

# Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			35.855.096,74	19,29%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	Não há	4.004.342,54	2,15%	233	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.125.178,35	1,68%	185	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.533.887,55	0,83%	370	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	2.497.263,53	1,34%	165	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	2027-05-16	711.901,64	0,38%	83	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	15.964.678,99	8,59%	107	1,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	478.667,60	0,26%	775	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.232.559,23	2,81%	921	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.000.000,00	3,23%	37	3,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.640.585,67	7,88%	934	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	10.000.000,00	5,38%	232	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.099.897,93	1,13%	1.189	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	13.924,70	0,01%	202	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.284.631,70	2,84%	714	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	842.378,21	0,45%	19	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	368.806,87	0,20%	111	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	44.844,27	0,02%	1.116	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.175.097,64	3,32%	357	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RENDA FIXA REFERENC...	D+0	Não há	744.319,26	0,40%	4.081	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

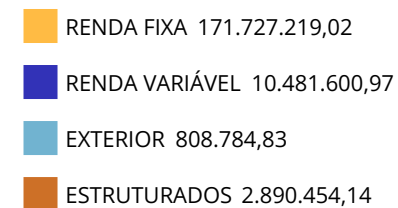
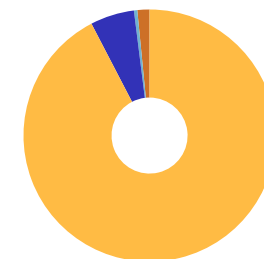
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	5.391.718,86	2,90%	234	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	36.954,28	0,02%	347	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	36.726.261,14	19,76%	1.003	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.939,82	0,00%	377	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	593.719,52	0,32%	90	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	571.932,05	0,31%	467	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	357.095,54	0,19%	297	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info		3.093.950,40	1,66%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não possui	2.583.784,36	1,39%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info		3.661.944,70	1,97%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SAFRA	S/Info		2.064.125,25	1,11%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info		1.020.730,68	0,55%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.140.262,93	0,61%	2.610	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	7.060.085,34	3,80%	1.097	1,18%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	740.857,40	0,40%	6.687	0,58%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SEGURIDADE FI AÇÕES	D+3 du	45 dias	312.683,05	0,17%	20.798	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	981.554,11	0,53%	17.676	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	246.158,14	0,13%	1.451	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	273.814,16	0,15%	11.912	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	282.193,47	0,15%	494	0,01%	Artigo 9º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	252.777,20	0,14%	412	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	2.081.867,33	1,12%	83	1,99%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	808.586,81	0,43%	7.098	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>185.908.058,96</b>				

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

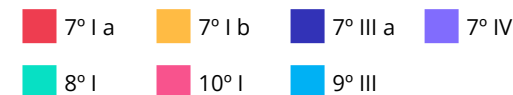
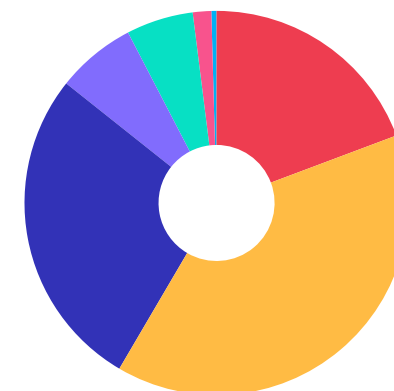
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	35.855.096,74	19,29%	10,00%	15,00%	100,00%	150.052.962,22
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	72.798.704,51	39,16%	10,00%	30,00%	100,00%	113.109.354,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	50.648.882,38	27,24%	10,00%	30,00%	60,00%	60.895.953,00
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	12.424.535,39	6,68%	0,00%	5,00%	20,00%	24.757.076,40
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.295.402,95
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.295.402,95
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>171.727.219,02</b>	<b>92,37%</b>	<b>30,00%</b>	<b>80,00%</b>	<b>290,00%</b>	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10.481.600,97	5,64%	5,00%	10,00%	30,00%	45.290.816,72
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.295.402,95
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.890.454,14	1,55%	0,00%	5,00%	10,00%	15.700.351,76
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.295.402,95
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>13.372.055,11</b>	<b>7,19%</b>	<b>5,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>50,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	9.295.402,95
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.295.402,95
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	808.784,83	0,44%	0,00%	4,00%	10,00%	17.782.021,07
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>808.784,83</b>	<b>0,44%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>20,00%</b>	



Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	113.868.055,14	61,25	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	35.855.096,74	19,29	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.982.066,87	4,83	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	6.175.097,64	3,32	0,00
BANCO BTG PACTUAL	2.583.784,36	1,39	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	2.497.263,53	1,34	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	1.140.262,93	0,61	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	1.095.155,41	0,59	0,00
ITAÚ DTVM	981.554,11	0,53	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	744.319,26	0,40	0,00
ITAÚ UNIBANCO	600.659,34	0,32	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	571.932,05	0,31	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	368.806,87	0,20	0,00
SICREDI	357.095,54	0,19	0,00
OCCAM BRASIL	246.158,14	0,13	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,29%	5,76%	2,60%	7,07%	8,74%	18,79%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	5,50%	2,49%	6,80%	8,35%	18,22%	0,75%	0,03%
<b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>	2,85%	8,54%	6,92%	10,30%	15,84%	14,80%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,84%	8,39%	6,81%	10,10%	15,28%	13,87%	1,26%	0,04%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	4,13%	11,16%	11,29%	9,84%	11,30%	11,03%	-	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2,69%	9,30%	7,72%	9,21%	11,21%	13,01%	1,59%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,99%	10,82%	10,99%	9,45%	10,80%	9,95%	2,29%	0,08%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	1,14%	5,42%	3,26%	6,67%	13,53%	20,82%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	5,37%	3,20%	6,58%	13,30%	20,31%	0,09%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,57%	5,93%	3,02%	6,92%	9,45%	19,90%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	5,91%	3,04%	6,89%	9,41%	19,60%	0,63%	0,02%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,41%	5,03%	2,05%	5,38%	-	-	5,17%	-
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,53%	8,76%	7,39%	8,55%	10,47%	15,54%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,59%	8,67%	7,44%	8,35%	10,36%	14,99%	1,49%	0,04%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,84%	6,04%	7,69%	5,95%	2,61%	3,48%	1,79%	0,06%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,10%	5,27%	3,19%	6,43%	13,21%	21,91%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,36%	3,24%	6,51%	13,40%	22,55%	0,06%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,19%	5,17%	3,24%	6,36%	13,50%	23,20%	0,02%	0,00%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,11%	5,29%	3,20%	6,47%	13,38%	22,33%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	5,23%	3,20%	6,42%	13,65%	23,76%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,13%	5,26%	3,10%	6,61%	13,03%	27,64%	0,23%	0,01%
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	5,29%	3,19%	6,45%	13,32%	22,25%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,97%	4,60%	2,80%	5,61%	11,56%	18,74%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18%	5,25%	3,28%	6,46%	13,49%	22,99%	0,03%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,15%	5,29%	3,24%	6,47%	13,47%	22,81%	0,02%	0,00%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	5,34%	3,26%	6,57%	13,81%	23,57%	0,03%	0,00%

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
LETRA FINANCEIRA SAFRA	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,81%	6,03%	3,94%	7,24%	12,48%	16,41%	0,56%	0,02%
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	4,58%	1,78%	5,96%	7,63%	-	0,51%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	8,18%	5,11%	8,52%	-	-	1,16%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	2,29%	7,36%	5,46%	9,40%	-	-	0,95%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-

