

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

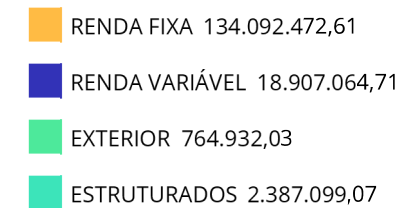
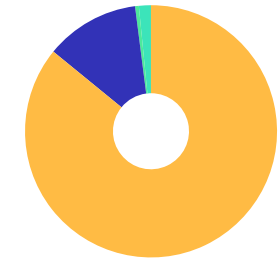
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	17.331.415,31	11,10%	664	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.702.490,47	1,09%	942	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.725.832,66	1,11%	783	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	2.726.056,06	1,75%	237	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	14.524.262,28	9,30%	572	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	2.966.691,86	1,90%	91	1,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	11.380.086,89	7,29%	1.136	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.200.510,89	5,89%	61	3,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.435.428,34	0,92%	515	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	842.196,90	0,54%	140	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	2.914.790,05	1,87%	189	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.257.212,34	13,61%	927	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	473.179,84	0,30%	252	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	21.584.862,00	13,82%	723	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	9.372.402,08	6,00%	218	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.518.744,19	0,97%	980	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.166.511,06	7,15%	218	1,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.969.799,39	1,26%	1.126	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.832.938,90	1,17%	590	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.178.336,14	3,96%	1.505	0,71%	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
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.175.595,06	2,67%	29.477	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.290.241,34	3,39%	1.074	0,81%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.429.953,27	0,92%	12.084	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	764.932,03	0,49%	11.624	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	196.288,46	0,13%	95	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.190.810,61	1,40%	182	0,68%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			156.151.568,42				

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

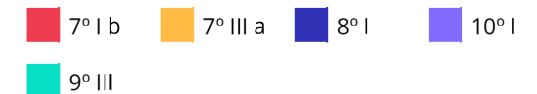
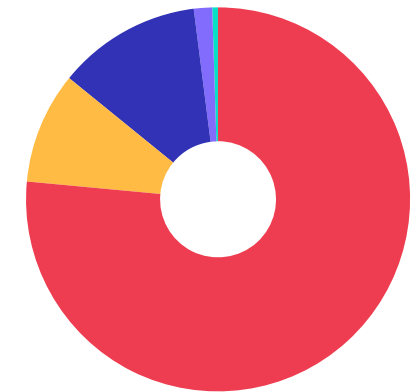
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	100,00%	156.151.568,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	119.437.417,97	76,49%	0,00%	55,00%	100,00%	36.714.150,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	14.655.054,64	9,39%	0,00%	12,00%	60,00%	79.035.886,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	60,00%	93.690.941,05
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	31.230.313,68
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,25%	5,00%	7.807.578,42
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,25%	5,00%	7.807.578,42
Total Renda Fixa	100,00%	134.092.472,61	85,87%	0,00%	72,00%	350,00%	



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%	18.907.064,71	12,11%	0,00%	19,00%	30,00%	27.938.405,82
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	46.845.470,53
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.387.099,07	1,53%	0,00%	1,80%	10,00%	13.228.057,77
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,20%	5,00%	7.807.578,42
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	21.294.163,78	13,64%	0,00%	22,00%	75,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	764.932,03	0,49%	0,00%	3,00%	10,00%	14.850.224,81
Total Exterior	10,00%	764.932,03	0,49%	0,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	96.743.717,55	61,96	-
CAIXA DTVM	59.407.850,87	38,04	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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%
IMA Geral (Benchmark)	1,74%	8,64%	4,83%	8,64%	14,01%	20,10%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,72%	8,65%	4,88%	8,65%	14,27%	19,93%	0,85%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	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%
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,30%	14,47%	10,61%	14,47%	15,72%	12,70%	3,08%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,31%	14,66%	10,79%	14,66%	15,89%	13,02%	3,16%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
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%
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%

