

2023

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

Junho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	10.612.654,39	11,93%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	502.506,92	0,57%	5.696.060.085,44	0,01%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	535.697,18	0,60%	6.493.608.770,37	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	801.145,37	0,90%	936.474.291,29	0,09%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.292.672,82	2,58%	134.623.585,97	1,70%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	586.747,30	0,66%	5.348.206.988,95	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	713.467,10	0,80%	5.947.143.642,03	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.615.622,42	1,82%	8.254.253.931,25	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.843.727,10	14,44%	4.240.209.456,14	0,30%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.164.711,38	1,31%	7.342.301.496,88	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.560,31	0,04%	14.603.622.203,04	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.909.855,31	3,27%	2.099.537.000,43	0,14%	7º I b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	723.554,87	0,81%	290.613.636,58	0,25%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.711.851,21	10,92%	725.460.751,19	1,34%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.707.248,74	4,17%	10.391.025.294,46	0,04%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.049.321,59	13,55%	138.362.302,85	8,71%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.269.197,36	1,43%	1.330.366.206,19	0,10%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.171,32	0,00%	3.021.387.375,69	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.585.834,36	1,78%	810.368.157,20	0,20%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.690.493,61	3,03%	324.216.474,05	0,83%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.897.761,75	2,13%	468.779.708,09	0,40%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	898.676,49	1,01%	1.452.015.178,41	0,06%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.265.966,53	3,67%	653.548.043,56	0,50%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.993.567,38	2,24%	234.456.759,31	0,85%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.251.095,65	1,41%	1.312.877.349,58	0,10%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.549.202,62	1,74%	1.826.911.890,36	0,08%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	764.175,23	0,86%	155.764.584,77	0,49%	8º I

Investimentos

\$ 88.930.753,55

Disponibilidades Financeiras

\$ 48.962,89

Total Carteira

\$ 88.979.716,44

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	369.246,58	0,42%	423.061.697,41	0,09%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	204.956,34	0,23%	95.268.876,14	0,22%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	982.488,58	1,10%	18.983.582,05	5,18%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	749.082,32	0,84%	652.308.818,52	0,11%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1.107.042,11	1,24%	288.636.067,89	0,38%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.514.779,74	1,70%	2.036.420.590,68	0,07%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.213.450,59	1,36%	99.945.010,60	1,21%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	507.519,93	0,57%	1.566.821.792,54	0,03%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.309.701,05	4,85%	1.596.861.875,61	0,27%	10º I

Investimentos

\$ 88.930.753,55

Disponibilidades Financeiras

\$ 48.962,89

Total Carteira

\$ 88.979.716,44

Governança (Pró Gestão)

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.455,403324	129.206,70
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.643,195922	92.863,92
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.810,534839	235.716,21
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	4.971,610153	725.855,08
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.781,465608	1.678.294,43
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.841,658929	348.599,44
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.245,871851	639.996,37
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.201,226133	369.287,06
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	5.106,40556	745.535,21
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	5.042,267572	620.198,91
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	5.077,748951	619.485,37
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	5.007,149299	620.886,51
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	5.070,622967	745.381,58
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.291,086987	15.873,26
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.438,133147	103.324,53
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	4.972,402387	343.095,76
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.303,067348	124.788,95
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	4.986,443919	1.790.133,37
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	4.956,206967	664.131,73

Investimentos

\$ 88.930.753,55

Disponibilidades Financeiras

\$ 48.962,89

Total Carteira

\$ 88.979.716,44

Governança (Pró Gestão)

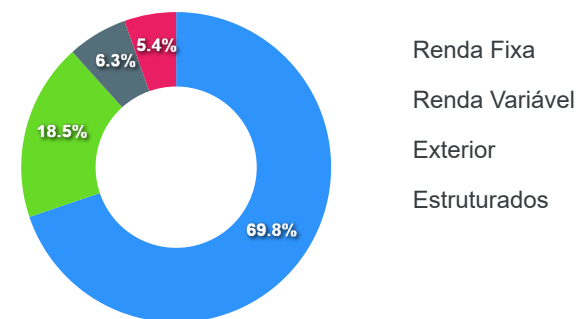
[GPA](#)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	11,93%	10.612.654,39 88,07%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	27,79%	24.724.268,08 72,21%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	30,05%	26.738.790,22 29,95%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	18,51%	16.470.976,54 11,49%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,19%	2.838.613,01 6,81%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,07%	2.728.230,33 6,93%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,41%	4.817.220,98 4,59%

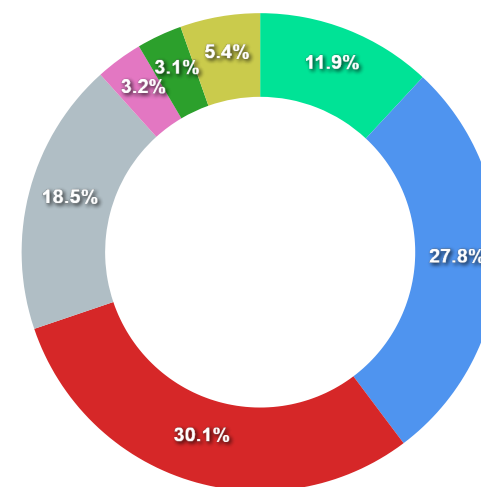
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos



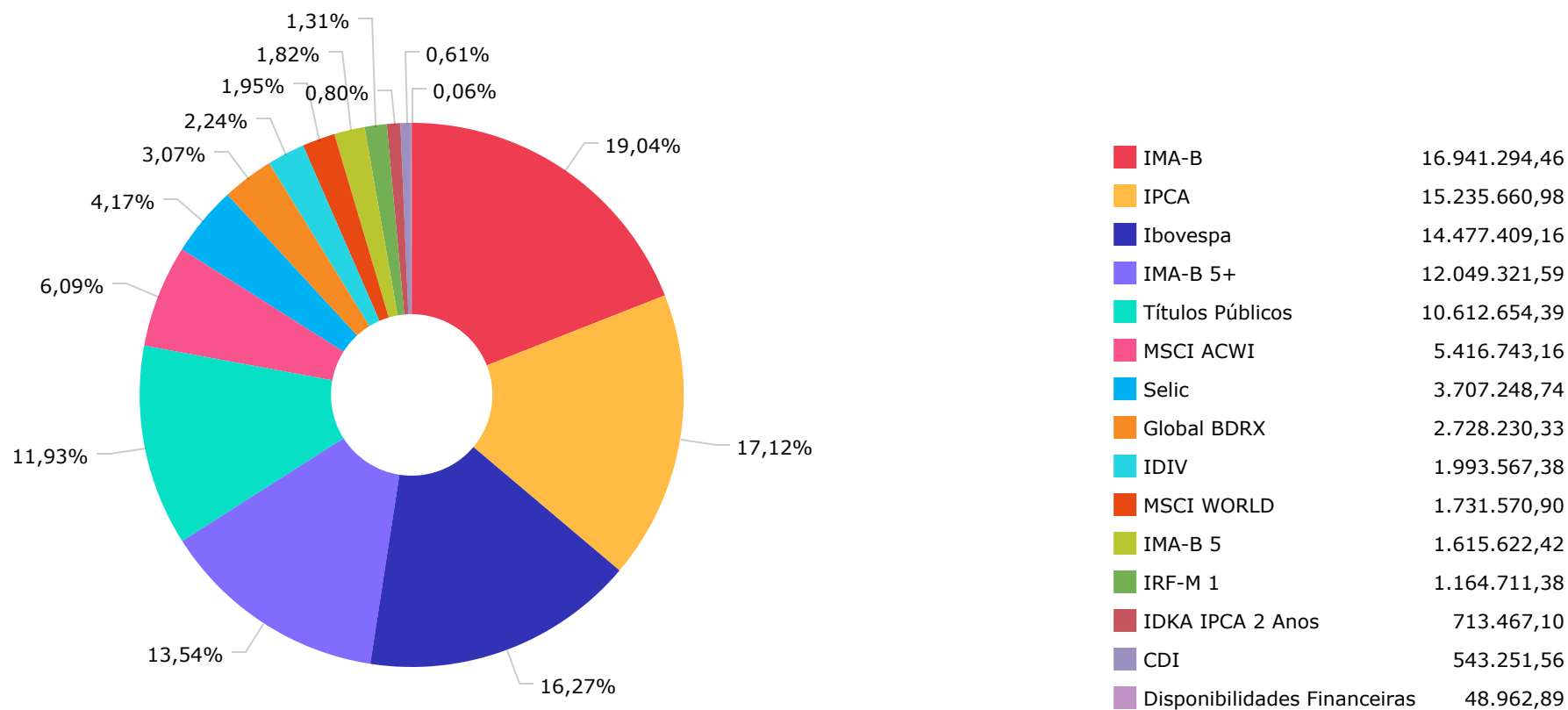
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	11,93%	0,00%	15,00%	100,00%	78.367.062,05
7º I b - FI 100% Títulos TN	27,79%	0,00%	20,00%	100,00%	64.255.448,36
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	88.979.716,44
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.448.985,82
7º III a - FI Referenciados RF	30,05%	0,00%	20,00%	60,00%	26.649.039,64
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	53.387.829,86
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	17.795.943,29
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.448.985,82
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.448.985,82
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.448.985,82

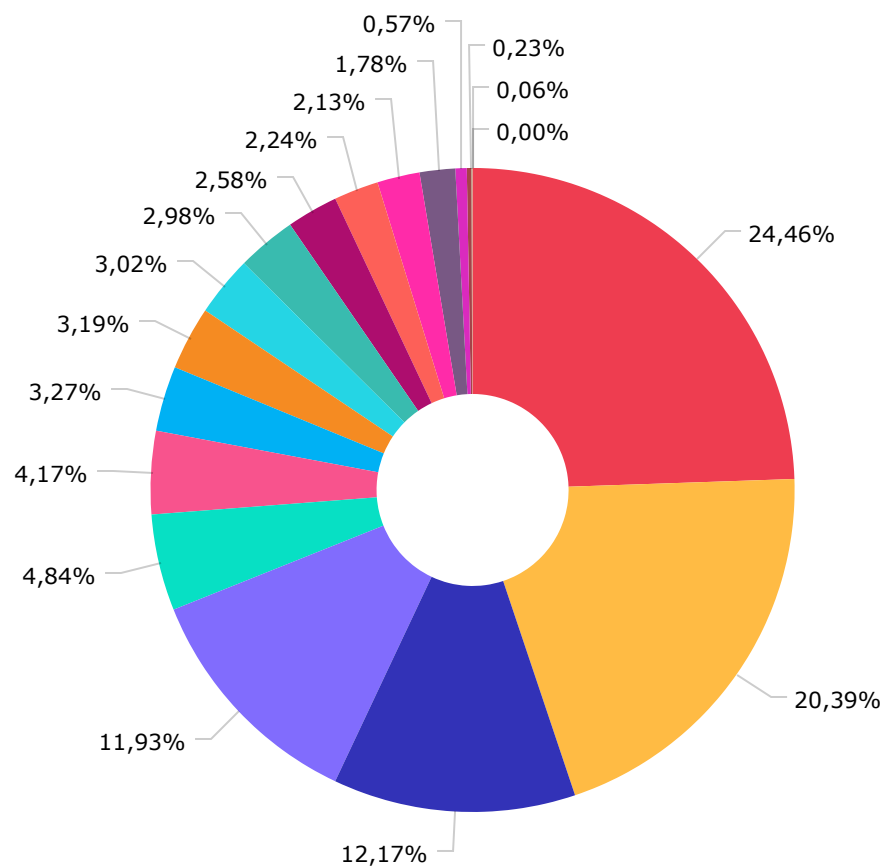
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	18,51%	0,00%	28,00%	30,00%	10.222.938,39
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	26.693.914,93
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.897.971,64
9º II - Constituídos no Brasil	3,19%	0,00%	2,00%	10,00%	6.059.358,63
9º III - Ações - BDR Nível I	3,07%	0,00%	5,00%	10,00%	6.169.741,31
10º I - Fundos Multimercados	5,41%	0,00%	5,00%	10,00%	4.080.750,66
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.448.985,82
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.448.985,82
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.448.985,82
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.448.985,82

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,81	6,66	4,42	6,66	13,77	16,42	1,11	2,34
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,15	6,37	3,26	6,37	13,60	24,20	0,02	0,05
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,13	6,55	3,23	6,55	13,52	23,55	0,04	0,09
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,48	15,14	5,90	15,14	14,44	0,60		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47	14,53	5,60	14,53	13,40	-1,43	6,60	13,89
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,11	-0,68	1,94	-0,68	1,21	-0,16	5,44	11,46
IBOVESPA - BENCHMARK	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87		
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	9,05	7,69	15,96	7,69	19,95	-6,93	7,50	15,80
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	8,01	5,57	14,39	5,57	19,10	-11,84	6,95	14,63
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8,63	6,85	15,61	6,85	17,92	-21,86	7,79	16,40
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,39	6,66	15,10	6,66	17,15	-33,62	7,85	16,54
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	7,60	16,00
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8,16	11,84	18,12	11,84	17,01	-3,57	7,14	15,03
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	7,74	7,45	16,13	7,45	15,89	-22,46	6,90	14,53
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8,89	8,06	17,13	8,06	15,45	-16,81	7,53	15,87
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,27	-1,57	7,34	-1,57	13,35	-15,61	7,12	14,99
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,75	3,91	15,52	3,91	5,48	-28,99	7,86	16,55
IDIV - BENCHMARK	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,54	8,46	13,30	8,46	16,15	7,61	7,31	15,40
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04	6,60	2,14	6,60	9,23	19,78	0,83	1,74

