

Relatório Analítico dos Investimentos

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



Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			120.184.237,94	13,30%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.403.037,76	0,93%	942	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	38.691.668,00	4,28%	572	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.072.227,20	1,11%	723	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	33.123.102,79	3,66%	714	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	32.217.993,01	3,56%	115	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	75.357.140,32	8,34%	118	6,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	124.146.711,06	13,73%	164	5,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	5.402.600,86	0,60%	14	3,96%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	96.728.447,59	10,70%	470	3,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não possui	10.995.273,36	1,22%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SAFRA	S/Info		87.149.230,40	9,64%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	7.926.583,00	0,88%	115	3,46%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	D+1 du	Não há	5.391.410,50	0,60%	561	0,36%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.140.668,82	0,57%	12	0,96%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	8.333.060,91	0,92%	3.732	3,00%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	28.218.473,40	3,12%	3.044	2,13%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.364.220,38	0,37%	2.523	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.977.944,14	0,33%	328	9,35%	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
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	2.381.272,46	0,26%	156	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	11.406.913,93	1,26%	621	1,71%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.868.096,02	0,43%	2.666	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.939.419,55	0,55%	1.256	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	30.443.250,05	3,37%	16.598	13,20%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	11.040.429,72	1,22%	27	9,00%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	14.316.614,80	1,58%	102	1,24%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	D+6 du	Não há	6.128.134,06	0,68%	9	0,22%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	21.618.402,99	2,39%	212	7,49%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	9.951.381,21	1,10%	22.263	2,51%	Artigo 9º, Inciso III
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	2.680.936,93	0,30%	27	3,00%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	7.490.191,27	0,83%	10	14,93%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	16.171.493,58	1,79%	22	11,88%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	11.109.820,92	1,23%	81	1,94%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	38.707.427,42	4,28%	23.779	4,71%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRÁ...	Não se ...	Não se aplica	579.920,96	0,06%	29	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	790.979,99	0,09%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	1.552.600,34	0,17%		0,09%	Artigo 11º

Página 2 de 30

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

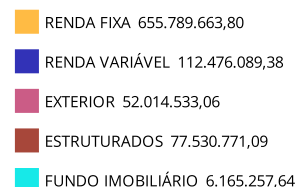
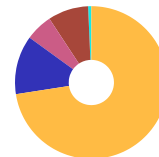
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	S/Info	Não se aplica	788.920,00	0,09%		0,05%	Artigo 11º
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	S/Info	Não se aplica	3.820.000,00	0,42%		0,84%	Artigo 11º
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - ...	S/Info	Não se aplica	3.737,30	0,00%		1,05%	Artigo 11º
BTG PACTUAL CRÉDITO IMOBILIÁRIO FII - BTC11	S/Info	Não se aplica	362.340,00	0,04%		0,13%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			903.976.314,97				

Página 3 de 30

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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

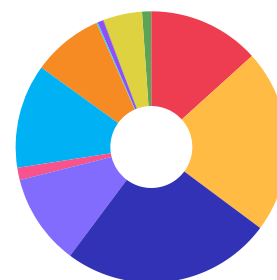
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	120.184.237,94	13,30%	3,00%	10,00%	55,00%	377.002.735,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	197.865.169,08	21,89%	30,00%	40,00%	80,00%	525.315.882,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	226.277.759,51	25,03%	10,00%	17,00%	60,00%	316.108.029,47
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	98.144.503,76	10,86%	2,00%	5,00%	20,00%	82.650.759,23
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,02%	2,00%	18.079.526,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	13.317.993,50	1,47%	0,00%	0,90%	5,00%	31.880.822,25
Total Renda Fixa	100,00%	655.789.663,80	72,55%	45,00%	72,92%	222,00%	



ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	112.113.749,38	12,40%	5,00%	11,00%	40,00%	249.476.776,61
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	90.397.631,50
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	76.159.870,12	8,42%	2,00%	7,00%	10,00%	14.237.761,38
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	1.370.900,97	0,15%	0,00%	0,15%	1,00%	7.668.862,18
Artigo 11º	10,00%	6.165.257,64	0,68%	0,00%	0,90%	2,00%	11.914.268,66
Desenquadrado - RV	0,00%	362.340,00	0,04%	0,00%	0,00%	0,00%	-362.340,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	196.172.118,11	21,70%	7,00%	19,05%	63,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	42.063.151,85	4,65%	2,00%	5,00%	10,00%	48.334.479,65
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.951.381,21	1,10%	0,50%	1,03%	10,00%	80.446.250,29
Total Exterior	10,00%	52.014.533,06	5,75%	2,50%	6,03%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	195.509.412,83	21,63	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	172.085.587,91	19,04	0,04
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	120.184.237,94	13,30	-
CAIXA DTVM	53.503.185,45	5,92	-
WESTERN ASSET	38.707.427,42	4,28	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	37.609.403,51	4,16	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	36.551.534,31	4,04	0,12
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	32.658.832,71	3,61	0,42
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	29.064.285,71	3,22	1,79
CLARITAS INVESTIMENTOS	11.406.913,93	1,26	0,12
BANCO J. SAFRA S/A	11.109.820,92	1,23	0,01
BANCO BTG PACTUAL	10.995.273,36	1,22	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	6.472.784,47	0,72	0,00
MIRAE ASSET	6.128.134,06	0,68	-
ARX INVESTIMENTOS	5.140.668,82	0,57	0,01
NAVI CAPITAL	4.939.419,55	0,55	0,34
ICATU VANGUARDA	3.868.096,02	0,43	0,01
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIR...	3.820.000,00	0,42	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	3.364.220,38	0,37	0,00
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	2.680.936,93	0,30	0,02
BRZ INVESTIMENTOS	579.920,96	0,06	0,04
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	3.737,30	0,00	0,00
PLURAL	0,02	0,00	-
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 '	120.184.237,94	13,30	3,00	55,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	197.865.169,08	21,89	30,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	226.277.759,51	25,03	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,01	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	13.317.993,50	1,47	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	112.113.749,38	12,40	5,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	42.063.151,85	4,65	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	9.951.381,21	1,10	0,50	10,00
Artigo 10º, Inciso I	76.159.870,12	8,42	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	1.370.900,97	0,15	0,00	1,00
Artigo 11º	6.165.257,64	0,68	0,00	2,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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
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%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03%	6,92%	2,49%	6,92%	10,00%	20,81%	0,89%	0,02%
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%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,12%	5,95%	3,19%	5,95%	13,13%	23,41%	0,01%	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	900,00%	0,00%	900,00%	0,00%	900,00%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,15%	6,37%	3,26%	6,37%	13,60%	24,20%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,13%	6,55%	3,23%	6,55%	13,52%	23,55%	0,04%	0,00%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,11%	6,79%	3,25%	6,79%	14,13%	25,24%	0,03%	0,00%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,07%	6,41%	3,11%	6,41%	13,44%	23,26%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
LETRA FINANCEIRA SAFRA	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	1,52%	10,80%	5,28%	10,80%	-	-	2,71%	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	1,60%	-	5,43%	-	-	-	2,57%	-

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 definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	1,52%	10,80%	5,28%	10,80%	-	-	2,71%	-
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	1,27%	6,00%	3,14%	6,00%	12,10%	21,02%	0,40%	0,01%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	6,92%	19,83%	10,24%	19,83%	27,85%	20,43%	5,02%	0,20%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	9,79%	-0,33%	9,59%	-0,33%	9,18%	-15,69%	7,48%	0,19%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	7,28%	4,79%	14,45%	4,79%	14,07%	-16,43%	6,99%	0,19%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3,96%	5,52%	6,65%	5,52%	12,62%	-	3,44%	0,06%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	7,81%	7,61%	15,33%	7,61%	19,60%	-3,72%	6,66%	0,18%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,65%	2,70%	14,55%	2,70%	10,94%	-13,43%	8,57%	0,19%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,24%	4,73%	16,62%	4,73%	14,29%	-4,39%	8,49%	0,20%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,93%	5,78%	14,56%	5,78%	13,83%	-18,28%	8,64%	0,19%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,39%	6,66%	15,10%	6,66%	17,15%	-33,62%	7,85%	0,22%
IBX (Benchmark)	8,87%	6,59%	14,96%	6,59%	17,60%	-9,50%	-	-
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	8,31%	5,68%	15,19%	5,68%	14,70%	-5,92%	7,76%	0,19%

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
IDIV (Benchmark)	8,78%	9,30%	13,95%	9,30%	17,73%	12,91%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,13%	4,29%	11,98%	4,29%	15,45%	-13,04%	6,62%	0,15%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	8,09%	10,12%	15,22%	10,12%	17,90%	3,03%	7,13%	0,15%