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
IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35%	11,24%	7,06%	11,24%	13,32%	17,31%	2,12%	0,04%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,39%	11,31%	7,20%	11,31%	13,23%	17,29%	2,17%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%	-	-
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%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	9,20%	3,88%	9,20%	10,92%	-	1,44%	0,03%
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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,54%	1,44%	5,54%	9,24%	21,24%	0,47%	0,03%

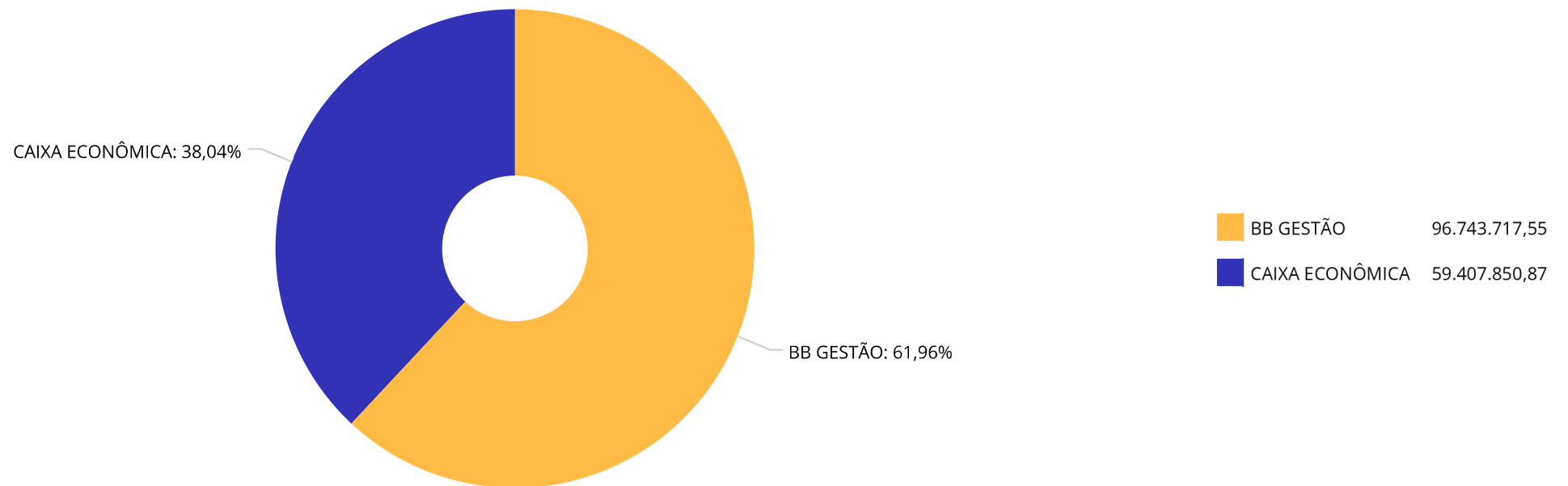
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	6,57%	3,17%	6,57%	13,52%	21,80%	0,47%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,94%	6,56%	2,81%	6,56%	12,47%	19,07%	0,61%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	8,37%	6,56%	13,83%	6,56%	16,30%	-10,29%	7,19%	0,16%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8,89%	8,06%	17,13%	8,06%	15,45%	-16,81%	7,53%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,18%	4,06%	12,50%	4,06%	9,82%	-8,47%	7,42%	0,15%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7,40%	2,75%	10,27%	2,75%	6,15%	-28,95%	7,62%	0,21%
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%	0,15%