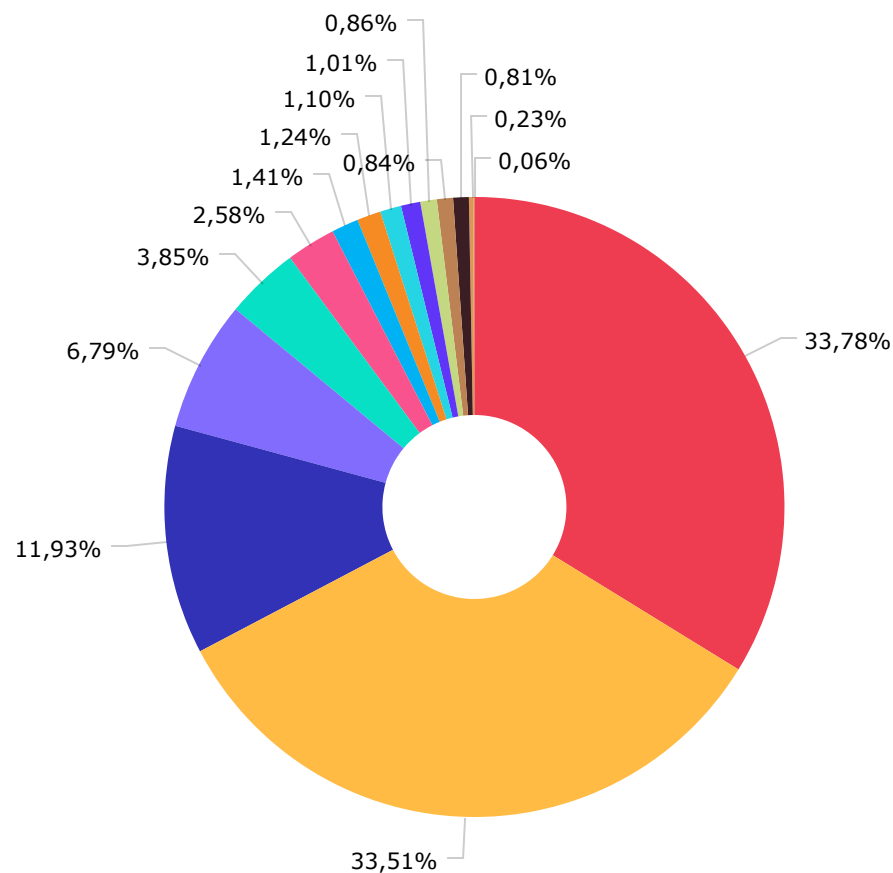
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B - BENCHMARK	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35	11,24	7,06	11,24	13,32	17,31	2,12	4,47
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37	11,28	7,11	11,28	13,29	17,23	2,15	4,52
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2,32	10,80	6,72	10,80	13,26	17,85	2,09	4,41
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,37	11,29	7,16	11,29	13,23	17,19	2,15	4,54
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03	7,00	2,57	7,00	10,18	21,01	0,88	1,86
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,35	14,75	10,82	14,75	16,02	12,69	3,20	6,74
IPCA - BENCHMARK	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,10	8,26	4,86	8,26	14,59	18,86	0,90	1,89
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,01	9,45	5,68	9,45	14,37	19,80	1,19	2,51
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80	8,76	5,04	8,76	13,97	19,98	0,95	2,00
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22	10,28	5,91	10,28	12,95	23,06	1,33	2,80
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,78	7,75	4,35	7,75	12,87	20,57	1,06	2,24
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95	9,20	3,88	9,20	10,92		1,44	3,04
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16	6,59	3,15	6,59	13,58	21,47	0,11	0,22
SELIC - BENCHMARK	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,07	6,38	3,09	6,38	13,28	22,89	0,01	0,02
MSCI WORLD - BENCHMARK	0,18	5,28	0,82	5,28	7,20	-5,27		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,56	21,72	5,61	21,72	25,89	-30,09	7,68	16,17
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-2,19	-2,72	-2,72	-2,72	1,52	-6,45	5,99	12,61
MSCI ACWI - BENCHMARK	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,00	20,17	10,43	20,17	28,33	20,97	5,04	10,62
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-2,57	2,86	-0,13	2,86	10,03	-6,01	8,25	17,37

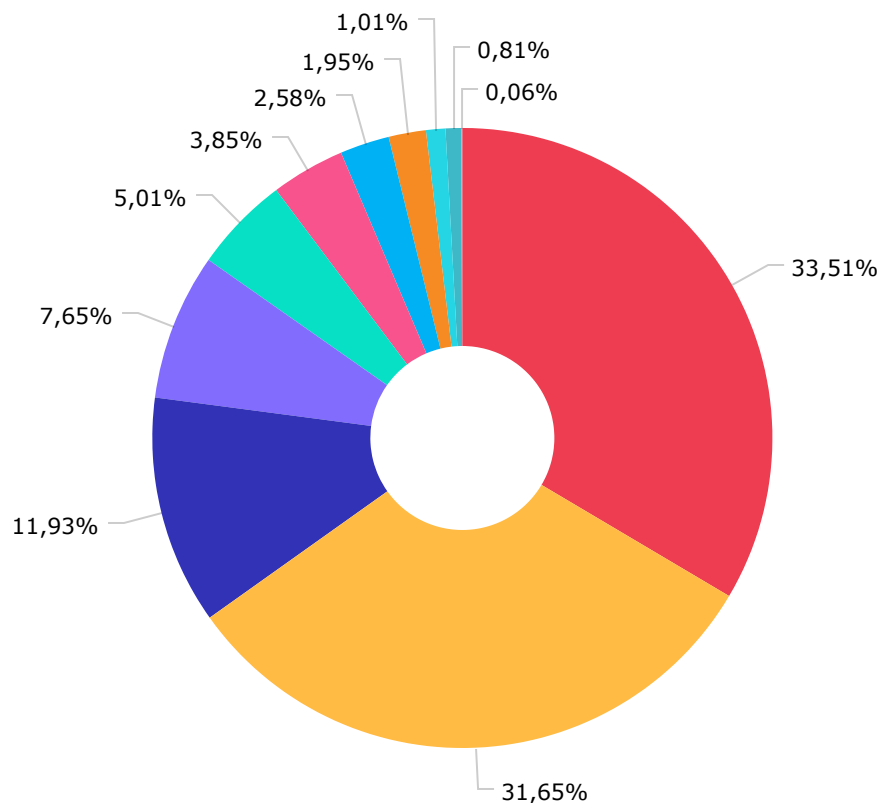




Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	21.761.172,80
Renda Fixa Indexados	18.142.422,54
Ações Livre	10.826.593,43
Títulos Públicos	10.612.654,39
Multimercados Livre	4.309.701,05
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	3.707.248,74
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	2.909.855,31
Ações Investimento no Exterior	2.838.613,01
Ações Indexados	2.690.493,61
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.648.514,77
Renda Fixa Duração Alta Soberano	2.292.672,82
Ações Dividendos	1.993.567,38
Ações Índice Ativo	1.897.761,75
Ações Sustentabilidade/Governança	1.585.834,36
Multimercados Macro	507.519,93
Ações Valor/Crescimento	204.956,34
Disponibilidades Financeiras	48.962,89
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	1.171,32



BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	30.056.676,90
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.819.567,60
TESOURO NACIONAL	10.612.654,39
ITAU UNIBANCO S.A.	6.041.755,10
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.425.183,83
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S....	2.292.672,82
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.251.095,65
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.107.042,11
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	982.488,58
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	898.676,49
ITAÚ DTVM S.A.	764.175,23
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	749.082,32
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	724.726,19
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	204.956,34
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	48.962,89



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.819.567,60
BANCO BRADESCO S.A.	28.158.915,15
TESOURO NACIONAL	10.612.654,39
ITAU UNIBANCO S.A.	6.805.930,33
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	4.460.855,85
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.425.183,83
SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRI...	2.292.672,82
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	1.731.570,90
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	898.676,49
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	724.726,19
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	48.962,89

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	76.550.855,53	871.703,64	255.860,00	78.370.841,73	1.204.142,56	1.204.142,56	1,56% ▲	1,56%	0,99%	0,99%	157,58%	4,28%
Fevereiro	78.370.841,73	1.541.794,21	679.235,13	78.604.427,93	-628.972,88	575.169,68	-0,79% ▼	0,75%	1,22%	2,23%	33,63%	3,54%
Março	78.604.427,93	2.311.001,22	1.358.000,00	80.367.794,75	810.365,60	1.385.535,28	1,02% ▲	1,78%	1,20%	3,45%	51,59%	3,18%
Abril	80.367.794,75	1.366.372,62	567.000,00	82.342.260,71	1.175.093,34	2.560.628,62	1,45% ▲	3,25%	0,99%	4,47%	72,71%	3,07%
Maio	82.342.260,71	2.480.415,53	1.232.046,07	85.591.259,29	2.000.629,12	4.561.257,74	2,39% ▲	5,73%	0,69%	5,20%	110,19%	2,80%
Junho	85.591.259,29	12.187.095,97	11.464.552,72	88.930.753,55	2.616.951,01	7.178.208,75	3,03% ▲	8,93%	0,36%	5,58%	160,04%	3,10%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.385.535,28	1,78%	3,45%
2º Trim	5.792.673,47	7,03%	2,06%
1º Sem	7.178.208,75	8,93%	5,58%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

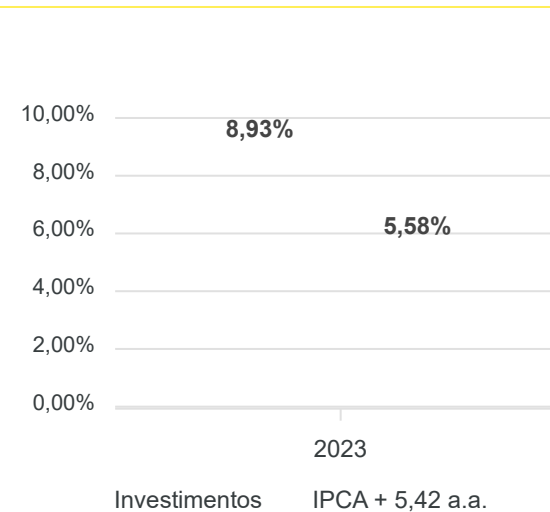


Gráfico Risco x Retorno

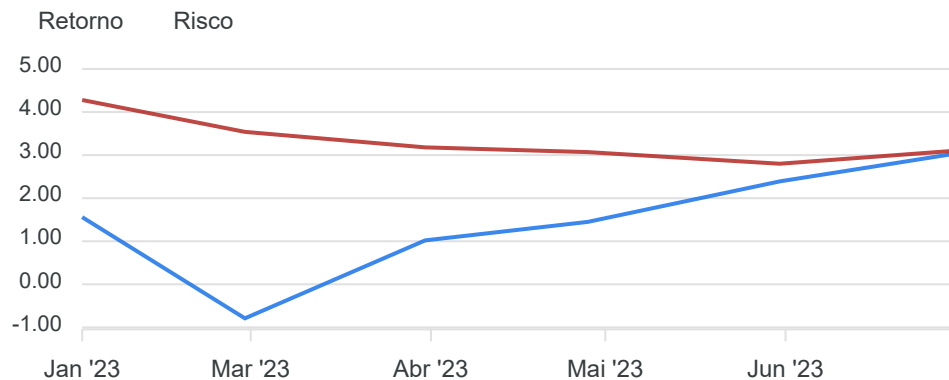
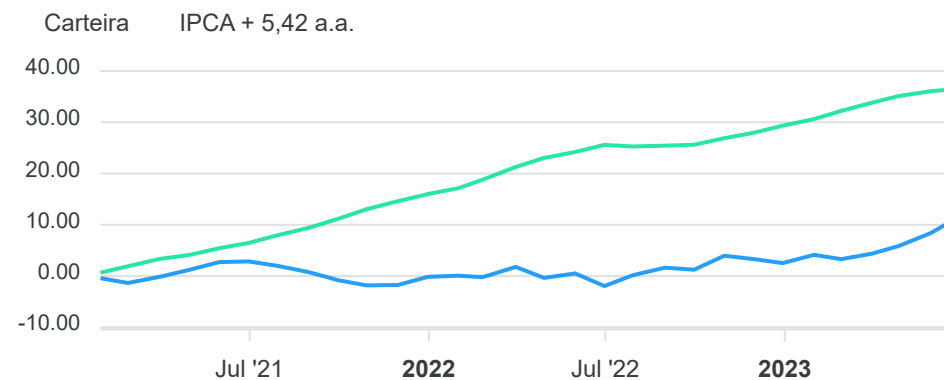
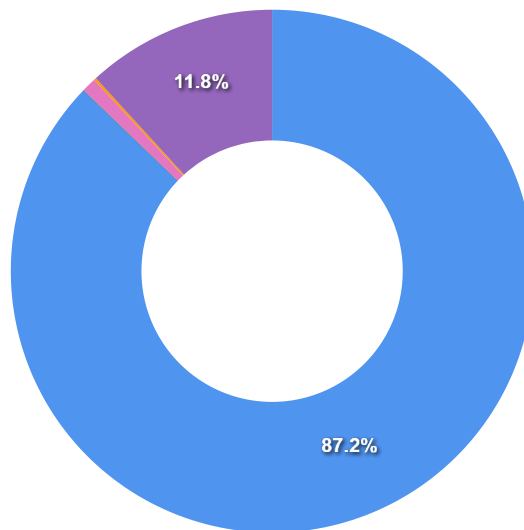


