



Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2023

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			515.937.939,01	31,80%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	68.088.818,76	4,20%	657	1,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.400.936,29	0,76%	784	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	16.354.195,96	1,01%	481	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	32.944.830,54	2,03%	775	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	38.226.965,82	2,36%	934	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	13.958.066,23	0,86%	313	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	33.134.927,56	2,04%	17	11,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.879.578,70	0,18%	1.461	1,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	74.886.087,04	4,62%	120	6,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	42.911.840,48	2,64%	120	9,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	13.728.655,42	0,85%	21	3,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.687.192,43	0,23%	4.306	2,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.911.784,57	0,98%	207	2,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	36.540.248,29	2,25%	144	3,70%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	22.430.801,61	1,38%	82	6,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	17.338.845,40	1,07%	227	1,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITÁU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.000.594,72	0,68%	210	0,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	15.959.452,50	0,98%	14	11,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	8.016.573,05	0,49%	30	3,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	3.271.927,14	0,20%	467	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	D+45 a ...	01/08/2016	10.849.159,67	0,67%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	69.214,26	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
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'
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	11.036.809,44	0,68%	51.887	1,01%	Artigo 8º, Inciso I
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	31.670.310,88	1,95%	13	5,98%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	9.876.205,61	0,61%	3.870	3,85%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	40.165.644,85	2,48%	3.133	3,28%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	8.757.905,55	0,54%	38	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	8.830.812,25	0,54%	4.922	2,47%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.663.228,05	0,10%	2.610	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	21.305.374,48	1,31%	185	3,34%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	14.954.867,36	0,92%	158	1,69%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	32.029.172,29	1,97%	123	5,05%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	14.373.076,72	0,89%	208	6,20%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	27.937.459,42	1,72%	17.676	1,59%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.434.981,80	0,40%	39	1,30%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	12.707.947,55	0,78%	1.451	1,46%	Artigo 8º, Inciso I
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+7 du	Não há	1.966.283,90	0,12%	3	10,27%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	20.813.422,03	1,28%	50	1,49%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

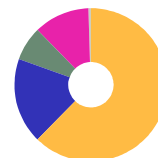
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	D+4 du ...	Não há	3.733.832,39	0,23%	37	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	15.628.351,66	0,96%	3.020	5,25%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR FIAÇÕES	D+4	Não há	10.689.003,81	0,66%	1.868	5,34%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	20.375.915,62	1,26%	100	1,75%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	13.103.510,05	0,81%	2	1,13%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.225.374,34	0,26%	1.726	5,51%	Artigo 9º, Inciso II
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO ...	D+11 du	Não há	14.862.646,29	0,92%	2	0,18%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	14.992.694,82	0,92%	5.319	1,88%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	5.490.722,91	0,34%	216	1,85%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO ...	D+8 du	Não há	10.703.200,05	0,66%	1.921	5,43%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+8 du	Não há	10.167.769,53	0,63%	509	5,16%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	23.919.339,48	1,47%	4.000	13,44%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	43.008.890,35	2,65%	2.165	9,40%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	13.532.137,63	0,83%	83	12,94%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	5.217.484,04	0,32%	583	3,06%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	12.488.258,45	0,77%	27	14,16%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	21.164.863,83	1,30%	21	9,71%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	13.499.697,41	0,83%	22	10,31%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.685.813,46	0,91%	20	8,92%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTR...	Não se ...	Não se aplica	595.870,12	0,04%	23	0,22%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	20.535.050,00	1,27%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	109.269,67	0,01%	39	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	7.886.290,06	0,49%	38	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.060.393,21	0,13%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	22.324.431,68	1,38%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	604.658,81	0,04%	18	0,14%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	12.204.148,53	0,75%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA		Não há	754.246,25	0,05%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	4.139.230,55	0,26%		5,88%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.648.000,00	0,29%		4,09%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		251.144,72	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.622.403.232,64				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			251.144,72				Artigo 6º
PL Total			1.622.654.377,36				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	515.937.939,01	31,80%	17,00%	32,00%	100,00%	1.106.465.293,63
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	353.202.095,23	21,77%	10,00%	20,00%	100,00%	1.269.201.137,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.622.403.232,64
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	81.120.161,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	130.470.227,28	8,04%	1,00%	7,00%	60,00%	842.971.712,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	973.441.939,58
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	324.480.646,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	10.918.373,94	0,67%	0,00%	0,00%	5,00%	70.201.787,69
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	81.120.161,63
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	81.120.161,63
Total Renda Fixa	100,00%	1.010.528.635,46	62,29%	28,00%	59,00%	460,00%	

