	<b>9,31%</b>	<b>30,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	282.972,88	0,37%	0,00%	5,00%	10,00%	7.275.723,89
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>282.972,88</b>	<b>0,37%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	





Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.938.796,22	56,81	-
CAIXA DTVM	32.648.171,43	43,19	-

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	58.427.251,40	77,30	21,25	95,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	14.476.720,74	19,15	20,95	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	2.400.022,63	3,18	3,59	20,00
Artigo 9º, Inciso III	282.972,88	0,37	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>	2,65%	11,41%	6,89%	11,41%	18,80%	17,59%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,63%	11,17%	6,84%	11,17%	18,22%	16,71%	1,37%	0,04%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	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%
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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	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%



**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 ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,41%	4,61%	1,70%	4,61%	10,96%	-	0,89%	0,01%
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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12%	6,42%	3,25%	6,42%	13,55%	23,98%	0,01%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	<b>-0,08%</b>	<b>2,87%</b>	<b>0,76%</b>	<b>2,87%</b>	<b>3,16%</b>	<b>15,42%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,18%	11,77%	7,06%	11,77%	13,08%	-	2,16%	0,04%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8,96%	5,17%	14,28%	5,17%	12,53%	-7,54%	7,42%	0,17%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7,40%	2,75%	10,27%	2,75%	6,15%	-28,95%	7,62%	0,21%
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	0,56%	6,31%	2,18%	6,31%	7,04%	-4,52%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,38%	7,15%	3,82%	7,15%	9,33%	-2,81%	6,71%	0,15%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	8,03%	13,04%	24,57%	13,04%	18,85%	-28,83%	10,00%	0,27%