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/06/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	77.565.916,68	87,22
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	801.145,37	0,90
Até D+3600	129.206,70	0,15
Acima D+3600	10.483.447,69	11,79
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.573.262,08	0,00	0,00	10.612.654,39	39.392,31	0,37% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	493.601,65	0,00	0,00	502.506,92	8.905,27	1,80% ▲	0,95%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	523.284,57	0,00	0,00	535.697,18	12.412,61	2,37% ▲	2,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	793.611,22	0,00	0,00	801.145,37	7.534,15	0,95% ▲	1,44%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.490.536,66	760.000,00	0,00	2.292.672,82	42.136,16	1,87% ▲	2,09%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.580.870,53	5.000.000,00	0,00	9.711.851,21	130.980,68	1,37% ▲	1,19%
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.663.554,70	0,00	5.034.033,08	3.707.248,74	77.727,12	0,90% ▲	0,01%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	9.874.172,05	1.823.425,97	0,00	12.049.321,59	351.723,57	3,01% ▲	3,20%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1.801.886,05	0,00	1.823.425,97	0,00	21.539,92	1,20% ▲	1,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	574.652,13	0,00	0,00	586.747,30	12.095,17	2,10% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	706.100,59	0,00	0,00	713.467,10	7.366,51	1,04% ▲	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.575.516,66	0,00	4.000.000,00	1.615.622,42	40.105,76	0,72% ▲	0,88%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.601.814,02	4.000.000,00	0,00	12.843.727,10	241.913,08	1,92% ▲	2,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.151.378,83	0,00	0,00	1.164.711,38	13.332,55	1,16% ▲	0,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.174,77	0,00	0,00	34.560,31	385,54	1,13% ▲	0,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.239.769,35	0,00	0,00	1.269.197,36	29.428,01	2,37% ▲	2,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.846.545,58	0,00	0,00	2.909.855,31	63.309,73	2,22% ▲	1,33%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	710.882,22	0,00	0,00	723.554,87	12.672,65	1,78% ▲	1,06%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.726,94	603.670,00	607.093,67	1.171,32	2.868,05	0,47% ▲	0,02%
	60.237.340,60	12.187.095,97	11.464.552,72	62.075.712,69	1.115.828,84	1,83%	1,53%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.456.531,98	0,00	0,00	1.585.834,36	129.302,38	8,88% ▲	7,60%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.467.156,63	0,00	0,00	2.690.493,61	223.336,98	9,05% ▲	7,50%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	1.756.985,53	0,00	0,00	1.897.761,75	140.776,22	8,01% ▲	6,95%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	821.569,25	0,00	0,00	898.676,49	77.107,24	9,39% ▲	7,85%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.999.425,18	0,00	0,00	3.265.966,53	266.541,35	8,89% ▲	7,53%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.836.680,33	0,00	0,00	1.993.567,38	156.887,05	8,54% ▲	7,31%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.156.705,97	0,00	0,00	1.251.095,65	94.389,68	8,16% ▲	7,14%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.471.702,38	0,00	0,00	1.549.202,62	77.500,24	5,27% ▲	7,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	709.285,10	0,00	0,00	764.175,23	54.890,13	7,74% ▲	6,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	342.700,10	0,00	0,00	369.246,58	26.546,48	7,75% ▲	7,86%
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	188.673,27	0,00	0,00	204.956,34	16.283,07	8,63% ▲	7,79%
-	15.207.415,72	0,00	0,00	16.470.976,54	1.263.560,82	8,31%	7,37%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	498.481,93	0,00	0,00	507.519,93	9.038,00	1,81% ▲	1,11%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.027.593,54	0,00	0,00	4.309.701,05	282.107,51	7,00% ▲	5,04%
-	4.526.075,47	0,00	0,00	4.817.220,98	291.145,51	6,43%	4,63%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.004.516,49	0,00	0,00	982.488,58	-22.027,91	-2,19% ▼	5,99%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.507.722,24	0,00	0,00	1.514.779,74	7.057,50	0,47% ▲	6,60%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.227.057,87	0,00	0,00	1.213.450,59	-13.607,28	-1,11% ▼	5,44%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	744.889,36	0,00	0,00	749.082,32	4.192,96	0,56% ▲	7,68%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.136.241,54	0,00	0,00	1.107.042,11	-29.199,43	-2,57% ▼	8,25%
	5.620.427,50	0,00	0,00	5.566.843,34	-53.584,16	-0,95%	5,07%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	478.395,30	0,00	0,00	502.506,92	24.111,62	5,04% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	478.739,96	22.206,98	0,00	535.697,18	34.750,24	6,94% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	792.834,37	0,00	22.206,98	801.145,37	30.517,98	3,85% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIXA	1.429.026,58	760.000,00	0,00	2.292.672,82	103.646,24	4,73% ▲
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	4.421.711,47	5.000.000,00	0,00	9.711.851,21	290.139,74	3,08% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	6.888.509,51	1.707.304,22	5.116.796,98	3.707.248,74	228.231,99	2,66% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIXA	8.816.645,26	2.223.425,97	0,00	12.049.321,59	1.009.250,36	9,14% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENTA FIXA	1.749.664,03	0,00	1.823.425,97	0,00	73.761,94	4,22% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	566.338,97	0,00	575.332,48	0,00	8.993,51	1,59% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	559.578,07	0,00	0,00	586.747,30	27.169,23	4,86% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	698.548,14	0,00	0,00	713.467,10	14.918,96	2,14% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	5.491.963,71	0,00	4.000.000,00	1.615.622,42	123.658,71	2,25% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	7.541.918,77	4.707.075,18	0,00	12.843.727,10	594.733,15	4,86% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	1.129.131,20	0,00	0,00	1.164.711,38	35.580,18	3,15% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	33.480,31	0,00	0,00	34.560,31	1.080,00	3,23% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.184.366,14	0,00	0,00	1.269.197,36	84.831,22	7,16% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	2.747.452,48	0,00	0,00	2.909.855,31	162.402,83	5,91% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIXA	664.604,12	29.360,78	0,00	723.554,87	29.589,97	4,26% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENTA FIXA REFERENCIADO DI	3.235,08	1.584.510,99	1.594.093,67	1.171,32	7.518,92	0,47% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.511.548,56	0,00	131.742,71	10.612.654,39	232.848,54	2,22% ▲
	56.187.692,03	16.033.884,12	13.263.598,79	62.075.712,69	3.117.735,33	5,29%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.373.646,78	0,00	0,00	1.585.834,36	212.187,58	15,45% ▲
BRABESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.320.235,55	0,00	0,00	2.690.493,61	370.258,06	15,96% ▲
BRABESCO SELECTION FIAÇÕES	1.658.983,96	0,00	0,00	1.897.761,75	238.777,79	14,39% ▲
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	780.800,99	0,00	0,00	898.676,49	117.875,50	15,10% ▲
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.788.284,06	0,00	0,00	3.265.966,53	477.682,47	17,13% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.759.539,00	0,00	0,00	1.993.567,38	234.028,38	13,30% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.059.216,62	0,00	0,00	1.251.095,65	191.879,03	18,12% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.443.280,39	0,00	0,00	1.549.202,62	105.922,23	7,34% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	658.030,79	0,00	0,00	764.175,23	106.144,44	16,13% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	319.638,22	0,00	0,00	369.246,58	49.608,36	15,52% ▲
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	177.287,43	0,00	0,00	204.956,34	27.668,91	15,61% ▲
	14.338.943,79	0,00	0,00	16.470.976,54	2.132.032,75	14,87%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	486.041,70	0,00	0,00	507.519,93	21.478,23	4,42% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.902.703,33	0,00	0,00	4.309.701,05	406.997,72	10,43% ▲
	4.388.745,03	0,00	0,00	4.817.220,98	428.475,95	9,76%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.009.940,19	0,00	0,00	982.488,58	-27.451,61	-2,72% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.434.409,42	0,00	0,00	1.514.779,74	80.370,32	5,60% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.190.299,45	0,00	0,00	1.213.450,59	23.151,14	1,94% ▲
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	709.314,35	0,00	0,00	749.082,32	39.767,97	5,61% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.108.450,49	0,00	0,00	1.107.042,11	-1.408,38	-0,13% ▼
	5.452.413,90	0,00	0,00	5.566.843,34	114.429,44	2,10%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	462.049,25	0,00	0,00	502.506,92	40.457,67	8,76% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	460.808,28	22.206,98	0,00	535.697,18	52.681,92	10,91% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	754.161,32	0,00	22.206,98	801.145,37	69.191,03	9,17% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.376.361,02	760.000,00	0,00	2.292.672,82	156.311,80	7,32% ▲
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.269.291,64	5.000.000,00	0,00	9.711.851,21	442.559,57	4,77% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.009.807,94	4.449.873,83	5.149.796,98	3.707.248,74	397.363,95	4,70% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.515.259,20	2.223.425,97	0,00	12.049.321,59	1.310.636,42	12,20% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1.690.594,60	0,00	1.823.425,97	0,00	132.831,37	7,86% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	546.495,40	0,00	575.332,48	0,00	28.837,08	5,28% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	541.976,95	0,00	0,00	586.747,30	44.770,35	8,26% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	669.307,90	0,00	0,00	713.467,10	44.159,20	6,60% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.264.333,40	0,00	4.000.000,00	1.615.622,42	351.289,02	6,67% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.258.414,84	4.707.075,18	0,00	12.843.727,10	878.237,08	7,34% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.076.200,26	16.685,45	0,00	1.164.711,38	71.825,67	6,57% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.436,61	0,00	0,00	34.560,31	2.123,70	6,55% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.140.440,37	0,00	0,00	1.269.197,36	128.756,99	11,29% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.638.641,44	0,00	0,00	2.909.855,31	271.213,87	10,28% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	643.651,90	29.360,78	0,00	723.554,87	50.542,19	7,51% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	162.911,22	3.549.755,00	3.728.706,96	1.171,32	17.212,06	0,46% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.290.708,26	0,00	257.224,55	10.612.654,39	579.170,68	5,63% ▲
	51.803.851,80	20.758.383,19	15.556.693,92	62.075.712,69	5.070.171,62	8,89%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.488.882,59	0,00	0,00	1.585.834,36	96.951,77	6,51% ▲
BRANESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.498.293,30	0,00	0,00	2.690.493,61	192.200,31	7,69% ▲
BRANESCO SELECTION FIAÇÕES	1.797.606,85	0,00	0,00	1.897.761,75	100.154,90	5,57% ▲
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	842.598,07	0,00	0,00	898.676,49	56.078,42	6,66% ▲
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.022.473,42	0,00	0,00	3.265.966,53	243.493,11	8,06% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.838.125,33	0,00	0,00	1.993.567,38	155.442,05	8,46% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.118.668,63	0,00	0,00	1.251.095,65	132.427,02	11,84% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.573.872,70	0,00	0,00	1.549.202,62	-24.670,08	-1,57% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	711.221,69	0,00	0,00	764.175,23	52.953,54	7,45% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	355.361,62	0,00	0,00	369.246,58	13.884,96	3,91% ▲
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	191.817,25	0,00	0,00	204.956,34	13.139,09	6,85% ▲
	15.438.921,45	0,00	0,00	16.470.976,54	1.032.055,09	6,68%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	475.822,55	0,00	0,00	507.519,93	31.697,38	6,66% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.586.286,40	0,00	0,00	4.309.701,05	723.414,65	20,17% ▲
	4.062.108,95	0,00	0,00	4.817.220,98	755.112,03	18,59%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.009.955,12	0,00	0,00	982.488,58	-27.466,54	-2,72% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.322.605,46	0,00	0,00	1.514.779,74	192.174,28	14,53% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.221.759,96	0,00	0,00	1.213.450,59	-8.309,37	-0,68% ▼
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	615.397,58	0,00	0,00	749.082,32	133.684,74	21,72% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.076.255,21	0,00	0,00	1.107.042,11	30.786,90	2,86% ▲
	5.245.973,33	0,00	0,00	5.566.843,34	320.870,01	6,12%

Cenário Econômico

Repetindo o bom desempenho do mês anterior, o mês de junho foi muito positivo para as carteiras de investimento. O segmento de renda fixa teve um bom desempenho, principalmente nos fundos de atrelados a inflação, que continuam se beneficiando do fechamento da curva de juros. A renda variável teve o melhor desempenho para um mês neste ano e o IBOVESPA fechou em alta próxima dos 9%, trazendo o índice para o campo positivo no acumulado do ano. A exceção ficou com os fundos de investimento no exterior, com exposição cambial que fecharam no negativo com o fortalecimento do real frente ao dólar.

A inflação segue surpreendendo com dados inferiores as projeções do mercado. E as principais surpresas vieram da alimentação e combustíveis, destacando também para as surpresas baixistas mais favoráveis dos núcleos da inflação. Com esses indicadores, várias revisões de projeção estão sendo feitas pelo mercado, caindo o IPCA para próximo de 5% no acumulado ao final de 2023.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Na renda fixa, o fechamento em curso da curva de juros, tem propiciado bons retornos nas estratégias CDI e IMA's. Os Títulos Públicos Federais seguem apresentando remuneração bastante competitiva. Já na renda variável as projeções de mercado se confirmaram, e o desempenho das estratégias atreladas ao Ibovespa foi muito boa. A exceção ficou com os fundos de investimento no exterior, com exposição cambial, que não performaram adequadamente com o fortalecimento do real frente ao dólar.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 07 de julho de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,30%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+3

Quantidade de Cotistas
664

Patrimônio Líquido Fundo
5.696.060.085,44

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IPCA

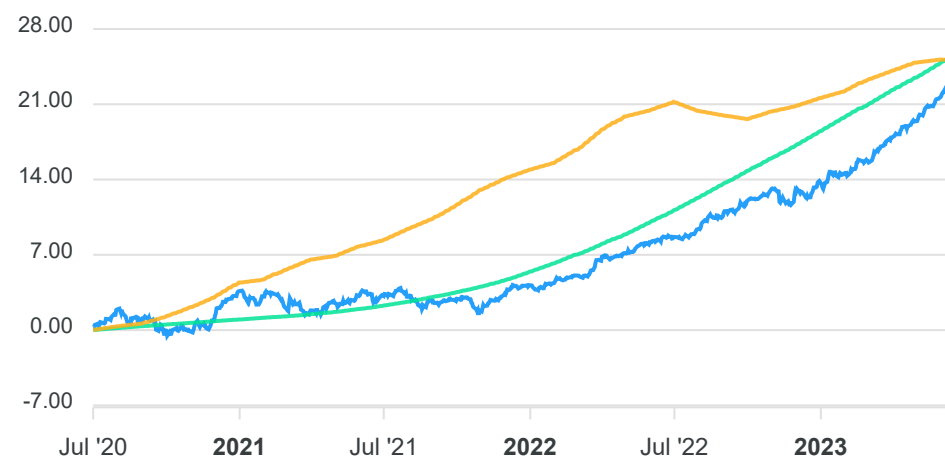
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe de Renda Fixa.