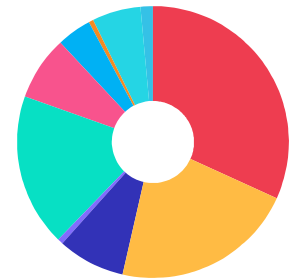


RENDA FIXA	1.010.528.635,46
RENDA VARIÁVEL	294.574.690,04
EXTERIOR	117.841.173,09
ESTRUTURADOS	190.671.503,50
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.787.230,55

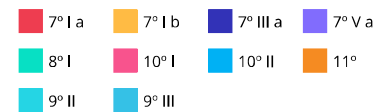
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	294.574.690,04	18,16%	6,00%	22,00%	35,00%	273.266.441,38
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	567.841.131,42
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	123.597.145,17	7,62%	1,00%	7,00%	10,00%	38.643.178,09
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	67.074.358,33	4,13%	1,00%	3,00%	5,00%	14.045.803,30
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	81.120.161,63
Artigo 11º	5,00%	8.787.230,55	0,54%	0,00%	0,00%	5,00%	72.332.931,08
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	494.033.424,09	30,45%	8,00%	32,00%	95,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	93.921.833,61	5,79%	1,00%	7,00%	10,00%	68.318.489,65
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	23.919.339,48	1,47%	1,00%	2,00%	10,00%	138.320.983,78
Total Exterior	10,00%	117.841.173,09	7,26%	2,00%	9,00%	20,00%	



Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	515.937.939,01	31,80	-
CAIXA DTVM	189.507.743,79	11,68	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	155.065.973,50	9,56	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	149.791.204,90	9,23	0,03
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	90.155.330,44	5,56	0,93
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	58.971.049,90	3,63	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	58.799.756,01	3,62	0,20
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	44.672.118,40	2,75	0,03
ITAÚ UNIBANCO	38.292.416,20	2,36	0,01
ITAÚ DTVM	34.372.441,22	2,12	0,01
ICATU VANGUARDA	33.134.927,56	2,04	0,06
ARX INVESTIMENTOS	31.670.310,88	1,95	0,07
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	28.530.609,73	1,76	0,02
XP GESTÃO DE RECURSOS	26.317.355,47	1,62	0,01
XP ASSET MANAGEMENT	25.096.343,92	1,55	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	22.929.090,49	1,41	0,01
TARPON INVESTIMENTOS	20.813.422,03	1,28	0,40
VINCI PARTNERS	16.692.227,17	1,03	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	15.367.837,15	0,95	0,15
OCCAM BRASIL	12.707.947,55	0,78	0,10
ALASKA ASSET MANAGEMENT	11.036.809,44	0,68	0,12
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	11.000.594,72	0,68	-
OLIVEIRA TRUST	10.949.159,67	0,67	0,10
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.490.722,91	0,34	0,07
REAG GESTORA DE RECURSOS	4.648.000,00	0,29	0,01

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	515.937.939,01	31,80	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	353.202.095,23	21,77	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	130.470.227,28	8,04	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	10.918.373,94	0,67	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	294.574.690,04	18,16	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	93.921.833,61	5,79	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	23.919.339,48	1,47	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	123.597.145,17	7,62	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	67.074.358,33	4,13	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	8.787.230,55	0,54	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	1,23%	5,88%	3,56%	7,18%	14,83%	25,38%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	1,30%	6,23%	3,76%	7,60%	15,79%	28,00%	0,00%	0,00%

CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,43%	6,86%	4,14%	8,39%	17,43%	31,14%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-20,34%	-42,13%	-0,92%	-10,77%	11.789.999.900,00%	287,98%	-	-

