

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2023

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			137.345.398,78	31,18%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.317.274,03	3,02%	29	6,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	23.090.222,40	5,24%	20	11,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	31.253.193,73	7,09%	657	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.711.260,80	1,52%	481	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	2.251.811,05	0,51%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	9.015.885,50	2,05%	105	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	10.181.279,63	2,31%	301	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.439.041,95	2,14%	107	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	28.005.882,23	6,36%	775	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	8.655.930,74	1,97%	1.189	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	11.300.933,43	2,57%	313	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	22.573.968,77	5,12%	122	14,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA ...	D+0	Não há	4.693.110,74	1,07%	1.719	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.701.293,72	2,20%	207	0,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	16.791.354,16	3,81%	1.116	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.916.863,00	0,44%	227	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	5.000.000,00	1,14%	30	2,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.051.821,71	0,24%	3.133	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	10.452.561,04	2,37%	162	0,77%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

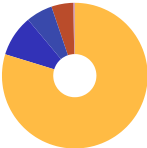
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.598.916,28	0,36%	41	15,00%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	7.101.441,40	1,61%	593	2,35%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.545.600,05	0,35%	30.087	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.514.707,84	0,80%	21.999	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	8.093.252,88	1,84%	185	1,27%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.669.133,75	0,38%	158	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.678.502,16	0,61%	123	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.709.477,31	0,62%	1.451	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	4.931.153,21	1,12%	58	0,95%	Artigo 9º, Inciso II
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	986.374,92	0,22%	76	0,18%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	1.615.540,72	0,37%	46	1,33%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	1.378.857,78	0,31%	154	0,76%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	1.497.266,01	0,34%	216	0,51%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	15.523.456,87	3,52%	494	0,76%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	10.246.846,52	2,33%	119	1,58%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.453.992,81	1,24%	7.098	0,35%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.505.941,43	1,25%	10	11,14%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.703.250,00	0,39%		1,59%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		36.227,23	0,01%		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			440.502.799,35				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			36.227,23	Artigo 6º			
PL Total			440.539.026,58				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	137.345.398,78	31,18%	20,00%	29,50%	81,95%	223.646.645,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	153.222.715,49	34,78%	17,70%	23,60%	81,95%	207.769.328,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	75,00%	60.676.590,39	13,77%	0,00%	14,50%	75,00%	269.700.509,12
Total Renda Fixa	100,00%	351.244.704,66	79,74%	37,70%	67,60%	238,90%	

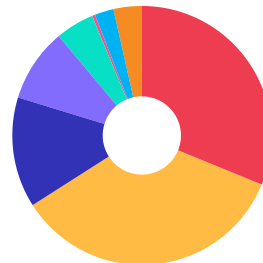


- RENTA FIXA 351.244.704,66
- RENTA VARIÁVEL 40.415.414,42
- EXTERIOR 25.932.649,51
- ESTRUTURADOS 21.206.780,76
- FUNDO IMOBILIÁRIO 1.703.250,00

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

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	45,00%	40.415.414,42	9,17%	10,00%	13,40%	45,00%	157.810.845,29
Artigo 8º, Inciso II	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	22.025.139,97
Artigo 10º, Inciso I	15,00%	21.206.780,76	4,81%	1,50%	5,50%	15,00%	44.868.639,14
Artigo 10º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	10,00%	44.050.279,94
Artigo 11º	15,00%	1.703.250,00	0,39%	0,00%	1,00%	15,00%	64.372.169,90
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	45,00%	63.325.445,18	14,38%	11,50%	22,40%	90,00%	



7º I a 7º I b 7º III a 8º I
10º I 11º 9º II 9º III

Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	137.345.398,78	31,18	-
CAIXA DTVM	123.884.251,47	28,12	-
BANESTES DTVM	85.427.346,98	19,39	1,18
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	75.086.897,16	17,05	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	10.505.941,43	2,38	0,63
OCCAM BRASIL	2.709.477,31	0,62	0,02
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.497.266,01	0,34	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.051.821,71	0,24	0,00

