

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

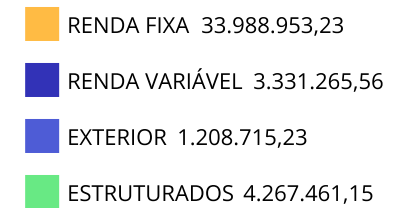
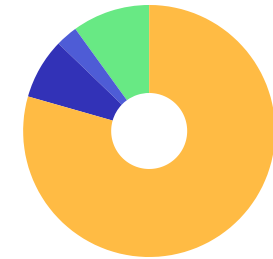
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	92.803,25	0,22%	1.518	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	435.638,07	1,02%	11.732	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	37.439,32	0,09%	2.785	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	206.319,62	0,48%	4.272	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	208.755,82	0,49%	30.087	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	539.694,37	1,26%	21.999	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	265.689,49	0,62%	185	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	398.501,53	0,93%	6.687	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	94.865,60	0,22%	2.366	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	251.327,36	0,59%	17	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	547.555,29	1,28%	10.688	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	297.715,85	0,70%	22.872	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	497.703,51	1,16%	155	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	413.295,87	0,97%	494	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	739.291,18	1,73%	2.165	0,16%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	353.912,20	0,83%	119	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	357.846,63	0,84%	930	0,48%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	2.584.039,01	6,04%	3.125	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	232.372,13	0,54%	657	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		152.844,81	0,36%		0,00%	DF - Artigo 6º

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			42.796.395,17				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			152.844,81				Artigo 6º
PL Total			42.949.239,98				

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

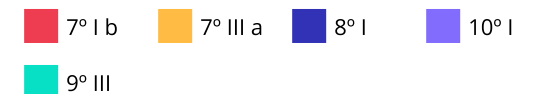
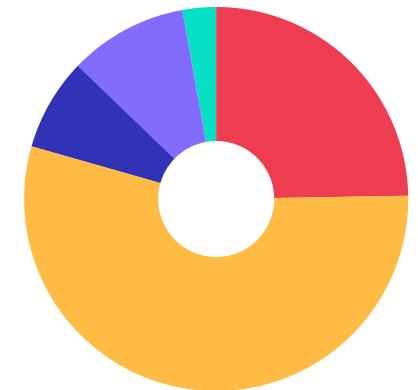
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	33,00%	100,00%	42.796.395,17
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	10.584.365,95	24,73%	0,00%	8,50%	100,00%	32.212.029,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	23.404.587,28	54,69%	0,00%	33,00%	60,00%	2.273.249,82
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.279.639,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	427.963,95
Total Renda Fixa	100,00%	33.988.953,23	79,42%	0,00%	77,50%	271,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.331.265,56	7,78%	0,00%	9,00%	20,00%	5.228.013,47
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	4.279.639,52
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.267.461,15	9,97%	0,00%	10,00%	10,00%	12.178,37
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	7.598.726,71	17,76%	0,00%	19,50%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.208.715,23	2,82%	0,00%	3,00%	10,00%	3.070.924,29
Total Exterior	10,00%	1.208.715,23	2,82%	0,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB ASSET MANAGEMENT	13.530.836,15	31,62	-
CAIXA DTVM	12.539.953,02	29,30	-
ITAÚ UNIBANCO	10.723.239,40	25,06	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	5.011.748,06	11,71	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	739.291,18	1,73	0,00
ITAÚ DTVM	251.327,36	0,59	0,00

