

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.157.532,02	3,83%	657	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.053.479,11	4,92%	953	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.403.806,49	1,70%	301	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	1.999.887,73	2,43%	165	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	900.257,51	1,09%	39	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	8.516.935,10	10,33%	775	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.715.510,44	5,72%	921	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.000.668,36	2,43%	934	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.119.919,42	1,36%	698	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	54.303,62	0,07%	139	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.141.940,25	2,60%	1.189	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.171.895,30	11,13%	714	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	516.492,48	0,63%	23	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	1.850.666,46	2,25%	88	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.589.013,39	3,14%	38	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	D+1	Não há	841.622,21	1,02%	18	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.001.050,72	2,43%	1.196	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.797.979,46	2,18%	1.116	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.728.838,13	2,10%	146	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.000.560,56	1,21%	357	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '

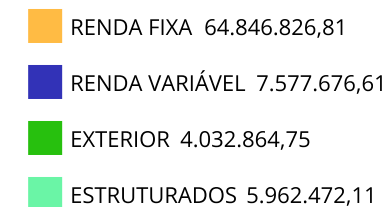
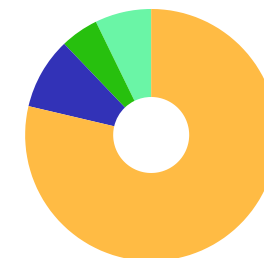


Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	1.384.807,98	1,68%	35	1,74%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	606.686,31	0,74%	657	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			82.419.840,28				

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

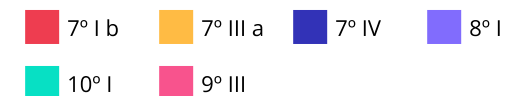
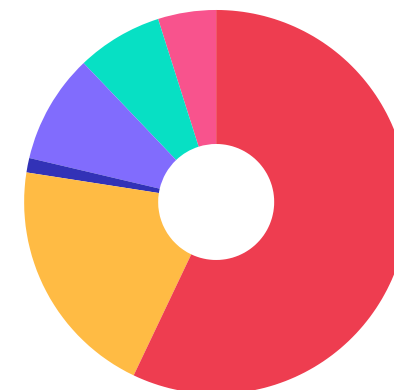
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,55%	81,95%	67.543.059,11
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	47.034.980,61	57,07%	20,49%	38,32%	100,00%	35.384.859,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	16.809.109,77	20,39%	20,89%	27,85%	60,00%	32.642.794,40
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	1.002.736,43	1,22%	0,00%	2,00%	20,00%	15.481.231,63
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.120.992,01
Total Renda Fixa	100,00%	64.846.826,81	78,68%	41,38%	76,72%	266,95%	



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%	7.577.676,61	9,19%	1,89%	13,28%	20,00%	8.906.291,45
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.962.472,11	7,23%	3,75%	5,00%	10,00%	2.279.511,92
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	13.540.148,72	16,43%	5,64%	18,28%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.032.864,75	4,89%	0,50%	5,00%	10,00%	4.209.119,28
Total Exterior	10,00%	4.032.864,75	4,89%	0,50%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	45.465.120,94	55,16	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	9.859.794,95	11,96	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.008.990,59	10,93	-
ITAÚ UNIBANCO	4.869.659,32	5,91	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	4.629.315,85	5,62	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	3.583.283,75	4,35	0,00
SICREDI	2.001.050,72	2,43	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.999.887,73	2,43	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 '	0,00	0,00	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	47.034.980,61	57,07	20,49	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	16.809.109,77	20,39	20,89	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	7.577.676,61	9,19	1,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	4.032.864,75	4,89	0,50	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.962.472,11	7,23	3,75	10,00

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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	5,50%	2,49%	6,80%	8,35%	18,22%	0,75%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,51%	8,65%	7,32%	8,42%	10,21%	15,02%	1,50%	0,04%
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%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	1,16%	5,35%	3,20%	6,57%	13,41%	20,53%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,56%	5,85%	2,97%	6,83%	9,26%	19,47%	0,67%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,53%	8,76%	7,39%	8,55%	10,47%	15,54%	-	-
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%
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-

