

Relatório Analítico dos Investimentos

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



Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			532.552.263,40	31,65%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	69.317.237,44	4,12%	664	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.528.779,27	0,74%	783	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	16.696.444,21	0,99%	515	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	33.638.247,12	2,00%	773	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	38.621.296,93	2,30%	927	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.251.175,82	0,85%	352	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	33.466.324,75	1,99%	15	12,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.951.808,14	0,18%	1.525	1,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	75.656.486,10	4,50%	118	6,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	43.930.695,94	2,61%	62	11,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.016.429,10	0,83%	23	2,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.755.447,29	0,22%	4.234	2,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	16.291.477,89	0,97%	218	2,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	36.916.969,62	2,19%	139	3,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	22.964.376,80	1,36%	82	6,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	17.750.412,06	1,05%	228	1,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.245.257,92	0,67%	208	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	16.215.417,00	0,96%	14	11,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	7.970.910,76	0,47%	31	3,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 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	2.584.826,95	0,15%	470	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	D+45 a ...	01/08/2016	10.983.571,17	0,65%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
MASTER II FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	55.277,22	0,00%		3,64%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL 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	12.052.818,73	0,72%	51.084	1,02%	Artigo 8º, Inciso I
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	34.410.828,85	2,04%	12	6,40%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	10.856.485,09	0,65%	3.732	3,90%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	43.765.361,56	2,60%	3.044	3,30%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	9.523.474,91	0,57%	39	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	9.347.654,89	0,56%	4.867	2,47%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.819.327,99	0,11%	2.523	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	23.387.807,81	1,39%	184	3,34%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	16.164.138,41	0,96%	156	1,69%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	34.711.228,60	2,06%	123	5,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	15.696.662,07	0,93%	207	6,35%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	29.408.653,61	1,75%	17.026	1,61%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.953.951,11	0,41%	38	1,41%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	13.997.302,11	0,83%	1.398	1,46%	Artigo 8º, Inciso I
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+7 du	Não há	1.880.544,05	0,11%	3	10,49%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	22.920.736,19	1,36%	49	1,46%	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
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.119.432,77	0,24%	38	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	16.919.055,37	1,01%	3.155	5,17%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	11.589.984,97	0,69%	1.841	5,38%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	20.091.848,18	1,19%	102	1,75%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	12.918.183,89	0,77%	2	1,12%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.242.499,93	0,25%	1.656	5,68%	Artigo 9º, Inciso II
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO ...	D+11 du	Não há	14.264.265,84	0,85%	2	0,19%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	14.876.448,74	0,88%	4.967	2,34%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	5.349.620,91	0,32%	212	1,85%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO ...	D+8 du	Não há	10.874.902,20	0,65%	1.830	5,66%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+8 du	Não há	9.699.259,21	0,58%	496	5,05%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	23.675.665,00	1,41%	3.835	13,69%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	46.051.277,36	2,74%	2.264	9,37%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	14.105.995,16	0,84%	83	12,90%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	5.465.681,66	0,32%	583	3,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	8.204.602,02	0,49%	155	7,28%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	12.646.853,56	0,75%	27	14,16%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	21.555.475,24	1,28%	21	9,71%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.034.763,34	0,83%	22	10,31%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.570.865,41	0,87%	20	8,92%	Artigo 10º, Inciso I

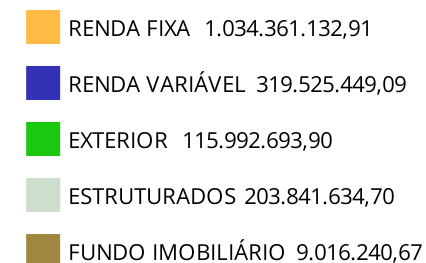
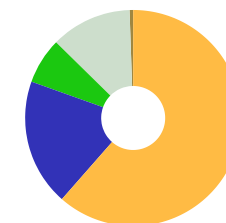


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	579.920,96	0,03%	29	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	20.482.588,01	1,22%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	98.070,75	0,01%	39	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	7.869.564,81	0,47%	38	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.080.106,34	0,12%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	22.448.356,02	1,33%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	601.507,88	0,04%	18	0,14%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	12.216.769,03	0,73%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	D+0	Não há	829.237,15	0,05%	10	2,91%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	4.316.240,67	0,26%		5,83%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.700.000,00	0,28%		4,09%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		263.146,43	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.682.737.151,27				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			263.146,43				Artigo 6º
PL Total			1.683.000.297,70				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 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%	532.552.263,40	31,65%	17,00%	32,00%	100,00%	1.150.184.887,87
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	358.830.372,11	21,32%	10,00%	20,00%	100,00%	1.323.906.779,16
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.682.737.151,27
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	84.136.857,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	131.939.649,00	7,84%	1,00%	7,00%	60,00%	877.702.641,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.009.642.290,76
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	336.547.430,25
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	11.038.848,40	0,66%	0,00%	0,00%	5,00%	73.098.009,16
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	84.136.857,56
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	84.136.857,56
Total Renda Fixa	100,00%	1.034.361.132,91	61,47%	28,00%	59,00%	460,00%	



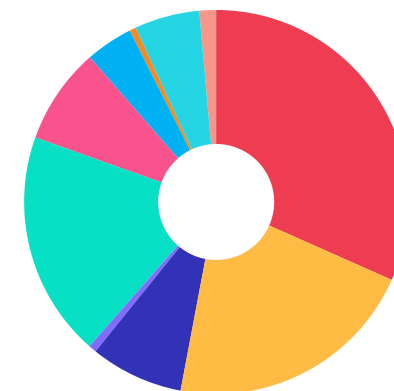
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



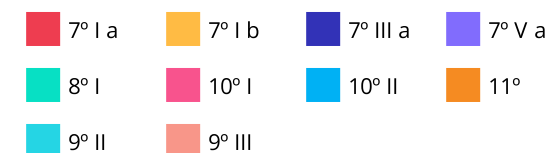


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	319.525.449,09	18,99%	6,00%	22,00%	35,00%	269.432.553,85
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	588.958.002,94
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	136.635.513,75	8,12%	1,00%	7,00%	10,00%	31.638.201,38
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	67.206.120,95	3,99%	1,00%	3,00%	5,00%	16.930.736,61
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	84.136.857,56
Artigo 11º	5,00%	9.016.240,67	0,54%	0,00%	0,00%	5,00%	75.120.616,89
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	532.383.324,46	31,64%	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%	92.317.028,90	5,49%	1,00%	7,00%	10,00%	75.956.686,23
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	23.675.665,00	1,41%	1,00%	2,00%	10,00%	144.598.050,13
Total Exterior	10,00%	115.992.693,90	6,89%	2,00%	9,00%	20,00%	