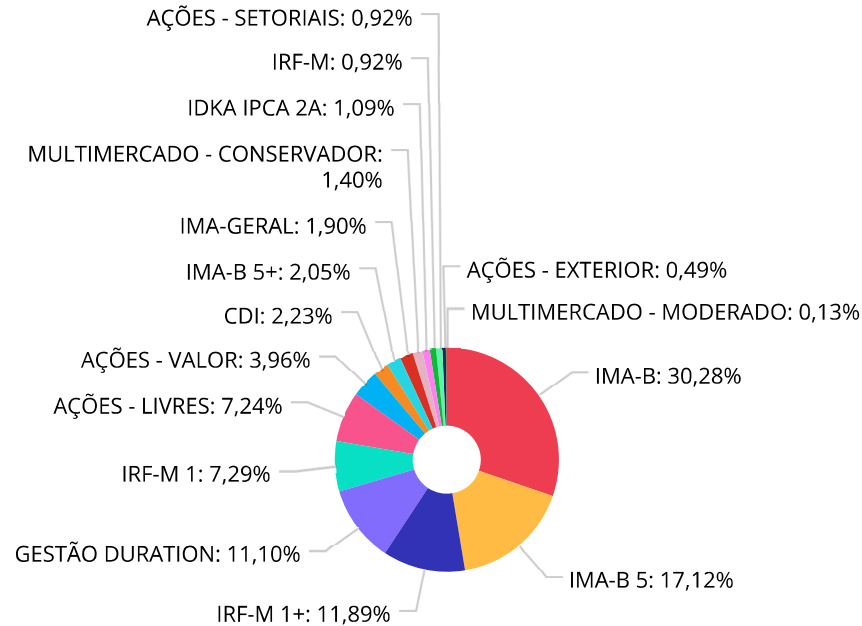
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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)



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

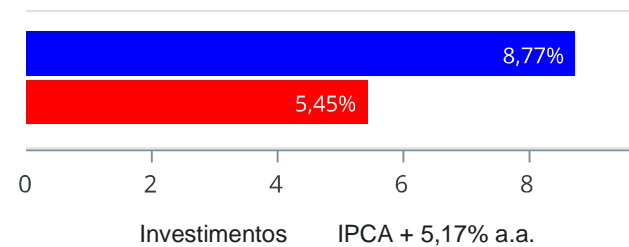


IMA-B	47.275.635,34	IMA-B 5	26.740.031,95	IRF-M 1+	18.572.912,97
GESTÃO DURATION	17.331.415,31	IRF-M 1	11.380.086,89	AÇÕES - LIVRES	11.298.775,30
AÇÕES - VALOR	6.178.336,14	CDI	3.488.543,58	IMA-B 5+	3.199.235,90
IMA-GERAL	2.966.691,86	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.190.810,61	IDKA IPCA 2A	1.702.490,47
IRF-M	1.435.428,34	AÇÕES - SETORIAIS	1.429.953,27	AÇÕES - EXTERIOR	764.932,03
MULTIMERCADO - MODERADO	196.288,46				

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	139.753.920,86	1.554.575,71	1.895.897,34	140.823.064,53	1.410.465,30	1.410.465,30	1,01%	1,01%	0,97%	0,97%	103,69%	3,05%
Fevereiro	140.823.064,53	1.734.708,68	1.940.368,04	140.503.485,04	-113.920,13	1.296.545,17	-0,08%	0,93%	1,20%	2,19%	42,38%	2,55%
Março	140.503.485,04	2.565.736,77	1.918.130,97	143.075.267,95	1.924.177,11	3.220.722,28	1,36%	2,30%	1,17%	3,39%	67,97%	2,12%
Abril	143.075.267,95	2.736.078,21	2.103.119,93	145.698.917,58	1.990.691,35	5.211.413,63	1,39%	3,72%	0,97%	4,39%	84,66%	2,13%
Mai	145.698.917,58	6.233.364,13	6.217.072,62	148.830.551,36	3.115.342,27	8.326.755,90	2,14%	5,94%	0,67%	5,10%	116,51%	1,91%
Junho	148.830.551,36	3.242.090,86	2.953.919,54	153.107.829,15	3.989.106,47	12.315.862,37	2,68%	8,77%	0,34%	5,45%	160,83%	2,18%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