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 Maio/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	5,76%	2,60%	7,07%	8,74%	18,79%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,49%	2,47%	6,77%	8,61%	18,88%	0,68%	0,03%
IMA Geral (Benchmark)	1,77%	6,78%	4,95%	7,60%	12,55%	18,47%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,87%	6,88%	5,08%	7,71%	12,69%	18,24%	0,64%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	2,85%	8,54%	6,92%	10,30%	15,84%	14,80%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,84%	8,39%	6,81%	10,10%	15,28%	13,87%	1,26%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	4,13%	11,16%	11,29%	9,84%	11,30%	11,03%	-	-
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	4,11%	11,04%	11,20%	9,70%	11,04%	10,48%	2,42%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,99%	10,82%	10,99%	9,45%	10,80%	9,95%	2,29%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,14%	5,42%	3,26%	6,67%	13,53%	20,82%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	5,37%	3,20%	6,58%	13,30%	20,31%	0,09%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,57%	5,93%	3,02%	6,92%	9,45%	19,90%	-	-
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%
IMA-B (Benchmark)	2,53%	8,76%	7,39%	8,55%	10,47%	15,54%	-	-

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
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,76%	8,93%	7,70%	8,66%	9,01%	14,13%	1,64%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,53%	8,69%	7,37%	8,43%	10,29%	15,07%	1,45%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	2,20%	7,34%	5,54%	8,93%	14,73%	16,57%	-	-
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%
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,04%	4,93%	2,98%	6,02%	12,37%	19,93%	0,01%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,18%	4,77%	3,20%	5,96%	13,02%	22,47%	0,03%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,15%	5,29%	3,24%	6,47%	13,47%	22,81%	0,02%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	5,23%	3,20%	6,42%	13,65%	23,76%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,49%	5,73%	3,75%	6,94%	12,68%	24,34%	0,26%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,13%	5,26%	3,10%	6,61%	13,03%	27,64%	0,23%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,35%	7,88%	6,13%	7,48%	11,36%	20,73%	1,00%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	4,58%	1,78%	5,96%	7,63%	-	0,51%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,78%	3,48%	3,27%	4,17%	11,61%	16,56%	1,52%	0,04%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	0,98%	6,19%	2,63%	8,15%	17,68%	24,90%	1,66%	0,03%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,36%	5,28%	3,28%	6,50%	13,45%	23,47%	0,18%	0,01%
Global BDRX (Benchmark)	5,90%	14,58%	8,54%	9,75%	14,79%	-0,17%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	3,74%	-1,28%	3,24%	-3,69%	-2,71%	-14,17%	-	-
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	1,46%	-3,42%	-3,87%	-4,95%	-11,28%	-21,90%	8,08%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,71%	-3,81%	0,46%	-6,19%	-10,27%	-16,05%	8,04%	0,18%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	16,49%	25,86%	23,28%	20,73%	17,29%	-19,53%	10,37%	0,34%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	0,90%	0,34%	1,57%	-2,66%	-0,08%	-10,75%	6,98%	0,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,99%	-4,33%	-2,44%	-7,07%	-12,86%	-34,01%	9,07%	0,23%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3,08%	-3,48%	0,99%	-5,96%	-9,91%	-15,82%	8,14%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,20%	3,59%	6,51%	1,03%	-1,45%	-7,32%	8,54%	0,19%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	11,99%	-1,81%	6,06%	-6,99%	-16,97%	-48,29%	9,27%	0,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	5,45%	-0,27%	3,87%	-2,96%	-3,49%	-27,65%	7,45%	0,21%
IDIV (Benchmark)	0,84%	0,48%	2,64%	-1,14%	-0,85%	1,55%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,52%	8,64%	9,15%	7,44%	3,29%	-6,81%	5,73%	0,20%