IFIX (Benchmark)	4,71%	10,05%	14,28%	10,05%	12,87%	14,54%	-	-
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RBDS11	-3,77%	12,40%	-10,79%	12,40%	-12,46%	-86,52%	27,84%	0,78%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11	13,78%	12,78%	26,54%	12,78%	7,92%	-17,54%	7,45%	0,35%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	8,58%	-11,36%	18,75%	-11,36%	-4,91%	-20,73%	8,40%	0,32%
BTG PACTUAL CRÉDITO IMOBILIÁRIO FII - BTC11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-3,80%	-8,24%	3,94%	0,07%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	6,25%	8,24%	16,00%	8,24%	13,14%	-7,87%	7,61%	0,17%

IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,75%	8,05%	3,23%	8,05%	13,95%	40,88%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,56%	6,84%	2,66%	6,84%	11,38%	34,59%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,14%	8,30%	1,07%	8,30%	3,66%	4,12%	-	-

IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	0,60%	7,08%	2,77%	7,08%	11,89%	35,84%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-

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 + 9,50% ao ano (Benchmark)	0,68%	7,57%	3,00%	7,57%	12,92%	38,35%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP MULTISTRATÉGIA	-2,68%	47,88%	1,23%	47,88%	43,45%	21,35%	4,39%	0,47%

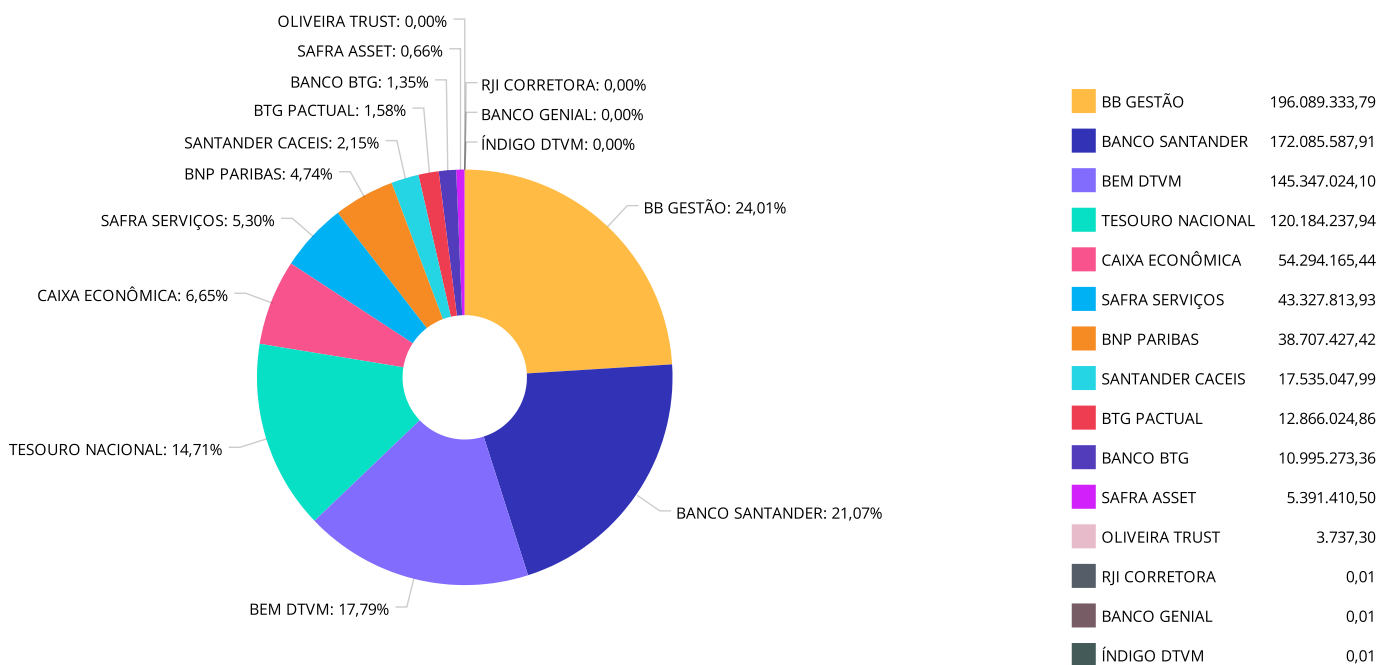
S&P 500 (Benchmark)	6,47%	15,91%	8,30%	15,91%	17,57%	3,56%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6,98%	20,06%	10,37%	20,06%	28,23%	20,74%	5,04%	0,20%

