

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	549.607,29	1,65%	6.483.473.627,64	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	96.447,15	0,29%	5.638.426.224,35	0,00%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.820.613,44	5,46%	1.191.739.626,46	0,15%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	494.696,12	1,48%	6.493.608.770,37	0,01%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.321.114,34	3,96%	4.459.933.733,33	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.193.373,35	9,57%	3.511.010.528,94	0,09%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.798.748,70	5,39%	1.220.487.574,87	0,15%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.792.564,00	8,37%	1.551.038.458,72	0,18%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	463.973,66	1,39%	1.128.559.610,31	0,04%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	70,93	0,00%	4.278.810.513,26	0,00%	7º III a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.209.189,56	15,61%	746.954.336,58	0,70%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.905.372,72	5,71%	14.982.085.274,92	0,01%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	577.197,01	1,73%	10.391.025.294,46	0,01%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.242.689,18	12,71%	1.330.366.206,19	0,32%	7º III a
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.357.881,99	7,06%	592.169.733,93	0,40%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.318.121,66	6,95%	337.897.308,55	0,69%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.067.926,65	3,20%	424.732.955,32	0,25%	8º I
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	321.990,14	0,96%	105.403.402,08	0,31%	8º I
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.177.464,16	3,53%	117.821.298,92	1,00%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.665.864,97	4,99%	2.036.420.590,68	0,08%	9º III

Investimentos

\$ 33.374.907,02

Disponibilidades Financeiras

\$ 299.158,85

Total Carteira

\$ 33.674.065,87

Governança (Pró Gestão)

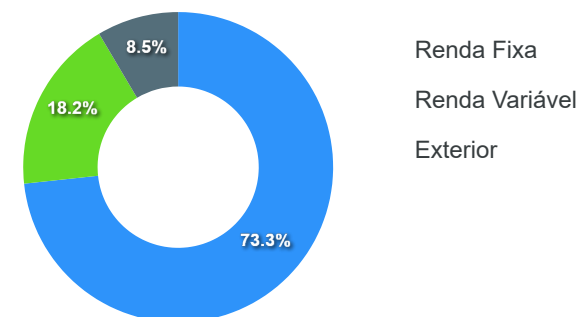


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	37,21%	12.531.138,05 62,79%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	35,44%	11.934.519,40 24,56%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	18,01%	6.065.920,44 11,99%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	8,44%	2.843.329,13 1,56%

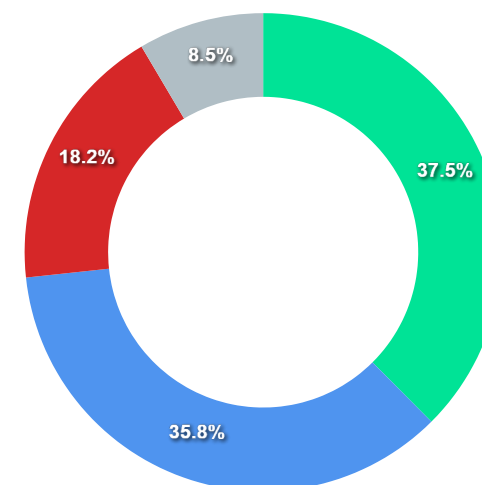
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