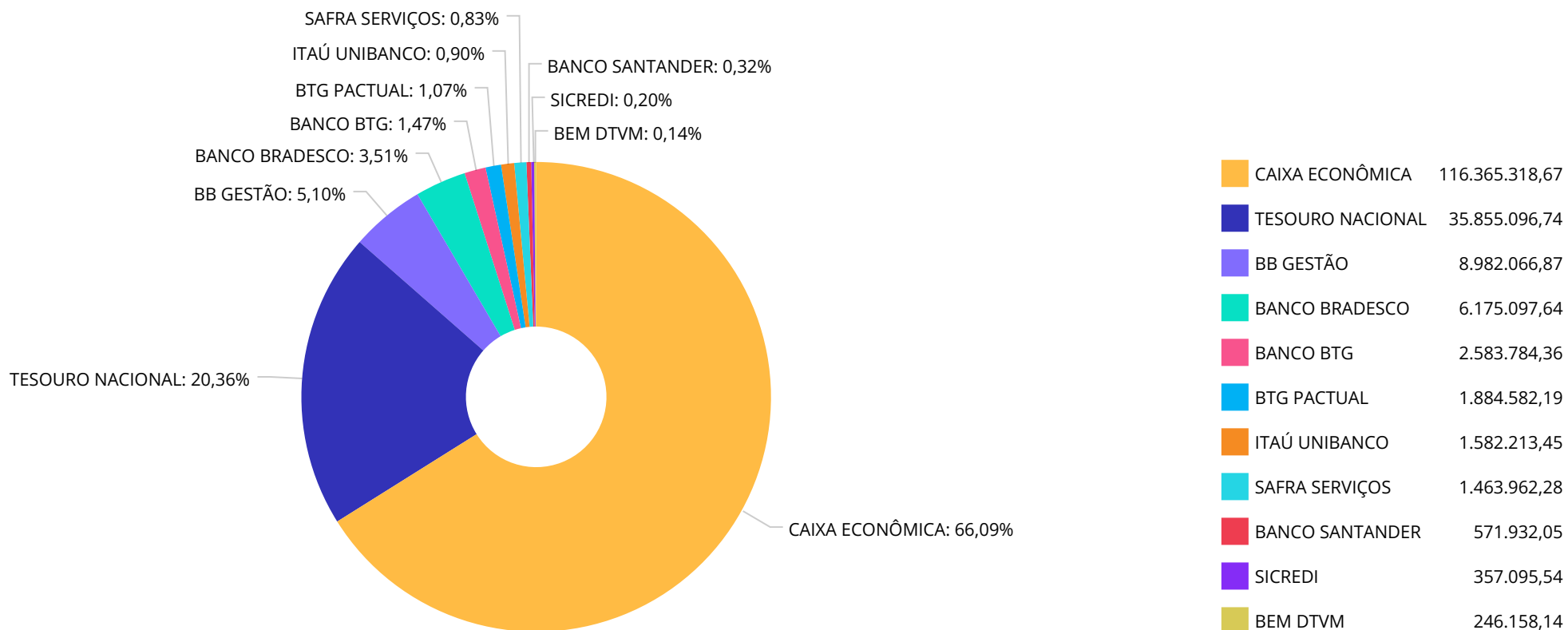
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	5,90%	14,58%	8,54%	9,75%	14,79%	-0,17%	-	-
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	3,74%	-1,28%	3,24%	-3,69%	-2,71%	-14,17%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6,15%	-0,76%	3,02%	-4,39%	-5,09%	-22,33%	7,44%	0,22%
OCCAM FIC AÇÕES	0,44%	-5,07%	-1,26%	-7,60%	-5,85%	-17,65%	7,19%	0,17%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,64%	-6,49%	-2,04%	-4,81%	-4,28%	-20,00%	6,88%	0,22%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,44%	-2,50%	-0,58%	-5,48%	-4,40%	-38,53%	7,65%	0,24%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	11,99%	-1,81%	6,06%	-6,99%	-16,97%	-48,29%	9,27%	0,31%
CAIXA SEGURIDADE FI AÇÕES	8,10%	28,81%	27,06%	33,56%	42,34%	-3,30%	6,82%	0,32%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,48%	1,50%	2,00%	0,48%	-6,59%	-	3,22%	0,07%
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	0,56%	4,28%	0,55%	-1,39%	6,70%	-11,51%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,21%	12,31%	7,30%	6,81%	10,60%	16,12%	6,05%	0,22%
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	2,12%	5,72%	2,36%	-2,22%	7,87%	-6,83%	-	-