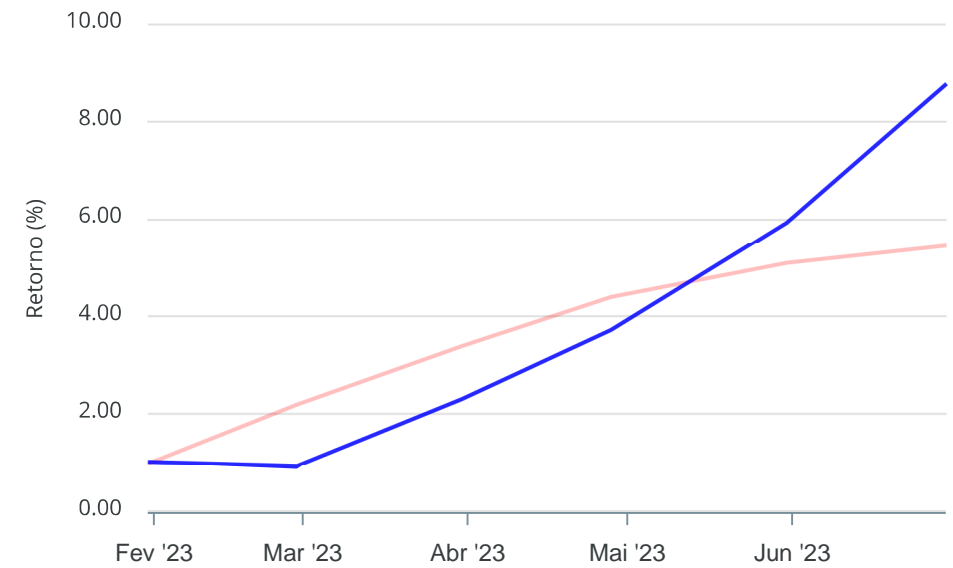
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.638.796,12	0,00	0,00	2.726.056,06	87.259,94	3,31%	3,31%	3,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	383.498,73	75.280,82	0,00	473.179,84	14.400,29	3,14%	3,30%	3,08%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.964.910,11	0,00	0,00	9.200.510,89	235.600,78	2,63%	2,63%	1,37%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.906.261,51	0,00	0,00	11.166.511,06	260.249,55	2,39%	2,39%	2,17%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	14.187.721,25	0,00	0,00	14.524.262,28	336.541,03	2,37%	2,37%	2,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	21.140.397,11	0,00	52.513,04	21.584.862,00	496.977,93	2,35%	2,35%	2,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	8.631.196,54	2.437.572,29	1.938.201,98	9.372.402,08	241.835,23	2,18%	2,63%	1,37%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.157.515,95	250.000,00	0,00	1.435.428,34	27.912,39	1,98%	2,09%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	17.762.433,83	250.000,00	1.000.000,00	17.331.415,31	318.981,48	1,77%	1,80%	0,95%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	2.667.589,40	250.000,00	0,00	2.966.691,86	49.102,46	1,68%	1,72%	0,85%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	11.182.434,08	67.839,82	0,00	11.380.086,89	129.812,99	1,15%	1,16%	0,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.948.511,27	0,00	0,00	1.969.799,39	21.288,12	1,09%	1,09%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.040.172,00	0,00	0,00	21.257.212,34	217.040,34	1,03%	1,03%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.708.222,36	0,00	0,00	1.725.832,66	17.610,30	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.685.308,72	0,00	0,00	1.702.490,47	17.181,75	1,02%	1,02%	0,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.569.447,65	0,00	66.090,37	1.518.744,19	15.386,91	0,98%	1,00%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.887.378,70	0,00	0,00	2.914.790,05	27.411,35	0,95%	0,95%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	834.451,04	0,00	0,00	842.196,90	7.745,86	0,93%	0,93%	0,47%
Total Renda Fixa	131.296.246,37	3.330.692,93	3.056.805,39	134.092.472,61	2.522.338,70	1,92%		1,38%