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%

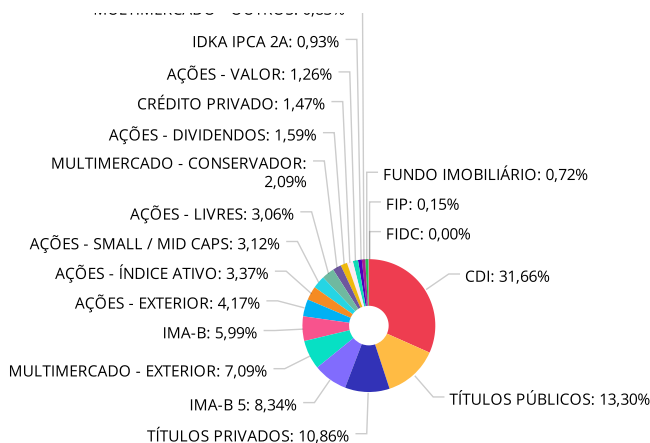
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,88%	12,69%	5,59%	12,69%	16,08%	5,21%	5,19%	17,681%
MSCI WORLD (Benchmark)	0,18%	5,28%	0,82%	5,28%	7,20%	-5,27%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,39%	4,29%	-0,52%	4,29%	13,08%	2,11%	5,66%	13,208%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,68%	11,26%	1,64%	11,26%	11,68%	-33,69%	10,66%	20,606%
MSCI ACWI (Benchmark)	-0,09%	4,18%	0,15%	4,18%	5,27%	-8,63%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,57%	2,86%	-0,13%	2,86%	10,03%	-6,01%	8,25%	14,492%

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



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



CDI	286.216.254,45	TÍTULOS PÚBLICOS	120.184.237,94	TÍTULOS PRIVADOS	98.144.503,76
IMA-B 5	75.357.140,32	MULTIMERCADO - EXTERIOR	64.133.863,14	IMA-B	54.166.496,06
AÇÕES - EXTERIOR	37.697.918,26	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	30.443.250,05	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	28.218.473,40
AÇÕES - LIVRES	27.677.130,56	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	18.852.430,51	AÇÕES - DIVIDENDOS	14.367.981,44
CRÉDITO PRIVADO	13.317.993,50	AÇÕES - VALOR	11.406.913,93	IDKA IPCA 2A	8.403.037,76
MULTIMERCADO - OUTROS	7.490.191,27	FUNDO IMOBILIÁRIO	6.527.597,64	FIP	1.370.900,97
FIDC	0,01				

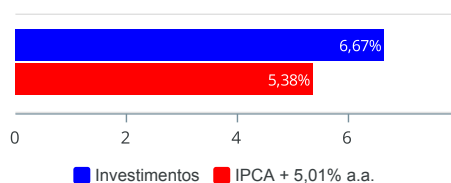
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	22/12/2022	10.024	4.003,428809	4.137,997852	40.130.370,38	41.479.290,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	08/12/2022	9.902	4.039,3211897	4.201,298218	39.997.357,72	41.601.254,95	Curva
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/01/2031	02/07/2004	3.100	2.696,27782581	8.309,168836	8.358.461,26	25.758.423,39	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/01/2031	07/12/2004	1.500	2.874,26939333	8.309,168836	4.311.404,09	12.463.753,25	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