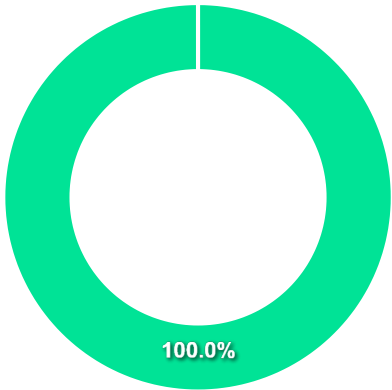
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	2,00%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP JUROS BRASIL FI RENDA FIXA LP	5.898.546,72	99,99	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	500,92	0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	25,79	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / PROV.AUDIT 28/06/24	0,27	0,00	Outros
Valores a pagar / Controladoria	-48,51	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-67,82	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.898.546,72	99.99%
Valores a pagar/receber	443,65	0.01%
Outros	0,23	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
572

Patrimônio Líquido Fundo
6.493.608.770,37

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

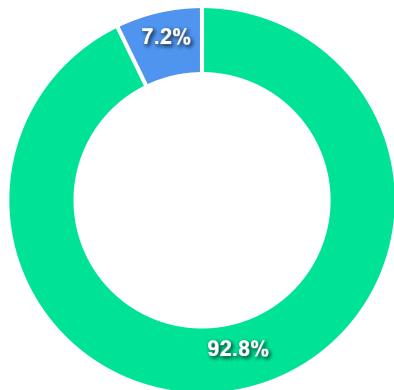
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	4,52%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.552.465,46	92.80%
Operação compromissada	352.705,61	7.19%
Derivativos	262,33	0.01%
Valores a pagar/receber	130,78	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	559.924,36	11,41	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	554.387,55	11,30	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	516.489,39	10,53	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	417.752,91	8,52	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	399.818,35	8,15	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	356.082,95	7,26	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2031	352.705,61	7,19	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	348.087,17	7,10	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	343.914,89	7,01	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	331.279,86	6,75	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	272.393,05	5,55	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	148.734,76	3,03	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	117.258,66	2,39	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	105.186,10	2,14	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	81.155,45	1,65	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	200,75	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK27	140,65	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	56,75	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ26	41,95	0,00	Derivativos
Outros Valores a receber	25,96	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ30	21,83	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa Selic	16,18	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	8,57	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Auditoria	3,78	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,40	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	-7,41	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa Cetip	-29,37	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
189

Patrimônio Líquido Fundo
936.474.291,29

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IPCA

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos e derivativos de renda fixa, sendo que poderá incorrer nos seguintes fatores de risco: taxa de juros pré-fixadas, taxa de juros pós-fixadas, índices de preço e derivativos.

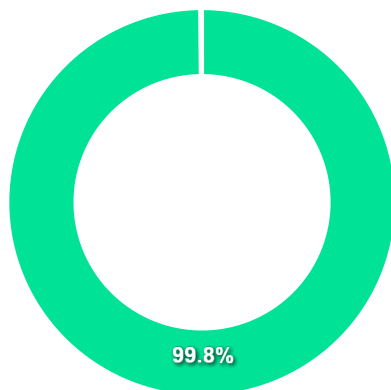
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,95%	9,20%	3,88%	9,20%	10,92%	-%	1,44%	3,04%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	976.716,88	99,84	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2031	1.509,45	0,15	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	31,27	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	18,46	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	2,84	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	2,33	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-7,75	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-8,06	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	976.716,88	99.84%
Operação compromissada	1.509,45	0.15%
Valores a pagar/receber	39,09	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E
VALORES MOBILIARIOS S.A.

Gestão
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
95

Patrimônio Líquido Fundo
134.623.585,97

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Alta Soberano

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em títulos de emissão
do Tesouro Nacional atrelados ao IPCA.

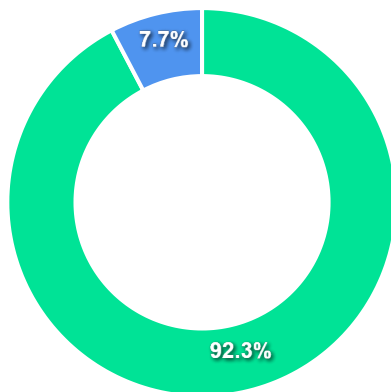
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,32%	10,80%	6,72%	10,80%	13,26%	17,85%	2,09%	4,41%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	127.500,73	92.32%
Operação compromissada	10.613,36	7.68%
Valores a pagar/receber	-1,87	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	15.465,97	11,20	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	15.308,51	11,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	12.997,94	9,41	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	12.563,14	9,10	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	12.003,35	8,69	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	11.408,97	8,26	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	10.958,20	7,93	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	10.685,31	7,74	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	10.613,36	7,68	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	9.483,94	6,87	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	7.879,66	5,71	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	6.836,46	4,95	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	1.611,19	1,17	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	298,10	0,22	Títulos Federais
Outros Valores a receber	15,08	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	7,85	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-24,80	-0,02	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
773

Patrimônio Líquido Fundo
5.348.206.988,95

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IPCA

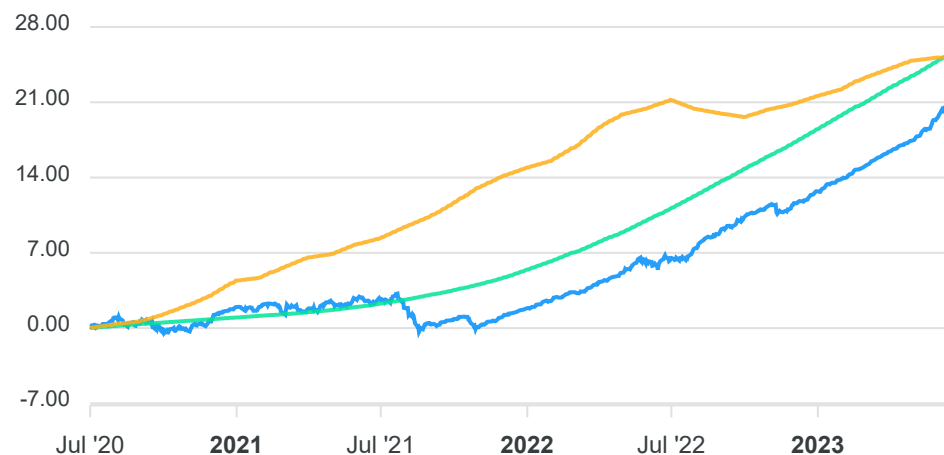
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA
MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:
10.948.555/0001-13.

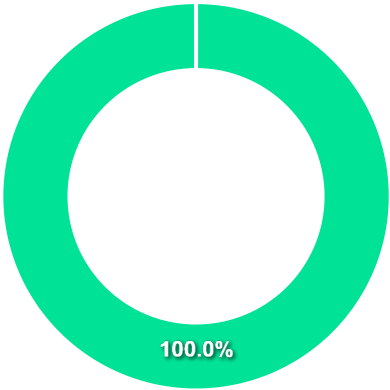
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,10%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	1,89%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA LP	5.462.598,32	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	23,78	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-565,00	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.462.598,32	100.01%
Valores a pagar/receber	-541,23	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
901

Patrimônio Líquido Fundo
5.947.143.642,03

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IDKA IPCA 2 Anos

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a
taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.

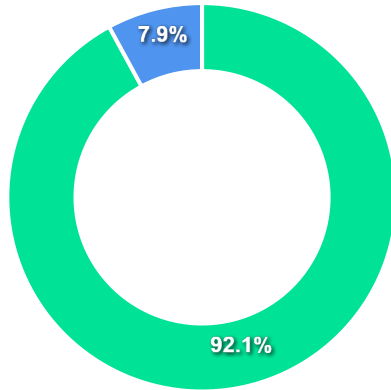
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,04%	6,60%	2,14%	6,60%	9,23%	19,78%	0,83%	1,74%
Benchmark	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	3.610.416,93	63,84	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.521.692,29	26,91	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	448.090,96	7,92	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2029	40.391,56	0,71	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	33.965,98	0,60	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.358,11	0,02	Títulos Federais
Outros Valores a receber	121,71	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	97,94	0,00	Outros
Outras Disponibilidades	10,58	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-348,18	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.207.824,87	92.08%
Operação compromissada	448.090,96	7.92%
Outros	97,94	0.00%
Valores a pagar/receber	-215,88	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
927

Patrimônio Líquido Fundo
8.254.253.931,25

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

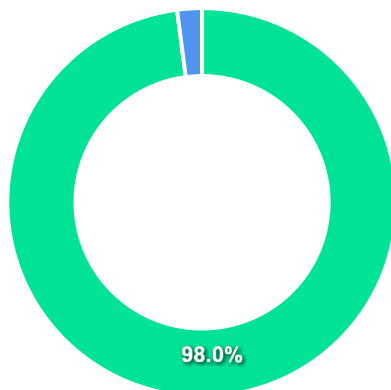
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	7,00%	2,57%	7,00%	10,18%	21,01%	0,88%	1,86%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	2.185.363,97	26,57	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.145.243,82	26,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.469.548,90	17,86	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	1.187.436,25	14,43	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	1.055.400,31	12,83	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2024	168.712,69	2,05	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2026	13.549,83	0,16	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.344,53	0,02	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	120,25	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	23,78	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-483,00	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	8.057.887,61	97.95%
Operação compromissada	168.712,69	2.05%
Valores a pagar/receber	-338,98	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
723

Patrimônio Líquido Fundo
4.240.209.456,14

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B.

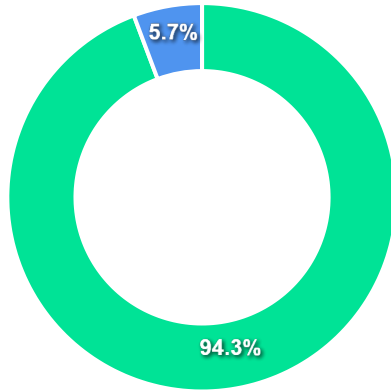
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,35%	11,24%	7,06%	11,24%	13,32%	17,31%	2,12%	4,47%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.636.638,71	94.30%
Operação compromissada	280.313,95	5.70%
Valores a pagar/receber	-254,04	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	661.316,40	13,45	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	580.793,80	11,81	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	411.730,70	8,37	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	394.410,86	8,02	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	359.245,34	7,31	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	356.728,88	7,26	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	353.927,85	7,20	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	335.303,43	6,82	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	321.221,89	6,53	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	303.254,28	6,17	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	280.313,95	5,70	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	272.942,26	5,55	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	130.064,83	2,65	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	117.178,10	2,38	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	37.189,15	0,76	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.330,95	0,03	Títulos Federais
Outros Valores a receber	23,78	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,47	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-288,28	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.186

Patrimônio Líquido Fundo
7.342.301.496,88

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IRF-M 1

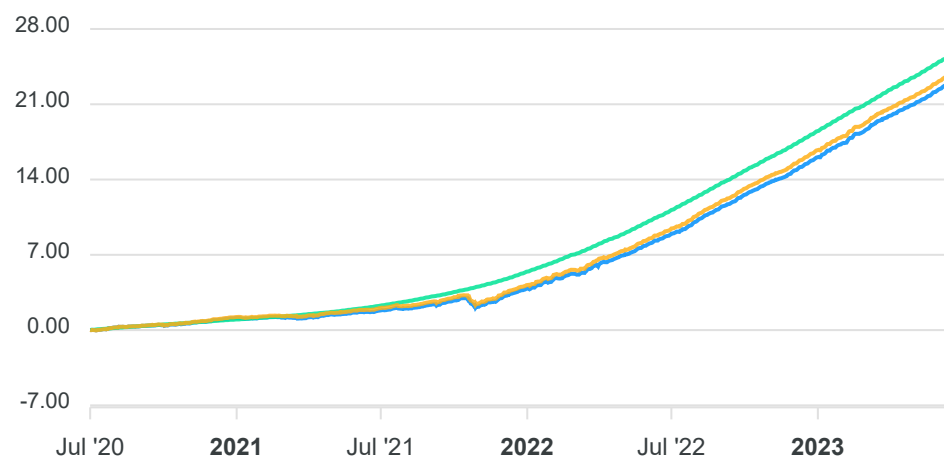
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.

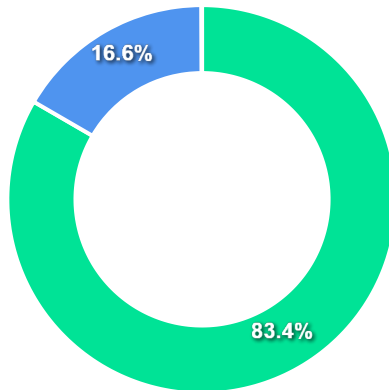
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,59%	3,15%	6,59%	13,58%	21,47%	0,11%	0,22%
Benchmark	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2025	6.178.686,46	83,39	Operação compromissada
LTN - Venc.: 01/01/2024	1.014.720,72	13,70	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2024	130.407,44	1,76	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	81.518,36	1,10	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	3.486,29	0,05	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	955,27	0,01	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24	395,89	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	335,13	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24	188,77	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	12,77	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	0,00	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-451,05	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	6.178.686,46	83.38%
Títulos Federais	1.226.646,52	16.55%
Valores a pagar/receber	3.990,52	0.05%
Derivativos	919,79	0.01%
Outros	12,77	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
714

Patrimônio Líquido Fundo
14.603.622.203,04

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
CDI

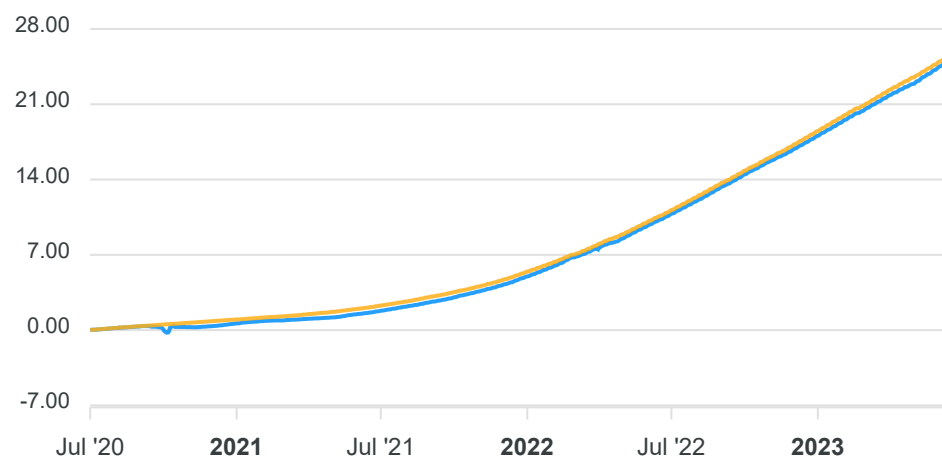
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais, com prazo médio de carteira superior 365 dias.