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)

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 '	137.345.398,78	31,18	20,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	153.222.715,49	34,78	17,70	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60.676.590,39	13,77	0,00	75,00
Artigo 8º, Inciso I	40.415.414,42	9,17	10,50	45,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	10.409.192,64	2,36	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	15.523.456,87	3,52	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	21.206.780,76	4,81	1,50	15,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 11º	1.703.250,00	0,39	0,00	15,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	1,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	5,41%	3,22%	6,65%	13,42%	20,73%	0,11%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,57%	5,93%	3,02%	6,92%	9,45%	19,90%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	1,56%	1,78%	2,90%	1,62%	4,47%	0,51%	0,05%

IMA-B (Benchmark)	2,53%	8,76%	7,39%	8,55%	10,47%	15,54%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,57%	8,71%	7,49%	8,42%	10,21%	14,97%	1,51%	0,04%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,62%	8,73%	7,41%	8,58%	10,54%	11,75%	1,47%	0,04%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,84%	6,04%	7,69%	5,95%	2,61%	3,48%	1,79%	0,06%

IRF-M (Benchmark)	2,20%	7,34%	5,54%	8,93%	14,73%	16,57%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	7,20%	5,47%	8,74%	14,38%	15,91%	0,80%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,20%	7,30%	5,49%	8,85%	14,60%	16,28%	0,81%	0,03%

CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
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%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	2,99%	2,67%	4,13%	11,18%	20,91%	0,03%	0,01%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	0,85%	4,06%	2,46%	4,95%	10,12%	15,95%	0,01%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	1,25%	3,18%	2,92%	4,11%	10,24%	17,32%	0,12%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	4,57%	1,78%	5,94%	8,55%	20,30%	0,51%	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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,81%	6,03%	3,94%	7,24%	12,48%	16,41%	0,56%	0,02%
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%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
--------------------------	---	---	---	---	---	---	---	---

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	2,58%	9,14%	6,12%	10,93%	-	-	9,85%	-

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%

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 EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,70%	-0,90%	3,15%	-4,34%	-5,27%	-17,03%	8,41%	0,19%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,29%	-1,67%	1,69%	-4,34%	-4,55%	-16,42%	8,56%	0,18%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,39%	-2,47%	-0,56%	-5,42%	-4,27%	-38,32%	7,60%	0,23%
OCCAM FIC AÇÕES	0,44%	-5,07%	-1,26%	-7,60%	-5,85%	-17,65%	7,19%	0,17%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3,08%	-3,48%	0,99%	-5,96%	-9,91%	-15,82%	8,14%	0,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,99%	-4,33%	-2,44%	-7,07%	-12,86%	-34,01%	9,07%	0,23%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,20%	3,59%	6,51%	1,03%	-1,45%	-7,32%	8,54%	0,19%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2,11%	-9,14%	-4,08%	-9,89%	-9,62%	-22,84%	7,34%	0,18%

IDIV (Benchmark)	0,84%	0,48%	2,64%	-1,14%	-0,85%	1,55%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2,31%	1,88%	5,00%	-0,59%	-0,78%	-6,36%	6,19%	0,16%

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
IFIX (Benchmark)	5,43%	5,10%	7,30%	5,10%	6,84%	6,99%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,90%	8,14%	10,53%	-1,23%	8,19%	-25,62%	19,24%	0,16%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,56%	4,28%	0,55%	-1,39%	6,70%	-11,51%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,21%	12,31%	7,30%	6,81%	10,60%	16,12%	6,05%	0,22%
SMLL (Benchmark)	13,54%	4,71%	13,69%	1,56%	-7,34%	-32,24%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,56%	0,58%	3,54%	-1,24%	-7,32%	-25,59%	5,71%	0,21%