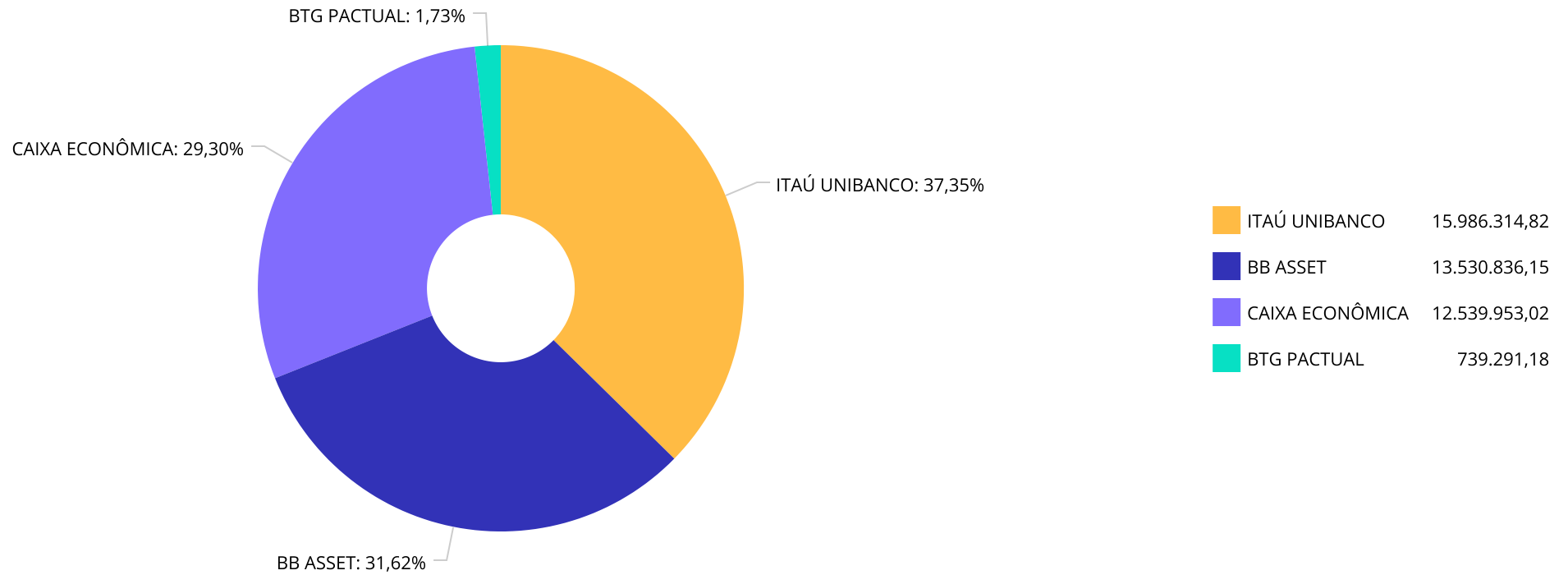
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,68%	-0,08%	2,23%	-1,65%	-1,88%	-2,84%	6,55%	0,15%
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%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	1,12%	12,23%	7,30%	6,82%	10,60%	16,01%	6,03%	0,22%
SMLL (Benchmark)	13,54%	4,71%	13,69%	1,56%	-7,34%	-32,24%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	11,40%	4,28%	11,54%	1,53%	-5,57%	-24,91%	9,42%	0,27%

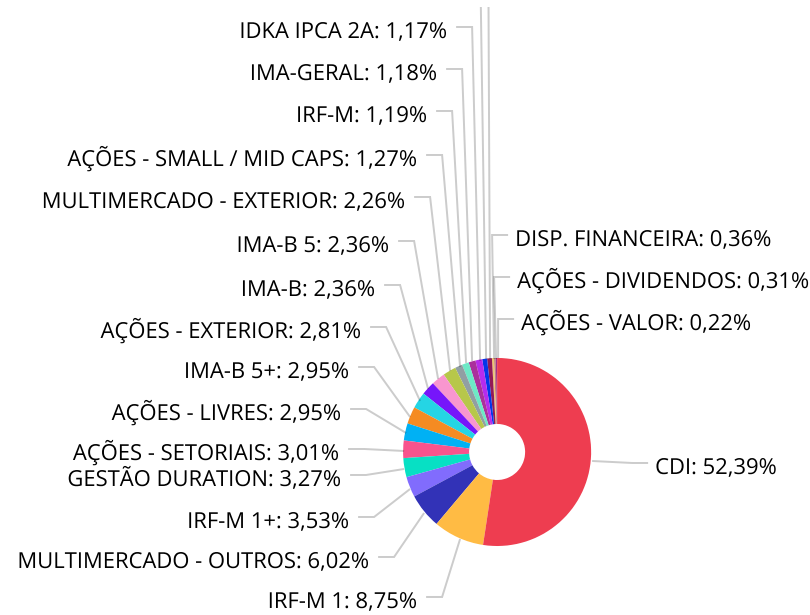
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,80%	14,00%	8,47%	8,53%	13,81%	-3,05%	8,28%	16,769%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,13%	6,13%	3,68%	1,04%	8,94%	-4,47%	6,35%	15,080%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,93%	7,44%	3,87%	3,18%	2,15%	0,84%	5,37%	19,355%