CRÉDITO
& MERCADO

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	532.552.263,40	31,65	-
CAIXA ASSET	206.300.585,59	12,26	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	157.191.625,77	9,34	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	151.064.886,83	8,98	0,03
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	90.492.241,64	5,38	0,94
AZ QUEST INVESTIMENTOS	64.145.321,56	3,81	0,22
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	59.881.346,42	3,56	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	47.870.605,35	2,84	0,03
ITAÚ UNIBANCO	39.372.327,07	2,34	0,01
ITAÚ DTVM	36.362.604,72	2,16	0,01
ARX INVESTIMENTOS	34.410.828,85	2,04	0,08
ICATU VANGUARDA	33.466.324,75	1,99	0,06
XP GESTÃO DE RECURSOS	28.509.040,34	1,69	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	28.450.223,57	1,69	0,02
XP ASSET MANAGEMENT	24.816.661,34	1,47	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	23.049.863,90	1,37	0,01
TARPON INVESTIMENTOS	22.920.736,19	1,36	0,32
VINCI PARTNERS	17.165.438,95	1,02	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	15.598.661,70	0,93	0,13
OCCAM BRASIL	13.997.302,11	0,83	0,12
ALASKA ASSET MANAGEMENT	12.052.818,73	0,72	0,12
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	11.245.257,92	0,67	-
OLIVEIRA TRUST	10.983.571,17	0,65	0,09
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.349.620,91	0,32	0,07
REAG GESTORA DE RECURSOS	4.700.000,00	0,28	0,01

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 '	532.552.263,40	31,65	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	358.830.372,11	21,32	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 '	131.939.649,00	7,84	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	11.038.848,40	0,66	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	319.525.449,09	18,99	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	92.317.028,90	5,49	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	23.675.665,00	1,41	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	136.635.513,75	8,12	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	67.206.120,95	3,99	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	9.016.240,67	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 Junho/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	1,17%	7,13%	3,44%	7,13%	14,90%	26,34%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	1,24%	7,54%	3,64%	7,54%	15,83%	28,93%	-	-
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,36%	8,32%	4,01%	8,32%	17,50%	32,14%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-20,19%	-53,81%	-29,51%	-53,81%	-37,02%	235,57%	-	-
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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03%	6,92%	2,49%	6,92%	10,00%	20,81%	0,89%	0,02%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	1,00%	6,91%	2,47%	6,91%	9,72%	20,38%	0,87%	0,03%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,03%	6,94%	2,52%	6,94%	9,94%	20,35%	0,90%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,38%	11,47%	7,19%	11,47%	13,33%	16,94%	2,19%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,39%	11,31%	7,20%	11,31%	13,23%	17,29%	2,17%	0,04%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,85%	9,09%	5,18%	9,09%	11,34%	10,46%	1,95%	0,04%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,37%	11,22%	7,05%	11,22%	13,24%	17,23%	2,16%	0,04%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,51%	11,47%	7,48%	11,47%	13,21%	17,04%	2,29%	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,37%	11,29%	7,16%	11,29%	13,23%	17,19%	2,15%	0,05%



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
IRF-M (Benchmark)	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,10%	9,48%	5,45%	9,48%	16,45%	18,13%	0,91%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,10%	9,56%	5,47%	9,56%	16,61%	18,51%	0,90%	0,03%
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%	-	-
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%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	-0,57%	-	-	-	-	-	4,33%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
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 FI MULTIMERCADO	1,85%	7,37%	3,92%	7,37%	-	-	0,58%	-
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-4,36%	-5,08%	-4,30%	-5,08%	-	-	4,10%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	-2,41%	-	-	-	-	-	3,10%	0,24%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	0,96%	3,41%	0,28%	3,41%	2,11%	-58,54%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,52%	-5,41%	5,46%	-5,41%	-	-	-	0,14%
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%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	2,21%	-	-	-	-	-	2,47%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	4,76%	11,01%	8,48%	11,01%	-	-	2,45%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	4,24%	5,80%	7,08%	5,80%	-2,85%	-	3,85%	0,09%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	-0,78%	1,26%	-1,19%	1,26%	1,81%	-	1,67%	0,06%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,39%	6,66%	15,10%	6,66%	17,15%	-33,62%	7,85%	0,22%
OCCAM FIC AÇÕES	10,15%	4,56%	11,89%	4,56%	13,86%	-8,85%	8,32%	0,18%
BB AGRO FIC AÇÕES	5,85%	0,53%	8,15%	0,53%	7,14%	-4,48%	7,30%	0,16%

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
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,07%	7,26%	15,64%	7,26%	19,04%	-11,73%	7,03%	0,17%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,93%	5,78%	14,56%	5,78%	13,83%	-18,28%	8,64%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,27%	-1,57%	7,34%	-1,57%	13,35%	-15,61%	7,12%	0,19%
XP INVESTOR FI AÇÕES	8,43%	12,55%	17,61%	12,55%	20,30%	-2,51%	6,12%	0,20%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,65%	2,70%	14,55%	2,70%	10,94%	-13,43%	8,57%	0,19%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	9,21%	9,83%	16,96%	9,83%	19,50%	7,28%	7,34%	0,16%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,26%	12,91%	16,42%	12,91%	21,38%	11,22%	6,15%	0,19%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9,21%	17,61%	22,83%	17,61%	29,24%	9,31%	8,09%	0,18%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8,37%	7,39%	15,81%	7,39%	15,11%	-9,65%	7,57%	0,17%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10,33%	11,33%	19,32%	11,33%	16,60%	-11,98%	7,84%	0,21%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	10,13%	24,83%	30,45%	24,83%	48,58%	32,81%	10,29%	0,26%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,77%	13,72%	19,95%	13,72%	20,91%	2,63%	8,04%	0,18%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3,96%	5,52%	6,65%	5,52%	12,62%	-	3,44%	0,06%
IDIV (Benchmark)	8,78%	9,30%	13,95%	9,30%	17,73%	12,91%	-	-
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 RENDA II FII - RBRD11	5,24%	4,63%	20,63%	4,63%	4,55%	-33,90%	18,40%	0,22%