IMA-B 5 (Benchmark)	0,57%	5,93%	3,02%	6,92%	9,45%	19,90%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,61%	5,90%	3,02%	6,87%	9,27%	19,31%	0,68%	0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,60%	5,85%	2,99%	6,83%	9,12%	18,95%	0,68%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	5,91%	3,04%	6,89%	9,41%	19,60%	0,63%	0,02%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	0,56%	5,85%	2,99%	6,85%	8,99%	19,01%	0,65%	0,03%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,56%	5,83%	2,96%	6,81%	9,23%	19,39%	0,67%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	2,53%	8,76%	7,39%	8,55%	10,47%	15,54%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,64%	8,72%	7,43%	8,46%	10,14%	15,01%	1,54%	0,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,66%	8,88%	7,53%	8,59%	10,24%	14,73%	1,55%	0,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,57%	8,71%	7,49%	8,42%	10,21%	14,97%	1,51%	0,04%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,85%	8,74%	7,44%	8,52%	9,94%	14,64%	1,70%	0,05%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,51%	8,64%	7,32%	8,40%	10,19%	14,96%	1,49%	0,04%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,56%	7,11%	5,45%	6,97%	9,05%	8,96%	1,16%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	2,20%	7,34%	5,54%	8,93%	14,73%	16,57%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	7,20%	5,47%	8,74%	14,38%	15,91%	0,80%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,20%	7,30%	5,49%	8,85%	14,60%	16,28%	0,81%	0,03%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,17%	7,23%	5,47%	8,80%	14,54%	15,91%	0,81%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,19%	5,17%	3,24%	6,36%	13,50%	23,20%	0,02%	0,00%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	900,00%	-	900,00%	0,00%	-	-	-
IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88%	6,83%	5,12%	7,65%	12,47%	17,91%	0,69%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,81%	6,03%	3,94%	7,24%	12,48%	16,41%	0,56%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,35%	7,88%	6,13%	7,48%	11,36%	20,73%	1,00%	0,03%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	1,91%	-	5,79%	-	-	-	1,72%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,74%	-0,75%	1,64%	-	-	-	4,91%	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,40%	5,43%	3,64%	6,98%	-	-	0,52%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	8,42%	-4,91%	-2,38%	-6,26%	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	0,63%	2,43%	0,47%	3,30%	2,11%	-58,98%	-	-
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	1,25%	4,67%	2,44%	5,46%	10,78%	19,98%	0,33%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	3,74%	-1,28%	3,24%	-3,69%	-2,71%	-14,17%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,20%	3,59%	6,51%	1,03%	-1,45%	-7,32%	8,54%	0,19%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	8,21%	7,70%	9,82%	3,75%	4,03%	2,38%	9,29%	0,22%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,47%	-5,48%	2,02%	-7,83%	-10,85%	-19,99%	8,15%	0,21%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2,05%	-3,77%	0,03%	-7,44%	-9,03%	-25,30%	5,47%	0,20%
BB AGRO FIC AÇÕES	2,66%	-5,03%	-2,72%	-7,52%	-12,35%	-11,07%	7,61%	0,20%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,44%	-2,50%	-0,58%	-5,48%	-4,40%	-38,53%	7,65%	0,24%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,48%	1,50%	2,00%	0,48%	-6,59%	-	3,22%	0,07%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	2,12%	5,97%	3,98%	8,73%	-	-	2,69%	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,70%	-0,90%	3,15%	-4,34%	-5,27%	-17,03%	8,41%	0,19%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,86%	0,57%	3,95%	-1,77%	-2,60%	-3,84%	7,23%	0,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,64%	-6,49%	-2,04%	-4,81%	-4,28%	-20,00%	6,88%	0,22%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4,71%	-0,75%	3,15%	-2,86%	-1,04%	-17,84%	7,73%	0,19%
OCCAM FIC AÇÕES	0,44%	-5,07%	-1,26%	-7,60%	-5,85%	-17,65%	7,19%	0,17%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,79%	1,50%	2,29%	1,38%	6,19%	-	2,62%	0,06%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,40%	2,06%	1,56%	1,51%	4,80%	-	3,35%	0,06%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	13,28%	13,36%	13,63%	7,95%	20,91%	24,32%	6,83%	0,29%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6,14%	0,91%	4,51%	-4,03%	-6,49%	-20,56%	8,46%	0,23%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,02%	4,30%	6,15%	2,80%	5,83%	2,22%	6,74%	0,19%
XP INVESTOR FI AÇÕES	5,21%	3,80%	6,40%	2,16%	2,64%	-7,50%	8,30%	0,20%
IDIV (Benchmark)	0,84%	0,48%	2,64%	-1,14%	-0,85%	1,55%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2,31%	1,88%	5,00%	-0,59%	-0,78%	-6,36%	6,19%	0,16%
IFIX (Benchmark)	5,43%	5,10%	7,30%	5,10%	6,84%	6,99%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	10,79%	-0,58%	12,76%	3,01%	-17,39%	-36,77%	16,15%	0,27%
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,46%	9,01%	5,17%	11,03%	19,46%	53,50%	-	-