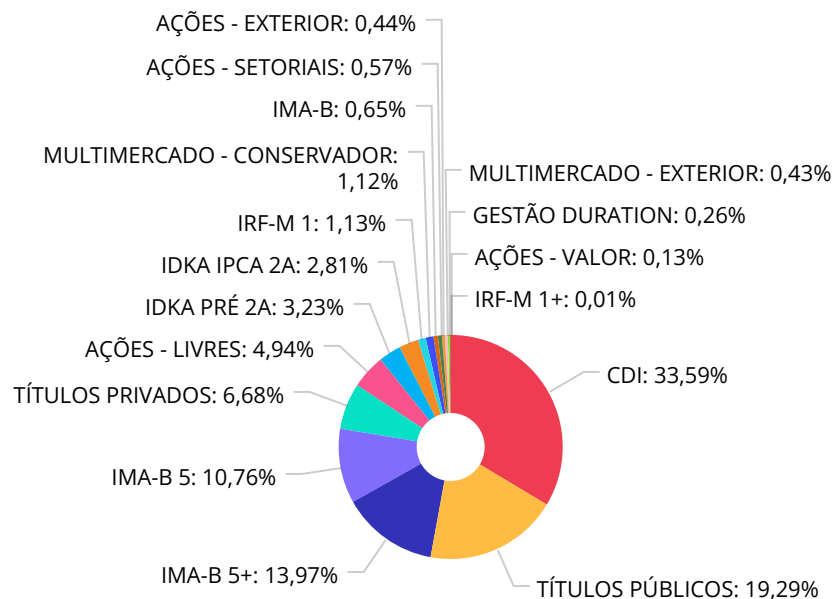
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	2,12%	5,72%	2,36%	-2,22%	7,87%	-6,83%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3,04%	5,69%	3,42%	0,54%	7,86%	-6,37%	6,35%	15,073%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	5,90%	14,58%	8,54%	9,75%	14,79%	-0,17%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,71%	7,52%	4,60%	2,50%	8,12%	-9,49%	7,22%	14,719%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,80%	14,00%	8,47%	8,53%	13,81%	-3,05%	8,28%	16,769%

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



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



■ CDI	62.446.831,48	■ TÍTULOS PÚBLICOS	35.855.096,74	■ IMA-B 5+	25.964.678,99
■ IMA-B 5	20.011.553,21	■ TÍTULOS PRIVADOS	12.424.535,39	■ AÇÕES - LIVRES	9.181.902,38
■ IDKA PRÉ 2A	6.000.000,00	■ IDKA IPCA 2A	5.232.559,23	■ IRF-M 1	2.099.897,93
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.081.867,33	■ IMA-B	1.199.473,75	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.053.540,45
■ AÇÕES - EXTERIOR	808.784,83	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	808.586,81	■ GESTÃO DURATION	478.667,60
■ AÇÕES - VALOR	246.158,14	■ IRF-M 1+	13.924,70		

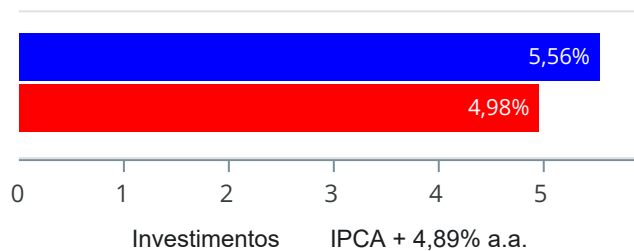
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2023)

<b>Títulos Públicos</b>	<b>Vencimento</b>	<b>Compra</b>	<b>Qtde</b>	<b>P.U. Compra</b>	<b>P.U. Atual</b>	<b>\$ Pago</b>	<b>\$ Atual</b>	<b>Marcação</b>
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	24/08/2022	2.443	4093,115400	4.189,305076	9.999.480,92	10.234.472,30	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	07/06/2022	3.600	4.135,37157300	4.280,05926	14.887.337,66	15.408.213,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	29/03/2023	2.419	4.132,9683	4.220,581266	9.997.650,32	10.209.586,08	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	173.429.444,47	4.987.810,03	4.310.211,82	176.361.325,05	2.254.282,37	2.254.282,37	1,29%	1,29%	0,95%	0,95%	136,31%	1,63%
Fevereiro	176.361.325,05	12.705.868,66	11.807.661,78	178.224.171,19	964.639,26	3.218.921,63	0,54%	1,85%	1,18%	2,15%	86,04%	1,78%
Março	178.224.171,19	31.786.826,51	31.094.426,32	180.951.134,09	2.034.562,71	5.253.484,34	1,14%	3,00%	1,15%	3,32%	90,49%	1,37%
Abril	180.951.134,09	5.326.205,67	4.617.202,33	183.492.627,82	1.832.490,39	7.085.974,73	1,01%	4,04%	0,95%	4,31%	93,91%	1,26%
Mai	183.492.627,82	25.184.496,68	25.436.904,59	185.908.058,96	2.667.839,05	9.753.813,78	1,45%	5,56%	0,65%	4,98%	111,52%	1,36%

