

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

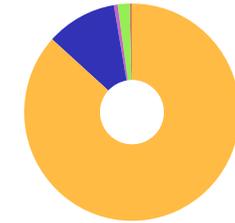
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	16.339.073,36	18,22%	664	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.667.385,69	9,67%	942	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	6.946.348,00	7,75%	237	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	5.664.440,25	6,32%	1.136	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.674.466,90	4,10%	515	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.738.920,66	4,17%	189	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	4.386.066,17	4,89%	120	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	12.624.711,03	14,08%	370	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.235.489,64	5,84%	723	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.638.384,33	2,94%	980	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.008.474,75	6,70%	218	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	149.744,47	0,17%	12	7,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.689.481,61	1,88%	233	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	515.366,17	0,57%	4.867	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.381.137,78	2,66%	1.354	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.428.424,66	2,71%	21.398	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	4.167.312,76	4,65%	2.068	1,30%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	494.895,23	0,55%	3.835	0,29%	Artigo 9º, Inciso III
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.289.857,02	1,44%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	236.188,46	0,26%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	52.613,02	0,06%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	10.904,30	0,01%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	329.600,00	0,37%		0,45%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		73.444,42	0,08%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			89.669.286,26				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			73.444,42				Artigo 6º
PL Total			89.742.730,68				

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

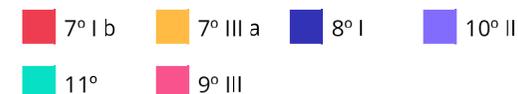
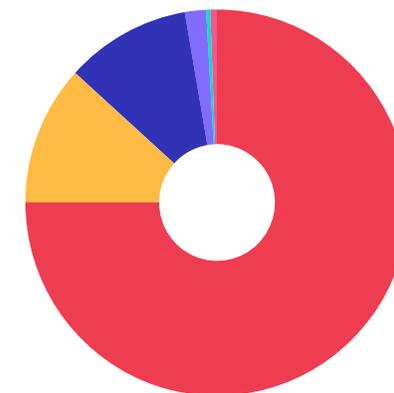
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	100,00%	89.669.286,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	67.276.901,70	75,03%	0,00%	70,00%	100,00%	22.392.384,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	10.486.085,16	11,69%	0,00%	9,00%	60,00%	43.315.486,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	60,00%	53.801.571,76
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	20,00%	17.933.857,25
Total Renda Fixa	100,00%	77.762.986,86	86,72%	0,00%	84,00%	340,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	9.492.241,37	10,59%	0,00%	12,00%	30,00%	17.408.544,51
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,20%	10,00%	8.966.928,63
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	1.589.562,80	1,77%	0,00%	2,00%	5,00%	2.893.901,51
Artigo 11º	5,00%	329.600,00	0,37%	0,00%	0,80%	5,00%	4.153.864,31
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	11.411.404,17	12,73%	0,00%	15,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	494.895,23	0,55%	0,00%	1,00%	10,00%	8.472.033,40
Total Exterior	10,00%	494.895,23	0,55%	0,00%	1,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	76.013.199,75	84,77	-
CAIXA DTVM	5.235.489,64	5,84	-
SOMMA INVESTIMENTOS	4.167.312,76	4,65	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.689.481,61	1,88	0,00
RENDA ASSET MANAGEMENT	1.289.857,02	1,44	0,37
ITAÚ UNIBANCO	494.895,23	0,55	0,00
ZION INVEST	329.600,00	0,37	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	247.092,76	0,28	0,10
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	149.744,47	0,17	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	52.613,02	0,06	0,09

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,31%	14,66%	10,79%	14,66%	15,89%	13,02%	3,16%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-2,89%	-17,95%	-6,22%	-17,95%	-20,81%	-60,13%	2,66%	0,10%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,39%	11,31%	7,20%	11,31%	13,23%	17,29%	2,17%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35%	11,24%	7,06%	11,24%	13,32%	17,31%	2,12%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	9,44%	5,43%	9,44%	16,38%	18,13%	0,90%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,30%	7,10%	3,67%	7,10%	13,07%	25,65%	0,28%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,18%	11,77%	7,06%	11,77%	13,08%	-	2,16%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	9,20%	3,88%	9,20%	10,92%	-	1,44%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,56%	1,44%	5,56%	8,39%	-	0,47%	0,03%