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

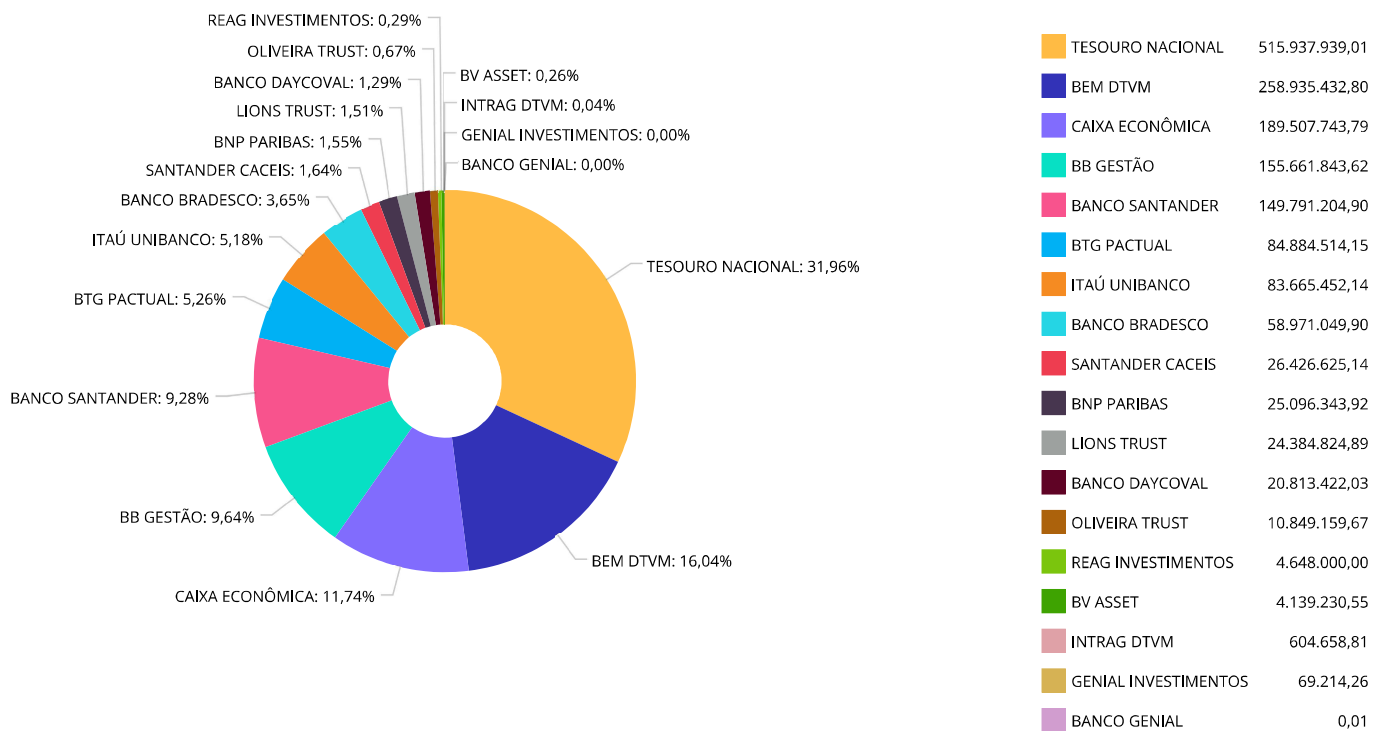
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-2,40%	-24,89%	-5,18%	-25,61%	-94,02%	-94,21%	0,83%	0,87%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,74%	5,43%	3,05%	6,63%	10,15%	30,45%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,10%	16,62%	16,85%	16,49%	-2,59%	73,57%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,24%	11,19%	11,54%	10,24%	5,53%	-	-	0,12%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	0,81%	-6,36%	-0,61%	-7,56%	-8,94%	-9,63%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,82%	5,84%	3,29%	7,13%	11,18%	32,92%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	1,04%	-22,52%	-5,14%	-0,90%	39,62%	10,67%	23,81%	0,39%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,91%	6,24%	3,53%	7,62%	12,22%	35,41%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,69%	-3,75%	-3,68%	2,01%	-1,19%	15,15%	-	-
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,03%	6,84%	3,89%	8,36%	13,77%	39,19%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	4,04%	51,95%	52,13%	51,88%	37,84%	103,03%	6,64%	0,48%
S&P 500 (Benchmark)	0,25%	8,86%	5,28%	2,44%	1,15%	-0,58%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1,23%	12,43%	7,55%	6,96%	15,57%	21,88%	6,06%	0,20%
SMLL (Benchmark)	13,54%	4,71%	13,69%	1,56%	-7,34%	-32,24%	-	-