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 + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,09%	10,19%	4,23%	10,19%	18,57%	52,56%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-10,25%	-32,59%	-13,26%	-32,59%	-57,91%	-94,79%	10,04%	0,31%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,41%	5,86%	2,19%	5,86%	9,33%	29,66%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	0,56%	-5,84%	0,44%	-5,84%	-6,36%	-7,69%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,21%	10,95%	-0,06%	10,95%	6,98%	-	-	0,12%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,26%	16,32%	-0,43%	16,32%	-2,18%	74,04%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,48%	6,35%	2,42%	6,35%	10,35%	32,11%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	1,12%	-21,65%	3,23%	-21,65%	40,76%	17,79%	7,09%	0,39%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,56%	6,84%	2,66%	6,84%	11,38%	34,59%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	0,10%	-3,65%	-1,87%	-3,65%	-2,38%	17,29%	-	-
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	0,68%	7,57%	3,00%	7,57%	12,92%	38,35%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	-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%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7,07%	20,38%	10,59%	20,38%	34,24%	27,00%	5,06%	0,19%



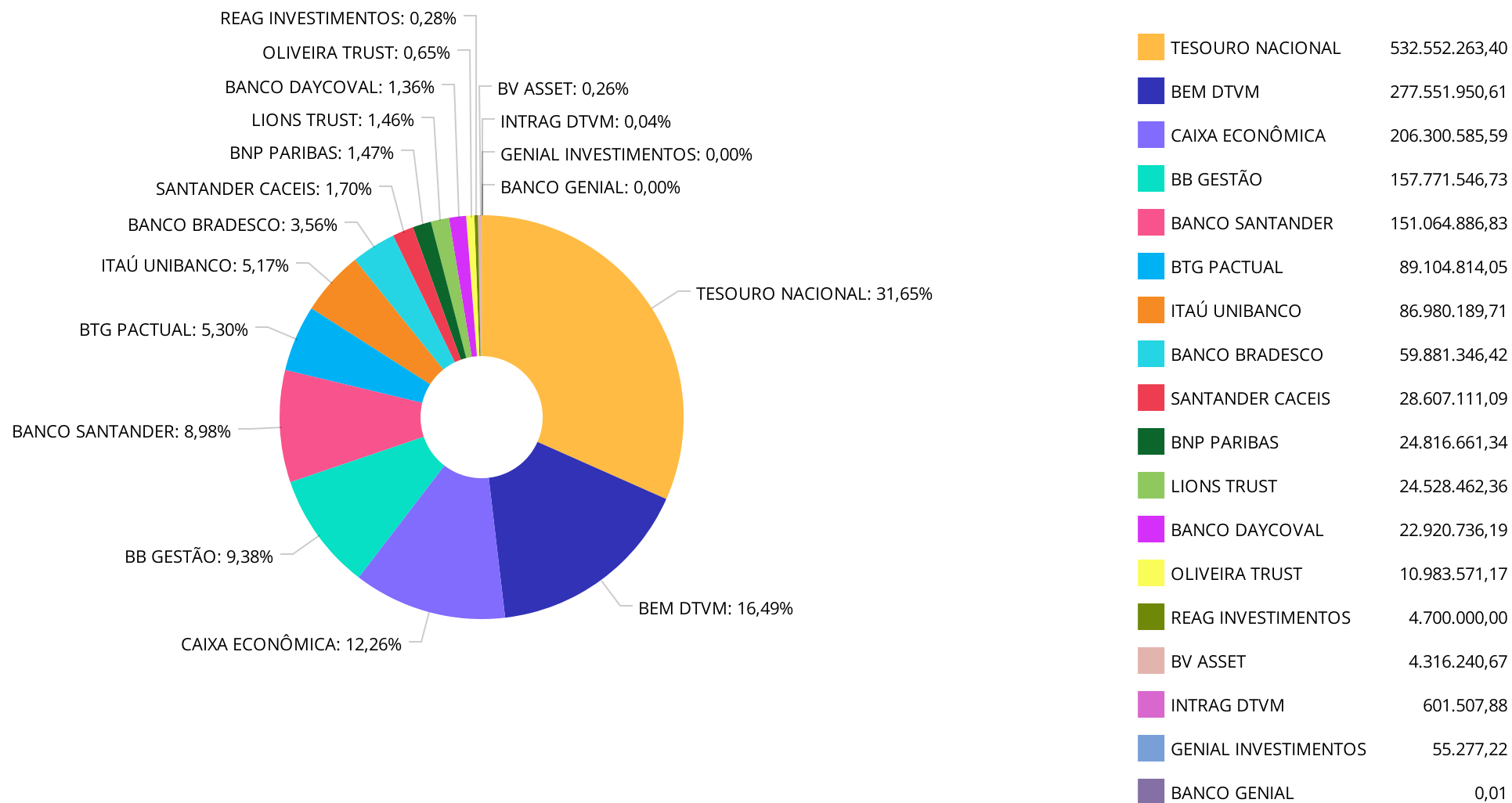
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,74%	9,35%	15,69%	9,35%	13,42%	-19,86%	8,83%	0,19%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8,96%	9,59%	15,93%	9,59%	13,67%	-20,21%	9,11%	0,20%