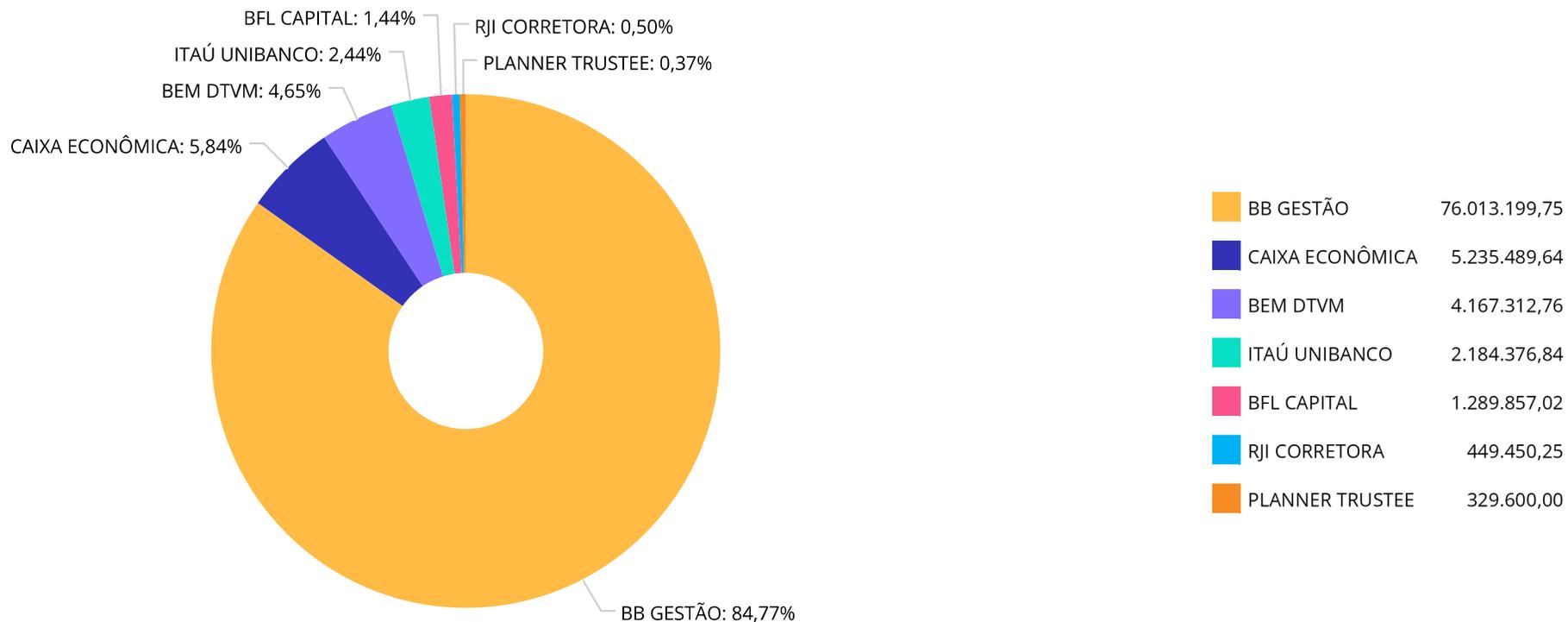
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8,96%	5,17%	14,28%	5,17%	12,53%	-7,54%	7,42%	0,17%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,96%	1,86%	14,48%	1,86%	12,06%	-17,44%	7,92%	0,18%
BB AGRO FIC AÇÕES	5,85%	0,53%	8,15%	0,53%	7,14%	-4,48%	7,30%	0,16%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8,88%	6,51%	15,45%	6,51%	17,05%	-11,63%	7,60%	0,17%
IFIX (Benchmark)	4,71%	10,05%	14,28%	10,05%	12,87%	14,54%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	7,29%	-26,95%	-8,44%	-26,95%	-50,48%	154,32%	14,96%	0,31%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,08%	-0,39%	-0,21%	-0,39%	-0,93%	-1,74%	-	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,58%	-3,39%	-1,73%	-3,39%	-6,97%	-12,96%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,56%	6,84%	2,66%	6,84%	11,38%	34,59%	-	-
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,10%	-0,59%	-0,29%	-0,59%	-1,76%	-3,23%	-	-
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,14%	-0,86%	-0,34%	-0,86%	-1,58%	-3,42%	-	-