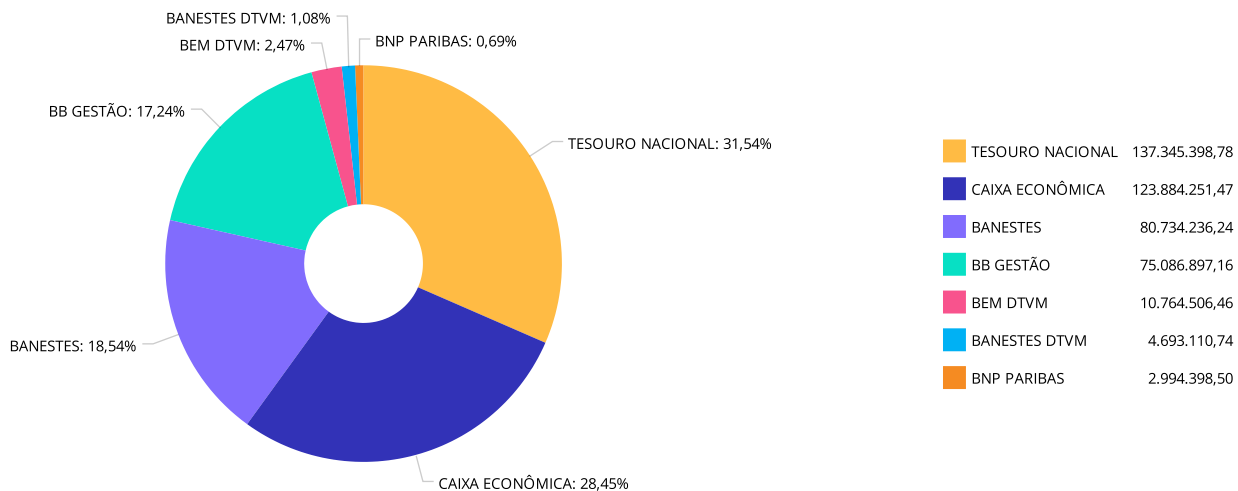
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,90%	14,58%	8,54%	9,75%	14,79%	-0,17%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,80%	14,00%	8,47%	8,53%	13,81%	-3,05%	8,28%	16,769%

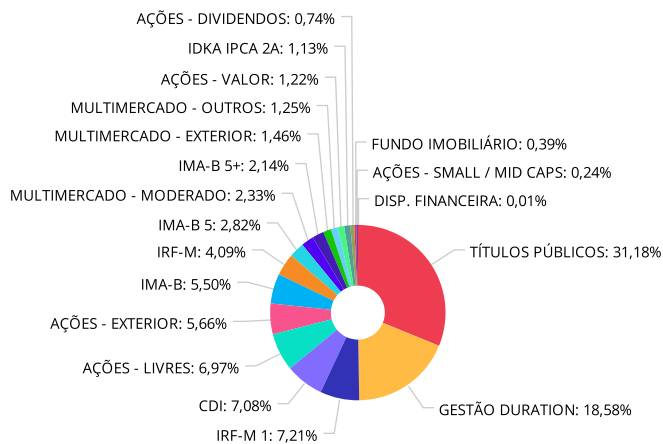
MSCI WORLD (Benchmark)	0,63%	5,09%	0,95%	-0,93%	8,13%	-8,34%	-	-
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	12,68%	16,20%	3,59%	8,14%	8,38%	-53,28%	13,11%	26,624%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-0,68%	-1,25%	-3,71%	-2,03%	2,68%	-11,05%	8,58%	14,380%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,65%	2,90%	0,41%	2,76%	7,91%	-7,44%	9,44%	11,372%