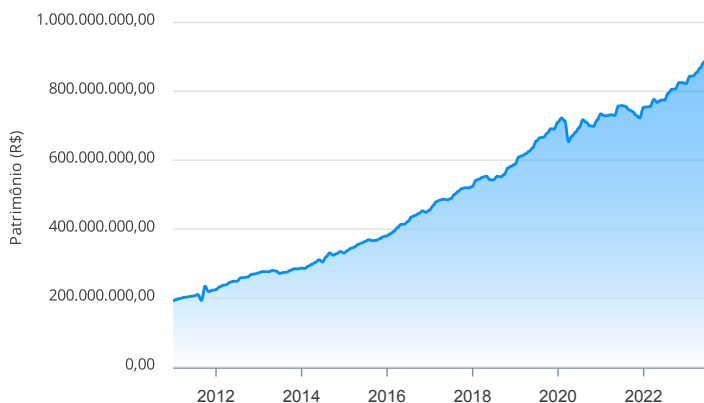
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	815.902.378,16	126.292.000,00	117.210.724,81	835.853.709,02	10.870.055,67	10.870.055,67	1,32%	1,32%	0,96%	0,96%	137,26%	3,16%
Fevereiro	835.853.709,02	46.297.000,00	42.886.541,64	836.429.851,20	-2.834.316,18	8.035.739,49	-0,34%	0,98%	1,19%	2,16%	45,07%	3,12%
Março	836.429.851,20	8.308.000,00	4.338.050,76	846.960.596,62	6.560.796,18	14.596.535,67	0,78%	1,76%	1,16%	3,35%	52,66%	3,17%
Abril	846.960.596,62	98.493.200,00	95.575.950,76	858.188.627,84	8.310.781,98	22.907.317,65	0,98%	2,76%	0,96%	4,34%	63,51%	2,65%
Mai	858.188.627,84	6.788.800,00	4.448.818,30	874.214.454,68	13.685.845,14	36.593.162,79	1,59%	4,39%	0,66%	5,03%	87,32%	2,76%
Junho	874.214.454,68	28.425.000,00	27.515.448,38	894.211.417,22	19.087.410,92	55.680.573,71	2,18%	6,67%	0,33%	5,38%	124,08%	2,69%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

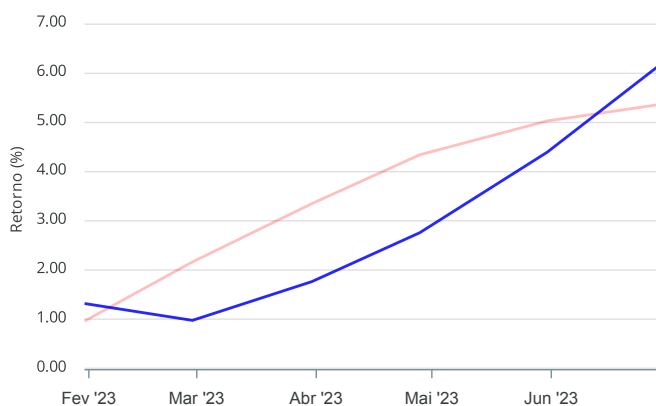


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	37.795.145,09	0,00	0,00	38.691.668,00	896.522,91	2,37%	2,37%	2,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.840.632,67	0,00	0,00	10.072.227,20	231.594,53	2,35%	2,35%	2,12%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5.317.319,42	0,00	0,00	5.402.600,86	85.281,44	1,60%	1,60%	2,57%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	122.772.333,45	0,00	0,00	124.146.711,06	1.374.377,61	1,12%	1,12%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	114.795.869,09	7.984.000,00	27.419.700,00	96.728.447,59	1.368.278,50	1,11%	1,15%	0,02%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.332.043,37	0,00	0,00	5.391.410,50	59.367,13	1,11%	1,11%	0,03%
LETRA FINANCEIRA BTG	10.876.959,43	0,00	0,00	10.995.273,36	118.313,93	1,09%	-	-
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	31.876.311,81	0,00	0,00	32.217.993,01	341.681,20	1,07%	1,07%	0,00%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	7.845.467,00	0,00	0,00	7.926.583,00	81.116,00	1,03%	1,03%	0,89%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	74.589.789,46	0,00	0,00	75.357.140,32	767.350,86	1,03%	1,03%	0,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.318.233,20	0,00	0,00	8.403.037,76	84.804,56	1,02%	1,02%	0,78%
LETRA FINANCEIRA SAFRA	86.423.083,17	0,00	0,00	87.149.230,40	726.147,23	0,84%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.373.030,60	20.731.000,00	135.800,00	33.123.102,79	154.872,19	0,47%	1,13%	0,04%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	120.291.976,48	0,00	0,00	120.184.237,94	-107.738,54	-0,09%	-	-
Total Renda Fixa	648.448.194,25	28.715.000,00	27.555.500,00	655.789.663,80	6.181.969,55	0,95%		0,47%