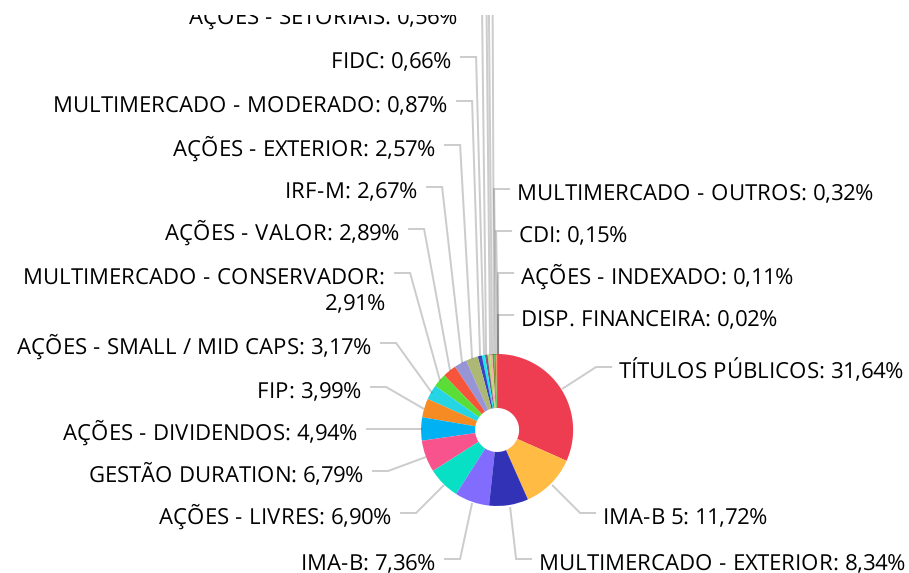
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	-1,02%	-0,16%	2,20%	-0,16%	2,31%	2,05%	5,44%	13,145%
MSCI WORLD (Benchmark)	0,18%	5,28%	0,82%	5,28%	7,20%	-5,27%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-0,78%	1,02%	0,12%	1,02%	7,24%	-13,40%	5,16%	13,100%
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%
MSCI ACWI (Benchmark)	-0,09%	4,18%	0,15%	4,18%	5,27%	-8,63%	-	-
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	0,41%	1,34%	1,32%	1,34%	9,60%	-3,42%	5,47%	16,202%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,57%	2,86%	-0,13%	2,86%	10,03%	-6,01%	8,25%	14,492%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULT...	1,60%	-5,49%	7,20%	-5,49%	-0,91%	29,15%	4,43%	17,536%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	-4,61%	-16,62%	-0,30%	-16,62%	-14,99%	8,44%	7,42%	23,040%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIM...	-1,41%	3,85%	-0,64%	3,85%	-	-	5,55%	-
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	-4,03%	0,57%	-4,55%	0,57%	13,15%	-	6,78%	20,398%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	532.552.263,40	■ IMA-B 5	197.189.856,67	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	140.309.894,75
■ IMA-B	123.859.635,12	■ AÇÕES - LIVRES	116.155.247,16	■ GESTÃO DURATION	114.200.742,48
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	83.190.684,70	■ FIP	67.206.120,95	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	53.288.836,47
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	48.992.214,08	■ AÇÕES - VALOR	48.708.530,71	■ IRF-M	44.964.049,13
■ AÇÕES - EXTERIOR	43.289.551,75	■ MULTIMERCADO - MODERADO	14.570.865,41	■ FIDC	11.038.848,40
■ AÇÕES - SETORIAIS	9.347.654,89	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	9.016.240,67	■ IDKA IPCA 2A	7.970.910,76
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.953.951,11	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.465.681,66	■ CDI	2.584.826,95
■ AÇÕES - INDEXADO	1.880.544,05	■ DISP. FINANCEIRA	263.146,43		



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

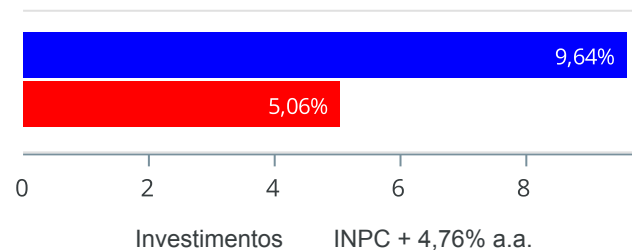
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.284,293039	10.048.181,87	14.566.596,33	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	13/12/2022	12.000	3959,170000	4.255,739586	47.510.040,00	51.068.875,03	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.434,879497	14.651.394,86	15.300.334,26	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.434,879497	7.520.551,00	14.191.614,39	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.434,879497	13.087.396,08	17.739.517,99	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.434,879497	25.480.686,71	26.609.276,98	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.434,879497	36.097.639,50	37.696.475,72	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.434,879497	55.208.154,53	57.653.433,46	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.505,338858	24.699.419,65	27.032.033,15	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.505,338858	20.000.340,99	22.188.793,88	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.505,338858	20.609.488,43	22.864.594,70	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.505,338858	25.008.464,96	27.933.100,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.442,059123	25.347.747,49	26.652.354,74	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.442,059123	41.512.279,91	44.420.591,23	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.442,059123	25.038.468,13	27.984.972,47	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/04/2022	12.000	4159,261023	4.442,059123	49.911.132,28	53.304.709,48	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	16/05/2023	10.000	428.739,166800	4.534,498866	4.287.391.668,00	45.344.988,66	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%
Mai	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%
Junho	1.622.403.232,64	20.114.029,88	12.907.496,29	1.682.737.151,27	53.127.385,04	147.931.272,11	3,26%	9,64%	0,29%	5,06%	190,45%	4,10%