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

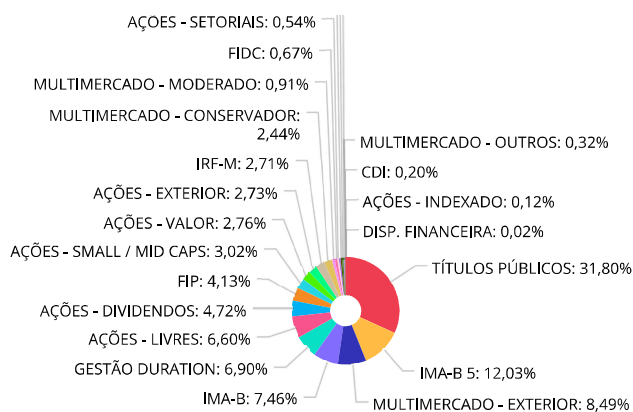
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,56%	0,58%	3,54%	-1,24%	-7,32%	-25,59%	5,71%	0,21%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,56%	0,56%	3,23%	-1,26%	-6,88%	-25,11%	5,74%	0,21%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,90%	14,58%	8,54%	9,75%	14,79%	-0,17%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	1,62%	0,86%	1,54%	-2,89%	3,56%	-1,37%	6,43%	13,072%
MSCI WORLD (Benchmark)	0,63%	5,09%	0,95%	-0,93%	8,13%	-8,34%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1,04%	1,81%	-0,55%	-0,37%	7,51%	-15,19%	7,38%	13,073%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,15%	5,77%	0,57%	4,87%	13,44%	-1,22%	8,75%	13,146%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,56%	4,28%	0,55%	-1,39%	6,70%	-11,51%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	2,61%	5,57%	3,40%	5,78%	13,30%	-7,12%	9,11%	14,021%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	0,87%	0,93%	0,65%	-2,91%	9,38%	-7,47%	6,27%	16,209%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	5,62%	-12,59%	-9,89%	-11,22%	3,34%	4,93%	7,00%	-
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULT...	4,47%	-6,98%	-5,97%	-6,36%	4,59%	22,75%	4,77%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	3,58%	4,79%	-3,42%	-0,24%	18,99%	-	6,39%	19,603%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIM...	2,06%	5,34%	0,43%	-	-	-	8,59%	-



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



TÍTULOS PÚBLICOS	515.937.939,01	IMA-B 5	195.189.165,00	MULTIMERCADO - EXTERIOR	137.742.218,59
IMA-B	121.119.495,69	GESTÃO DURATION	112.034.244,02	AÇÕES - LIVRES	107.055.335,23
AÇÕES - DIVIDENDOS	76.626.606,62	FIP	67.074.358,33	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	48.923.550,40
AÇÕES - VALOR	44.737.119,84	AÇÕES - EXTERIOR	44.272.708,68	IRF-M	44.040.917,61
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	39.520.093,49	MULTIMERCADO - MODERADO	14.685.813,46	FIDC	10.918.373,94
AÇÕES - SETORIAIS	8.830.812,25	FUNDO IMOBILIÁRIO	8.787.230,55	IDKA IPCA 2A	8.016.573,05
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.434.981,80	MULTIMERCADO - OUTROS	5.217.484,04	CDI	3.271.927,14
AÇÕES - INDEXADO	1.966.283,90	DISP. FINANCEIRA	251.144,72		