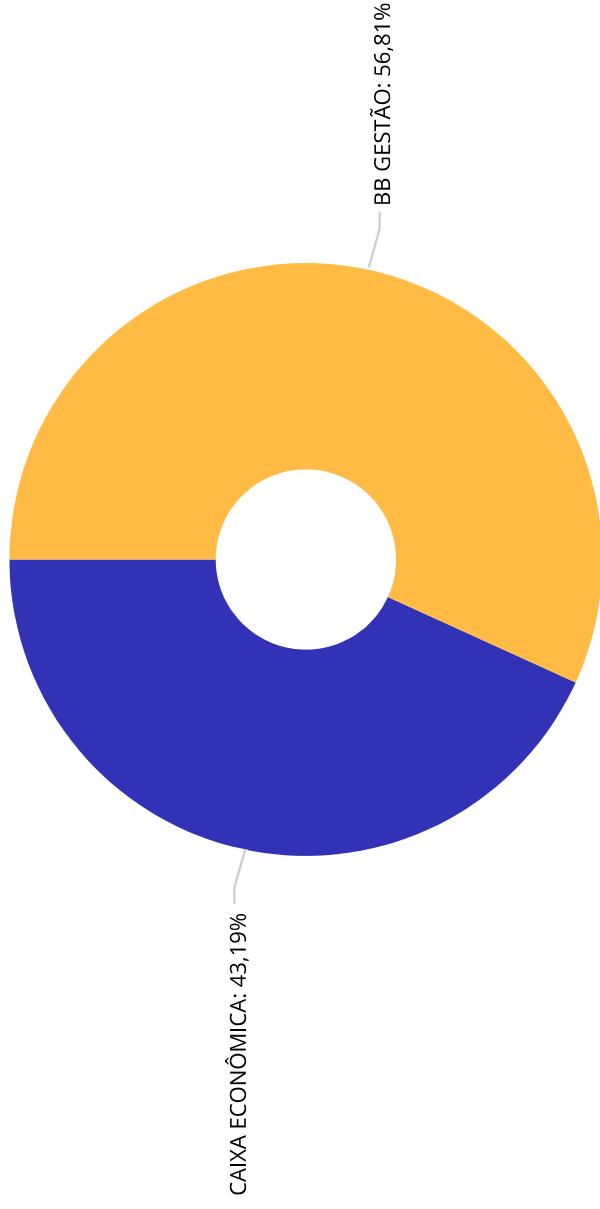


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

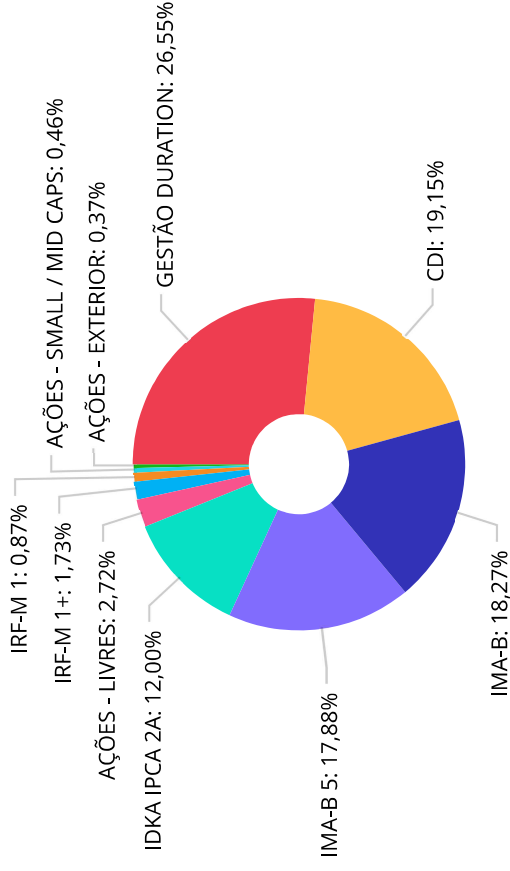
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	0,56%	6,31%	2,18%	6,31%	7,04%	-4,52%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,38%	7,15%	3,82%	7,15%	9,33%	-2,81%	6,71%	15,065%



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



BB GESTÃO	42.938.796,22
CAIXA ECONÔMICA	32.648.171,43



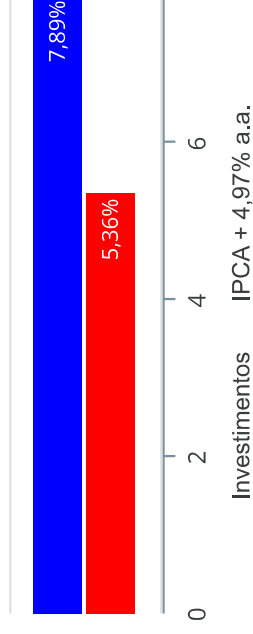
Sub-Segmento	Valor	Sub-Segmento	Valor
■ GESTÃO DURATION	20.069.867,04	■ IMA-B	14.476.720,74
■ IDKA IPCA 2A	9.072.041,50	■ IRF-M 1+	2.055.367,84
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	344.654,79	■ AÇÕES - EXTERIOR	282.972,88
■ CDI	20.069.867,04	■ IMA-B 5	13.809.089,13
■ AÇÕES - LIVRES	9.072.041,50	■ IRF-M 1	1.305.564,04
■ AÇÕES - EXTERIOR	344.654,79		658.855,92



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	67.604.623,89	650.466,88	807.000,00	68.148.346,73	700.255,96	700.255,96	1,04%	1,04%	0,96%	0,96%	108,28%	1,63%
Fevereiro	68.148.346,73	3.096.919,62	3.020.248,30	68.785.329,89	560.311,84	1.260.567,80	0,82%	1,87%	1,19%	2,16%	86,45%	1,40%
Março	68.785.329,89	3.983.119,32	1.009.000,00	72.764.776,52	1.005.327,31	2.265.895,11	1,40%	3,29%	1,16%	3,34%	98,59%	1,07%
Abril	72.764.776,52	829.829,93	986.700,00	73.420.681,89	812.775,44	3.078.670,55	1,12%	4,45%	0,96%	4,33%	102,67%	1,02%
Mai	73.420.681,89	2.990.734,38	3.128.267,54	74.390.912,38	1.107.763,65	4.186.434,20	1,51%	6,02%	0,66%	5,01%	120,09%	0,97%
Junho	74.390.912,38	880.466,84	991.700,00	75.586.967,65	1.307.288,43	5.493.722,63	1,76%	7,89%	0,32%	5,36%	147,24%	1,21%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