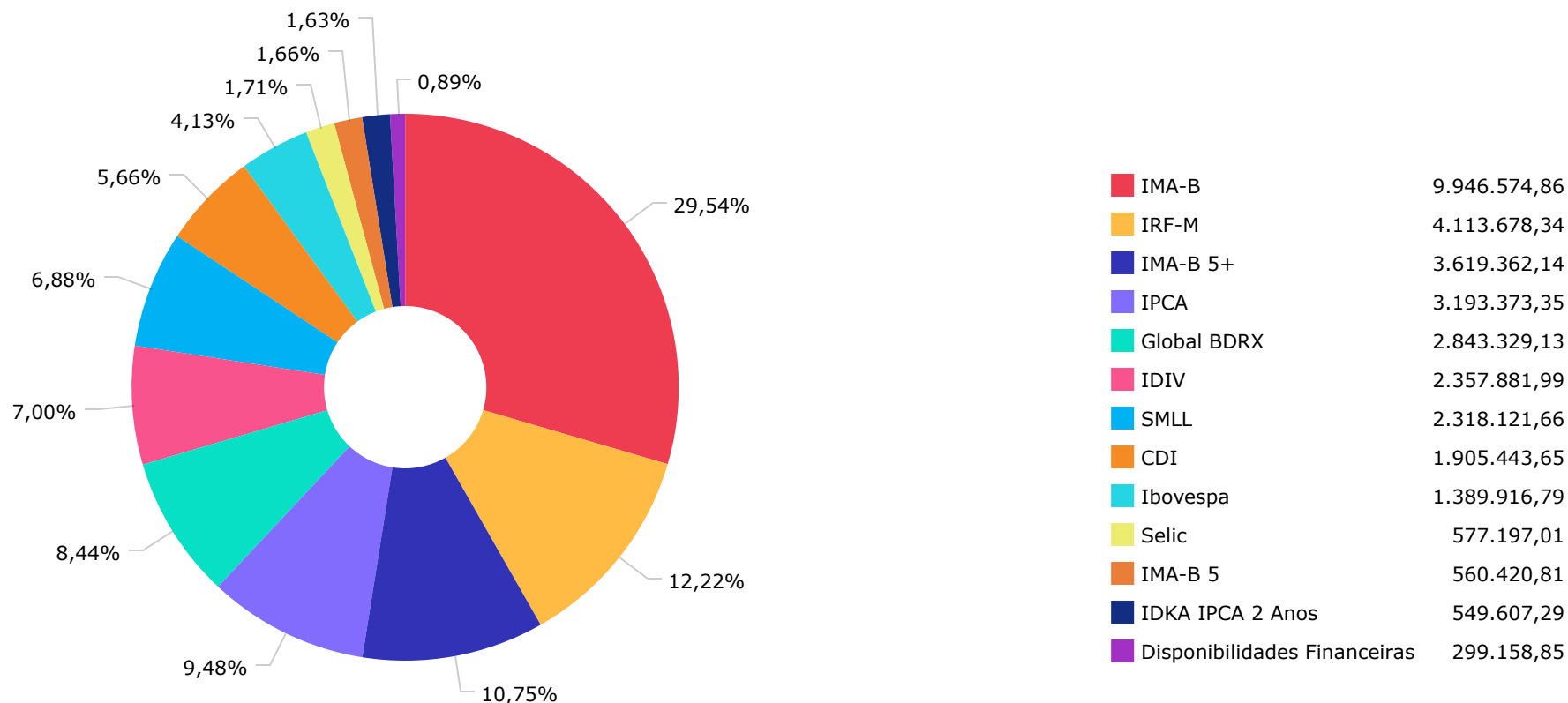


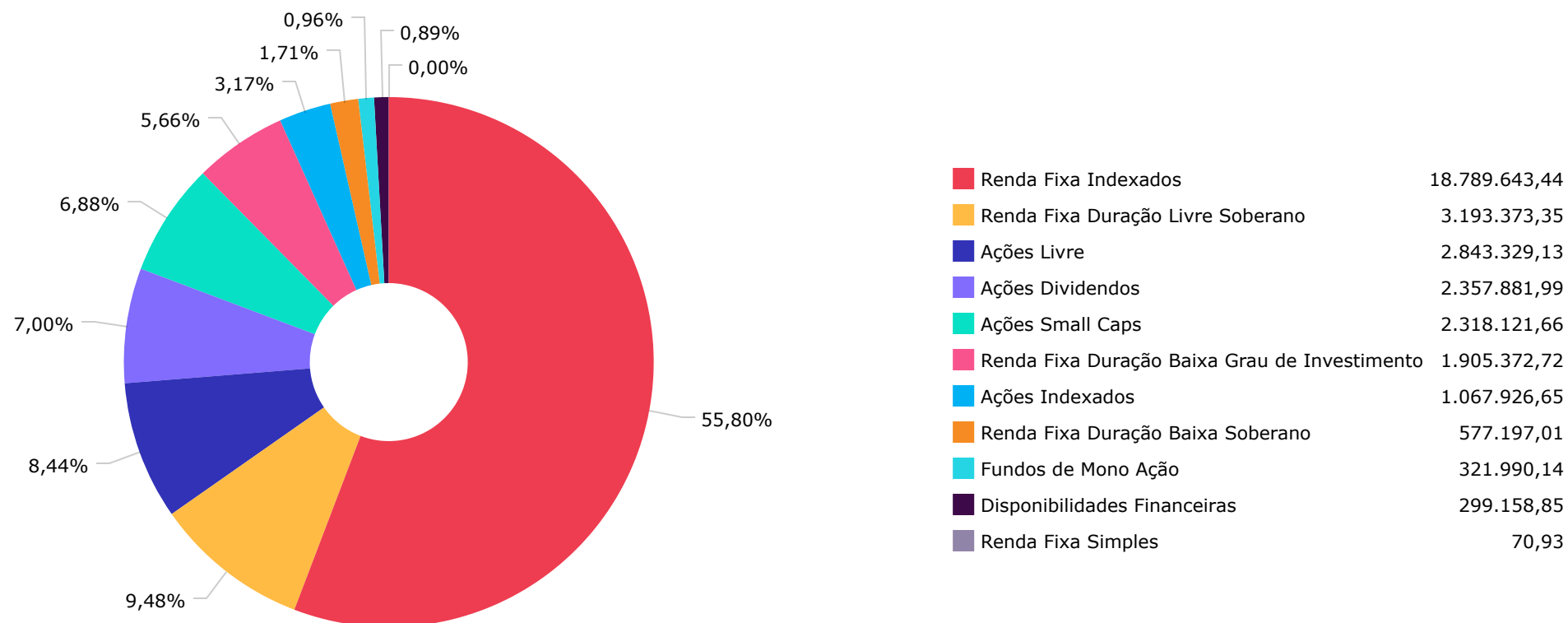
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	33.674.065,87
7º I b - FI 100% Títulos TN	37,21%	0,00%	50,00%	100,00%	21.142.927,82
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	33.674.065,87
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.683.703,29
7º III a - FI Referenciados RF	35,44%	0,00%	15,00%	60,00%	8.269.920,12
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	20.204.439,52
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	6.734.813,17
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.683.703,29
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.683.703,29
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.683.703,29