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
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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,24%	5,29%	3,32%	6,47%	13,49%	23,07%	0,04%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,36%	3,24%	6,51%	13,40%	22,55%	0,06%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,19%	5,17%	3,24%	6,36%	13,50%	23,20%	0,02%	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1,16%	5,34%	3,22%	6,50%	13,42%	22,46%	0,03%	0,00%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	5,34%	3,26%	6,57%	13,81%	23,57%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88%	6,83%	5,12%	7,65%	12,47%	17,91%	0,69%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,19%	7,30%	5,73%	8,08%	12,48%	17,83%	0,92%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	1,56%	1,78%	2,89%	1,43%	4,52%	0,51%	0,05%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,67%	5,98%	3,91%	7,25%	11,96%	17,50%	0,44%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,81%	6,03%	3,94%	7,24%	12,48%	16,41%	0,56%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,35%	7,88%	6,13%	7,48%	11,36%	20,73%	1,00%	0,03%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	-1,46%	-	-	-	-	-	2,24%	-



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
--	-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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 ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,82%	4,76%	3,66%	5,91%	10,85%	14,15%	1,13%	0,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,78%	3,48%	3,27%	4,17%	11,61%	16,56%	1,52%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,97%	3,29%	3,50%	3,43%	9,35%	12,63%	2,08%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1,30%	5,32%	3,41%	6,49%	13,18%	22,85%	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%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6,15%	-0,76%	3,02%	-4,39%	-5,09%	-22,33%	7,44%	0,22%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	3,58%	-1,45%	3,06%	-3,70%	-2,56%	-14,15%	7,96%	0,19%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	16,51%	24,10%	23,05%	19,06%	15,41%	-21,18%	10,39%	0,34%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	11,99%	-1,81%	6,06%	-6,99%	-16,97%	-48,29%	9,27%	0,31%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,70%	-0,90%	3,15%	-4,34%	-5,27%	-17,03%	8,41%	0,19%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,75%	8,57%	12,93%	3,48%	4,33%	2,28%	6,54%	0,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,24%	-3,56%	1,78%	-8,04%	-12,35%	-33,13%	8,46%	0,25%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	5,00%	-4,28%	1,30%	-8,88%	-14,22%	-	8,48%	0,25%
S&P 500 (Benchmark)	0,25%	8,86%	5,28%	2,44%	1,15%	-0,58%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1,12%	12,23%	7,30%	6,82%	10,60%	16,01%	6,03%	0,22%