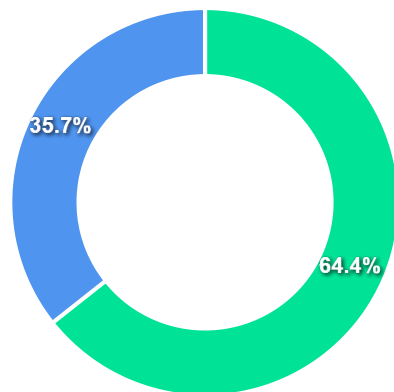
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,13%	6,55%	3,23%	6,55%	13,52%	23,55%	0,04%	0,09%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	8.989.409,46	64.35%
Operação compromissada	4.982.123,76	35.66%
Derivativos	-239,50	-0.00%
Outros	-925,91	-0.01%
Valores a pagar/receber	-1.006,37	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	4.982.123,76	35,66	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2023	2.051.491,01	14,68	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027	1.869.761,57	13,38	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	1.141.839,03	8,17	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	777.435,07	5,56	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024	738.507,29	5,29	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2024	524.245,09	3,75	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026	485.300,44	3,47	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2025	460.405,73	3,30	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028	433.723,61	3,10	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	261.443,42	1,87	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026	127.468,79	0,91	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	74.451,06	0,53	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	43.337,36	0,31	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	937,70	0,01	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	197,31	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN25	50,11	0,00	Derivativos
Outros Valores a receber	24,31	0,00	Valores a pagar/receber
LFT - Venc.: 01/03/2029	0,00	0,00	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF29	-106,02	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF24	-183,59	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas / Bolsa Mercadoria Futu...	-295,61	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições vendidas / Bolsa Mercadoria Futu...	-827,60	-0,01	Outros
Outros Valores a pagar	-1.968,37	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 0,40%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 208

Patrimônio Líquido Fundo
 2.099.537.000,43

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IPCA

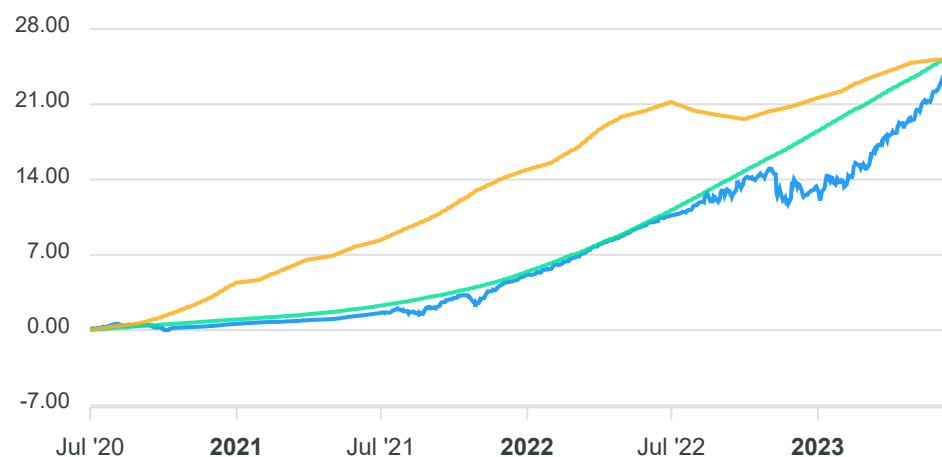
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre

Política de Investimento
 Alocar preponderante em cotas de fundos de investimento de renda fixa atrelados ao IMA e seus sub-índices, podendo alocar também em fundos de investimento de renda fixa que seguem o CDI.

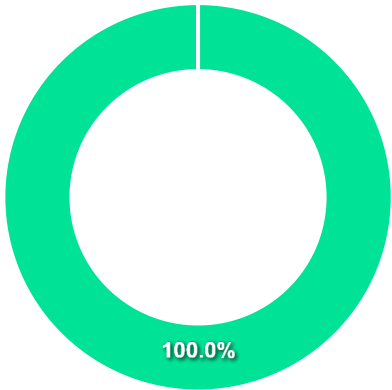
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	2,80%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	2.139.443,57	99,80	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.225,85	0,20	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	754,22	0,04	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-729,60	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.143.669,42	100.00%
Valores a pagar/receber	94,62	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.

Gestão
 SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
 0,40%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 61

Patrimônio Líquido Fundo
 290.613.636,58

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IPCA

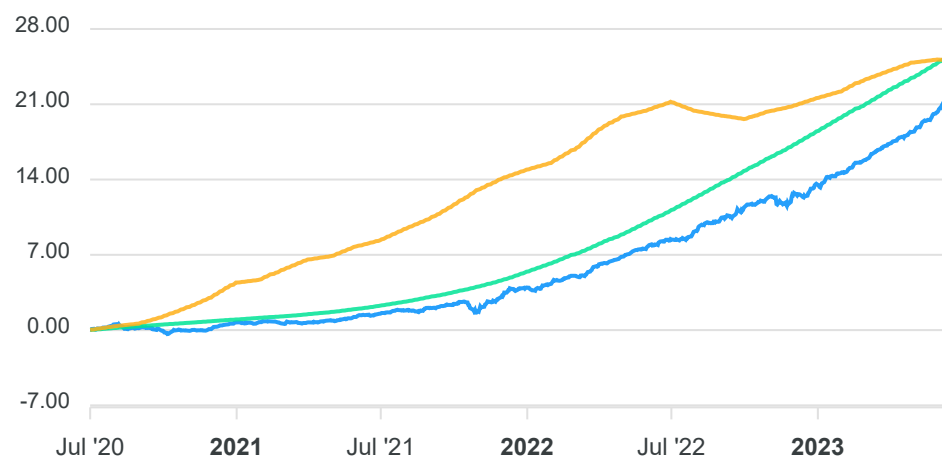
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos que invistam em ativos de renda fixa relacionados à variação das taxas de juros pós ou pré-fixados, de índices de preços, ou ambos, sendo vedada a exposição à moeda estrangeira e renda variável.

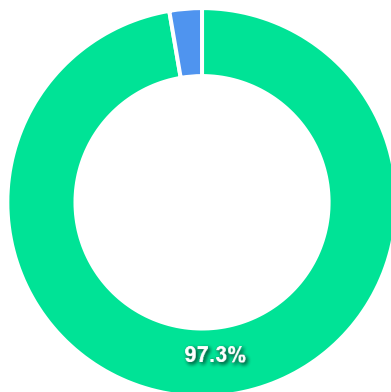
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,78%	7,75%	4,35%	7,75%	12,87%	20,57%	1,06%	2,24%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	173.528,57	53,01	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	110.221,17	33,67	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	34.800,05	10,63	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	8.883,17	2,71	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-68,95	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	318.549,79	97.31%
Valores a pagar/receber	8.819,22	2.69%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADERCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADERCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,40%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+4

Quantidade de Cotistas

148

Patrimônio Líquido Fundo

725.460.751,19

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

IPCA

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

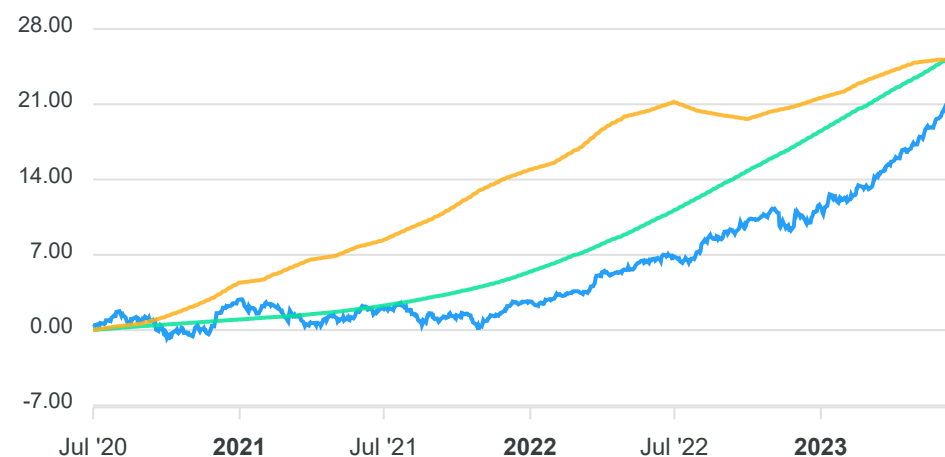
Política de Investimento

Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de renda fixa, os quais atuam nos mercados de juros pré e pós-fixados e índices de preços, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

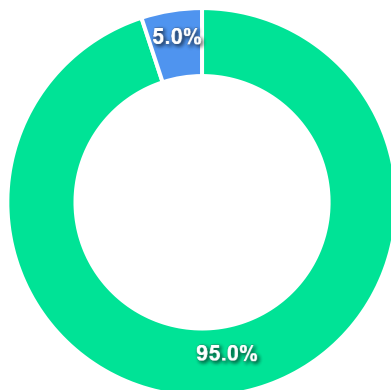
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,01%	9,45%	5,68%	9,45%	14,37%	19,80%	1,19%	2,51%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	261.740,67	36,77	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	181.879,75	25,55	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	142.430,81	20,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	36.121,26	5,07	Valores a pagar/receber
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	35.941,43	5,05	Fundos de Investimento
Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	35.484,41	4,98	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	14.459,90	2,03	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	3.166,96	0,44	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	476,34	0,07	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	464,90	0,07	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-271,67	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	676.045,17	94.96%
Valores a pagar/receber	35.859,59	5.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,15%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+0

Quantidade de Cotistas

683

Patrimônio Líquido Fundo

10.391.025.294,46

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

Selic

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Baixa Soberano

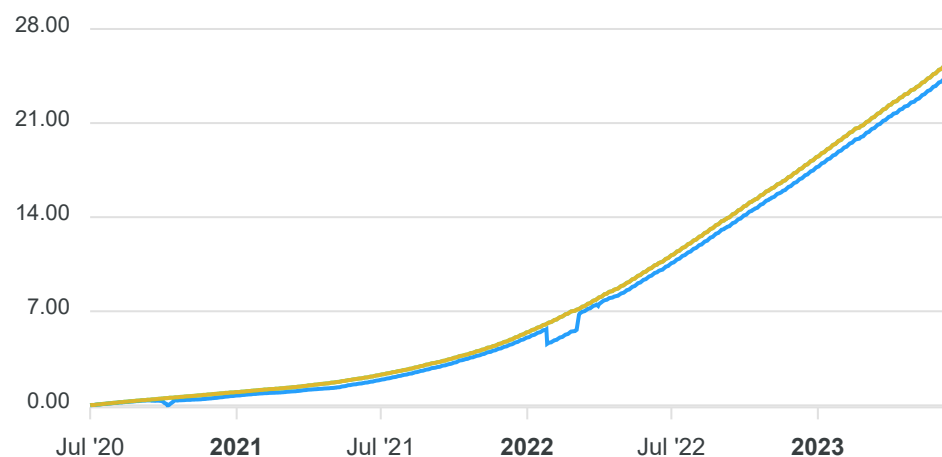
Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em carteira composta de ativos ou modalidades operacionais vinculados a variação do CDI, sendo vedada a exposição em moeda estrangeira e renda variável.

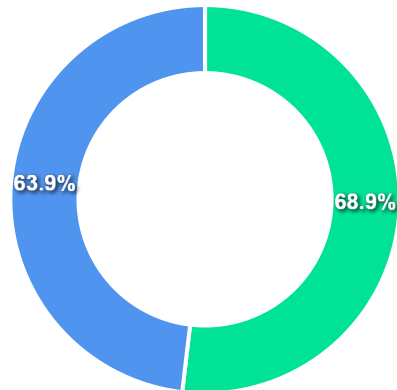
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,07%	6,38%	3,09%	6,38%	13,28%	22,89%	0,01%	0,02%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	7.078.613,14	68.88%
Títulos Federais	6.567.095,98	63.91%
Valores a pagar/receber	-3.369.454,43	-32.79%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	3.550.185,17	34,55	Operação compromissada
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2027	1.976.131,10	19,23	Operação compromissada
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	1.552.296,88	15,11	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2026	1.378.425,82	13,41	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024	1.282.697,73	12,48	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2024	1.105.023,21	10,75	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.000.113,77	9,73	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027	626.761,41	6,10	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	566.800,32	5,52	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	444.484,59	4,33	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	160.732,25	1,56	Valores a pagar/receber
LFT - Venc.: 01/09/2026	86.718,91	0,84	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	76.070,21	0,74	Títulos Federais
Outros Valores a receber	23,92	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-3.530.210,61	-34,35	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,20%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+1

Quantidade de Cotistas

37

Patrimônio Líquido Fundo

138.362.302,85

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

IMA-B 5+

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

Política de Investimento

Investe seus recursos em cotas de fundo de investimento, nos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

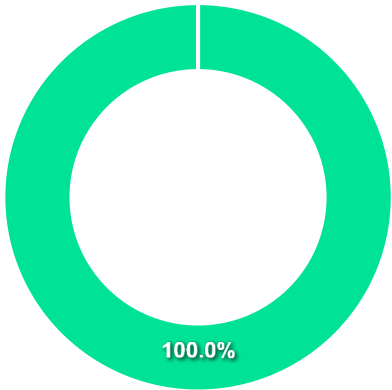
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,35%	14,75%	10,82%	14,75%	16,02%	12,69%	3,20%	6,74%
Benchmark	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	142.875,51	100,01	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	10,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	8,50	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-39,30	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	142.875,51	100.01%
Valores a pagar/receber	-20,80	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 228

Patrimônio Líquido Fundo
 1.330.366.206,19

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
 IMA-B

Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

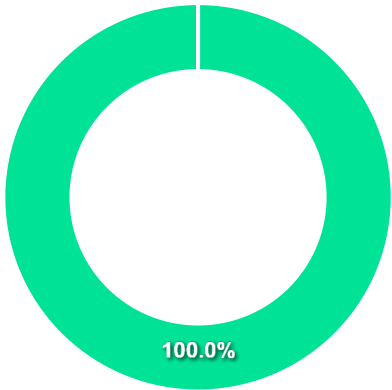
Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 dias.

COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,29%	7,16%	11,29%	13,23%	17,19%	2,15%	4,54%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	1.359.682,85	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	23,78	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-87,68	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.359.682,85	100.00%
Valores a pagar/receber	-63,90	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
470
Patrimônio Líquido Fundo
3.021.387.375,69

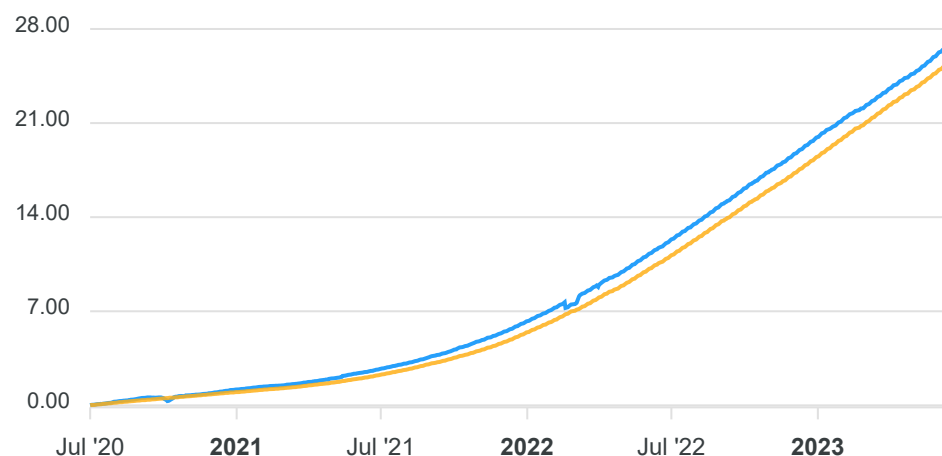
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
CDI
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa e cotas de fundos de índice de renda fixa.

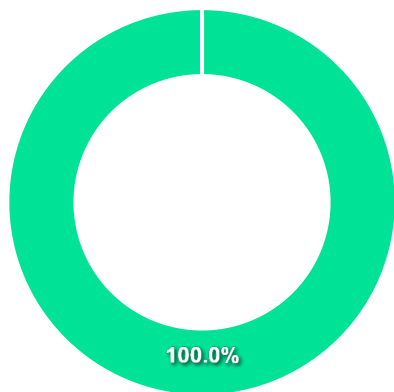
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,15%	6,37%	3,26%	6,37%	13,60%	24,20%	0,02%	0,05%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	2.861.734,47	99,13	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER DI INSTITUCIONAL EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	25.649,98	0,89	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	43,45	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-488,56	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.887.384,45	100.02%
Valores a pagar/receber	-440,11	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4

Quantidade de Cotistas
 1.354

Patrimônio Líquido Fundo
 810.368.157,20

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Sustentabilidade/Governança

Política de Investimento
 Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

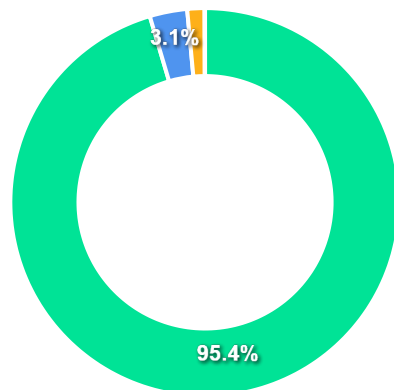
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,88%	6,51%	15,45%	6,51%	17,05%	-11,63%	7,60%	16,00%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	778.131,17	95.42%
Operação compromissada	25.389,76	3.11%
Valores a pagar/receber	11.505,27	1.41%
Derivativos	437,83	0.05%
Outros	34,61	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	89.006,22	10,91	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	48.298,28	5,92	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	46.739,31	5,73	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	43.839,71	5,38	Ações
B3 ON NM - B3SA3	29.597,17	3,63	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	26.436,60	3,24	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	25.389,76	3,11	Operação compromissada
BRASIL ON NM - BBAS3	22.619,57	2,77	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	20.209,05	2,48	Ações
WEG ON NM - WEGE3	20.019,08	2,45	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	19.130,81	2,35	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	17.255,88	2,12	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	15.796,07	1,94	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	11.650,05	1,43	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	9.167,88	1,12	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	8.434,48	1,03	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	8.253,01	1,01	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	7.914,38	0,97	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	7.613,35	0,93	Ações
JBS ON NM - JBSS3	7.245,32	0,89	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PRIO3	7.203,03	0,88	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	7.172,26	0,88	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RDOR3	7.041,64	0,86	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BPAC11	6.995,86	0,86	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	6.909,49	0,85	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	6.678,35	0,82	Ações
GRUPO NATURAON NM - NTCO3	6.558,93	0,80	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,50%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+3

Quantidade de Cotistas

47

Patrimônio Líquido Fundo

324.216.474,05

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 8º, Inciso I

Benchmark

Ibovespa

Classificação ANBIMA

Ações Indexados

Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações, bônus ou recibos de subscrição, Certificados de Depósito de Ações e BDR Nível II e III.

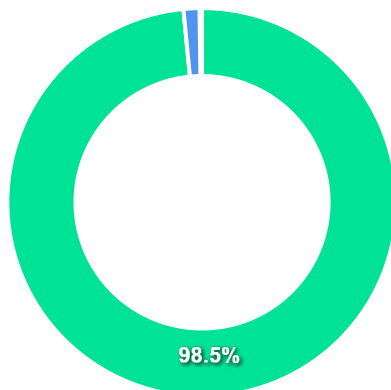
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	9,05%	7,69%	15,96%	7,69%	19,95%	-6,93%	7,50%	15,80%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	292.151,06	98.48%
Valores a pagar/receber	3.905,82	1.32%
Operação compromissada	555,52	0.19%
Derivativos	62,44	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	37.676,64	12,70	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	14.390,37	4,85	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	11.607,73	3,91	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	10.268,96	3,46	Ações
B3 ON NM - B3SA3	10.201,51	3,44	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	8.578,82	2,89	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	7.919,89	2,67	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	7.574,28	2,55	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	6.511,00	2,19	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	6.482,62	2,19	Ações
WEG ON NM - WEGE3	6.123,73	2,06	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	5.732,13	1,93	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ABEV3	5.366,21	1,81	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	5.303,23	1,79	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBAS3	5.221,68	1,76	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	4.512,43	1,52	Ações
Outros Valores a receber	4.352,06	1,47	Valores a pagar/receber
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.269,88	1,44	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	4.189,25	1,41	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	3.593,97	1,21	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RDOR3	3.197,34	1,08	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	3.133,89	1,06	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SUZB3	2.743,84	0,92	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	2.717,53	0,92	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	2.648,47	0,89	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	2.624,09	0,88	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - GGBR4	2.620,04	0,88	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
 LTDA

Gestão
 BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração
 1,50%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4

Quantidade de Cotistas
 145

Patrimônio Líquido Fundo
 468.779.708,09

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Índice Ativo

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 67% dos seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações, cotas de Fundos de ações e cotas dos Fundos de índice de ações. O fundo não pode conter mais de 20 empresas emissoras de ações.

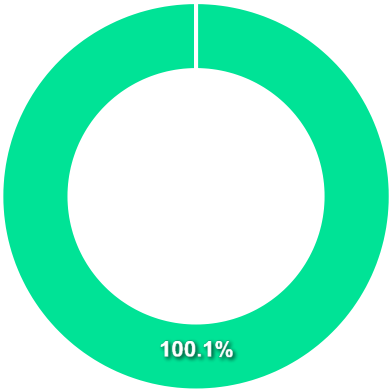
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,01%	5,57%	14,39%	5,57%	19,10%	-11,84%	6,95%	14,63%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL FI AÇÕES	484.415,38	100,12	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	19,40	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-624,09	-0,13	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	484.415,38	100.12%
Valores a pagar/receber	-594,69	-0.12%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM

Gestão
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
3,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4 ou D+33

Quantidade de Cotistas
2.523

Patrimônio Líquido Fundo
1.451.994.845,07

Patrimônio Líquido Master
1.452.015.178,41

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, preponderantemente, em cotas do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 17.009.959/0001-90.

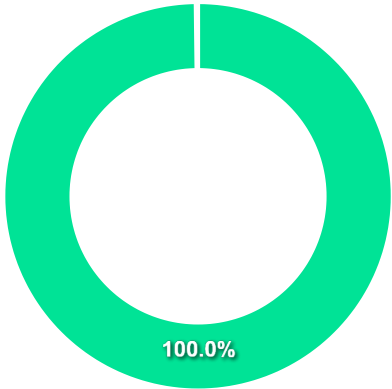
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	9,39%	6,66%	15,10%	6,66%	17,15%	-33,62%	7,85%	16,54%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FIAÇÃOE...	1.267.736,60	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	3.901,13	0,31	Valores a pagar/receber
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	2.426,42	0,19	Operação compromissada
Outros Valores a pagar	-6.327,18	-0,50	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.267.736,60	100.00%
Operação compromissada	2.426,42	0.19%
Valores a pagar/receber	-2.426,05	-0.19%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 1,50%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+25

Quantidade de Cotistas
 1.074

Patrimônio Líquido Fundo
 653.548.043,56

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

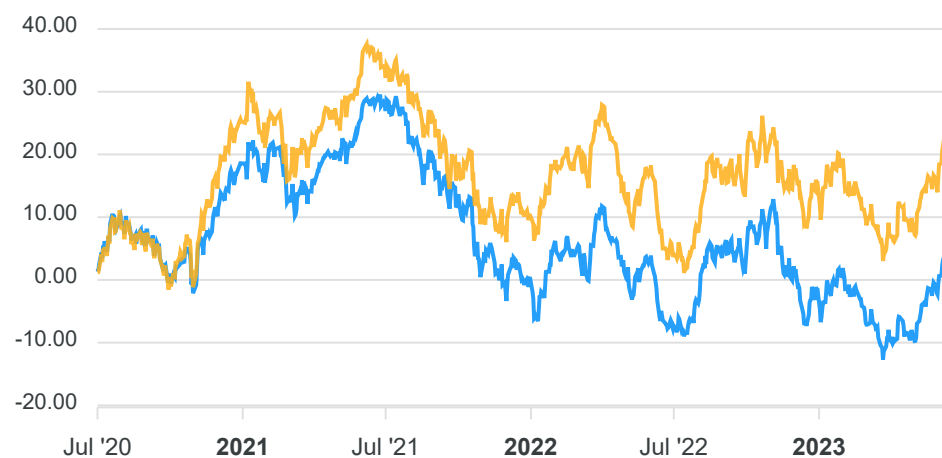
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de ações geridos por gestores distintos.

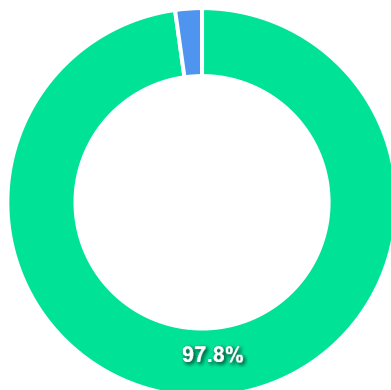
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,89%	8,06%	17,13%	8,06%	15,45%	-16,81%	7,53%	15,87%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	670.626,37	97.79%
Valores a pagar/receber	15.190,78	2.21%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	60.013,61	8,89	Fundos de Investimento
Cotas de OCEANA SELECTION 30 E FIC AÇÕES	59.511,04	8,82	Fundos de Investimento
Cotas de NAVI INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	58.471,01	8,66	Fundos de Investimento
Cotas de CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	58.446,98	8,66	Fundos de Investimento
Cotas de VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	57.441,23	8,51	Fundos de Investimento
Cotas de SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI AÇÕES	54.861,65	8,13	Fundos de Investimento
Cotas de TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	51.755,01	7,67	Fundos de Investimento
Cotas de MILES CAIXA VIRTUS FIC AÇÕES	45.238,99	6,70	Fundos de Investimento
Cotas de TRUXT C VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	43.788,10	6,49	Fundos de Investimento
Cotas de APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	41.054,14	6,08	Fundos de Investimento
Cotas de OCCAM FIC AÇÕES	33.209,36	4,92	Fundos de Investimento
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	25.823,05	3,83	Fundos de Investimento
Cotas de BRASIL CAPITAL 30 FIC AÇÕES	21.380,72	3,17	Fundos de Investimento
Cotas de LEBLON AÇÕES II INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	17.890,26	2,65	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	16.292,67	2,41	Valores a pagar/receber
Cotas de EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	16.287,94	2,41	Fundos de Investimento
Cotas de MOAT CAIXA AÇÕES FIC AÇÕES	15.461,32	2,29	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	9.991,96	1,48	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.101,89	-0,16	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
2.279

Patrimônio Líquido Fundo
234.456.759,31

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
IDIV

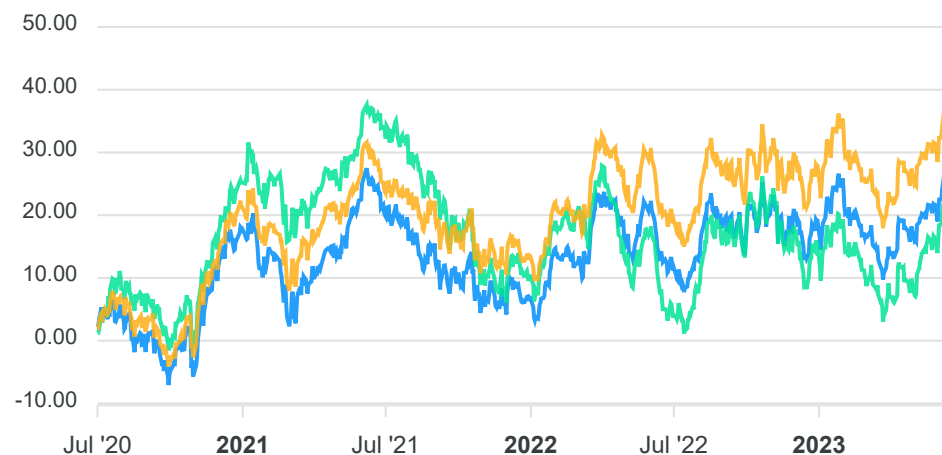
Classificação ANBIMA
Ações Dividendos

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ações de empresas que possuam a política e/ou potencial de distribuição de dividendos e/ou juros sobre o capital.