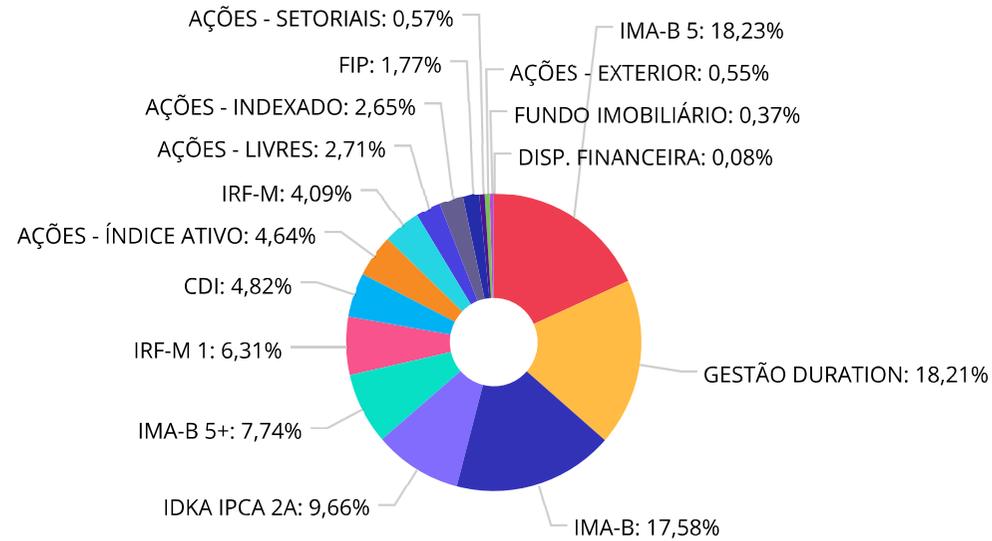
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%

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



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

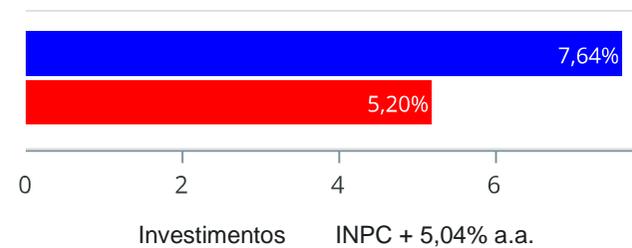


IMA-B 5	16.363.631,69	GESTÃO DURATION	16.339.073,36	IMA-B	15.779.775,03	IDKA IPCA 2A	8.667.385,69
IMA-B 5+	6.946.348,00	IRF-M 1	5.664.440,25	CDI	4.327.865,94	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	4.167.312,76
IRF-M	3.674.466,90	AÇÕES - LIVRES	2.428.424,66	AÇÕES - INDEXADO	2.381.137,78	FIP	1.589.562,80
AÇÕES - SETORIAIS	515.366,17	AÇÕES - EXTERIOR	494.895,23	FUNDO IMOBILIÁRIO	329.600,00	DISP. FINANCEIRA	73.444,42

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	80.648.303,23	6.031.633,40	5.646.291,66	81.770.771,17	737.126,20	737.126,20	0,91%	0,91%	0,89%	0,89%	101,96%	2,79%
Fevereiro	81.770.771,17	1.362.789,78	934.252,26	82.134.014,72	-65.293,97	671.832,23	-0,08%	0,83%	1,12%	2,03%	40,93%	2,49%
Março	82.134.014,72	7.786.123,31	7.170.215,59	83.749.617,78	999.695,34	1.671.527,57	1,21%	2,05%	1,09%	3,14%	65,18%	2,06%
Abril	83.749.617,78	1.089.379,89	668.131,92	85.232.265,43	1.061.399,68	2.732.927,25	1,26%	3,33%	0,88%	4,05%	82,27%	2,02%
Mai	85.232.265,43	1.201.384,48	777.097,70	87.195.969,79	1.539.417,58	4.272.344,83	1,80%	5,19%	0,79%	4,88%	106,45%	1,76%
Junho	87.195.969,79	1.205.375,87	768.543,67	89.669.286,26	2.036.484,27	6.308.829,10	2,32%	7,64%	0,31%	5,20%	146,79%	1,98%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