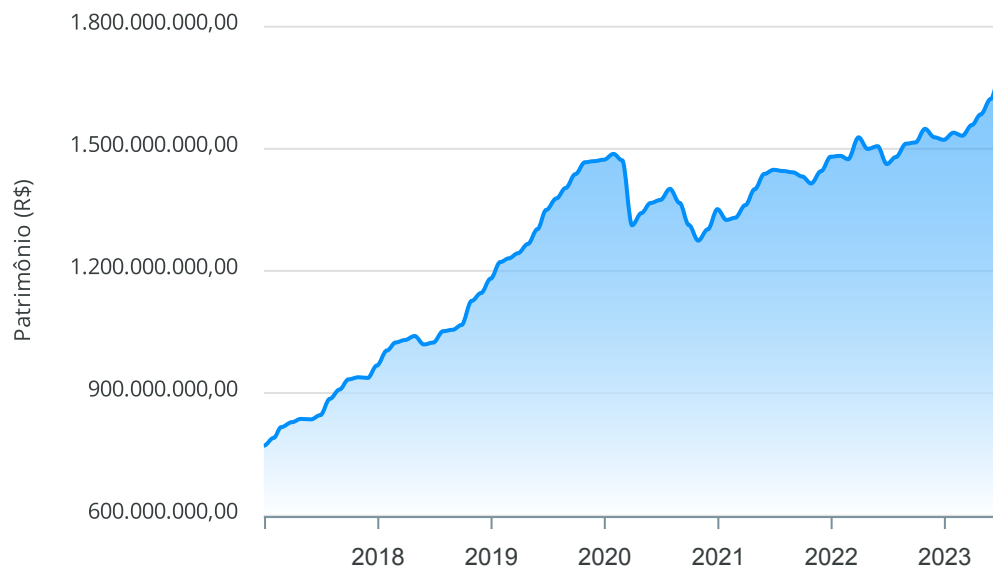
Investimentos x Meta de Rentabilidade



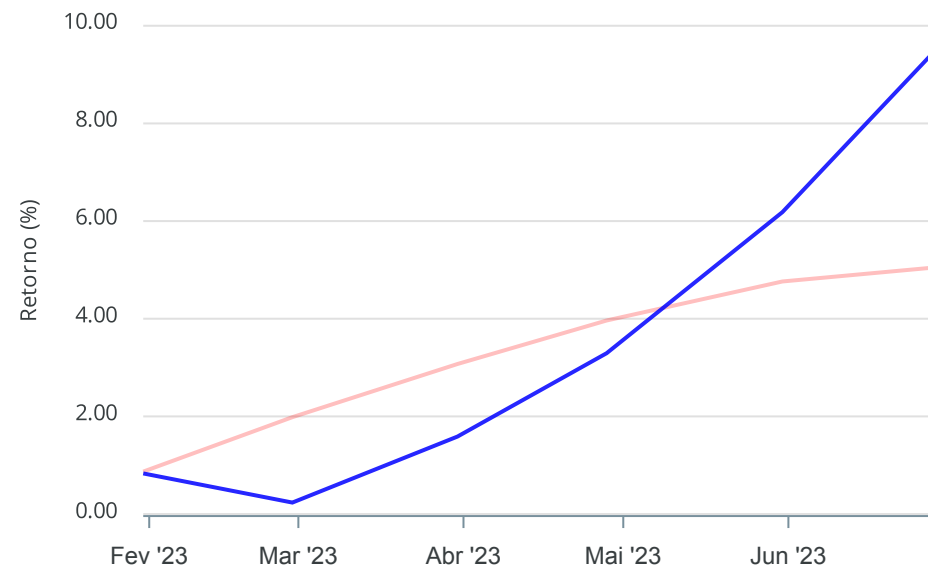
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	69.214,26	0,00	23.815,11	55.277,22	9.878,07	14,27%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	515.937.939,01	0,00	0,00	532.552.263,40	16.614.324,39	3,22%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.879.578,70	0,00	0,00	2.951.808,14	72.229,44	2,51%	2,51%	2,29%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.911.784,57	0,00	0,00	16.291.477,89	379.693,32	2,39%	2,39%	2,17%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	22.430.801,61	0,00	0,00	22.964.376,80	533.575,19	2,38%	2,38%	2,19%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	42.911.840,48	0,00	0,00	43.930.695,94	1.018.855,46	2,37%	2,37%	2,16%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	17.338.845,40	0,00	0,00	17.750.412,06	411.566,66	2,37%	2,37%	2,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.000.594,72	0,00	0,00	11.245.257,92	244.663,20	2,22%	2,22%	1,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	32.944.830,54	0,00	0,00	33.638.247,12	693.416,58	2,10%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.958.066,23	0,00	0,00	14.251.175,82	293.109,59	2,10%	2,10%	0,90%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.728.655,42	0,00	0,00	14.016.429,10	287.773,68	2,10%	2,10%	0,91%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	16.354.195,96	0,00	0,00	16.696.444,21	342.248,25	2,09%	2,09%	0,90%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.687.192,43	0,00	0,00	3.755.447,29	68.254,86	1,85%	1,85%	1,95%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	68.088.818,76	0,00	0,00	69.317.237,44	1.228.418,68	1,80%	1,80%	0,95%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	15.959.452,50	0,00	0,00	16.215.417,00	255.964,50	1,60%	1,60%	2,57%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	10.849.159,67	0,00	0,00	10.983.571,17	134.411,50	1,24%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	38.226.965,82	0,00	0,00	38.621.296,93	394.331,11	1,03%	1,03%	0,88%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	36.540.248,29	0,00	0,00	36.916.969,62	376.721,33	1,03%	1,03%	0,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.400.936,29	0,00	0,00	12.528.779,27	127.842,98	1,03%	1,03%	0,90%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	74.886.087,04	0,00	0,00	75.656.486,10	770.399,06	1,03%	1,03%	0,89%



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
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	33.134.927,56	0,00	0,00	33.466.324,75	331.397,19	1,00%	1,00%	0,87%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	3.271.927,14	12.000.000,00	12.800.000,00	2.584.826,95	112.899,81	0,74%	1,15%	0,02%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	8.016.573,05	0,00	0,00	7.970.910,76	-45.662,29	-0,57%	-0,57%	4,33%
Total Renda Fixa	1.010.528.635,46	12.000.000,00	12.823.815,11	1.034.361.132,91	24.656.312,56	2,44%		1,30%

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
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.733.832,39	0,00	0,00	4.119.432,77	385.600,38	10,33%	10,33%	7,84%
OCCAM FIC AÇÕES	12.707.947,55	0,00	0,00	13.997.302,11	1.289.354,56	10,15%	10,15%	8,32%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	20.813.422,03	0,00	0,00	22.920.736,19	2.107.314,16	10,12%	10,12%	10,29%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.876.205,61	0,00	0,00	10.856.485,09	980.279,48	9,93%	9,93%	8,64%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	21.305.374,48	0,00	0,00	23.387.807,81	2.082.433,33	9,77%	9,77%	8,04%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.663.228,05	0,00	0,00	1.819.327,99	156.099,94	9,39%	9,39%	7,85%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.373.076,72	0,00	0,00	15.696.662,07	1.323.585,35	9,21%	9,21%	7,34%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	11.036.809,44	0,00	0,00	12.052.818,73	1.016.009,29	9,21%	9,21%	8,09%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	40.165.644,85	0,00	0,00	43.765.361,56	3.599.716,71	8,96%	8,96%	9,11%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.757.905,55	0,00	0,00	9.523.474,91	765.569,36	8,74%	8,74%	8,83%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	31.670.310,88	0,00	0,00	34.410.828,85	2.740.517,97	8,65%	8,65%	8,57%
XP INVESTOR FI AÇÕES	10.689.003,81	0,00	0,00	11.589.984,97	900.981,16	8,43%	8,43%	6,12%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	32.029.172,29	0,00	0,00	34.711.228,60	2.682.056,31	8,37%	8,37%	7,57%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.628.351,66	0,00	0,00	16.919.055,37	1.290.703,71	8,26%	8,26%	6,15%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.954.867,36	0,00	0,00	16.164.138,41	1.209.271,05	8,09%	8,09%	7,13%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.434.981,80	0,00	0,00	6.953.951,11	518.969,31	8,06%	8,06%	7,03%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	43.008.890,35	0,00	0,00	46.051.277,36	3.042.387,01	7,07%	7,07%	5,06%
BB AGRO FIC AÇÕES	8.830.812,25	0,00	0,00	9.347.654,89	516.842,64	5,85%	5,85%	7,30%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	27.937.459,42	0,00	0,00	29.408.653,61	1.471.194,19	5,27%	5,27%	7,12%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.139.230,55	0,00	34.538,56	4.316.240,67	211.548,68	5,11%	5,24%	18,40%