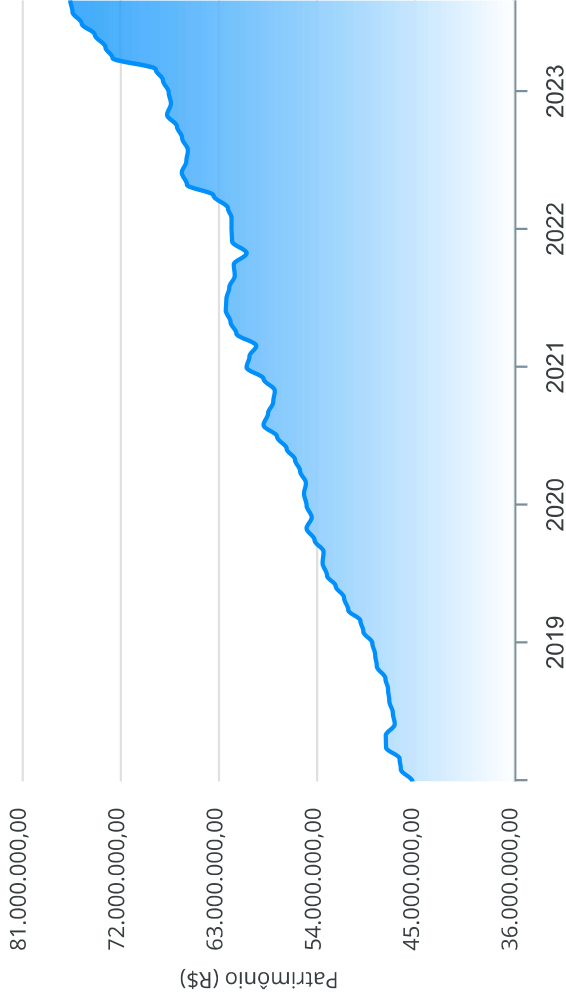




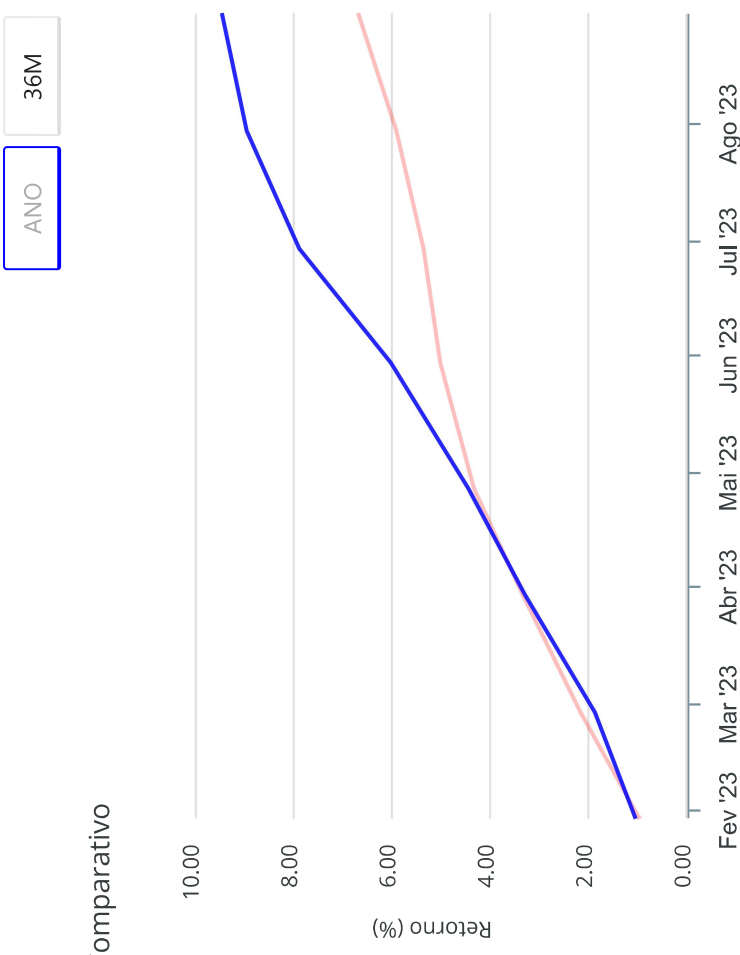
CRÉDITO  
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 (%)	(%) Insttit	Var - Mês
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.272.132,00	0,00	0,00	1.305.564,04	33.432,04	2,63%	2,63%	1,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.434.441,01	0,00	0,00	5.563.349,12	128.908,11	2,37%	2,37%	2,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.935.817,08	0,00	0,00	6.075.513,65	139.696,57	2,35%	2,35%	2,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	2.123.895,90	0,00	0,00	2.170.226,36	46.330,46	2,18%	2,18%	2,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.234.891,88	0,00	0,00	10.450.313,96	215.422,08	2,10%	2,10%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	9.449.078,33	0,00	0,00	9.619.553,08	170.474,75	1,80%	1,80%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	642.039,40	11.000,00	1.700,00	658.855,92	7.516,52	1,15%	1,16%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.860.911,95	0,00	0,00	5.926.283,83	65.371,88	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.025.100,95	0,00	0,00	3.056.660,81	31.559,86	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.725.368,70	0,00	0,00	6.794.744,39	69.375,69	1,03%	1,03%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.648.548,57	0,00	0,00	6.717.089,38	68.540,81	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.954.672,68	