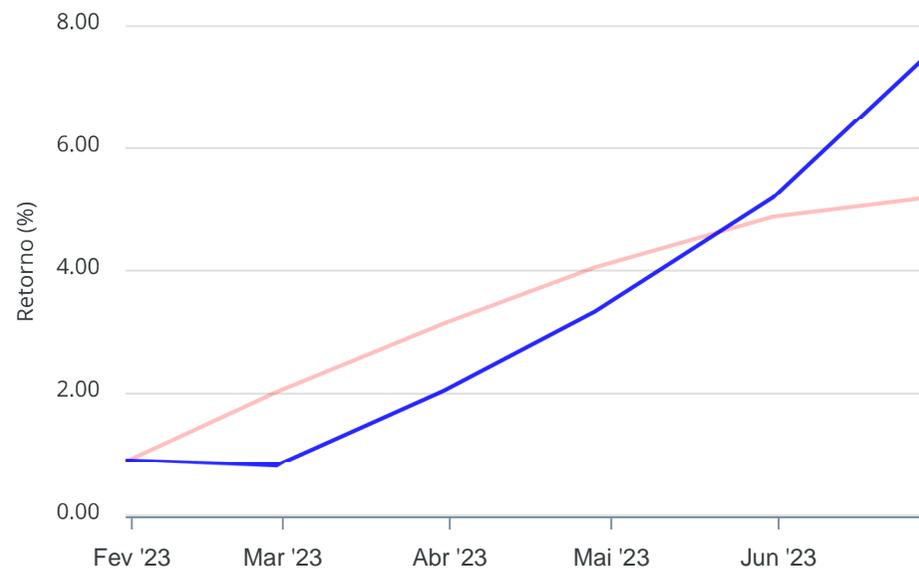
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	6.723.998,25	0,00	0,00	6.946.348,00	222.349,75	3,31%	3,31%	3,16%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.868.439,71	0,00	0,00	6.008.474,75	140.035,04	2,39%	2,39%	2,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.115.108,05	0,00	0,00	5.235.489,64	120.381,59	2,35%	2,35%	2,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	4.292.431,48	0,00	0,00	4.386.066,17	93.634,69	2,18%	2,18%	2,16%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.599.146,68	0,00	0,00	3.674.466,90	75.320,22	2,09%	2,09%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	16.049.517,34	0,00	0,00	16.339.073,36	289.556,02	1,80%	1,80%	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.667.836,17	0,00	0,00	1.689.481,61	21.645,44	1,30%	1,30%	0,28%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.484.972,84	114.861,70	0,00	5.664.440,25	64.605,71	1,15%	1,16%	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.579.913,30	0,00	0,00	8.667.385,69	87.472,39	1,02%	1,02%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.703.758,99	0,00	0,00	3.738.920,66	35.161,67	0,95%	0,95%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	12.508.241,62	0,00	0,00	12.624.711,03	116.469,41	0,93%	0,93%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.285.677,13	1.090.514,17	766.216,31	2.638.384,33	28.409,34	0,84%	1,00%	0,01%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	154.202,80	0,00	2.327,36	149.744,47	-2.130,97	-1,38%	-2,89%	2,66%
Total Renda Fixa	76.033.244,36	1.205.375,87	768.543,67	77.762.986,86	1.292.910,30	1,69%		1,21%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.228.693,69	0,00	0,00	2.428.424,66	199.730,97	8,96%	8,96%	7,42%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.186.989,65	0,00	0,00	2.381.137,78	194.148,13	8,88%	8,88%	7,60%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	3.860.220,37	0,00	0,00	4.167.312,76	307.092,39	7,96%	7,96%	7,92%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	307.200,00	0,00	0,00	329.600,00	22.400,00	7,29%	7,29%	14,96%
BB AGRO FIC AÇÕES	486.870,98	0,00	0,00	515.366,17	28.495,19	5,85%	5,85%	7,30%
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	52.652,58	0,00	0,00	52.613,02	-39,56	-0,08%	-	-
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	10.915,21	0,00	0,00	10.904,30	-10,91	-0,10%	-	-
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	1.291.623,73	0,00	0,00	1.289.857,02	-1.766,71	-0,14%	-	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	237.570,44	0,00	0,00	236.188,46	-1.381,98	-0,58%	-	-
Total Renda Variável	10.662.736,65	0,00	0,00	11.411.404,17	748.667,52	7,02%		7,92%

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	499.988,78	0,00	0,00	494.895,23	-5.093,55	-1,02%	-1,02%	5,44%
Total Exterior	499.988,78	0,00	0,00	494.895,23	-5.093,55	-1,02%		5,44%

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	15.555.081,03	0,00	0,00	16.339.073,36	783.992,33	5,04%	5,04%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	6.269.993,47	0,00	0,00	6.946.348,00	676.354,53	10,79%	10,79%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.604.830,29	0,00	0,00	6.008.474,75	403.644,46	7,20%	7,20%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.890.137,15	0,00	0,00	5.235.489,64	345.352,49	7,06%	7,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	4.097.014,57	0,00	0,00	4.386.066,17	289.051,60	7,06%	7,06%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.485.075,81	0,00	0,00	3.674.466,90	189.391,09	5,43%	5,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	12.445.544,15	0,00	0,00	12.624.711,03	179.166,88	1,44%	1,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.489.182,61	0,00	0,00	8.667.385,69	178.203,08	2,10%	2,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.388.420,09	114.861,70	8.994,46	5.664.440,25	170.152,92	3,09%	3,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.700.133,48	0,00	103.639,31	3.738.920,66	142.426,49	3,85%	3,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.287.788,51	3.381.278,54	2.098.812,16	2.638.384,33	68.129,44	1,46%	2,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.629.743,27	0,00	0,00	1.689.481,61	59.738,34	3,67%	3,67%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	159.676,37	0,00	2.327,36	149.744,47	-7.604,54	-4,76%	-6,22%
Total Renda Fixa	73.002.620,80	3.496.140,24	2.213.773,29	77.762.986,86	3.477.999,11	4,68%	