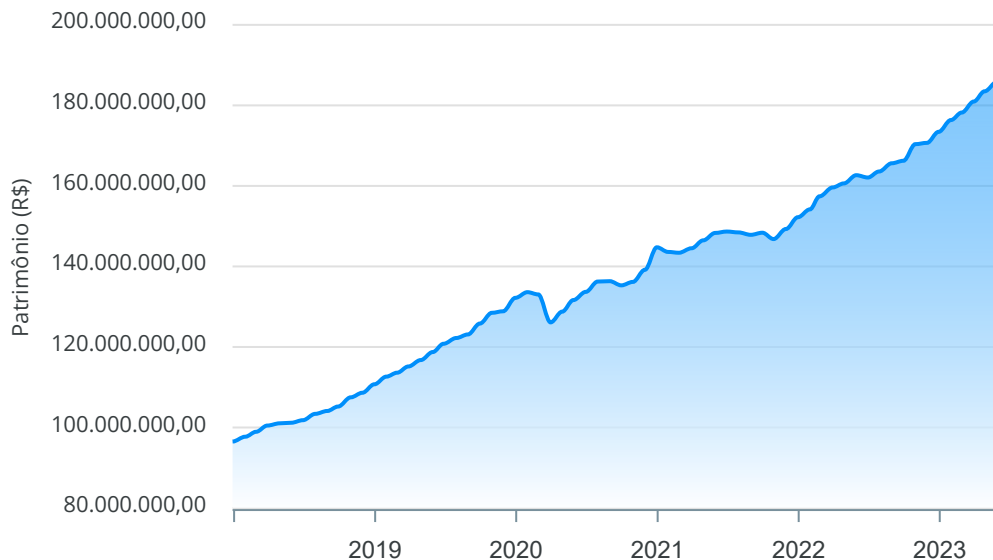
Investimentos x Meta de Rentabilidade





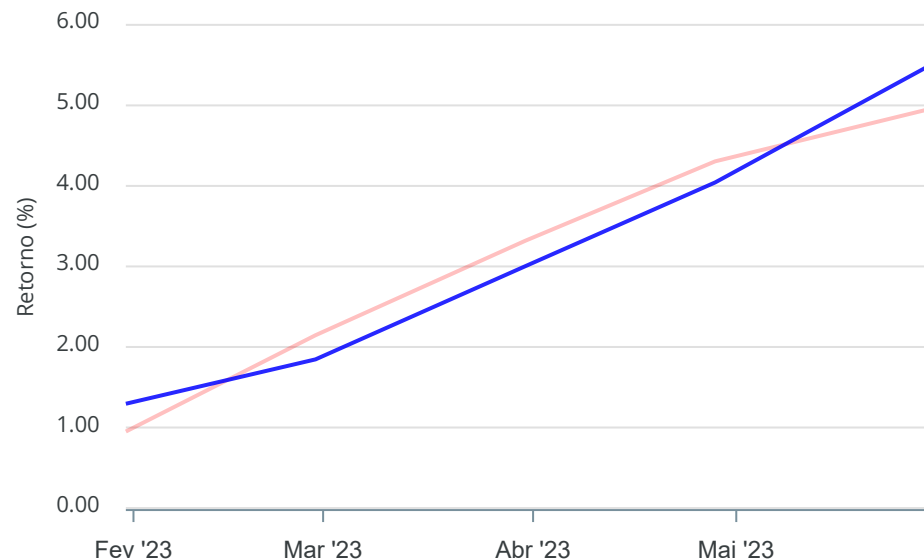
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO  36M