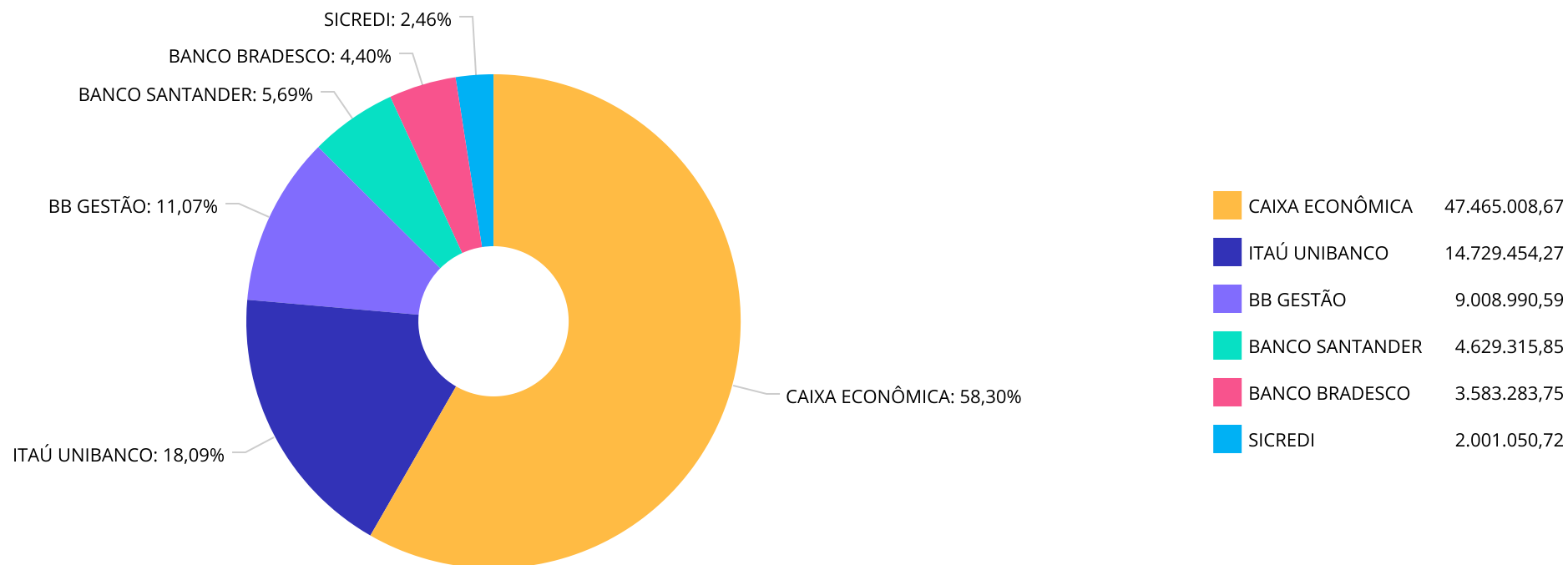
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	13,54%	4,71%	13,69%	1,56%	-7,34%	-32,24%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	13,18%	4,64%	13,20%	1,51%	-7,90%	-33,41%	10,55%	0,31%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	11,40%	4,28%	11,54%	1,53%	-5,57%	-24,91%	9,42%	0,27%

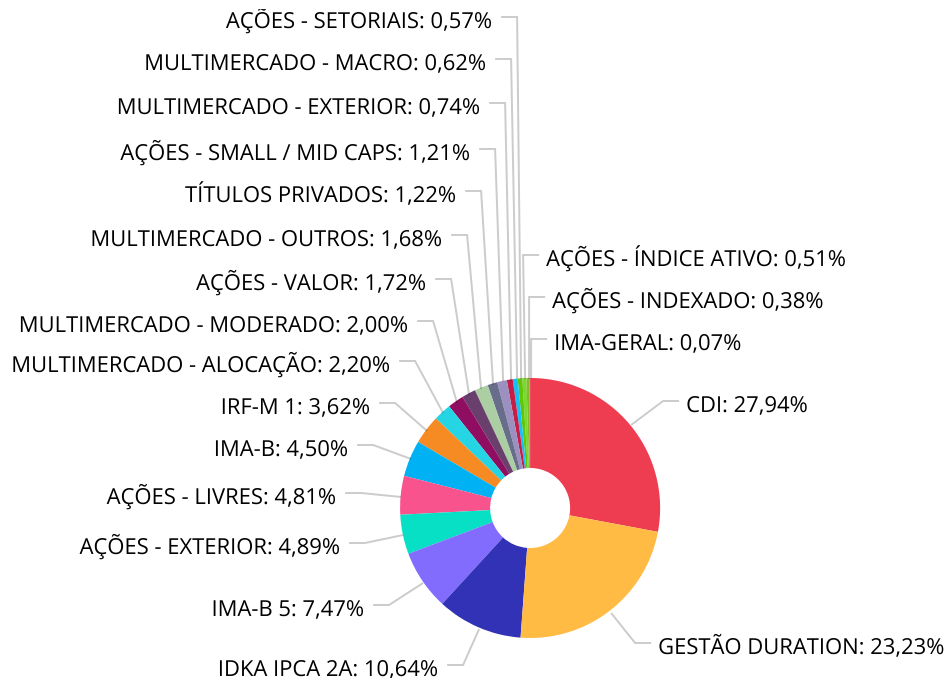
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,17%	6,22%	4,37%	1,30%	9,48%	-3,66%	7,45%	14,059%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,80%	14,00%	8,47%	8,53%	13,81%	-3,05%	8,28%	16,769%