MSCI ACWI (Benchmark)	0,56%	4,28%	0,55%	-1,39%	6,70%	-11,51%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-1,42%	1,00%	1,60%	1,64%	6,47%	-4,78%	8,15%	12,864%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	2,61%	5,57%	3,40%	5,78%	13,30%	-7,12%	9,11%	14,021%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	137.345.398,78	■ GESTÃO DURATION	81.833.044,73	■ IRF-M 1	31.746.153,14	■ CDI	31.185.758,62
■ AÇÕES - LIVRES	30.707.563,21	■ AÇÕES - EXTERIOR	24.946.274,59	■ IMA-B	24.250.022,53	■ IRF-M	18.012.194,23
■ IMA-B 5	12.433.090,68	■ MULTIMERCADO - MODERADO	10.246.846,52	■ IMA-B 5+	9.439.041,95	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.440.367,73
■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.505.941,43	■ AÇÕES - VALOR	5.387.979,47	■ IDKA IPCA 2A	5.000.000,00	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.268.050,03
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.703.250,00	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.051.821,71	■ DISP. FINANCEIRA	36.227,23		



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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	26/01/2023	1.860	3.898,63633039	4.161,280719	7.251.463,57	7.739.982,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	13/12/2022	975	3928,920938	4.062,90041	3.830.697,91	3.961.327,89	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	09/03/2022	730	3.882,81549107	4.184,447961	2.834.455,31	3.054.647,01	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/02/2022	2.475	4041,475328	4.319,832306	10.002.651,44	10.691.584,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/04/2022	1.560	4217,247417	4.357,756594	6.578.905,97	6.798.100,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/10/2022	912	4164,832110	4.261,109496	3.798.326,88	3.886.131,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/11/2022	925	3987,369527	4.157,021974	3.688.316,81	3.845.245,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/11/2022	1.820	3907,209923	4.062,90041	7.111.122,06	7.394.478,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	29/12/2021	665	4.198,229405	4.553,675367	2.791.822,55	3.028.194,11	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/02/2022	617	3968,953944	4.344,575944	2.448.844,58	2.680.603,35	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/02/2022	2.430	4.007,88968105	4.403,575242	9.739.171,92	10.700.687,83	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/02/2022	202	3968,953944	4.344,575944	801.728,70	877.604,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	602	4175,438692	4.440,443098	2.513.614,09	2.673.146,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	878	4175,438692	4.440,443098	3.666.035,17	3.898.709,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	100	4175,438692	4.440,443098	417.543,87	444.044,30	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	140	4164,883793	4.340,081978	583.083,73	607.611,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	35	4164,883793	4.340,081978	145.770,93	151.902,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	308	4113,258152	4.229,874573	1.266.883,51	1.302.801,36	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	500	4113,258152	4.229,874573	2.056.629,08	2.114.937,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	22	4113,258152	4.229,874573	90.491,68	93.057,24	Curva



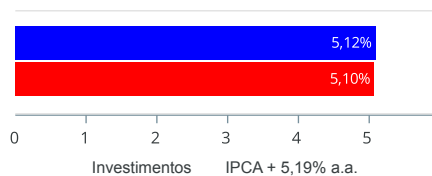
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/02/2022	202	3968,953944	4.344,575944	801.728,70	877.604,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	602	4175,438692	4.440,443098	2.513.614,09	2.673.146,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	878	4175,438692	4.440,443098	3.666.035,17	3.898.709,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	100	4175,438692	4.440,443098	417.543,87	444.044,30	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	140	4164,883793	4.340,081978	583.083,73	607.611,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	35	4164,883793	4.340,081978	145.770,93	151.902,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	308	4113,258152	4.229,874573	1.266.883,51	1.302.801,36	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	500	4113,258152	4.229,874573	2.056.629,08	2.114.937,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	22	4113,258152	4.229,874573	90.491,68	93.057,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/08/2022	2.490	4058,501854	4.282,275293	10.105.669,62	10.662.865,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/02/2022	50	3.962,3416127	4.344,575944	198.117,08	217.228,79	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	15/12/2021	707	4.267,647108	4.651,411911	3.017.226,51	3.288.548,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	06/05/2022	611	4076,821575	4.280,905232	2.490.937,98	2.615.633,09	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	03/06/2022	830	4087,350009	4.245,26713	3.392.500,51	3.523.571,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	22/08/2022	488	4099,695852	4.205,011261	2.000.651,58	2.052.045,49	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	13/09/2022	975	4.029,55247710	4.317,079803	3.928.813,67	4.209.152,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	06/05/2022	177	4.076,82157506	4.280,905232	721.597,42	757.720,22	Curva