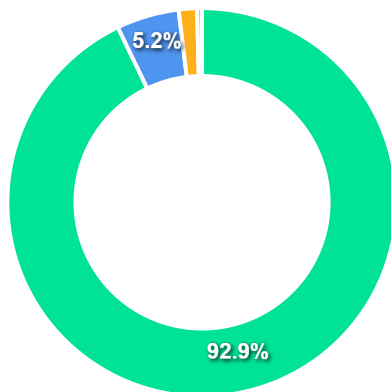
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,54%	8,46%	13,30%	8,46%	16,15%	7,61%	7,31%	15,40%
Benchmark	8,78%	9,30%	13,95%	9,30%	17,73%	12,91%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	221.974,56	92.88%
Outros	12.417,65	5.20%
Valores a pagar/receber	3.619,47	1.51%
Fundos de Investimento	976,26	0.41%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
GERDAU PN N1 - GGBR4	17.736,47	7,42	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	12.717,77	5,32	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	12.267,04	5,13	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	11.544,16	4,83	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	10.654,81	4,46	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	10.347,17	4,33	Ações
TELEF BRASIL ON - VIVT3	10.228,52	4,28	Ações
VALE ON N1 - VALE3	10.125,02	4,24	Ações
JBS ON NM - JBSS3	9.728,04	4,07	Ações
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	7.863,83	3,29	Ações
B3 ON NM - B3SA3	7.542,38	3,16	Ações
SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	7.362,77	3,08	Ações
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	7.346,93	3,07	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	7.262,75	3,04	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7.187,76	3,01	Ações
Ações / Ações - VBBR3 / CNPJ do emissor: 34.274.233/0001-0...	7.187,75	3,01	Outros
ITAUSA PN N1 - ITSA4	6.975,51	2,92	Ações
TAESA UNT N2 - TAEE11	6.228,00	2,61	Ações
SID NACIONAL ON - CSNA3	6.226,62	2,61	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	5.316,91	2,22	Ações
CEMIG ON N1 - CMIG3	5.266,81	2,20	Ações
BRADESPAR PN N1 - BRAP4	4.669,01	1,95	Ações
PORTO SEGURO ON NM - PSSA3	4.074,05	1,70	Ações
Outros Valores a receber	3.986,37	1,67	Valores a pagar/receber
Ações / Ações - CMIN3 / CNPJ do emissor: 08.902.291/0001-1...	3.903,10	1,63	Outros
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	3.358,69	1,41	Ações
COPASA ON NM - CSMG3	3.019,81	1,26	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
 LTDA

Gestão
 CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+15

Quantidade de Cotistas
 2.815

Patrimônio Líquido Fundo
 1.312.877.349,58

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

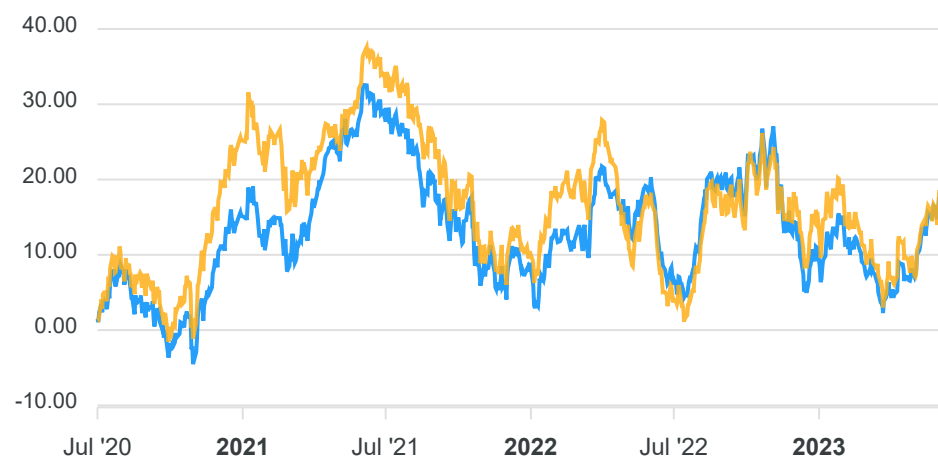
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de renda variável, podendo aproveitar oportunidades disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento.

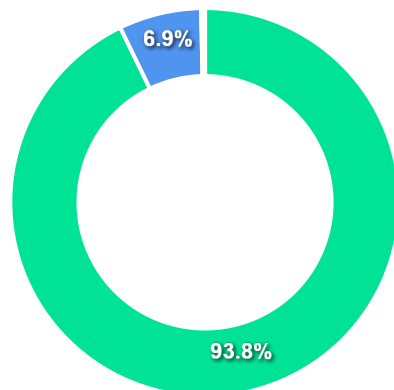
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,16%	11,84%	18,12%	11,84%	17,01%	-3,57%	7,14%	15,03%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	1.027.251,74	93.84%
Operação compromissada	75.801,73	6.92%
Derivativos	2.255,23	0.21%
Títulos Federais	1.314,45	0.12%
Outros	-296,24	-0.03%
Valores a pagar/receber	-11.689,70	-1.07%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2024	75.801,73	6,92	Operação compromissada
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	39.210,97	3,58	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	32.421,98	2,96	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	26.209,41	2,39	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	25.765,50	2,35	Ações
WEG ON NM - WEGE3	25.084,84	2,29	Ações
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	24.315,04	2,22	Ações
SANEPAR UNT N2 - SAPR11	23.748,37	2,17	Ações
COPASA ON NM - CSMG3	22.575,78	2,06	Ações
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	22.433,74	2,05	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	21.824,59	1,99	Ações
VALE ON N1 - VALE3	21.226,59	1,94	Ações
AUREN ON NM - AURE3	20.402,72	1,86	Ações
NEOENERGIA ON ATZ NM - NEOE3	19.496,36	1,78	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	19.302,06	1,76	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	18.276,17	1,67	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	18.169,01	1,66	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	18.005,78	1,64	Ações
CELUL IRANI ON - RANI3	17.656,94	1,61	Ações
PORTO SEGURO ON NM - PSSA3	17.530,44	1,60	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TIMS3	16.176,23	1,48	Ações
MARCOPOLO PN N2 - POMO4	15.997,40	1,46	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MULT3	15.527,18	1,42	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VIVT3	15.218,84	1,39	Ações
Outros Valores a receber	14.599,16	1,33	Valores a pagar/receber
KLABIN S.A. UNT N2 - KLBN11	13.874,99	1,27	Ações
GPS ON NM - GGPS3	13.342,13	1,22	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 1,90%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+24

Quantidade de Cotistas
 17.026

Patrimônio Líquido Fundo
 1.502.509.907,38

Patrimônio Líquido Master
 1.826.911.890,36

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

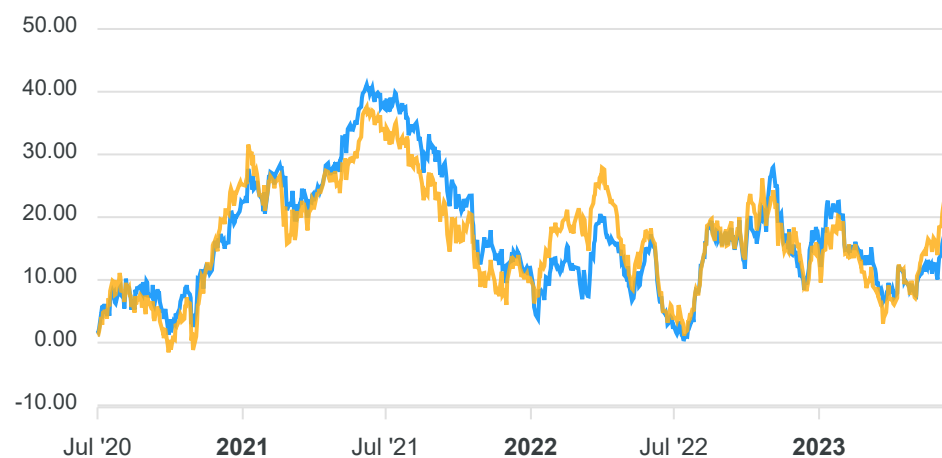
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ
 DUNAMIS MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 18.138.837/0001-67.

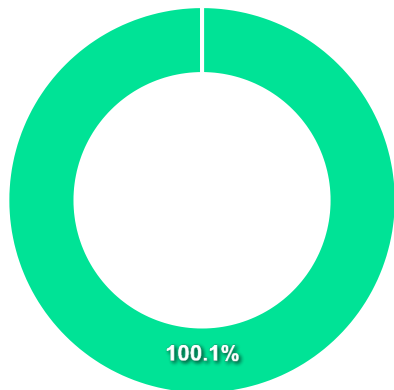
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,27%	-1,57%	7,34%	-1,57%	13,35%	-15,61%	7,12%	14,99%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES	1.513.267,20	99,82	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	3.876,61	0,26	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	2.854,50	0,19	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-4.058,29	-0,27	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.517.143,81	100.07%
Valores a pagar/receber	-1.133,78	-0.07%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,80%

Taxa de Performance
10,00%

Disponibilidade de Resgate
D+24

Quantidade de Cotistas
17

Patrimônio Líquido Fundo
155.764.584,77

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos classificados como Ações, os quais investem em ativos financeiros que tenham como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado.

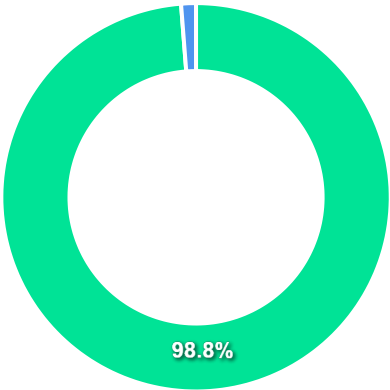
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	7,74%	7,45%	16,13%	7,45%	15,89%	-22,46%	6,90%	14,53%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS MULTIGESTOR X FI...	158.457,76	98,60	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.078,18	1,29	Valores a pagar/receber
Cotas de ITAÚ CAIXA FIAÇÕES	264,72	0,16	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	8,45	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-109,58	-0,07	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	158.722,48	98.77%
Valores a pagar/receber	1.977,04	1.23%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 2,50%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+24

Quantidade de Cotistas
 83

Patrimônio Líquido Fundo
 341.230.820,46

Patrimônio Líquido Master
 423.061.697,41

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ
 PHOENIX FI AÇÕES, CNPJ: 09.094.073/0001-64.

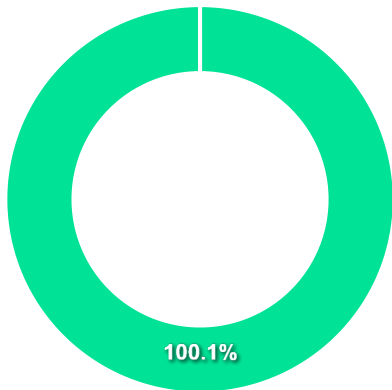
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	7,75%	3,91%	15,52%	3,91%	5,48%	-28,99%	7,86%	16,55%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ PHOENIX FI AÇÕES	346.595,64	99,92	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	782,73	0,23	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	70,00	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	16,91	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-587,11	-0,17	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	347.378,36	100.14%
Valores a pagar/receber	-500,21	-0.14%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
LTDA

Gestão
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS
S.A.

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
3.306

Patrimônio Líquido Fundo
95.268.876,14

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

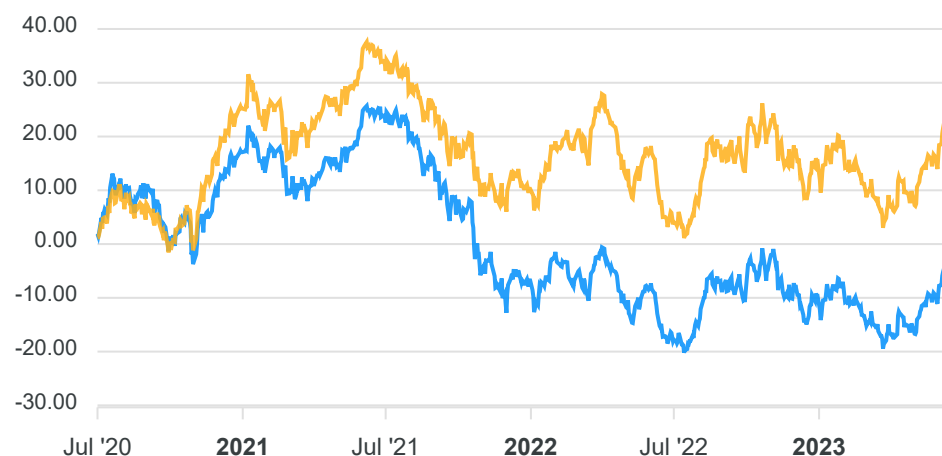
Classificação ANBIMA
Ações Valor/Crescimento

Política de Investimento
Aplica seus recursos no mercado de renda variável, utilizando-se de análise fundamentalista, observando entre outros aspectos, a potencialidade do valor intrínseco das ações selecionadas.

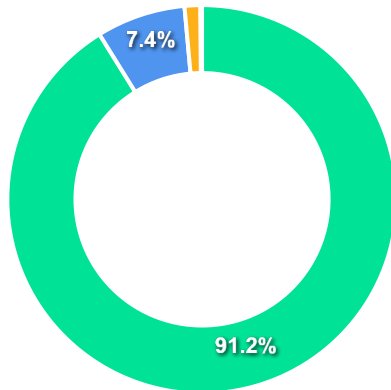
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,63%	6,85%	15,61%	6,85%	17,92%	-21,86%	7,79%	16,40%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	89.030,53	91.16%
Operação compromissada	7.220,80	7.39%
Valores a pagar/receber	1.260,07	1.29%
Derivativos	83,73	0.09%
Outros	65,78	0.07%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	10.078,08	10,32	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2024	7.220,80	7,39	Operação compromissada
ITAUSA PN N1 - ITSA4	4.560,47	4,67	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	4.300,13	4,40	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	4.243,20	4,34	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	3.841,48	3,93	Ações
B3 ON NM - B3SA3	3.562,40	3,65	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	3.377,37	3,46	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	3.239,45	3,32	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	2.948,28	3,02	Ações
WEG ON NM - WEGE3	2.771,49	2,84	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	2.720,14	2,79	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	2.704,91	2,77	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	2.468,80	2,53	Ações
Outros Valores a receber	2.139,85	2,19	Valores a pagar/receber
BTGP BANCO UNT - BPAC11	1.719,03	1,76	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	1.712,07	1,75	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	1.705,57	1,75	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	1.670,56	1,71	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	1.668,00	1,71	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	1.607,76	1,65	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	1.390,69	1,42	Ações
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	1.377,65	1,41	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	1.180,93	1,21	Ações
MARCOPOLO PN N2 - POMO4	981,51	1,01	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	966,21	0,99	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	873,84	0,89	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA

Taxa de Administração

0,70%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+5

Quantidade de Cotistas

45

Patrimônio Líquido Fundo

18.983.582,05

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 9º, Inciso II

Benchmark

MSCI WORLD

Classificação ANBIMA

Ações Investimento no Exterior

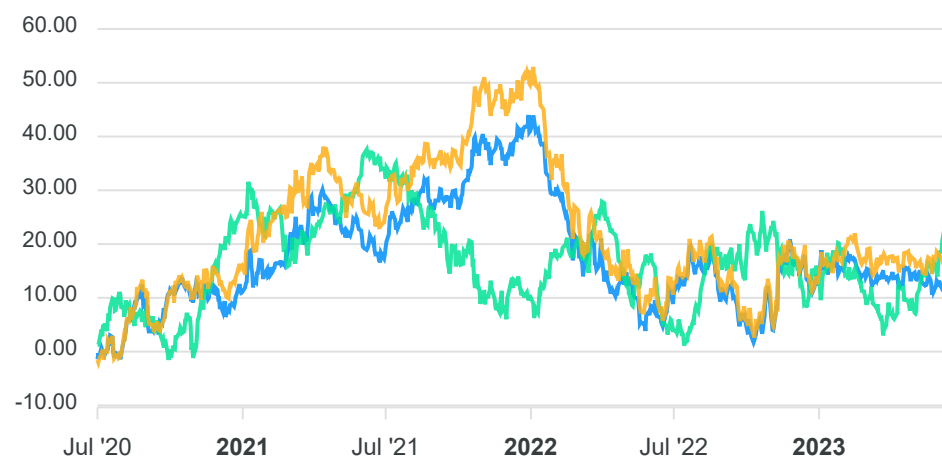
Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 90% de seus recursos em cotas do BNP PARIBAS GLOBAL LOW VOL EQUITY I CAP (LU0823418115), domiciliado em Luxemburgo.