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



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

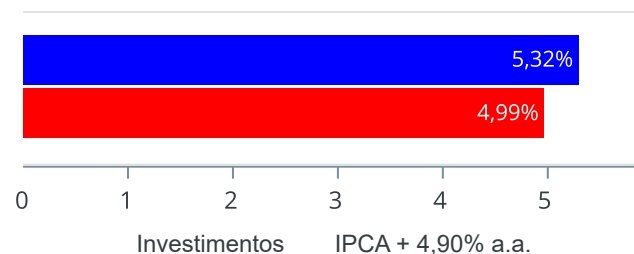


■ CDI	23.028.603,93	■ GESTÃO DURATION	19.144.299,19	■ IDKA IPCA 2A	8.768.989,55	■ IMA-B 5	6.155.398,82
■ AÇÕES - EXTERIOR	4.032.864,75	■ AÇÕES - LIVRES	3.963.634,20	■ IMA-B	3.708.932,81	■ IRF-M 1	2.983.562,46
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.812.555,58	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.650.752,22	■ AÇÕES - VALOR	1.419.704,66	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.384.807,98
■ TÍTULOS PRIVADOS	1.002.736,43	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	993.928,47	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	606.686,31	■ MULTIMERCADO - MACRO	507.670,02
■ AÇÕES - SETORIAIS	466.707,09	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	417.898,08	■ AÇÕES - INDEXADO	315.804,11	■ IMA-GERAL	54.303,62

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	80.597.269,66	2.262.425,76	2.223.101,03	81.844.337,39	1.207.743,00	1.207.743,00	1,50%	1,50%	0,95%	0,95%	157,54%	2,40%
Fevereiro	81.844.337,39	1.134.395,77	1.500.000,00	81.369.991,22	-108.741,94	1.099.001,06	-0,13%	1,36%	1,19%	2,15%	63,48%	2,13%
Março	81.369.991,22	1.175.979,89	2.480.000,00	80.820.268,43	754.297,32	1.853.298,38	0,93%	2,30%	1,15%	3,32%	69,30%	1,94%
Abril	80.820.268,43	1.474.938,66	1.901.252,53	81.206.727,96	812.773,40	2.666.071,78	1,01%	3,33%	0,95%	4,31%	77,32%	1,85%
Maio	81.206.727,96	11.547.890,63	11.895.631,30	82.419.840,28	1.560.852,99	4.226.924,77	1,92%	5,32%	0,65%	4,99%	106,65%	1,75%