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	402.887.789,48	32.202.341,49	32.876.834,31	408.088.099,37	5.874.802,71	5.874.802,71	1,46%	1,46%	0,98%	0,98%	149,55%	3,32%
Fevereiro	408.088.099,37	15.002.337,74	7.694.217,47	415.561.942,63	165.722,99	6.040.525,70	0,04%	1,50%	1,21%	2,19%	68,37%	3,39%
Março	415.561.942,63	10.362.437,29	10.943.519,96	418.524.435,25	3.543.575,29	9.584.100,99	0,85%	2,36%	1,18%	3,39%	69,66%	2,82%
Abril	418.524.435,25	27.134.167,72	14.433.320,70	434.865.946,73	3.640.664,46	13.224.765,45	0,84%	3,23%	0,97%	4,40%	73,35%	2,59%
Maio	434.865.946,73	14.343.953,55	17.156.203,70	440.010.681,80	7.956.985,22	21.181.750,67	1,83%	5,12%	0,67%	5,10%	100,25%	2,65%

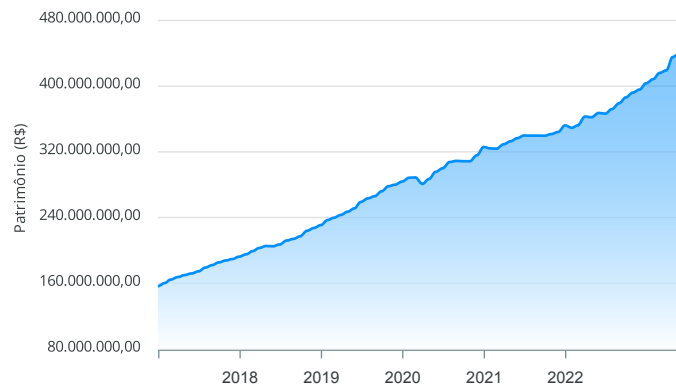
Investimentos x Meta de Rentabilidade



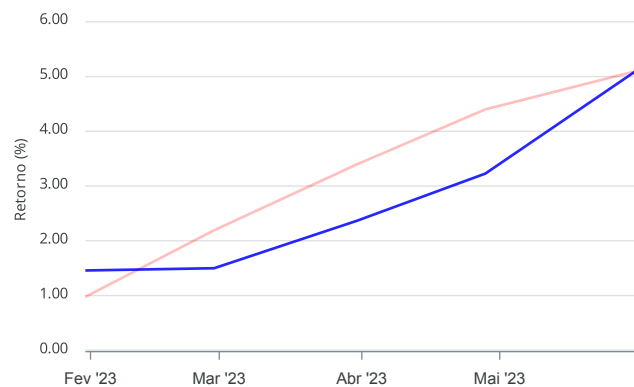
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.178.065,70	0,00	0,00	9.439.041,95	260.976,25	2,84%	2,84%	1,79%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.977.668,46	0,00	0,00	13.317.274,03	339.605,57	2,62%	2,62%	1,47%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.868.779,17	0,00	0,00	1.916.863,00	48.083,83	2,57%	2,57%	1,51%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	11.058.180,62	0,00	0,00	11.300.933,43	242.752,81	2,20%	2,20%	0,81%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.568.436,90	0,00	0,00	6.711.260,80	142.823,90	2,17%	2,17%	0,80%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	30.675.215,67	0,00	0,00	31.253.193,73	577.978,06	1,88%	1,88%	0,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	27.509.324,20	0,00	0,00	28.005.882,23	496.558,03	1,81%	1,81%	0,56%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	22.295.250,12	0,00	0,00	22.573.968,77	278.718,65	1,25%	1,25%	0,12%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.590.168,39	0,00	0,00	9.701.293,72	111.125,33	1,16%	1,16%	0,03%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.825.899,30	0,00	0,00	23.090.222,40	264.323,10	1,16%	1,16%	0,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	16.600.293,80	0,00	0,00	16.791.354,16	191.060,36	1,15%	1,15%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.559.766,61	0,00	0,00	8.655.930,74	96.164,13	1,12%	1,12%	0,09%
TÍTULOS PÚBLICOS	137.881.160,84	0,00	1.989.534,00	137.345.398,78	1.453.771,94	1,05%	-	-
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	10.383.347,82	9.536.025,71	15.334.981,82	4.693.110,74	108.719,03	0,55%	0,85%	0,01%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.251.930,74	0,00	0,00	2.251.811,05	-119,69	-0,01%	-0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.182.227,51	0,00	0,00	10.181.279,63	-947,88	-0,01%	-0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.016.874,30	0,00	0,00	9.015.885,50	-988,80	-0,01%	-0,01%	0,51%
Total Renda Fixa	349.422.590,15	14.536.025,71	17.324.515,82	351.244.704,66	4.610.604,62	1,32%		0,52%