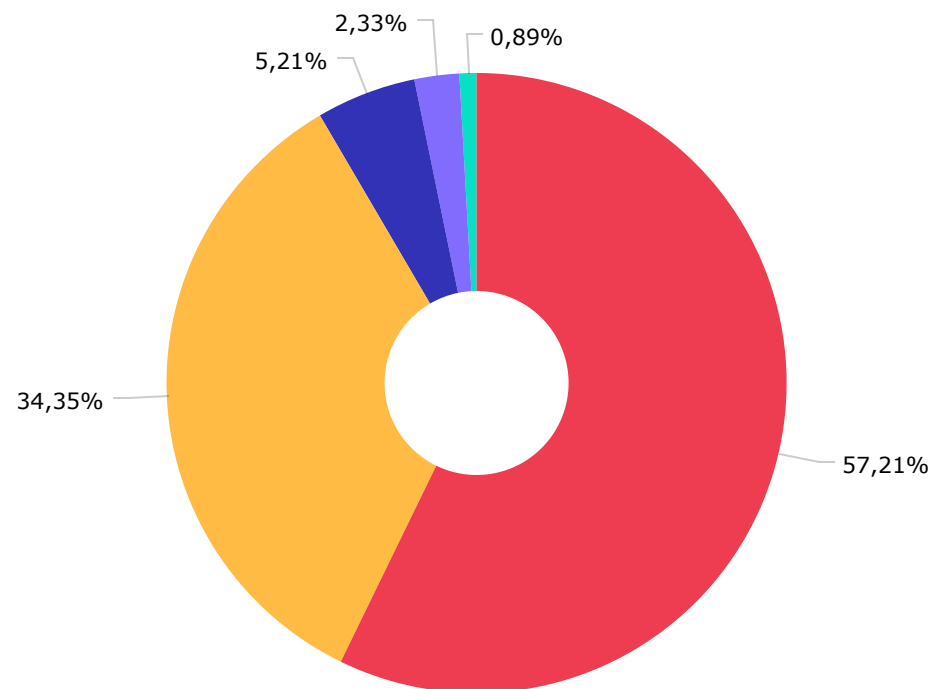
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	18,01%	0,00%	19,00%	30,00%	4.036.299,32
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	10.102.219,76
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.367.406,59
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.367.406,59
9º III - Ações - BDR Nível I	8,44%	0,00%	9,00%	10,00%	524.077,46
10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	3.367.406,59
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.683.703,29
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.683.703,29
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.683.703,29
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.683.703,29

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09	6,44	3,16	6,44	13,54	23,74	0,01	0,02
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00	5,98	2,90	5,98	12,44	20,85	0,01	0,01
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
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,19	6,42	3,31	6,42	8,57	-1,30	5,69	11,97
IBOVESPA - BENCHMARK	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87		
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	18,65	34,39	43,21	34,39	62,96	126,65	17,44	36,72
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	8,90	7,32	15,55	7,32	19,57	-6,91	7,35	15,48
IDIV - BENCHMARK	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91		
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	7,90	7,28	14,22	7,28	14,52	-7,08	6,96	14,65
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02	6,56	2,10	6,56	9,43	20,20	0,78	1,64
IMA-B - BENCHMARK	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81		
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
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,39	11,31	7,20	11,31	13,23	17,29	2,17	4,57
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		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	6,99	2,56	6,99	10,05	20,76	0,90	1,89
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03	6,92	2,49	6,92	10,00	20,80	0,89	1,87