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
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	1.361.983,14	0,00	10.460,70	1.552.600,34	201.077,90	14,76%	13,78%	7,45%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.480.742,92	0,00	0,00	4.939.419,55	458.676,63	10,24%	10,24%	8,49%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7.580.632,42	0,00	0,00	8.333.060,91	752.428,49	9,93%	9,93%	8,64%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.712.396,30	0,00	0,00	2.977.944,14	265.547,84	9,79%	9,79%	7,48%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.075.567,31	0,00	0,00	3.364.220,38	288.653,07	9,39%	9,39%	7,85%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	3.499.600,00	0,00	0,00	3.820.000,00	320.400,00	9,16%	8,58%	8,40%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	25.897.493,84	0,00	0,00	28.218.473,40	2.320.979,56	8,96%	8,96%	9,11%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.731.260,05	0,00	0,00	5.140.668,82	409.408,77	8,65%	8,65%	8,57%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	10.531.872,12	0,00	0,00	11.406.913,93	875.041,81	8,31%	8,31%	7,76%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.577.292,69	0,00	0,00	3.868.096,02	290.803,33	8,13%	8,13%	6,62%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.203.124,78	0,00	0,00	2.381.272,46	178.147,68	8,09%	8,09%	7,13%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	10.240.881,38	0,00	0,00	11.040.429,72	799.548,34	7,81%	7,81%	6,66%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	28.377.531,73	0,00	0,00	30.443.250,05	2.065.718,32	7,28%	7,28%	6,99%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	742.500,00	0,00	6.160,00	788.920,00	52.580,00	7,08%	6,25%	7,61%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	36.182.739,96	0,00	0,00	38.707.427,42	2.524.687,46	6,98%	6,98%	5,04%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	10.390.733,61	0,00	0,00	11.109.820,92	719.087,31	6,92%	6,92%	5,02%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	15.554.966,25	0,00	0,00	16.171.493,58	616.527,33	3,96%	3,96%	3,44%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	7.377.961,52	0,00	0,00	7.490.191,27	112.229,75	1,52%	1,52%	2,71%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.647.317,23	0,00	0,00	2.680.936,93	33.619,70	1,27%	1,27%	0,40%
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RB...	3.724,00	0,00	0,00	3.737,30	13,30	0,36%	-3,77%	27,84%

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
BTG PACTUAL CRÉDITO IMOBILIÁRIO FII - BTC11	365.904,00	0,00	4.197,60	362.340,00	633,60	0,17%	0,00%	3,94%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	595.870,13	0,00	15.830,08	579.920,96	-119,09	-0,02%	-2,68%	4,39%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	792.053,36	0,00	0,00	790.979,99	-1.073,37	-0,14%	-	-
Total Renda Variável	182.924.148,76	0,00	36.648,38	196.172.118,11	13.284.617,73	7,26%		6,46%

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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	9.488.315,80	0,00	0,00	9.951.381,21	463.065,41	4,88%	4,88%	5,19%
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	6.086.757,97	0,00	0,00	6.128.134,06	41.376,09	0,68%	0,68%	10,66%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	14.519.029,43	0,00	0,00	14.316.614,80	-202.414,63	-1,39%	-1,39%	5,66%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	22.188.611,62	0,00	0,00	21.618.402,99	-570.208,63	-2,57%	-2,57%	8,25%
Total Exterior	52.282.714,82	0,00	0,00	52.014.533,06	-268.181,76	-0,51%		7,23%

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
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	106.004.448,38	24.505.048,00	37.523.126,84	96.728.447,59	3.742.078,05	2,87%	3,26%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	30.839.340,47	90.000.000,00	0,00	124.146.711,06	3.307.370,59	2,74%	3,19%
LETRA FINANCEIRA SAFRA	84.293.060,86	0,00	0,00	87.149.230,40	2.856.169,54	3,39%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	36.122.715,52	0,00	0,00	38.691.668,00	2.568.952,48	7,11%	7,11%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	73.523.179,11	0,00	0,00	75.357.140,32	1.833.961,21	2,49%	2,49%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	31.247.830,41	0,00	0,00	32.217.993,01	970.162,60	3,10%	3,10%
TÍTULOS PÚBLICOS	119.238.077,29	0,00	0,00	120.184.237,94	946.160,65	0,79%	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	101.358.966,27	20.984.200,00	90.135.800,00	33.123.102,79	915.736,52	0,75%	3,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.407.825,40	0,00	0,00	10.072.227,20	664.401,80	7,06%	7,06%
LETRA FINANCEIRA BTG	10.584.087,10	0,00	0,00	10.995.273,36	411.186,26	3,88%	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5.124.449,03	0,00	0,00	5.402.600,86	278.151,83	5,43%	5,43%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	7.731.654,00	0,00	0,00	7.926.583,00	194.929,00	2,52%	2,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.230.269,72	0,00	0,00	8.403.037,76	172.768,04	2,10%	2,10%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.221.814,44	0,00	0,00	5.391.410,50	169.596,06	3,25%	3,25%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	628.927.718,01	135.489.248,00	127.658.926,84	655.789.663,80	19.031.624,63	2,99%	