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 ELETROBRAS FI AÇÕES	1.270.879,11	0,00	0,00	1.429.953,27	159.074,16	12,52%	12,52%	13,53%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4.858.495,32	0,00	0,00	5.290.241,34	431.746,02	8,89%	8,89%	7,53%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.691.321,94	0,00	0,00	1.832.938,90	141.616,96	8,37%	8,37%	7,19%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.711.294,52	0,00	0,00	6.178.336,14	467.041,62	8,18%	8,18%	7,42%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	3.888.015,97	0,00	0,00	4.175.595,06	287.579,09	7,40%	7,40%	7,62%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.171.234,09	0,00	0,00	2.190.810,61	19.576,52	0,90%	0,90%	0,47%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,00	195.659,45	0,00	196.288,46	629,01	0,32%	0,94%	0,61%
Total Renda Variável	19.591.240,95	195.659,45	0,00	21.294.163,78	1.507.263,38	7,62%		7,10%

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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	754.491,05	0,00	0,00	764.932,03	10.440,98	1,38%	1,38%	6,71%
Total Exterior	754.491,05	0,00	0,00	764.932,03	10.440,98	1,38%		6,71%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	20.260.832,45	0,00	105.026,08	21.584.862,00	1.429.055,63	7,05%	7,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	13.559.916,69	0,00	0,00	14.524.262,28	964.345,59	7,11%	7,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	17.570.669,28	250.000,00	1.360.000,00	17.331.415,31	870.746,03	4,89%	5,04%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.416.353,89	0,00	0,00	11.166.511,06	750.157,17	7,20%	7,20%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	8.178.182,13	6.122.634,15	5.541.114,18	9.372.402,08	612.699,98	4,28%	6,86%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.611.326,97	0,00	0,00	9.200.510,89	589.183,92	6,84%	6,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	20.575.837,37	150.283,33	0,00	21.257.212,34	531.091,64	2,56%	2,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	10.834.270,69	202.761,13	0,00	11.380.086,89	343.055,07	3,11%	3,14%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.043.074,59	1.500.000,00	0,00	2.726.056,06	182.981,47	7,20%	10,79%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	2.390.853,54	450.000,00	0,00	2.966.691,86	125.838,32	4,43%	4,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.727.408,80	164.516,76	1.000.000,00	1.969.799,39	77.873,83	2,69%	3,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	474.816,48	2.427.634,29	52.770,78	2.914.790,05	65.110,06	2,24%	3,88%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.120.829,79	250.000,00	0,00	1.435.428,34	64.598,55	4,71%	5,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.159.504,25	0,00	3.209.869,36	0,00	50.365,11	1,59%	3,22%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.657.401,95	0,00	184.244,03	1.518.744,19	45.586,27	2,75%	2,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.682.805,43	0,00	0,00	1.725.832,66	43.027,23	2,56%	2,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	358.149,97	75.280,82	0,00	473.179,84	39.749,05	9,17%	10,61%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.667.486,95	0,00	0,00	1.702.490,47	35.003,52	2,10%	2,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	830.243,30	0,00	0,00	842.196,90	11.953,60	1,44%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	163.455,47	0,00	164.516,76	0,00	1.061,29	0,65%	3,08%

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.334,68	0,00	15.453,41	0,00	118,73	0,77%	3,15%
Total Renda Fixa	127.298.754,67	11.593.110,48	11.632.994,60	134.092.472,61	6.833.602,06	4,92%	

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
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4.516.487,09	0,00	0,00	5.290.241,34	773.754,25	17,13%	17,13%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.491.783,97	0,00	0,00	6.178.336,14	686.552,17	12,50%	12,50%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	3.786.648,45	0,00	0,00	4.175.595,06	388.946,61	10,27%	10,27%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	1.191.602,95	0,00	0,00	1.429.953,27	238.350,32	20,00%	20,00%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.610.219,73	0,00	0,00	1.832.938,90	222.719,17	13,83%	13,83%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.147.289,52	991.286,31	0,00	2.190.810,61	52.234,78	2,44%	3,17%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,00	195.659,45	0,00	196.288,46	629,01	0,32%	2,81%
Total Renda Variável	17.744.031,71	1.186.945,76	0,00	21.294.163,78	2.363.186,31	12,48%	