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
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	3.640.357,69	0,00	0,00	4.167.312,76	526.955,07	14,48%	14,48%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.062.537,12	0,00	0,00	2.381.137,78	318.600,66	15,45%	15,45%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.125.069,81	0,00	0,00	2.428.424,66	303.354,85	14,28%	14,28%
BB AGRO FIC AÇÕES	476.511,87	0,00	0,00	515.366,17	38.854,30	8,15%	8,15%
PUMA FIP MULTISTRATÉGIA	10.936,02	0,00	0,00	10.904,30	-31,72	-0,29%	-0,29%
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	52.725,11	0,00	0,00	52.613,02	-112,09	-0,21%	-0,21%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	240.334,40	0,00	0,00	236.188,46	-4.145,94	-1,73%	-1,73%
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTISTRATÉGIA	1.294.294,76	0,00	0,00	1.289.857,02	-4.437,74	-0,34%	-0,34%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	360.000,00	0,00	0,00	329.600,00	-30.400,00	-8,44%	-8,44%
Total Renda Variável	10.262.766,78	0,00	0,00	11.411.404,17	1.148.637,39	11,19%	

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	484.230,20	0,00	0,00	494.895,23	10.665,03	2,20%	2,20%
Total Exterior	484.230,20	0,00	0,00	494.895,23	10.665,03	2,20%	

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	19.986.535,04	0,00	5.000.000,00	16.339.073,36	1.352.538,32	6,77%	8,76%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	6.058.020,55	0,00	0,00	6.946.348,00	888.327,45	14,66%	14,66%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.397.747,92	0,00	0,00	6.008.474,75	610.726,83	11,31%	11,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.133.645,22	0,00	0,00	8.667.385,69	533.740,47	6,56%	6,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.706.314,81	0,00	0,00	5.235.489,64	529.174,83	11,24%	11,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	4.035.913,50	0,00	113.678,82	4.386.066,17	463.831,49	11,49%	11,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	5.862.014,42	6.497.500,00	168.225,69	12.624.711,03	433.422,30	3,51%	5,56%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.033.314,01	305.693,56	8.994,46	5.664.440,25	334.427,14	6,26%	6,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.519.647,58	0,00	103.639,31	3.738.920,66	322.912,39	9,17%	9,20%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.357.395,10	0,00	0,00	3.674.466,90	317.071,80	9,44%	9,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.093.201,41	11.873.493,17	10.552.359,21	2.638.384,33	224.048,96	1,73%	5,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.577.465,84	0,00	0,00	1.689.481,61	112.015,77	7,10%	7,10%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	182.497,20	0,00	17.635,31	149.744,47	-15.117,42	-8,28%	-17,95%
Total Renda Fixa	68.943.712,60	18.676.686,73	15.964.532,80	77.762.986,86	6.107.120,33	8,52%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.235.564,24	0,00	0,00	2.381.137,78	145.573,54	6,51%	6,51%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.309.103,87	0,00	0,00	2.428.424,66	119.320,79	5,17%	5,17%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	4.091.050,60	0,00	0,00	4.167.312,76	76.262,16	1,86%	1,86%
BB AGRO FIC AÇÕES	512.634,16	0,00	0,00	515.366,17	2.732,01	0,53%	0,53%
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	10.968,88	0,00	0,00	10.904,30	-64,58	-0,59%	-0,59%
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	52.820,25	0,00	0,00	52.613,02	-207,23	-0,39%	-0,39%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	244.480,34	0,00	0,00	236.188,46	-8.291,88	-3,39%	-3,39%
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	1.301.066,79	0,00	0,00	1.289.857,02	-11.209,77	-0,86%	-0,86%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	451.200,00	0,00	0,00	329.600,00	-121.600,00	-26,95%	-26,95%
Total Renda Variável	11.208.889,13	0,00	0,00	11.411.404,17	202.515,04	1,81%	

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	495.701,50	0,00	0,00	494.895,23	-806,27	-0,16%	-0,16%
Total Exterior	495.701,50	0,00	0,00	494.895,23	-806,27	-0,16%	

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.