0,00	0,00	6.015.380,69	60.708,01	1,02%	1,02%	0,78%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.496.719,80	869.466,84	990.000,00	6.443.175,80	66.989,16	0,91%	1,09%	0,01%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	2.098.708,40	0,00	0,00	2.107.261,11	8.552,71	0,41%	0,41%	0,89%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>71.902.326,65</b>	<b>880.466,84</b>	<b>991.700,00</b>	<b>72.903.972,14</b>	<b>1.112.878,65</b>	<b>1,55%</b>		<b>0,98%</b>



**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 SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.603.314,01	0,00	0,00	1.746.999,74	143.685,73	8,96%	8,96%	7,42%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIC AÇÕES	319.030,94	0,00	0,00	344.654,79	25.623,85	8,03%	8,03%	10,00%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	287.130,35	0,00	0,00	308.368,10	21.237,75	7,40%	7,40%	7,62%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.209.475,30</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.400.022,63</b>	<b>190.547,33</b>	<b>8,62%</b>		<b>7,82%</b>



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

**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	279.110,43	0,00	0,00	282.972,88	3.862,45	1,38%	1,38%	6,71%
<b>Total Exterior</b>	<b>279.110,43</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>282.972,88</b>	<b>3.862,45</b>	<b>1,38%</b>		<b>6,71%</b>