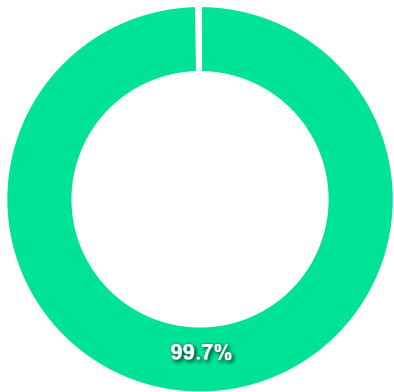
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,19%	-2,72%	-2,72%	-2,72%	1,52%	-6,45%	5,99%	12,61%
Benchmark	0,18%	5,28%	0,82%	5,28%	7,20%	-5,27%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de PARVEST EQUITY WORLD LOW VOLATILITY I USD CAP	18.851,37	98,82	Fundos de Investimento
Cotas de BNP PARIBAS MASTER CASH FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	177,00	0,93	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	173,07	0,91	Valores a pagar/receber
LFT - Venc.: 01/09/2027	40,53	0,21	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	12,30	0,06	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-177,74	-0,93	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	19.028,37	99.75%
Títulos Federais	40,53	0.21%
Valores a pagar/receber	7,64	0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA

Taxa de Administração
0,80%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+5

Quantidade de Cotistas
8.888

Patrimônio Líquido Fundo
652.308.818,52

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso II

Benchmark
MSCI WORLD

Classificação ANBIMA
Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do MS
GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY MASTER
INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ:
33.362.028/0001-28.

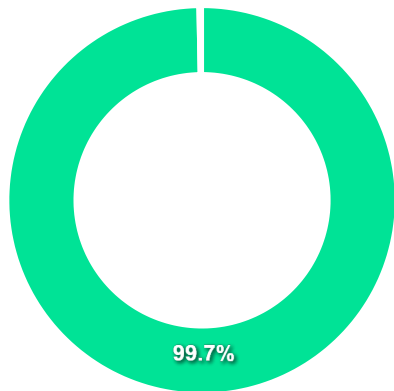
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,56%	21,72%	5,61%	21,72%	25,89%	-30,09%	7,68%	16,17%
Benchmark	0,18%	5,28%	0,82%	5,28%	7,20%	-5,27%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY MASTER INV...	624.367,86	99,62	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	4.454,49	0,71	Valores a pagar/receber
Cotas de XP CASH B1 FIC RENDA FIXA SIMPLES	530,56	0,08	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	3,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-2.581,21	-0,41	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	624.898,42	99.70%
Valores a pagar/receber	1.876,28	0.30%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
LTDA

Gestão
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA.

Taxa de Administração
0,85%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4 du

Quantidade de Cotistas
212

Patrimônio Líquido Fundo
288.636.067,89

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso II

Benchmark
MSCI ACWI

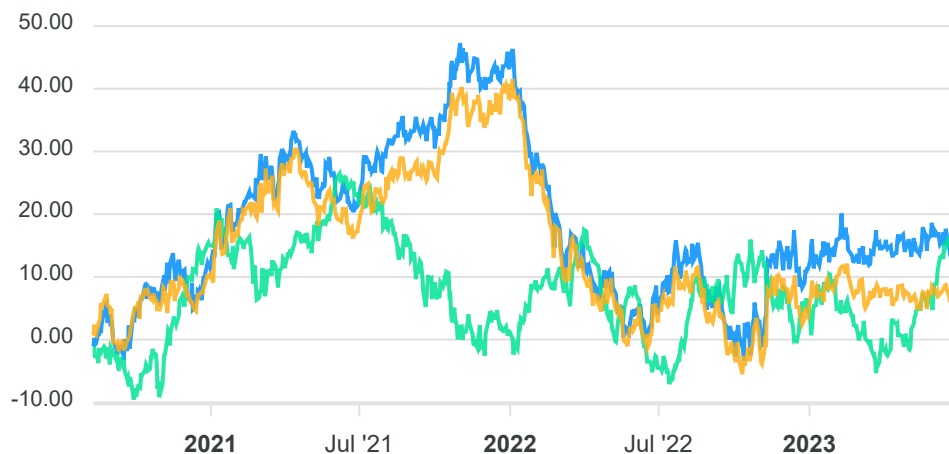
Classificação ANBIMA
Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS
INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ:
37.308.317/0001-08.

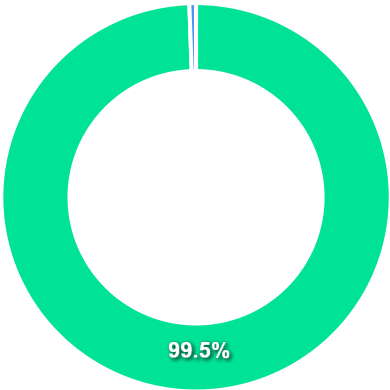
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,57%	2,86%	-0,13%	2,86%	10,03%	-6,01%	8,25%	17,37%
Benchmark	-0,09%	4,18%	0,15%	4,18%	5,27%	-8,63%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD IS IN...	292.330,13	99,52	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	1.612,66	0,55	Operação compromissada
Outros Valores a receber	12,76	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-211,13	-0,07	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	292.330,13	99.52%
Operação compromissada	1.612,66	0.55%
Valores a pagar/receber	-198,28	-0.07%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,70%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
491

Patrimônio Líquido Fundo
2.036.420.590,68

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
Global BDRX

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.

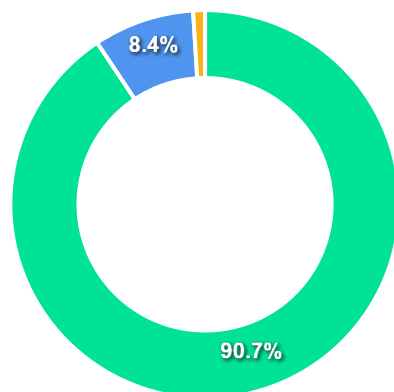
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	13,89%
Benchmark	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depositary Receipts	1.874.220,61	90.70%
Outros	172.990,43	8.37%
Fundos de Investimento	20.284,51	0.98%
Valores a pagar/receber	-1.068,24	-0.05%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
APPLE INC - AAPL34	243.447,26	11,78	Brazilian Depositary Rece...
MICROSOFT CORPORATIO - MSFT34	195.520,06	9,46	Brazilian Depositary Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	107.093,00	5,18	Brazilian Depositary Rece...
NVIDIA COR - NVDC34	90.311,07	4,37	Brazilian Depositary Rece...
TESLA, INC - TSLA34	66.039,22	3,20	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL35	61.693,45	2,99	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	61.575,39	2,98	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR / Ações - M1TA34 / CNPJ...	55.214,39	2,67	Outros
GENERAL MOTORS COMPANY - GMCO34	53.532,47	2,59	Brazilian Depositary Rece...
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD - TSMC34	40.496,64	1,96	Brazilian Depositary Rece...
UNITEDHEALTH GROUP INC - UNHH34	37.070,22	1,79	Brazilian Depositary Rece...
JPMORGAN CHASE & CO - JPMC34	36.546,56	1,77	Brazilian Depositary Rece...
EXXON MOBIL CORPORATIO - EXXO34	34.153,49	1,65	Brazilian Depositary Rece...
ELI LILLY AND COMPAN - LILY34	33.926,28	1,64	Brazilian Depositary Rece...
WALMART INC - WALM34	33.756,06	1,63	Brazilian Depositary Rece...
BROADCOM INC - AVGO34	29.518,30	1,43	Brazilian Depositary Rece...
MASTERCARD INCORPORATE - MSCD34	29.382,26	1,42	Brazilian Depositary Rece...
PROCTER & GAMBLE COMPANY - PGCO34	28.988,72	1,40	Brazilian Depositary Rece...
THE HOME DEPOT, INC - HOME34	26.493,04	1,28	Brazilian Depositary Rece...
ORACLE CORPORATION - ORCL34	24.883,91	1,20	Brazilian Depositary Rece...
CHEVRON CORPORATIO - CHVX34	24.609,03	1,19	Brazilian Depositary Rece...
TOYOTA MOTOR CORP - TMCO34	21.664,59	1,05	Brazilian Depositary Rece...
MERCK & CO, INC - MRCK34	21.456,08	1,04	Brazilian Depositary Rece...
THE COCA-COLA COMPAN - COCA34	21.160,39	1,02	Brazilian Depositary Rece...
ALIBABA GROUP HOLDING LT - BABA34	21.130,13	1,02	Brazilian Depositary Rece...
ABBVIE INC - ABBV34	20.921,90	1,01	Brazilian Depositary Rece...
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIA...	20.284,51	0,98	Fundos de Investimento

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 1,90%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+3

Quantidade de Cotistas
 2.070

Patrimônio Líquido Fundo
 99.945.010,60

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
 Global BDRX

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento em ações, os quais investem em certificados de ações (BDRs, classificados como Nível I, II ou III) de empresas norte-americanas ou listadas nas bolsas americanas, negociadas no mercado local.

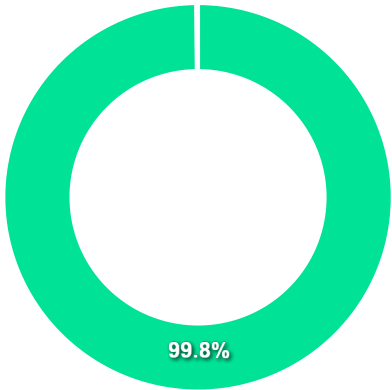
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,11%	-0,68%	1,94%	-0,68%	1,21%	-0,16%	5,44%	11,46%
Benchmark	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ FI AÇÕES BDR NÍVEL I	97.437,56	99,32	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	511,69	0,52	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	333,75	0,34	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	30,00	0,03	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-206,94	-0,21	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	97.949,24	99.84%
Valores a pagar/receber	156,82	0.16%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
5.716

Patrimônio Líquido Fundo
1.566.821.792,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
CDI

Classificação ANBIMA
Multimercados Macro

Política de Investimento
Aplica em fundos que invistam em carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, nacional e internacional, com prazo médio superior a 365 dias.

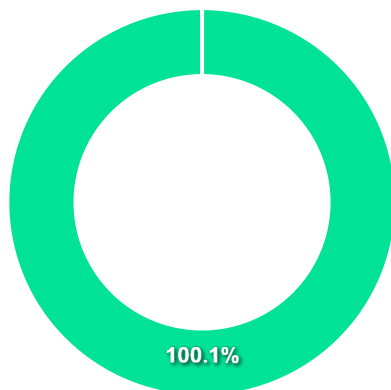
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,81%	6,66%	4,42%	6,66%	13,77%	16,42%	1,11%	2,34%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER HEDGE II FI MULTIMERCADO LP	352.126,24	22,33	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	292.972,58	18,58	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	291.403,01	18,48	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	254.214,33	16,12	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER HEDGE FI MULTIMERCADO LP	192.983,31	12,24	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	155.265,09	9,85	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	39.218,72	2,49	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	23,78	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.159,65	-0,07	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.578.183,29	100.07%
Valores a pagar/receber	-1.135,88	-0.07%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 1,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 6.968

Patrimônio Líquido Fundo
 1.596.861.875,61

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
 MSCI ACWI

Classificação ANBIMA
 Multimercados Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos nos mercados de renda fixa e renda variável, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial. No mercado de renda variável, realizará operações de derivativos envolvendo contratos futuros de S&P500.

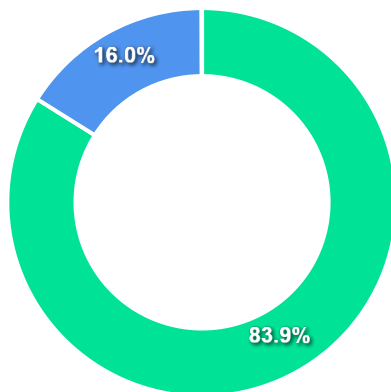
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	7,00%	20,17%	10,43%	20,17%	28,33%	20,97%	5,04%	10,62%
Benchmark	-0,09%	4,18%	0,15%	4,18%	5,27%	-8,63%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.389.925,98	83.93%
Operação compromissada	265.406,70	16.03%
Outros	979,03	0.06%
Valores a pagar/receber	-280,45	-0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
LFT - Venc.: 01/09/2027	432.325,44	26,12	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	405.817,42	24,52	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027	326.784,26	19,74	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	265.406,70	16,04	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2026	119.196,88	7,20	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	38.434,57	2,32	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028	29.693,23	1,79	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024	18.884,18	1,14	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2024	17.146,05	1,04	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	1.643,95	0,10	Títulos Federais
Outros Valores a receber	1.002,81	0,06	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	979,03	0,06	Outros
Outras Disponibilidades	10,63	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.293,89	-0,08	Valores a pagar/receber