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.578.500,00	0,00	14.000,00	1.703.250,00	138.750,00	8,79%	7,90%	19,24%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	9.702.066,17	0,00	0,00	10.452.561,04	750.494,87	7,74%	7,39%	7,60%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	7.620.712,90	0,00	0,00	8.093.252,88	472.539,98	6,20%	6,20%	8,54%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.005.926,11	0,00	0,00	1.051.821,71	45.895,60	4,56%	4,56%	5,71%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.582.922,90	0,00	0,00	2.678.502,16	95.579,26	3,70%	3,70%	8,41%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	6.875.399,19	0,00	0,00	7.101.441,40	226.042,21	3,29%	3,29%	8,56%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.409.749,94	0,00	0,00	3.514.707,84	104.957,90	3,08%	3,08%	8,14%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.557.720,30	0,00	0,00	1.598.916,28	41.195,98	2,64%	2,11%	7,34%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.367.292,11	0,00	0,00	5.505.941,43	138.649,32	2,58%	2,58%	9,85%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.631.527,29	0,00	0,00	1.669.133,75	37.606,46	2,30%	2,30%	6,19%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.515.515,21	0,00	0,00	1.545.600,05	30.084,84	1,99%	1,99%	9,07%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	10.067.828,37	0,00	0,00	10.246.846,52	179.018,15	1,78%	1,78%	1,52%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.388.701,44	0,00	0,00	5.453.992,81	65.291,37	1,21%	1,21%	6,05%
OCCAM FIC AÇÕES	2.697.653,83	0,00	0,00	2.709.477,31	11.823,48	0,44%	0,44%	7,19%
Total Renda Variável	61.001.515,76	0,00	14.000,00	63.325.445,18	2.337.929,42	3,83%		7,23%

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
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	1.223.652,68	0,00	0,00	1.378.857,78	155.205,10	12,68%	12,68%	13,11%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14.671.770,56	0,00	0,00	15.523.456,87	851.686,31	5,80%	5,80%	8,28%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	960.946,46	0,00	0,00	986.374,92	25.428,46	2,65%	2,65%	9,44%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.459.182,56	0,00	0,00	1.497.266,01	38.083,45	2,61%	2,61%	9,11%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	4.965.103,00	0,00	0,00	4.931.153,21	-33.949,79	-0,68%	-0,68%	8,58%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.638.766,52	0,00	0,00	1.615.540,72	-23.225,80	-1,42%	-1,42%	8,15%
Total Exterior	24.919.421,78	0,00	0,00	25.932.649,51	1.013.227,73	4,07%		8,68%

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.