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.523.278,04	0,00	0,00	15.964.678,99	441.400,95	2,84%	2,84%	1,79%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	820.281,15	0,00	0,00	842.378,21	22.097,06	2,69%	2,69%	1,59%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	348.016,97	0,00	0,00	357.095,54	9.078,57	2,61%	2,59%	1,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	13.660,33	0,00	13.924,70	264,37	1,94%	2,84%	1,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	487.908,66	0,00	18.000,00	478.667,60	8.758,94	1,80%	1,81%	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.163.819,80	0,00	87.449,35	3.125.178,35	48.807,90	1,54%	1,54%	1,16%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	722.050,54	0,00	21.287,51	711.901,64	11.138,61	1,54%	-1,41%	5,17%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	565.199,33	0,00	0,00	571.932,05	6.732,72	1,19%	1,19%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	34.711.279,01	1.593.709,40	2.005,24	36.726.261,14	423.277,97	1,17%	1,18%	0,03%
LETRA FINANCEIRA BTG	2.554.039,39	0,00	0,00	2.583.784,36	29.744,97	1,16%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.104.232,78	0,00	0,00	6.175.097,64	70.864,86	1,16%	1,16%	0,03%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.860,22	0,00	0,00	6.939,82	79,60	1,16%	1,16%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	44.334,01	0,00	0,00	44.844,27	510,26	1,15%	1,15%	0,02%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	3.620.972,28	0,00	0,00	3.661.944,70	40.972,42	1,13%	-	-
ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	587.105,24	0,00	0,00	593.719,52	6.614,28	1,13%	1,13%	0,23%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	1.009.370,32	0,00	0,00	1.020.730,68	11.360,36	1,13%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.075.135,34	1.442,32	0,00	2.099.897,93	23.320,27	1,12%	1,12%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.703.444,98	0,00	5.538.812,71	5.284.631,70	119.999,43	1,12%	1,22%	0,06%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	364.745,29	0,00	0,00	368.806,87	4.061,58	1,11%	1,11%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	5.332.935,40	0,00	0,00	5.391.718,86	58.783,46	1,10%	1,10%	0,00%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	3.060.587,67	0,00	0,00	3.093.950,40	33.362,73	1,09%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	35.776.071,36	0,00	297.456,03	35.855.096,74	376.481,41	1,05%	-	-
LETRA FINANCEIRA SAFRA	2.042.971,42	0,00	0,00	2.064.125,25	21.153,83	1,04%	-	-
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIA...	440.088,35	297.456,03	0,00	744.319,26	6.774,88	0,92%	1,13%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.396.887,47	0,00	3.418.534,65	0,00	21.647,18	0,64%	1,19%	0,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.777.178,97	713.292,96	10.000.000,00	14.640.585,67	150.113,74	0,61%	0,63%	0,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.192.219,56	0,00	6.000.000,00	5.232.559,23	40.339,67	0,36%	0,36%	0,75%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	31.145,38	58.951,64	53.356,12	36.954,28	213,38	0,24%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	10.000.000,00	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00%	3,98%	2,29%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,00	6.000.000,00	0,00	6.000.000,00	0,00	0,00%	2,29%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.534.025,46	0,00	0,00	1.533.887,55	-137,91	-0,01%	-0,01%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	4.005.984,00	0,00	4.004.342,54	-1.641,46	-0,04%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.497.263,53	-2.736,47	-0,11%	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2,99	0,00	2,98	0,00	-0,01	-0,33%	0,89%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>169.996.187,38</b>	<b>25.184.496,68</b>	<b>25.436.904,59</b>	<b>171.727.219,02</b>	<b>1.983.439,55</b>	<b>1,17%</b>		<b>0,71%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	661.538,60	0,00	0,00	740.857,40	79.318,80	11,99%	11,99%	9,27%
CAIXA SEGURIDADE FI AÇÕES	289.258,58	0,00	0,00	312.683,05	23.424,47	8,10%	8,10%	6,82%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.061.331,69	0,00	0,00	1.140.262,93	78.931,24	7,44%	7,44%	7,65%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6.650.839,69	0,00	0,00	7.060.085,34	409.245,65	6,15%	6,15%	7,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	2.033.142,40	0,00	0,00	2.081.867,33	48.724,93	2,40%	2,48%	3,22%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	798.906,98	0,00	0,00	808.586,81	9.679,83	1,21%	1,21%	6,05%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	975.360,07	0,00	0,00	981.554,11	6.194,04	0,64%	0,64%	6,88%
OCCAM FIC AÇÕES	245.083,97	0,00	0,00	246.158,14	1.074,17	0,44%	0,44%	7,19%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>12.715.461,98</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>13.372.055,11</b>	<b>656.593,13</b>	<b>5,16%</b>		<b>6,76%</b>

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	266.711,07	0,00	0,00	282.193,47	15.482,40	5,80%	5,80%	8,28%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	265.741,03	0,00	0,00	273.814,16	8.073,13	3,04%	3,04%	6,35%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	248.526,36	0,00	0,00	252.777,20	4.250,84	1,71%	1,71%	7,22%
<b>Total Exterior</b>	<b>780.978,46</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>808.784,83</b>	<b>27.806,37</b>	<b>3,56%</b>		<b>7,29%</b>

## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO & MERCADO. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