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	736.806,69	0,00	0,00	764.932,03	28.125,34	3,82%	3,82%
Total Exterior	736.806,69	0,00	0,00	764.932,03	28.125,34	3,82%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.499.219,16	0,00	105.026,08	21.584.862,00	2.190.668,92	11,23%	11,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	17.260.676,25	250.000,00	1.660.000,00	17.331.415,31	1.480.739,06	8,46%	8,76%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	13.052.016,73	0,00	0,00	14.524.262,28	1.472.245,55	11,28%	11,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.723.012,31	150.283,33	0,00	21.257.212,34	1.383.916,70	6,96%	7,00%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.031.499,55	0,00	0,00	11.166.511,06	1.135.011,51	11,31%	11,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.815.972,67	9.413.657,26	8.841.925,64	9.372.402,08	984.697,79	5,72%	11,25%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.275.996,53	0,00	0,00	9.200.510,89	924.514,36	11,17%	11,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	10.299.623,15	400.008,02	0,00	11.380.086,89	680.455,72	6,36%	6,49%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	2.869.382,06	974.450,93	1.100.000,00	2.966.691,86	222.858,87	5,80%	8,65%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.007.810,83	1.500.000,00	0,00	2.726.056,06	218.245,23	8,70%	14,66%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.910.300,93	995.926,87	2.100.000,00	1.969.799,39	163.571,59	4,19%	6,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.048.467,78	0,00	3.209.869,36	0,00	161.401,58	5,29%	6,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.613.085,21	0,00	0,00	1.725.832,66	112.747,45	6,99%	6,99%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	560.214,30	774.449,00	0,00	1.435.428,34	100.765,04	7,55%	9,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.156.398,73	450.000,00	0,00	1.702.490,47	96.091,74	5,98%	6,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.724.315,88	160,00	301.669,09	1.518.744,19	95.937,40	5,56%	5,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	451.655,78	2.427.634,29	52.770,78	2.914.790,05	88.270,76	3,07%	9,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	273.038,86	148.480,87	0,00	473.179,84	51.660,11	12,26%	14,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	821.384,50	0,00	23.992,37	842.196,90	44.804,77	5,45%	5,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	158.409,00	0,00	164.516,76	0,00	6.107,76	3,86%	6,37%

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	61.178,53	4.457,67	67.831,86	0,00	2.195,66	3,35%	6,59%
Total Renda Fixa	122.613.658,74	17.489.508,24	17.627.601,94	134.092.472,61	11.616.907,57	8,29%	

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 AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4.895.829,07	0,00	0,00	5.290.241,34	394.412,27	8,06%	8,06%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.937.276,29	0,00	0,00	6.178.336,14	241.059,85	4,06%	4,06%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.720.045,21	0,00	0,00	1.832.938,90	112.893,69	6,56%	6,56%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.063.871,38	0,00	0,00	4.175.595,06	111.723,68	2,75%	2,75%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	870.031,29	1.234.331,23	0,00	2.190.810,61	86.448,09	4,11%	6,57%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,00	195.659,45	0,00	196.288,46	629,01	0,32%	6,56%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	1.508.600,55	0,00	0,00	1.429.953,27	-78.647,28	-5,21%	-5,21%
Total Renda Variável	18.995.653,79	1.429.990,68	0,00	21.294.163,78	868.519,31	4,25%	

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	713.875,80	0,00	0,00	764.932,03	51.056,23	7,15%	7,15%
Total Exterior	713.875,80	0,00	0,00	764.932,03	51.056,23	7,15%	

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. 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.