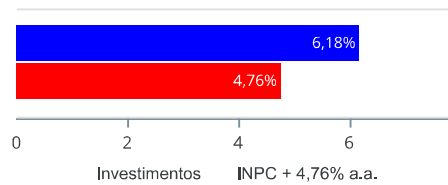
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.242,419713	10.048.181,87	14.424.227,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	13/12/2022	12.000	3959,170000	4.214,931826	47.510.040,00	50.579.181,91	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.299,174092	14.651.394,86	14.832.150,62	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.299,174092	7.520.551,00	13.757.357,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.299,174092	13.087.396,08	17.196.696,37	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.299,174092	25.480.686,71	25.795.044,55	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.299,174092	36.097.639,50	36.542.979,78	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.299,174092	55.208.154,53	55.889.263,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.347,002438	24.699.419,65	26.082.014,63	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.347,002438	20.000.340,99	21.408.987,01	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.347,002438	20.609.488,43	22.061.037,37	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.347,002438	25.008.464,96	26.951.415,12	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.280,851585	25.347.747,49	25.685.109,51	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.280,851585	41.512.279,91	42.808.515,85	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.280,851585	25.038.468,13	26.969.364,99	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/04/2022	12.000	4159,261023	4.280,851585	49.911.132,28	51.370.219,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	16/05/2023	10.000	428.739,166800	4.358,437498	4.287.391.668,00	43.584.374,98	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	1.521.923.415,51	19.745.851,98	15.034.568,84	1.539.330.940,80	12.696.242,15	12.696.242,15	0,83%	0,83%	0,87%	0,87%	95,74%	5,49%
Fevereiro	1.539.330.940,80	164.546.755,80	162.749.949,62	1.532.011.715,31	-9.116.031,67	3.580.210,48	-0,59%	0,24%	1,11%	1,98%	11,86%	4,56%
Março	1.532.011.715,31	42.891.324,38	37.407.841,36	1.558.225.520,96	20.730.322,63	24.310.533,11	1,35%	1,59%	1,07%	3,07%	51,64%	4,33%
Abril	1.558.225.520,96	42.954.742,00	43.288.697,99	1.584.077.622,79	26.186.057,82	50.496.590,93	1,68%	3,29%	0,86%	3,96%	83,10%	3,89%
Maió	1.584.077.622,79	143.992.950,33	149.974.636,62	1.622.403.232,64	44.307.296,14	94.803.887,07	2,80%	6,18%	0,77%	4,76%	129,83%	3,88%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