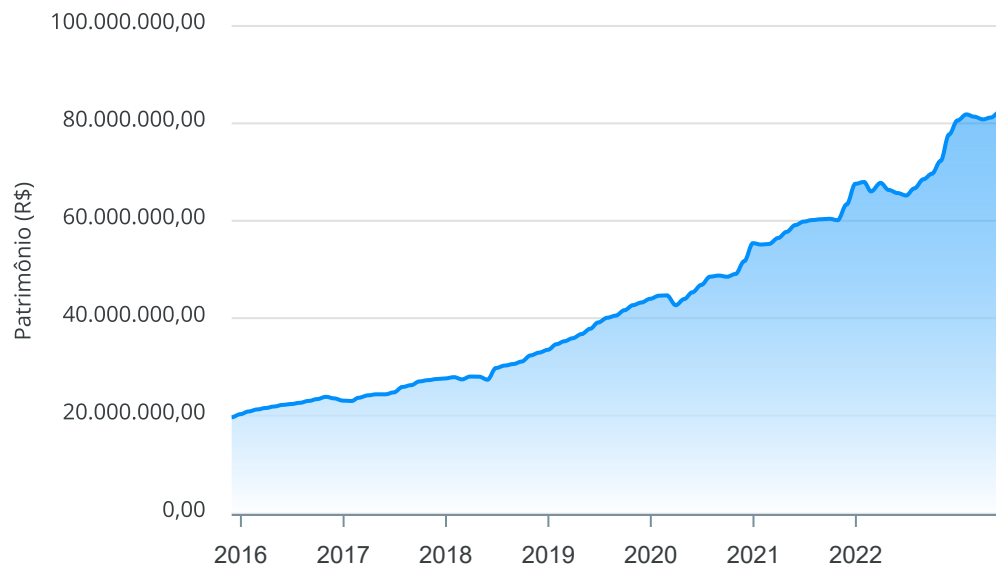
Investimentos x Meta de Rentabilidade



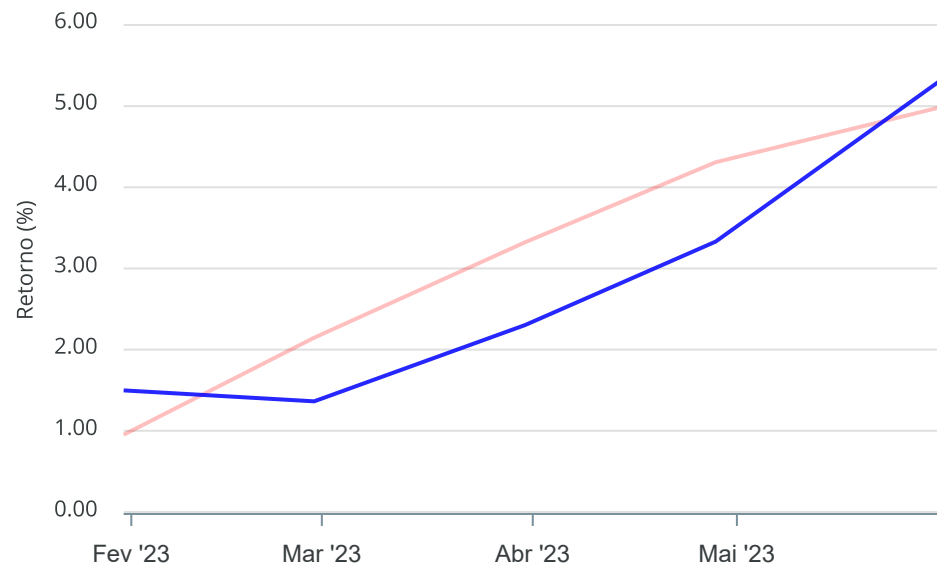
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.092.237,45	0,00	0,00	1.119.919,42	27.681,97	2,53%	2,53%	1,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.524.715,97	1.025,16	0,00	2.589.013,39	63.272,26	2,51%	2,51%	1,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.172.143,82	0,00	0,00	5.293.790,75	121.646,93	2,35%	2,35%	1,00%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.691.770,14	0,00	0,00	1.728.838,13	37.067,99	2,19%	2,19%	0,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.037.263,03	62.192,30	0,00	3.157.532,02	58.076,69	1,87%	1,88%	0,69%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	53.307,18	0,00	0,00	54.303,62	996,44	1,87%	1,87%	0,64%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.365.925,63	0,00	0,00	8.516.935,10	151.009,47	1,81%	1,81%	0,56%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	439.838,31	0,00	0,00	447.203,19	7.364,88	1,67%	1,67%	0,44%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	3.743.105,35	0,00	0,00	3.787.693,64	44.588,29	1,19%	1,19%	0,02%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	831.988,84	0,00	0,00	841.622,21	9.633,37	1,16%	1,16%	0,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.118.144,12	0,00	0,00	2.141.940,25	23.796,13	1,12%	1,12%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.019.908,44	2.063.200,91	0,00	9.171.895,30	88.785,95	0,98%	1,22%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.885.463,43	0,00	1.167.511,56	2.753.044,04	35.092,17	0,90%	1,24%	0,04%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.673.291,76	0,00	9.734.671,63	0,00	61.379,87	0,63%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.988.132,17	0,00	0,00	2.000.668,36	12.536,19	0,63%	0,63%	0,63%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1.840.331,21	0,00	0,00	1.850.666,46	10.335,25	0,56%	0,56%	0,67%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	788.362,46	1.000.000,00	0,00	1.797.979,46	9.617,00	0,54%	1,15%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.032.447,07	5.359,26	0,00	4.053.479,11	15.672,78	0,39%	0,39%	0,68%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.698.575,54	0,00	0,00	4.715.510,44	16.934,90	0,36%	0,36%	0,75%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	0,00	1.000.000,00	0,00	1.002.736,43	2.736,43	0,27%	-	-