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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.217.484,04	0,00	0,00	5.465.681,66	248.197,62	4,76%	4,76%	2,45%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	13.532.137,63	0,00	0,00	14.105.995,16	573.857,53	4,24%	4,24%	3,85%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13.499.697,41	0,00	0,00	14.034.763,34	535.065,93	3,96%	3,96%	3,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	0,00	8.031.511,65	0,00	8.204.602,02	173.090,37	2,16%	2,21%	2,47%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	21.164.863,83	0,00	0,00	21.555.475,24	390.611,41	1,85%	1,85%	0,58%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.648.000,00	0,00	26.000,00	4.700.000,00	78.000,00	1,68%	1,12%	7,09%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	12.488.258,45	0,00	0,00	12.646.853,56	158.595,11	1,27%	1,27%	0,40%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.060.393,21	0,00	0,00	2.080.106,34	19.713,13	0,96%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.324.431,68	0,00	0,00	22.448.356,02	123.924,34	0,56%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	12.204.148,53	0,00	0,00	12.216.769,03	12.620,50	0,10%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	595.870,12	0,00	15.830,08	579.920,96	-119,08	-0,02%	-2,68%	4,39%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	7.886.290,06	0,00	0,00	7.869.564,81	-16.725,25	-0,21%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.535.050,00	0,00	0,00	20.482.588,01	-52.461,99	-0,26%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	604.658,81	0,00	0,00	601.507,88	-3.150,93	-0,52%	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.685.813,46	0,00	0,00	14.570.865,41	-114.948,05	-0,78%	-0,78%	1,67%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	754.246,25	82.518,23	0,00	829.237,15	-7.527,33	-0,90%	-2,41%	3,10%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	109.269,67	0,00	7.312,54	98.070,75	-3.886,38	-3,56%	-10,25%	10,04%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.966.283,90	0,00	0,00	1.880.544,05	-85.739,85	-4,36%	-4,36%	4,10%
Total Renda Variável	494.033.424,09	8.114.029,88	83.681,18	532.383.324,46	30.319.551,67	6,04%		6,62%



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
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	10.703.200,05	0,00	0,00	10.874.902,20	171.702,15	1,60%	1,60%	4,43%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.225.374,34	0,00	0,00	4.242.499,93	17.125,59	0,41%	0,41%	5,47%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.992.694,82	0,00	0,00	14.876.448,74	-116.246,08	-0,78%	-0,78%	5,16%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	23.919.339,48	0,00	0,00	23.675.665,00	-243.674,48	-1,02%	-1,02%	5,44%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	20.375.915,62	0,00	0,00	20.091.848,18	-284.067,44	-1,39%	-1,39%	5,66%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	13.103.510,05	0,00	0,00	12.918.183,89	-185.326,16	-1,41%	-1,41%	5,55%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.490.722,91	0,00	0,00	5.349.620,91	-141.102,00	-2,57%	-2,57%	8,25%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	14.862.646,29	0,00	0,00	14.264.265,84	-598.380,45	-4,03%	-4,03%	6,78%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	10.167.769,53	0,00	0,00	9.699.259,21	-468.510,32	-4,61%	-4,61%	7,42%
Total Exterior	117.841.173,09	0,00	0,00	115.992.693,90	-1.848.479,19	-1,57%		5,82%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	491.491.340,24	42.873.916,68	50.990.043,10	532.552.263,40	49.177.049,58	9,20%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	65.991.211,49	0,00	0,00	69.317.237,44	3.326.025,95	5,04%	5,04%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	41.038.498,85	0,00	0,00	43.930.695,94	2.892.197,09	7,05%	7,05%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	73.815.239,73	0,00	0,00	75.656.486,10	1.841.246,37	2,49%	2,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	32.080.634,29	0,00	0,00	33.638.247,12	1.557.612,83	4,86%	4,86%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	21.424.434,29	0,00	0,00	22.964.376,80	1.539.942,51	7,19%	7,19%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	16.564.001,49	0,00	0,00	17.750.412,06	1.186.410,57	7,16%	7,16%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.197.029,61	0,00	0,00	16.291.477,89	1.094.448,28	7,20%	7,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	37.654.108,46	0,00	0,00	38.621.296,93	967.188,47	2,57%	2,57%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	36.008.536,06	0,00	0,00	36.916.969,62	908.433,56	2,52%	2,52%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.835.868,26	0,00	0,00	16.696.444,21	860.575,95	5,43%	5,43%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	15.380.569,50	0,00	0,00	16.215.417,00	834.847,50	5,43%	5,43%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	32.660.142,86	0,00	0,00	33.466.324,75	806.181,89	2,47%	2,47%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.512.385,08	0,00	0,00	14.251.175,82	738.790,74	5,47%	5,47%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.291.691,85	0,00	0,00	14.016.429,10	724.737,25	5,45%	5,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.617.645,33	0,00	0,00	11.245.257,92	627.612,59	5,91%	5,91%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	27.468.873,50	88.662.854,66	114.173.916,68	2.584.826,95	627.015,47	0,54%	3,26%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	10.597.671,37	0,00	0,00	10.983.571,17	385.899,80	3,64%	3,64%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.216.420,65	0,00	0,00	12.528.779,27	312.358,62	2,56%	2,56%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.746.380,49	0,00	0,00	2.951.808,14	205.427,65	7,48%	7,48%



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
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.570.584,78	0,00	0,00	3.755.447,29	184.862,51	5,18%	5,18%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	78.388,21	0,00	95.464,02	55.277,22	72.353,03	92,30%	-29,51%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	8.000.000,00	0,00	7.970.910,76	-29.089,24	-0,36%	-
Total Renda Fixa	989.241.656,40	139.536.771,34	165.259.423,80	1.034.361.132,91	70.842.128,97	6,28%	