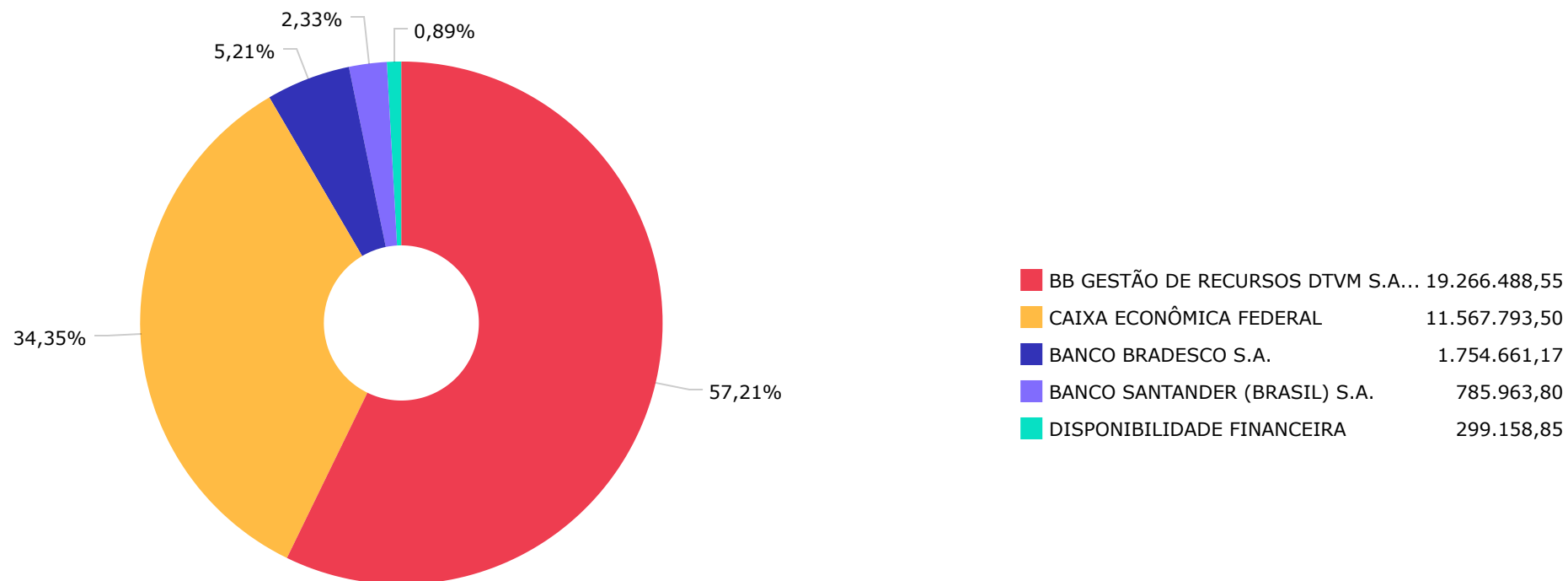
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,31	14,66	10,79	14,66	15,89	13,02	3,16	6,66
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,30	14,47	10,61	14,47	15,72	12,70	3,08	6,50
IPCA - BENCHMARK	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93	5,56	1,44	5,56	8,39		0,47	1,00
IRF-M - BENCHMARK	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,10	9,56	5,47	9,56	16,61	18,51	0,90	1,90
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09	9,44	5,43	9,44	16,38	18,13	0,90	1,90
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
SMLL - BENCHMARK	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	9,13	14,75	27,59	14,75	19,53	-29,89	10,66	22,46







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	19.266.488,55
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.567.793,50
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	1.754.661,17
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	785.963,80
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	299.158,85



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	30.350.140,81	0,00	0,00	30.710.050,23	359.909,42	359.909,42	1,19% ▲	1,19%	0,93%	0,93%	127,96%	4,40%
Fevereiro	30.710.050,23	2.306.697,51	2.884.479,40	29.954.427,78	-177.840,56	182.068,86	-0,58% ▼	0,60%	1,17%	2,11%	28,44%	3,67%
Março	29.954.427,78	577.781,89	0,00	30.901.133,23	368.923,56	550.992,42	1,21% ▲	1,82%	1,13%	3,27%	55,66%	3,13%
Abril	30.901.133,23	2.097.776,10	2.330.922,38	31.114.978,27	446.991,32	997.983,74	1,45% ▲	3,29%	0,94%	4,24%	77,59%	3,38%
Maio	31.114.978,27	233.109,87	0,00	32.243.751,42	895.663,28	1.893.647,02	2,86% ▲	6,24%	0,63%	4,90%	127,35%	3,03%
Junho	32.243.751,42	5.233.449,83	5.075.710,97	33.374.907,02	973.416,74	2.867.063,76	3,00% ▲	9,43%	0,30%	5,21%	181,00%	3,33%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	550.992,42	1,82%	3,27%
2º Trim	2.316.071,34	7,48%	1,88%
1º Sem	2.867.063,76	9,43%	5,21%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