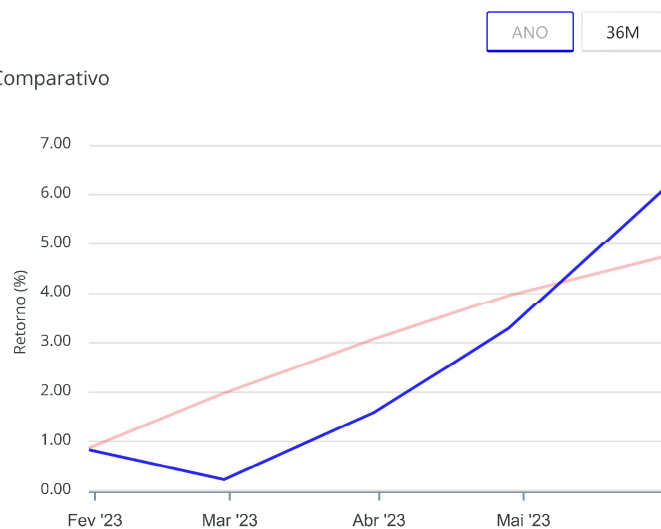


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	86.899,07	0,00	40.226,79	69.214,26	22.541,98	25,94%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	504.459.379,80	42.873.916,68	50.990.043,10	515.937.939,01	19.594.685,63	3,58%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.799.692,89	0,00	0,00	2.879.578,70	79.885,81	2,85%	2,85%	1,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	21.850.270,76	0,00	0,00	22.430.801,61	580.530,85	2,66%	2,66%	1,55%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.502.795,14	0,00	0,00	15.911.784,57	408.989,43	2,64%	2,64%	1,54%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	16.903.906,62	0,00	0,00	17.338.845,40	434.938,78	2,57%	2,57%	1,51%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	41.861.494,55	0,00	0,00	42.911.840,48	1.050.345,93	2,51%	2,51%	1,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.747.810,06	0,00	0,00	11.000.594,72	252.784,66	2,35%	2,35%	1,00%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.658.236,15	0,00	0,00	13.958.066,23	299.830,08	2,20%	2,20%	0,81%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	16.006.158,52	0,00	0,00	16.354.195,96	348.037,44	2,17%	2,17%	0,80%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.436.543,87	0,00	0,00	13.728.655,42	292.111,55	2,17%	2,17%	0,81%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	15.660.552,00	0,00	0,00	15.959.452,50	298.900,50	1,91%	1,91%	1,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	66.829.624,45	0,00	0,00	68.088.818,76	1.259.194,31	1,88%	1,88%	0,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	32.360.702,54	0,00	0,00	32.944.830,54	584.128,00	1,81%	1,81%	0,56%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.630.749,61	0,00	0,00	3.687.192,43	56.442,82	1,55%	1,55%	1,16%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	10.710.111,49	0,00	0,00	10.849.159,67	139.048,18	1,30%	1,30%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	37.987.435,68	0,00	0,00	38.226.965,82	239.530,14	0,63%	0,63%	0,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.325.634,59	0,00	0,00	12.400.936,29	75.301,70	0,61%	0,61%	0,68%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	36.323.784,42	0,00	0,00	36.540.248,29	216.463,87	0,60%	0,60%	0,68%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	74.469.898,81	0,00	0,00	74.886.087,04	416.188,23	0,56%	0,56%	0,67%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	32.950.871,26	0,00	0,00	33.134.927,56	184.056,30	0,56%	0,56%	0,65%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	18.850.348,26	62.462.854,66	78.303.916,68	3.271.927,14	262.640,90	0,32%	1,19%	0,02%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	8.000.000,00	0,00	8.016.573,05	16.573,05	0,21%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	999.412.900,55	113.336.771,34	129.334.186,57	1.010.528.635,46	27.113.150,14	2,71%		0,88%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	18.373.602,71	0,00	0,00	20.813.422,03	2.439.819,32	13,28%	13,28%	6,83%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	3.703.181,23	0,00	34.538,56	4.139.230,55	470.587,88	12,71%	10,79%	16,15%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10.199.091,53	0,00	0,00	11.036.809,44	837.717,91	8,21%	8,21%	9,29%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.548.096,14	0,00	0,00	1.663.228,05	115.131,91	7,44%	7,44%	7,65%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.517.837,44	0,00	0,00	3.733.832,39	215.994,95	6,14%	6,14%	8,46%
XP INVESTOR FI AÇÕES	10.160.157,93	0,00	0,00	10.689.003,81	528.845,88	5,21%	5,21%	8,30%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.145.319,24	0,00	0,00	6.434.981,80	289.662,56	4,71%	4,71%	7,73%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	38.413.041,43	0,00	0,00	40.165.644,85	1.752.603,42	4,56%	4,56%	5,71%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.375.972,68	0,00	0,00	8.757.905,55	381.932,87	4,56%	4,56%	5,74%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	30.315.268,92	0,00	0,00	31.670.310,88	1.355.041,96	4,47%	4,47%	8,15%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	572.736,72	0,00	0,00	595.870,12	23.133,40	4,04%	4,04%	6,64%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.024.178,65	0,00	0,00	15.628.351,66	604.173,01	4,02%	4,02%	6,74%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.838.897,02	0,00	0,00	14.373.076,72	534.179,70	3,86%	3,86%	7,23%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	30.886.248,26	0,00	0,00	32.029.172,29	1.142.924,03	3,70%	3,70%	8,41%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	20.579.911,49	0,00	21.305.374,48	725.462,99	3,53%	6,20%	8,54%