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



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

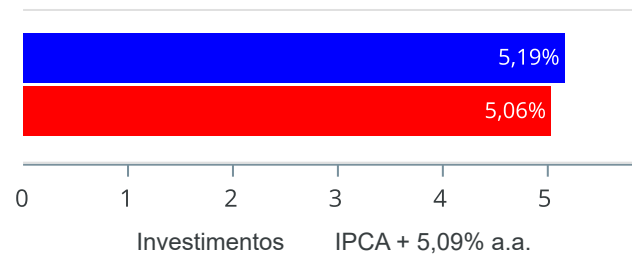


■ CDI	22.500.063,31	■ IRF-M 1	3.758.451,03	■ MULTIMERCADO - OUTROS	2.584.039,01
■ IRF-M 1+	1.516.072,80	■ GESTÃO DURATION	1.403.248,02	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.293.135,06
■ AÇÕES - LIVRES	1.265.467,04	■ IMA-B 5+	1.265.177,20	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.208.715,23
■ IMA-B	1.013.641,00	■ IMA-B 5	1.012.162,00	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	971.663,31
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	547.555,29	■ IRF-M	510.136,81	■ IMA-GERAL	508.935,11
■ IDKA IPCA 2A	501.065,95	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	357.846,63	■ MULTIMERCADO - MODERADO	353.912,20
■ DISP. FINANCEIRA	152.844,81	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	132.304,92	■ AÇÕES - VALOR	92.803,25

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

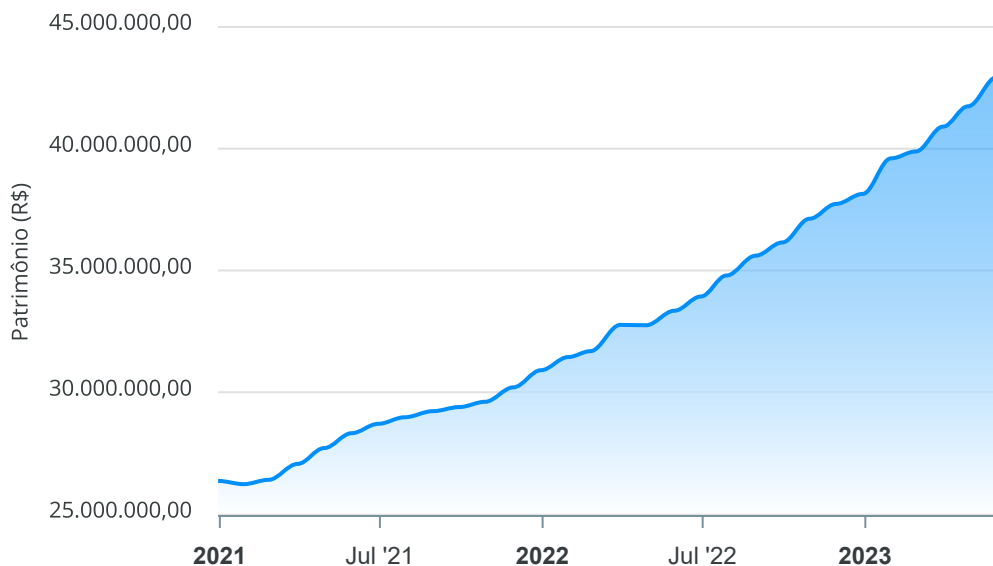
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	38.107.184,17	3.290.124,85	2.392.124,68	39.598.734,19	593.549,85	593.549,85	1,52%	1,52%	0,97%	0,97%	157,42%	1,67%
Fevereiro	39.598.734,19	5.816.115,61	5.528.971,95	39.881.960,90	-3.916,95	589.632,90	-0,01%	1,51%	1,20%	2,18%	69,46%	1,34%
Março	39.881.960,90	2.699.875,72	2.036.577,54	40.904.544,99	359.285,91	948.918,81	0,89%	2,41%	1,17%	3,37%	71,57%	1,39%
Abril	40.904.544,99	4.017.025,34	3.563.222,99	41.734.875,90	376.528,56	1.325.447,37	0,91%	3,34%	0,97%	4,37%	76,53%	1,35%
Mai	41.734.875,90	10.213.038,14	9.900.908,06	42.796.395,17	749.389,19	2.074.836,56	1,78%	5,19%	0,67%	5,06%	102,40%	1,34%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