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	37.751.843,81	0,00	0,00	43.765.361,56	6.013.517,75	15,93%	15,93%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	17.570.975,04	0,00	0,00	22.920.736,19	5.349.761,15	30,45%	30,45%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	29.971.731,63	0,00	0,00	34.711.228,60	4.739.496,97	15,81%	15,81%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	41.643.382,72	0,00	0,00	46.051.277,36	4.407.894,64	10,58%	10,58%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	30.039.815,76	0,00	0,00	34.410.828,85	4.371.013,09	14,55%	14,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	20.579.911,49	0,00	23.387.807,81	2.807.896,32	13,64%	19,95%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.532.976,26	0,00	0,00	16.919.055,37	2.386.079,11	16,42%	16,42%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.420.228,38	0,00	0,00	15.696.662,07	2.276.433,69	16,96%	16,96%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.029.168,55	0,00	0,00	16.164.138,41	2.134.969,86	15,22%	15,22%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	12.052.818,73	2.052.818,73	20,53%	22,83%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	27.397.922,04	0,00	0,00	29.408.653,61	2.010.731,57	7,34%	7,34%
XP INVESTOR FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	11.589.984,97	1.589.984,97	15,90%	17,61%
OCCAM FIC AÇÕES	12.509.964,99	0,00	0,00	13.997.302,11	1.487.337,12	11,89%	11,89%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.476.650,14	0,00	0,00	10.856.485,09	1.379.834,95	14,56%	14,56%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.231.695,61	0,00	0,00	9.523.474,91	1.291.779,30	15,69%	15,69%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.013.725,29	0,00	0,00	6.953.951,11	940.225,82	15,63%	15,63%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	13.173.235,34	0,00	0,00	14.105.995,16	932.759,82	7,08%	7,08%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13.159.875,73	0,00	0,00	14.034.763,34	874.887,61	6,65%	6,65%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	3.576.899,62	0,00	103.615,68	4.316.240,67	842.956,73	23,57%	20,63%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	20.742.178,47	0,00	0,00	21.555.475,24	813.296,77	3,92%	3,92%

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
BB AGRO FIC AÇÕES	8.642.919,93	0,00	0,00	9.347.654,89	704.734,96	8,15%	8,15%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.452.511,87	0,00	0,00	4.119.432,77	666.920,90	19,32%	19,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	20.123.241,85	0,00	20.579.911,49	0,00	456.669,64	2,27%	15,52%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.038.589,49	0,00	0,00	5.465.681,66	427.092,17	8,48%	8,48%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	20.758.989,06	1.294.742,00	0,00	22.448.356,02	394.624,96	1,79%	0,44%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	12.262.424,67	0,00	0,00	12.646.853,56	384.428,89	3,14%	3,14%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.580.694,64	0,00	0,00	1.819.327,99	238.633,35	15,10%	15,10%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	0,00	8.031.511,65	0,00	8.204.602,02	173.090,37	2,16%	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	11.323.329,69	810.000,00	0,00	12.216.769,03	83.439,34	0,69%	-1,87%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.700.000,00	0,00	78.000,00	4.700.000,00	78.000,00	1,66%	3,23%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.074.398,99	0,00	40.631,53	2.080.106,34	46.338,88	2,23%	0,28%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	572.887,89	0,00	15.830,08	579.920,96	22.863,15	3,99%	1,23%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	7.874.341,59	0,00	0,00	7.869.564,81	-4.776,78	-0,06%	-0,06%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	113.067,50	0,00	7.312,54	98.070,75	-7.684,21	-6,80%	-13,26%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	20.102.250,74	0,00	20.086.105,78	0,00	-16.144,96	-0,08%	34,50%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	394.733,86	226.267,50	0,00	601.507,88	-19.493,48	-3,14%	5,46%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	772.291,34	82.518,23	0,00	829.237,15	-25.572,42	-2,99%	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.571.491,99	0,00	0,00	20.482.588,01	-88.903,98	-0,43%	-0,43%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.880.544,05	-119.455,95	-5,97%	-4,30%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.745.799,24	0,00	0,00	14.570.865,41	-174.933,83	-1,19%	-1,19%
Total Renda Variável	468.346.233,72	58.024.950,87	40.911.407,10	532.383.324,46	51.923.546,97	10,84%	10,84%

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
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	10.144.309,07	0,00	0,00	10.874.902,20	730.593,13	7,20%	7,20%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	23.165.452,64	0,00	0,00	23.675.665,00	510.212,36	2,20%	2,20%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.187.232,29	0,00	0,00	4.242.499,93	55.267,64	1,32%	1,32%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.859.028,92	0,00	0,00	14.876.448,74	17.419,82	0,12%	0,12%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.356.426,65	0,00	0,00	5.349.620,91	-6.805,74	-0,13%	-0,13%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	9.728.374,65	0,00	0,00	9.699.259,21	-29.115,44	-0,30%	-0,30%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	13.000.884,24	0,00	0,00	12.918.183,89	-82.700,35	-0,64%	-0,64%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	20.195.922,38	0,00	0,00	20.091.848,18	-104.074,20	-0,52%	-0,52%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	0,00	14.500.000,00	0,00	14.264.265,84	-235.734,16	-1,63%	-4,55%
Total Exterior	100.637.630,84	14.500.000,00	0,00	115.992.693,90	855.063,06	0,74%	

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
TÍTULOS PÚBLICOS	477.675.700,98	42.873.916,68	54.040.694,07	532.552.263,40	66.043.339,81	12,69%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	63.736.390,80	0,00	0,00	69.317.237,44	5.580.846,64	8,76%	8,76%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	60.630.930,42	10.302.693,85	0,00	75.656.486,10	4.722.861,83	6,66%	6,92%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	39.498.842,35	0,00	0,00	43.930.695,94	4.431.853,59	11,22%	11,22%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	31.071.561,11	0,00	0,00	33.638.247,12	2.566.686,01	8,26%	8,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	35.876.322,12	219.416,68	0,00	38.621.296,93	2.525.558,13	7,00%	7,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	34.521.711,48	0,00	0,00	36.916.969,62	2.395.258,14	6,94%	6,94%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.601.906,00	0,00	0,00	22.964.376,80	2.362.470,80	11,47%	11,47%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	31.303.399,60	0,00	0,00	33.466.324,75	2.162.925,15	6,91%	6,91%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	15.949.675,89	0,00	0,00	17.750.412,06	1.800.736,17	11,29%	11,29%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.635.543,04	0,00	0,00	16.291.477,89	1.655.934,85	11,31%	11,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.255.698,72	0,00	0,00	16.696.444,21	1.440.745,49	9,44%	9,44%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	8.544.126,30	182.181.363,89	189.461.123,69	2.584.826,95	1.320.460,45	0,69%	6,37%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.008.193,16	0,00	0,00	14.251.175,82	1.242.982,66	9,56%	9,56%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	15.000.000,00	0,00	16.215.417,00	1.215.417,00	8,10%	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.802.615,73	0,00	0,00	14.016.429,10	1.213.813,37	9,48%	9,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.197.140,58	0,00	0,00	11.245.257,92	1.048.117,34	10,28%	10,28%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.710.282,83	0,00	0,00	12.528.779,27	818.496,44	6,99%	6,99%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	10.213.346,01	0,00	0,00	10.983.571,17	770.225,16	7,54%	7,54%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	10.408.177,72	0,00	7.000.000,00	3.755.447,29	347.269,57	3,34%	9,09%