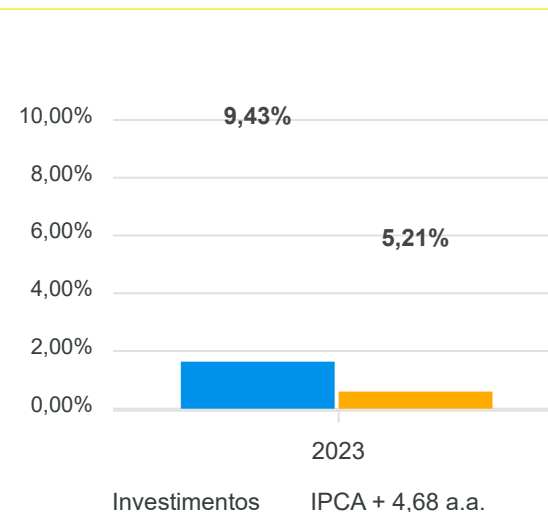
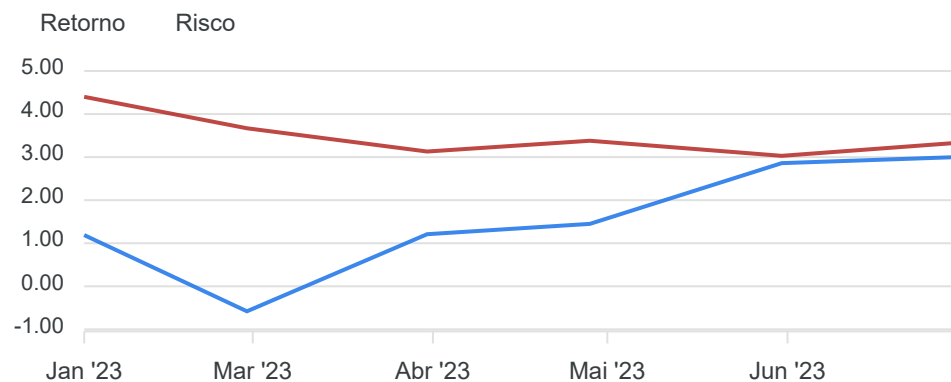
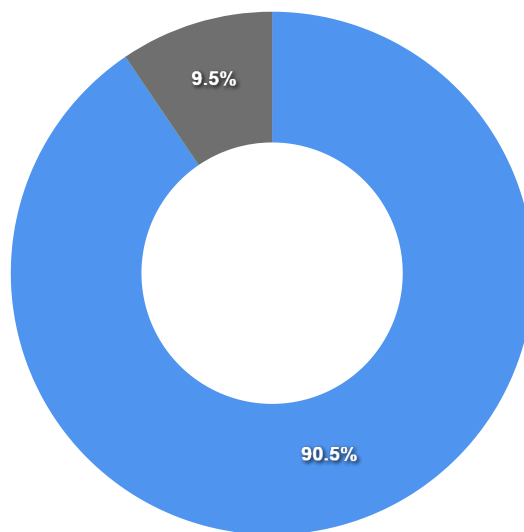


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 30/06/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	30.480.692,52	91,33
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	3.193.373,35	9,57
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.513.997,08	0,00	5.000.000,00	549.607,29	35.610,21	0,65% ▲	0,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	95.463,01	0,00	0,00	96.447,15	984,14	1,03% ▲	0,90%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.762.336,35	0,00	0,00	1.820.613,44	58.277,09	3,31% ▲	3,16%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	483.233,54	0,00	0,00	494.696,12	11.462,58	2,37% ▲	2,15%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.294.033,78	0,00	0,00	1.321.114,34	27.080,56	2,09% ▲	0,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.884.780,89	0,00	0,00	1.905.372,72	20.591,83	1,09% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.163.912,85	0,00	0,00	3.193.373,35	29.460,50	0,93% ▲	0,47%
BRANCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	571.082,46	0,00	0,00	577.197,01	6.114,55	1,07% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.741.347,62	0,00	0,00	1.798.748,70	57.401,08	3,30% ▲	3,08%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.735.128,23	0,00	0,00	2.792.564,00	57.435,77	2,10% ▲	0,90%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.144.316,85	0,00	0,00	4.242.689,18	98.372,33	2,37% ▲	2,15%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	459.249,08	0,00	0,00	463.973,66	4.724,58	1,03% ▲	0,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	75.710,97	75.710,97	70,93	70,93	0,09% ▲	0,01%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.157.738,86	0,00	5.209.189,56	51.450,70	1,00% ▲	2,17%
	23.848.881,74	5.233.449,83	5.075.710,97	24.465.657,45	459.036,85	1,91%	1,59%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.185.333,34	0,00	0,00	2.357.881,99	172.548,65	7,90% ▲	6,96%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.124.143,17	0,00	0,00	2.318.121,66	193.978,49	9,13% ▲	10,66%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	980.668,74	0,00	0,00	1.067.926,65	87.257,91	8,90% ▲	7,35%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	271.383,18	0,00	0,00	321.990,14	50.606,96	18,65% ▲	17,44%
-	5.561.528,43	0,00	0,00	6.065.920,44	504.392,01	9,07%	9,00%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.175.237,70	0,00	0,00	1.177.464,16	2.226,46	0,19% ▲	5,69%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.658.103,55	0,00	0,00	1.665.864,97	7.761,42	0,47% ▲	6,60%
	2.833.341,25	0,00	0,00	2.843.329,13	9.987,88	0,35%	2,36%

RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENTA FIJA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	75.710,97	75.710,97	70,93	70,93	0,09% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	5.455.687,78	0,00	5.000.000,00	549.607,29	93.919,51	1,72% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO LP	94.042,60	0,00	0,00	96.447,15	2.404,55	2,56% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.643.343,29	0,00	0,00	1.820.613,44	177.270,15	10,79% ▲
BB IMA-B FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.157.738,86	0,00	5.209.189,56	51.450,70	1,00% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	461.850,53	0,00	0,00	494.696,12	32.845,59	7,11% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.253.020,84	0,00	0,00	1.321.114,34	68.093,50	5,43% ▲
BB PERFIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.846.952,47	0,00	0,00	1.905.372,72	58.420,25	3,16% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	3.148.053,76	0,00	0,00	3.193.373,35	45.319,59	1,44% ▲
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	559.892,85	0,00	0,00	577.197,01	17.304,16	3,09% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIJA	2.310.749,24	0,00	2.330.922,38	0,00	20.173,14	0,87% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	1.626.246,92	0,00	0,00	1.798.748,70	172.501,78	10,61% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	342.057,94	2.330.885,97	0,00	2.792.564,00	119.620,09	4,48% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO IMA-B LP	3.959.114,28	0,00	0,00	4.242.689,18	283.574,90	7,16% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENTA FIJA	452.681,96	0,00	0,00	463.973,66	11.291,70	2,49% ▲
	23.153.694,46	7.564.335,80	7.406.633,35	24.465.657,45	1.154.260,54	4,95%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.064.331,29	0,00	0,00	2.357.881,99	293.550,70	14,22% ▲
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.816.829,39	0,00	0,00	2.318.121,66	501.292,27	27,59% ▲
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	924.177,10	0,00	0,00	1.067.926,65	143.749,55	15,55% ▲
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	224.845,42	0,00	0,00	321.990,14	97.144,72	43,21% ▲
	5.030.183,20	0,00	0,00	6.065.920,44	1.035.737,24	20,59%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.139.777,12	0,00	0,00	1.177.464,16	37.687,04	3,31% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.577.478,45	0,00	0,00	1.665.864,97	88.386,52	5,60% ▲
	2.717.255,57	0,00	0,00	2.843.329,13	126.073,56	4,64%

RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	728.607,48	0,00	739.898,56	0,00	11.291,08	1,55% ▲
BB FLUXO FIC RENTA FIJA SIMPLS PREVIDENCIÁRIO	0,00	75.710,97	75.710,97	70,93	70,93	0,09% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	4.443.144,46	806.697,51	5.000.000,00	549.607,29	299.765,32	5,71% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO LP	90.146,32	0,00	0,00	96.447,15	6.300,83	6,99% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	2.581.444,51	0,00	1.000.000,00	1.820.613,44	239.168,93	9,26% ▲
BB IMA-B FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.157.738,86	0,00	5.209.189,56	51.450,70	1,00% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	940.934,48	0,00	500.000,00	494.696,12	53.761,64	5,71% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.207.114,64	0,00	0,00	1.321.114,34	113.999,70	9,44% ▲
BB PERFIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	291.718,95	1.522.520,22	0,00	1.905.372,72	91.133,55	5,02% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	3.112.427,44	0,00	89.319,17	3.193.373,35	170.265,08	5,47% ▲
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	0,00	555.261,67	0,00	577.197,01	21.935,34	3,95% ▲
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIJA	556.110,62	0,00	555.261,67	0,00	-848,95	-0,15% ▼
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIJA	2.238.066,28	0,00	2.330.922,38	0,00	92.856,10	4,15% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	1.571.328,61	0,00	0,00	1.798.748,70	227.420,09	14,47% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	329.294,62	2.330.885,97	0,00	2.792.564,00	132.383,41	4,98% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO IMA-B LP	3.812.278,67	0,00	0,00	4.242.689,18	430.410,51	11,29% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENTA FIJA	433.951,83	0,00	0,00	463.973,66	30.021,83	6,92% ▲
	22.336.568,91	10.448.815,20	10.291.112,75	24.465.657,45	1.971.386,09	8,76%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.197.818,69	0,00	0,00	2.357.881,99	160.063,30	7,28% ▲
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.020.160,96	0,00	0,00	2.318.121,66	297.960,70	14,75% ▲
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	995.095,27	0,00	0,00	1.067.926,65	72.831,38	7,32% ▲
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	239.590,06	0,00	0,00	321.990,14	82.400,08	34,39% ▲
	5.452.664,98	0,00	0,00	6.065.920,44	613.255,46	11,25%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.106.383,84	0,00	0,00	1.177.464,16	71.080,32	6,42% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.454.523,08	0,00	0,00	1.665.864,97	211.341,89	14,53% ▲
	2.560.906,92	0,00	0,00	2.843.329,13	282.422,21	11,03%