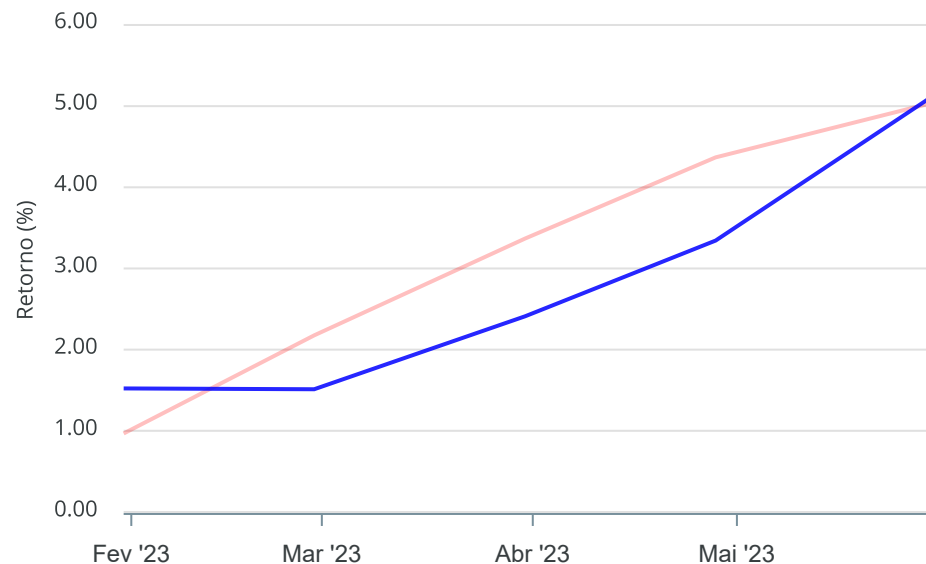
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	733.899,87	0,00	0,00	763.144,44	29.244,57	3,98%	3,98%	2,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	499.754,92	0,00	0,00	512.420,85	12.665,93	2,53%	2,53%	1,45%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	499.178,68	0,00	0,00	510.136,81	10.958,13	2,20%	2,20%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	499.596,43	0,00	0,00	508.935,11	9.338,68	1,87%	1,87%	0,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.061.528,89	0,00	0,00	3.107.279,89	45.751,00	1,49%	1,49%	0,26%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.926.368,71	0,00	0,00	1.949.085,31	22.716,60	1,18%	1,18%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.571.309,99	0,00	0,00	7.659.164,94	87.854,95	1,16%	1,16%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	498.809,13	1.000.000,00	0,00	1.516.072,80	17.263,67	1,15%	2,84%	1,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.607.213,08	0,00	0,00	6.683.258,51	76.045,43	1,15%	1,15%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.762.260,81	0,00	0,00	1.782.114,28	19.853,47	1,13%	1,13%	0,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.716.696,05	0,00	0,00	3.758.451,03	41.754,98	1,12%	1,12%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.876.884,40	0,00	1.889.790,03	0,00	12.905,63	0,69%	1,19%	0,13%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.049.894,60	0,00	1.056.556,49	0,00	6.661,89	0,63%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	499.492,10	0,00	0,00	502.641,65	3.149,55	0,63%	0,63%	0,63%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.279.280,63	0,00	1.287.111,75	0,00	7.831,12	0,61%	0,65%	0,80%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	502.032,76	2.032,76	0,41%	4,11%	2,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	499.125,32	0,00	0,00	501.065,95	1.940,63	0,39%	0,39%	0,68%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	846.096,89	4.880.502,36	5.427.713,31	319.216,18	20.330,24	0,36%	1,04%	0,01%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	501.220,15	1.220,15	0,24%	2,76%	1,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	1.400.000,00	0,00	1.403.248,02	3.248,02	0,23%	2,35%	1,00%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.000,00	0,00	999.944,20	-55,80	-0,01%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	509.566,16	0,00	0,00	509.520,35	-45,81	-0,01%	-0,01%	0,51%
Total Renda Fixa	33.936.956,66	9.280.502,36	9.661.171,58	33.988.953,23	432.665,79	1,27%		0,35%