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
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.648.082,53	0,00	0,00	2.951.808,14	303.725,61	11,47%	11,47%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	119.643,27	0,00	199.453,70	55.277,22	135.087,65	112,91%	-53,81%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.181.469,44	0,00	10.302.693,85	0,00	121.224,41	1,19%	7,36%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	11.595.646,39	0,00	11.712.858,26	0,00	117.211,87	1,01%	11,66%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	900,00%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	8.000.000,00	0,00	7.970.910,76	-29.089,24	-0,36%	-
Total Renda Fixa	942.186.406,48	258.577.391,10	272.716.823,57	1.034.361.132,91	106.314.158,90	8,85%	

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
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	40.863.027,95	0,00	46.051.277,36	5.188.249,41	12,70%	20,38%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	18.361.146,73	0,00	0,00	22.920.736,19	4.559.589,46	24,83%	24,83%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	39.934.448,43	0,00	0,00	43.765.361,56	3.830.913,13	9,59%	9,59%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	37.483.286,25	0,00	40.863.027,95	0,00	3.379.741,70	9,02%	20,06%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	17.609.165,00	0,00	0,00	20.482.588,01	2.873.423,01	16,32%	16,32%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	20.579.911,49	0,00	23.387.807,81	2.807.896,32	13,64%	13,72%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	32.321.389,25	0,00	0,00	34.711.228,60	2.389.839,35	7,39%	7,39%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.391.999,13	8.380.000,00	0,00	16.919.055,37	2.147.056,24	14,53%	12,91%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	12.052.818,73	2.052.818,73	20,53%	17,61%
XP INVESTOR FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	11.589.984,97	1.589.984,97	15,90%	12,55%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.679.280,65	0,00	0,00	16.164.138,41	1.484.857,76	10,12%	10,12%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	20.075.694,02	0,00	0,00	21.555.475,24	1.479.781,22	7,37%	7,37%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.291.691,03	0,00	0,00	15.696.662,07	1.404.971,04	9,83%	9,83%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	33.505.528,92	0,00	0,00	34.410.828,85	905.299,93	2,70%	2,70%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.709.472,47	0,00	0,00	9.523.474,91	814.002,44	9,35%	9,35%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	7.092.679,25	0,00	0,00	7.869.564,81	776.885,56	10,95%	10,95%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	13.332.537,27	0,00	0,00	14.105.995,16	773.457,89	5,80%	5,80%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13.300.366,08	0,00	0,00	14.034.763,34	734.397,26	5,52%	5,52%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	11.930.801,05	0,00	0,00	12.646.853,56	716.052,51	6,00%	6,00%
OCCAM FIC AÇÕES	13.387.073,56	0,00	0,00	13.997.302,11	610.228,55	4,56%	4,56%

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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.263.201,85	0,00	0,00	10.856.485,09	593.283,24	5,78%	5,78%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	4.923.590,74	0,00	0,00	5.465.681,66	542.090,92	11,01%	11,01%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.483.463,42	0,00	0,00	6.953.951,11	470.487,69	7,26%	7,26%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.700.056,27	0,00	0,00	4.119.432,77	419.376,50	11,33%	11,33%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.125.199,26	0,00	205.072,70	4.316.240,67	396.114,11	9,60%	4,63%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	392.158,01	0,00	15.830,08	579.920,96	203.593,03	51,92%	47,88%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.389.221,46	0,00	0,00	14.570.865,41	181.643,95	1,26%	1,26%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	0,00	8.031.511,65	0,00	8.204.602,02	173.090,37	2,16%	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.705.799,89	0,00	0,00	1.819.327,99	113.528,10	6,66%	6,66%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.011.592,35	0,00	40.631,53	2.080.106,34	109.145,52	5,43%	3,41%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	10.794.266,49	1.331.324,38	0,00	12.216.769,03	91.178,16	0,75%	-3,65%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	598.749,97	157.424,98	0,00	829.237,15	73.062,20	9,66%	-
BB AGRO FIC AÇÕES	9.298.102,04	0,00	0,00	9.347.654,89	49.552,85	0,53%	0,53%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	145.481,58	0,00	30.121,41	98.070,75	-17.289,42	-11,88%	-32,59%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	417.218,15	252.702,80	0,00	601.507,88	-68.413,07	-10,21%	-5,41%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.880.544,05	-119.455,95	-5,97%	-5,08%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.751.746,57	0,00	8.381.617,78	0,00	-370.128,79	-4,23%	4,29%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	29.876.967,90	0,00	0,00	29.408.653,61	-468.314,29	-1,57%	-1,57%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.144.668,03	1.294.742,00	0,00	22.448.356,02	-991.054,01	-4,23%	-5,84%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	5.999.000,00	0,00	156.000,00	4.700.000,00	-1.143.000,00	-19,05%	-21,65%



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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	22.372.255,95	0,00	20.579.911,49	0,00	-1.792.344,46	-8,01%	3,91%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	23.873.300,99	0,00	20.086.105,78	0,00	-3.787.195,21	-15,86%	13,25%
Total Renda Variável	484.672.600,01	102.890.645,25	90.358.318,72	532.383.324,46	35.178.397,92	7,08%	

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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	17.604.894,38	0,00	20.295.761,33	0,00	2.690.866,95	15,28%	21,72%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.203.517,42	0,00	24.604.669,08	0,00	2.401.151,66	10,81%	19,93%
FRANKLIN CLEARBRIDGE AÇÕES EUA GROWTH INVESTIMENTO...	11.877.728,42	0,00	13.387.618,02	0,00	1.509.889,60	12,71%	33,52%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	19.264.837,90	0,00	0,00	20.091.848,18	827.010,28	4,29%	4,29%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	0,00	10.145.000,00	0,00	10.874.902,20	729.902,20	7,19%	-5,49%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.726.042,30	0,00	0,00	14.876.448,74	150.406,44	1,02%	1,02%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.200.847,61	0,00	0,00	5.349.620,91	148.773,30	2,86%	2,86%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.186.540,99	0,00	0,00	4.242.499,93	55.958,94	1,34%	1,34%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	0,00	14.500.000,00	0,00	14.264.265,84	-235.734,16	-1,63%	0,57%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	0,00	10.145.000,00	0,00	9.699.259,21	-445.740,79	-4,39%	-16,62%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	0,00	13.387.618,02	0,00	12.918.183,89	-469.434,13	-3,51%	3,85%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	0,00	24.600.000,00	0,00	23.675.665,00	-924.335,00	-3,76%	-0,16%
Total Exterior	95.064.409,02	72.777.618,02	58.288.048,43	115.992.693,90	6.438.715,29	5,88%	

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.