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
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
942

Patrimônio Líquido Fundo
6.483.473.627,64

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, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

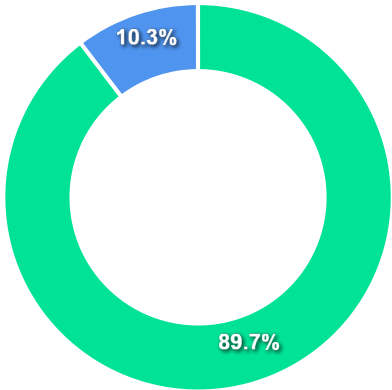
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	1,64%
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



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.813.518,74	89.67%
Operação compromissada	669.146,83	10.32%
Derivativos	736,55	0.01%
Valores a pagar/receber	177,23	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	3.299.967,72	50,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.746.277,84	26,93	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	767.273,17	11,83	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	669.146,83	10,32	Operação compromissada
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (17/08/20...	535,25	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/05/20...	203,15	0,00	Derivativos
Outras Disponibilidades	200,60	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	31,21	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	19,96	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	3,17	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,87	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,34	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,03	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/08/20...	-1,85	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa de Administração	-51,39	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-56,92	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+1

Quantidade de Cotistas
783

Patrimônio Líquido Fundo
5.638.426.224,35

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

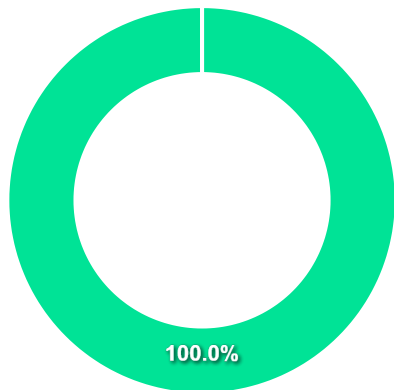
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,99%	2,56%	6,99%	10,05%	20,76%	0,90%	1,89%
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
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	5.638.499,75	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,64	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,12	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-44,75	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-54,69	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.638.499,75	100.00%
Valores a pagar/receber	-93,39	-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+2

Quantidade de Cotistas
237

Patrimônio Líquido Fundo
1.191.739.626,46

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5+

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

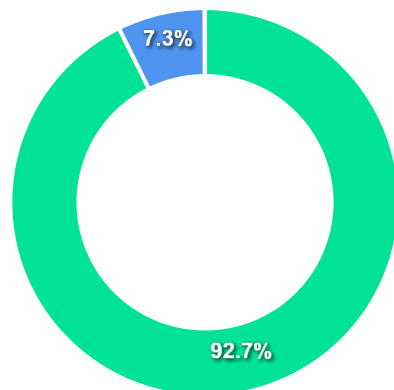
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,31%	14,66%	10,79%	14,66%	15,89%	13,02%	3,16%	6,66%
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



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.104.840,93	92.71%
Operação compromissada	86.435,84	7.25%
Derivativos	268,97	0.02%
Valores a pagar/receber	203,60	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	241.271,62	20,25	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	179.980,71	15,10	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	143.591,60	12,05	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	140.746,64	11,81	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	140.207,67	11,76	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	111.358,46	9,34	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	86.435,84	7,25	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	45.582,13	3,82	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	43.253,75	3,63	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	34.682,15	2,91	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	24.166,19	2,03	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/08/20...	205,01	0,02	Derivativos
Outras Disponibilidades	195,09	0,02	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/08/20...	63,96	0,01	Derivativos
Outros Valores a receber	27,74	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	2,54	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	2,29	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,87	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,03	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-7,71	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-8,05	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-9,20	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+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.