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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	24.341.153,90	0,00	0,00	28.218.473,40	3.877.319,50	15,93%	15,93%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	26.598.774,10	0,00	0,00	30.443.250,05	3.844.475,95	14,45%	14,45%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	35.070.152,53	0,00	0,00	38.707.427,42	3.637.274,89	10,37%	10,37%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	9.903.096,63	0,00	0,00	11.406.913,93	1.503.817,30	15,19%	15,19%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	9.572.987,82	0,00	0,00	11.040.429,72	1.467.441,90	15,33%	15,33%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7.273.947,52	0,00	0,00	8.333.060,91	1.059.113,39	14,56%	14,56%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	10.078.268,65	0,00	0,00	11.109.820,92	1.031.552,27	10,24%	10,24%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	15.163.408,23	0,00	0,00	16.171.493,58	1.008.085,35	6,65%	6,65%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.235.327,09	0,00	0,00	4.939.419,55	704.092,46	16,62%	16,62%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.487.678,72	0,00	0,00	5.140.668,82	652.990,10	14,55%	14,55%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	3.200.000,00	0,00	0,00	3.820.000,00	620.000,00	19,38%	18,75%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.922.950,20	0,00	0,00	3.364.220,38	441.270,18	15,10%	15,10%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.454.146,47	0,00	0,00	3.868.096,02	413.949,55	11,98%	11,98%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	7.114.553,04	0,00	0,00	7.490.191,27	375.638,23	5,28%	5,28%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	1.226.923,88	0,00	31.614,56	1.552.600,34	357.291,02	29,12%	26,54%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.066.752,46	0,00	0,00	2.381.272,46	314.520,00	15,22%	15,22%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.717.472,39	0,00	0,00	2.977.944,14	260.471,75	9,59%	9,59%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	680.130,00	0,00	18.480,00	788.920,00	127.270,00	18,71%	16,00%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.599.443,97	0,00	0,00	2.680.936,93	81.492,96	3,14%	3,14%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	572.887,89	0,00	15.830,08	579.920,96	22.863,15	3,99%	1,23%

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
BTG PACTUAL CRÉDITO IMOBILIÁRIO FII - BTC11	356.004,00	0,00	12.592,80	362.340,00	18.928,80	5,32%	0,00%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	782.713,29	0,00	0,00	790.979,99	8.266,70	1,06%	1,07%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RB...	4.189,50	0,00	0,00	3.737,30	-452,20	-10,79%	-10,79%
Total Renda Variável	174.422.962,30	0,00	78.517,44	196.172.118,11	21.827.673,25	12,51%	

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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	9.424.428,35	0,00	0,00	9.951.381,21	526.952,86	5,59%	5,59%
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	6.029.486,08	0,00	0,00	6.128.134,06	98.647,98	1,64%	1,64%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	21.645.905,73	0,00	0,00	21.618.402,99	-27.502,74	-0,13%	-0,13%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	14.390.773,75	0,00	0,00	14.316.614,80	-74.158,95	-0,52%	-0,52%
Total Exterior	51.490.593,91	0,00	0,00	52.014.533,06	523.939,15	1,02%	