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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.966.414,09	0,00	0,00	10.450.313,96	483.899,87	4,86%	4,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	9.157.981,27	0,00	0,00	9.619.553,08	461.571,81	5,04%	5,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.674.750,04	0,00	0,00	6.075.513,65	400.763,61	7,06%	7,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.193.967,80	0,00	0,00	5.563.349,12	369.381,32	7,11%	7,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.662.394,58	2.548.763,61	2.962.200,00	6.443.175,80	194.217,61	2,11%	3,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.624.584,43	0,00	0,00	6.794.744,39	170.159,96	2,57%	2,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.549.623,69	0,00	0,00	6.717.089,38	167.465,69	2,56%	2,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.645.372,51	2.128.267,54	0,00	5.926.283,83	152.643,78	2,64%	3,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	2.027.203,58	0,00	0,00	2.170.226,36	143.022,78	7,06%	7,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.891.703,33	0,00	0,00	6.015.380,69	123.677,36	2,10%	2,10%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.221.958,10	0,00	0,00	1.305.564,04	83.605,94	6,84%	6,84%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.992.744,48	0,00	0,00	3.056.660,81	63.916,33	2,14%	2,14%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	2.072.104,11	0,00	0,00	2.107.261,11	35.157,00	1,70%	1,70%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.094.998,77	0,00	2.128.267,54	0,00	33.268,77	1,59%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	631.312,72	24.000,00	16.200,00	658.855,92	19.743,20	3,01%	3,14%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>70.407.113,50</b>	<b>4.701.031,15</b>	<b>5.106.667,54</b>	<b>72.903.972,14</b>	<b>2.902.495,03</b>	<b>3,86%</b>	



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 SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.528.767,38	0,00	0,00	1.746.999,74	218.232,36	14,28%	14,28%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIC AÇÕES	276.682,87	0,00	0,00	344.654,79	67.971,92	24,57%	24,57%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	279.644,35	0,00	0,00	308.368,10	28.723,75	10,27%	10,27%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.085.094,60</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.400.022,63</b>	<b>314.928,03</b>	<b>15,10%</b>	



**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023**

**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	272.568,42	0,00	0,00	282.972,88	10.404,46	3,82%	3,82%
<b>Total Exterior</b>	<b>272.568,42</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>282.972,88</b>	<b>10.404,46</b>	<b>3,82%</b>	



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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.652.927,73	0,00	0,00	10.450.313,96	797.386,23	8,26%	8,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	5.591.003,33	3.349.907,59	0,00	9.619.553,08	678.642,16	7,59%	8,76%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.461.433,77	0,00	0,00	6.075.513,65	614.079,88	11,24%	11,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.970.142,05	0,00	2.000.000,00	5.563.349,12	593.207,07	8,51%	11,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.350.009,38	0,00	0,00	6.794.744,39	444.735,01	7,00%	7,00%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.278.266,61	0,00	0,00	6.717.089,38	438.822,77	6,99%	6,99%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.943.872,97	4.790.113,54	5.686.200,00	6.443.175,80	395.389,29	3,37%	6,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.644.951,57	0,00	0,00	6.015.380,69	370.429,12	6,56%	6,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.536.618,58	2.128.267,54	0,00	5.926.283,83	261.397,71	4,61%	6,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	1.996.970,75	0,00	56.248,30	2.170.226,36	229.503,91	11,49%	11,77%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.867.472,45	0,00	0,00	3.056.660,81	189.188,36	6,60%	6,60%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.174.374,29	0,00	0,00	1.305.564,04	131.189,75	11,17%	11,17%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.021.593,53	0,00	2.128.267,54	0,00	106.674,01	5,28%	-
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	2.056.248,30	0,00	2.107.261,11	51.012,81	2,48%	4,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	584.736,02	107.000,00	72.200,00	658.855,92	39.319,90	5,68%	6,49%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>65.074.373,03</b>	<b>12.431.536,97</b>	<b>9.942.915,84</b>	<b>72.903.972,14</b>	<b>5.340.977,98</b>	<b>7,91%</b>	



**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
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.661.160,80	0,00	0,00	1.746.999,74	85.838,94	5,17%	5,17%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIC AÇÕES	304.887,22	0,00	0,00	344.654,79	39.767,57	13,04%	13,04%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	300.117,29	0,00	0,00	308.368,10	8.250,81	2,75%	2,75%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.266.165,31</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.400.022,63</b>	<b>133.857,32</b>	<b>5,91%</b>	



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

**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	264.085,55	0,00	0,00	282.972,88	18.887,33	7,15%	7,15%
<b>Total Exterior</b>	<b>264.085,55</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>282.972,88</b>	<b>18.887,33</b>	<b>7,15%</b>	

#### 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 aliquotas 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.