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
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,00	516.113,00	0,00	516.492,48	379,48	0,07%	-1,46%	2,24%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.000.000,00	0,00	1.000.560,56	560,56	0,06%	1,16%	0,03%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.001.050,72	1.050,72	0,05%	1,16%	0,03%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	900.000,00	0,00	900.257,51	257,51	0,03%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	1.999.887,73	-112,27	-0,01%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.403.937,18	0,00	0,00	1.403.806,49	-130,69	-0,01%	-0,01%	0,51%
Total Renda Fixa	64.400.889,10	10.547.890,63	10.902.183,19	64.846.826,81	800.230,27	1,24%		0,51%

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 (%)	(%) Instít	Var - Mês
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	107.637,21	0,00	0,00	125.403,65	17.766,44	16,51%	16,51%	10,39%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	339.562,00	0,00	0,00	384.327,98	44.765,98	13,18%	13,18%	10,55%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	145.319,21	0,00	0,00	162.743,04	17.423,83	11,99%	11,99%	9,27%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	547.219,15	0,00	0,00	609.600,49	62.381,34	11,40%	11,40%	9,42%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.358.038,84	0,00	0,00	2.503.135,87	145.097,03	6,15%	6,15%	7,44%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	168.845,34	0,00	0,00	178.560,40	9.715,06	5,75%	5,75%	6,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.387.809,88	0,00	0,00	1.460.498,33	72.688,45	5,24%	5,24%	8,46%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	398.013,95	0,00	0,00	417.898,08	19.884,13	5,00%	5,00%	8,48%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	282.536,83	0,00	296.045,64	0,00	13.508,81	4,78%	2,30%	6,19%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.369.044,13	0,00	0,00	1.419.704,66	50.660,53	3,70%	3,70%	8,41%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESA FI AÇÕES	304.877,01	0,00	0,00	315.804,11	10.927,10	3,58%	3,58%	7,96%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	502.248,64	0,00	516.113,00	0,00	13.864,36	2,76%	0,64%	6,88%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.777.523,96	0,00	0,00	1.812.555,58	35.031,62	1,97%	1,97%	2,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	498.611,72	0,00	0,00	507.670,02	9.058,30	1,82%	1,82%	1,13%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.621.912,66	0,00	0,00	1.650.752,22	28.839,56	1,78%	1,78%	1,52%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	599.955,28	0,00	0,00	606.686,31	6.731,03	1,12%	1,12%	6,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	379.486,18	1.000.000,00	0,00	1.384.807,98	5.321,80	0,39%	1,30%	0,18%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	184.981,46	0,00	181.289,47	0,00	-3.691,99	-2,00%	6,20%	8,54%
Total Renda Variável	12.973.623,45	1.000.000,00	993.448,11	13.540.148,72	559.973,38	4,31%		5,43%



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	3.004.566,63	0,00	0,00	3.178.979,69	174.413,06	5,80%	5,80%	8,28%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	827.648,78	0,00	0,00	853.885,06	26.236,28	3,17%	3,17%	7,45%
Total Exterior	3.832.215,41	0,00	0,00	4.032.864,75	200.649,34	5,24%		8,10%

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.