BB AGRO FIC AÇÕES	8.602.231,39	0,00	0,00	8.830.812,25	228.580,86	2,66%	2,66%	7,61%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	13.204.683,67	0,00	0,00	13.532.137,63	327.453,96	2,48%	2,48%	3,22%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.617.926,39	0,00	0,00	14.954.867,36	336.940,97	2,30%	2,30%	6,19%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.108.967,19	0,00	0,00	5.217.484,04	108.516,85	2,12%	2,12%	2,69%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.677.781,57	0,00	0,00	9.876.205,61	198.424,04	2,05%	2,05%	5,47%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13.261.765,57	0,00	0,00	13.499.697,41	237.931,84	1,79%	1,79%	2,62%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.600.000,00	0,00	26.000,00	4.648.000,00	74.000,00	1,61%	1,04%	23,81%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	20.871.868,31	0,00	0,00	21.164.863,83	292.995,52	1,40%	1,40%	0,52%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	12.333.734,48	0,00	0,00	12.488.258,45	154.523,97	1,25%	1,25%	0,33%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	42.486.997,49	0,00	0,00	43.008.890,35	521.892,86	1,23%	1,23%	6,06%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATÉGIA	746.779,75	0,00	0,00	754.246,25	7.466,50	1,00%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.145.403,74	0,00	0,00	22.324.431,68	179.027,94	0,81%	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	27.761.161,84	0,00	0,00	27.937.459,42	176.297,58	0,64%	0,64%	6,88%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTISTRATÉGIA	2.047.522,36	0,00	0,00	2.060.393,21	12.870,85	0,63%	-	-
OCCAM FIC AÇÕES	12.652.493,22	0,00	0,00	12.707.947,55	55.454,33	0,44%	0,44%	7,19%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.627.311,68	0,00	0,00	14.685.813,46	58.501,78	0,40%	0,40%	3,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	20.501.347,48	0,00	20.579.911,49	0,00	78.564,01	0,38%	5,24%	8,46%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTISTRATÉGIA	11.808.456,24	350.000,00	0,00	12.204.148,53	45.692,29	0,38%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATÉGIA	20.555.688,00	0,00	0,00	20.535.050,00	-20.638,00	-0,10%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTISTR...	7.905.520,50	0,00	0,00	7.886.290,06	-19.230,44	-0,24%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	385.969,95	226.267,50	0,00	604.658,81	-7.578,64	-1,24%	-	-
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	2.001.018,17	0,00	0,00	1.966.283,90	-34.734,27	-1,74%	-1,74%	4,91%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	111.952,30	0,00	0,00	109.269,67	-2.682,63	-2,40%	-2,40%	0,83%
Total Renda Variável	479.090.211,19	21.156.178,99	20.640.450,05	494.033.424,09	14.427.483,96	3,01%		6,39%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	9.626.513,62	0,00	0,00	10.167.769,53	541.255,91	5,62%	5,62%	7,00%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	10.245.558,72	0,00	0,00	10.703.200,05	457.641,33	4,47%	4,47%	4,77%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.351.064,60	0,00	0,00	5.490.722,91	139.658,31	2,61%	2,61%	9,11%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	4.998.824,03	9.500.000,00	0,00	14.862.646,29	363.822,26	2,51%	3,58%	6,39%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	19.947.842,55	0,00	0,00	20.375.915,62	428.073,07	2,15%	2,15%	8,75%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	12.839.314,06	0,00	0,00	13.103.510,05	264.195,99	2,06%	2,06%	8,59%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	23.537.469,46	0,00	0,00	23.919.339,48	381.870,02	1,62%	1,62%	6,43%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.838.797,38	0,00	0,00	14.992.694,82	153.897,44	1,04%	1,04%	7,38%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.189.126,63	0,00	0,00	4.225.374,34	36.247,71	0,87%	0,87%	6,27%
Total Exterior	105,574,511,05	9,500,000,00	0,00	117,841,173,09	2,766,662,04	2,40%		7,20%

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.