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
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	373.985,59	0,00	0,00	435.638,07	61.652,48	16,49%	16,49%	10,37%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	355.836,60	0,00	0,00	398.501,53	42.664,93	11,99%	11,99%	9,27%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	491.523,13	0,00	0,00	547.555,29	56.032,16	11,40%	11,40%	9,42%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	57.050,94	0,00	61.736,48	0,00	4.685,54	8,21%	5,75%	6,54%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	35.149,07	0,00	0,00	37.439,32	2.290,25	6,52%	6,52%	5,73%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	250.176,69	0,00	0,00	265.689,49	15.512,80	6,20%	6,20%	8,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	238.343,13	0,00	0,00	251.327,36	12.984,23	5,45%	5,45%	7,45%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	523.577,76	0,00	0,00	539.694,37	16.116,61	3,08%	3,08%	8,14%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	90.356,22	0,00	0,00	92.803,25	2.447,03	2,71%	2,71%	8,04%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	204.692,42	0,00	0,00	208.755,82	4.063,40	1,99%	1,99%	9,07%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	176.698,18	0,00	85.000,00	94.865,60	3.167,42	1,79%	0,68%	6,55%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	347.729,15	0,00	0,00	353.912,20	6.183,05	1,78%	1,78%	1,52%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	294.217,46	0,00	93.000,00	206.319,62	5.102,16	1,73%	0,90%	6,98%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	249.032,23	0,00	0,00	252.675,84	3.643,61	1,46%	1,46%	8,08%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.351.664,61	200.000,00	0,00	2.584.039,01	32.374,40	1,27%	1,36%	0,18%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	229.794,03	0,00	0,00	232.372,13	2.578,10	1,12%	1,12%	6,03%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	354.362,41	0,00	0,00	357.846,63	3.484,22	0,98%	0,98%	1,66%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	732.535,78	0,00	739.291,18	6.755,40	0,92%	1,23%	6,06%
Total Renda Variável	6.624.189,62	932.535,78	239.736,48	7.598.726,71	281.737,79	3,85%		4,78%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	390.620,63	0,00	0,00	413.295,87	22.675,24	5,80%	5,80%	8,28%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	482.604,75	0,00	0,00	497.703,51	15.098,76	3,13%	3,13%	6,35%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	300.504,24	0,00	0,00	297.715,85	-2.788,39	-0,93%	-0,93%	5,37%
Total Exterior	1.173.729,62	0,00	0,00	1.208.715,23	34.985,61	2,98%		6,77%

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.