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
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	57.382.400,98	91.565.028,00	58.583.094,92	96.728.447,59	6.364.113,53	4,27%	6,37%
LETRA FINANCEIRA SAFRA	80.959.967,01	0,00	0,00	87.149.230,40	6.189.263,39	7,64%	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	70.481.090,66	0,00	0,00	75.357.140,32	4.876.049,66	6,92%	6,92%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	10.072.727,46	140.000.000,00	30.000.000,00	124.146.711,06	4.073.983,60	2,71%	5,95%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	84.774.959,99	0,00	50.000.000,00	38.691.668,00	3.916.708,01	4,62%	11,28%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.043.450,98	81.788.200,00	90.135.800,00	33.123.102,79	3.427.251,81	2,86%	6,55%
TÍTULOS PÚBLICOS	122.099.526,89	0,00	4.069.032,51	120.184.237,94	2.153.743,56	1,76%	-
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	30.276.031,48	0,00	0,00	32.217.993,01	1.941.961,53	6,41%	6,41%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	69.127.927,09	0,00	60.000.000,00	10.072.227,20	944.300,11	1,37%	11,24%
LETRA FINANCEIRA BTG	10.248.392,96	0,00	0,00	10.995.273,36	746.880,40	7,29%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.885.575,92	0,00	0,00	8.403.037,76	517.461,84	6,56%	6,56%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	7.413.192,50	0,00	0,00	7.926.583,00	513.390,50	6,93%	6,93%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.402.600,86	402.600,86	8,05%	-
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.048.518,82	0,00	0,00	5.391.410,50	342.891,68	6,79%	6,79%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	900,00%
Total Renda Fixa	593.813.762,75	318.353.228,00	292.787.927,43	655.789.663,80	36.410.600,48	5,88%	

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32.240.883,08	0,00	0,00	38.707.427,42	6.466.544,34	20,06%	20,06%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	25.748.425,96	0,00	0,00	28.218.473,40	2.470.047,44	9,59%	9,59%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	9.271.067,66	0,00	0,00	11.109.820,92	1.838.753,26	19,83%	19,83%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	29.053.016,50	0,00	0,00	30.443.250,05	1.390.233,55	4,79%	4,79%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	15.325.287,61	0,00	0,00	16.171.493,58	846.205,97	5,52%	5,52%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	10.259.704,08	0,00	0,00	11.040.429,72	780.725,64	7,61%	7,61%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	6.760.289,25	0,00	0,00	7.490.191,27	729.902,02	10,80%	10,80%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	10.793.594,22	0,00	0,00	11.406.913,93	613.319,71	5,68%	5,68%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7.877.677,30	0,00	0,00	8.333.060,91	455.383,61	5,78%	5,78%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	1.376.628,12	0,00	64.158,96	1.552.600,34	240.131,18	17,44%	12,78%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.716.365,68	0,00	0,00	4.939.419,55	223.053,87	4,73%	4,73%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.162.525,83	0,00	0,00	2.381.272,46	218.746,63	10,12%	10,12%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.154.289,26	0,00	0,00	3.364.220,38	209.931,12	6,66%	6,66%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	392.158,01	0,00	15.830,08	579.920,96	203.593,03	51,92%	47,88%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.709.077,82	0,00	0,00	3.868.096,02	159.018,20	4,29%	4,29%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.529.144,90	0,00	0,00	2.680.936,93	151.792,03	6,00%	6,00%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.005.425,15	0,00	0,00	5.140.668,82	135.243,67	2,70%	2,70%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	728.860,00	0,00	36.960,00	788.920,00	97.020,00	13,31%	8,24%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	730.366,68	0,00	0,00	790.979,99	60.613,31	8,30%	8,30%
BTG PACTUAL CRÉDITO IMOBILIÁRIO FII - BTC11	355.916,00	0,00	25.168,00	362.340,00	31.592,00	8,88%	0,00%

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
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RB...	3.325,00	0,00	0,00	3.737,30	412,30	12,40%	12,40%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.987.816,62	0,00	0,00	2.977.944,14	-9.872,48	-0,33%	-0,33%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	4.310.000,00	0,00	54.353,10	3.820.000,00	-435.646,90	-10,11%	-11,36%
Total Renda Variável	179.491.844,75	0,00	196.470,14	196.172.118,11	16.876.743,50	9,40%	

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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	8.831.042,63	0,00	0,00	9.951.381,21	1.120.338,58	12,69%	12,69%
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	5.508.177,06	0,00	0,00	6.128.134,06	619.957,00	11,26%	11,26%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	21.017.193,84	0,00	0,00	21.618.402,99	601.209,15	2,86%	2,86%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	13.727.321,70	0,00	0,00	14.316.614,80	589.293,10	4,29%	4,29%
Total Exterior	49.083.735,23	0,00	0,00	52.014.533,06	2.930.797,83	5,97%	

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.