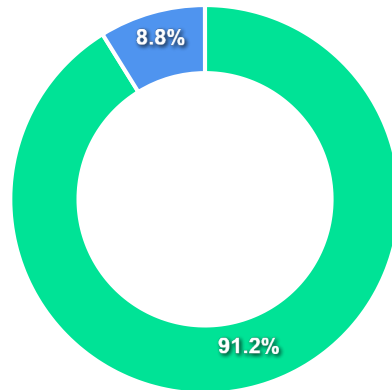
COMPARATIVO

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	5.920.421,52	91.17%
Operação compromissada	572.459,19	8.82%
Derivativos	645,60	0.01%
Valores a pagar/receber	179,78	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	749.303,27	11,54	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	631.654,74	9,73	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	615.103,67	9,47	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	572.459,19	8,82	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	550.270,98	8,47	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	539.464,81	8,31	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	475.774,87	7,33	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	475.575,26	7,32	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	453.854,06	6,99	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	452.539,93	6,97	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	364.535,98	5,61	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	238.146,93	3,67	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	157.407,99	2,42	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	135.063,37	2,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	81.725,66	1,26	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (17/05/20...	257,99	0,00	Derivativos
Outras Disponibilidades	202,30	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/08/20...	170,20	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (17/08/20...	149,37	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/05/20...	42,42	0,00	Derivativos
Outros Valores a receber	31,21	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/08/20...	27,41	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa Selic	16,11	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	3,17	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,87	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,02	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+1

Quantidade de Cotistas
515

Patrimônio Líquido Fundo
4.459.933.733,33

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IRF-M

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

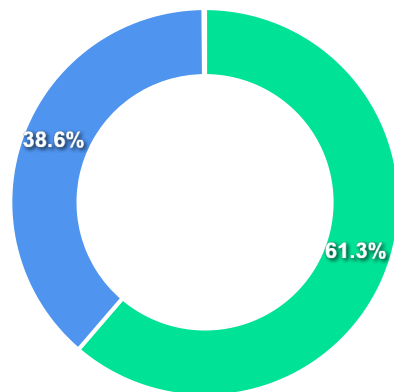
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,09%	9,44%	5,43%	9,44%	16,38%	18,13%	0,90%	1,90%
Benchmark	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.733.402,51	61.29%
Operação compromissada	1.720.591,43	38.58%
Derivativos	3.957,56	0.09%
Outros	1.618,26	0.04%
Valores a pagar/receber	436,41	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	1.720.591,43	38,58	Operação compromissada
LTN - Venc.: 01/07/2023	557.880,34	12,51	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2024	417.128,78	9,35	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	347.381,66	7,79	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	313.545,99	7,03	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	157.948,78	3,54	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2025	106.740,25	2,39	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2026	78.339,27	1,76	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024	67.214,56	1,51	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	67.208,58	1,51	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	67.197,96	1,51	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026	67.097,27	1,50	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	67.050,89	1,50	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2029	66.617,63	1,49	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026	59.756,40	1,34	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2025	55.699,27	1,25	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2024	48.177,92	1,08	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2025	41.927,95	0,94	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2031	40.803,11	0,91	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2024	35.861,41	0,80	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2024	31.479,16	0,71	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2033	22.883,31	0,51	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	10.619,42	0,24	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2023	4.842,59	0,11	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas / DI FUTURO BMF - 01/0...	1.207,79	0,03	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF26	1.045,82	0,02	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF29	717,00	0,02	Derivativos

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
370

Patrimônio Líquido Fundo
3.511.010.528,94

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, exclusivamente, em Títulos Públicos
Federais registrados no SELIC e ou Operações Compromissadas
lastreadas em Títulos Públicos Federais registrados no SELIC.

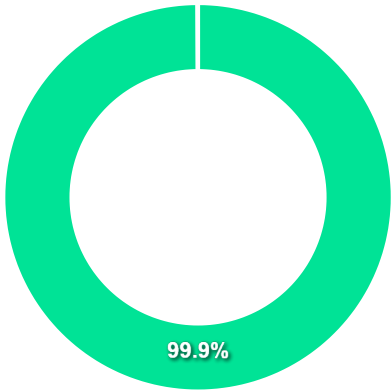
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,93%	5,56%	1,44%	5,56%	8,39%	-%	0,47%	1,00%
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
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	3.508.532,67	99,93	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	2.483,62	0,07	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	31,47	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	31,21	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	9,94	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	2,39	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,87	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-27,85	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-29,13	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.508.532,67	99.93%
Operação compromissada	2.483,62	0.07%
Valores a pagar/receber	18,89	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
252

Patrimônio Líquido Fundo
1.220.487.574,87

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5+

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Investe em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços.

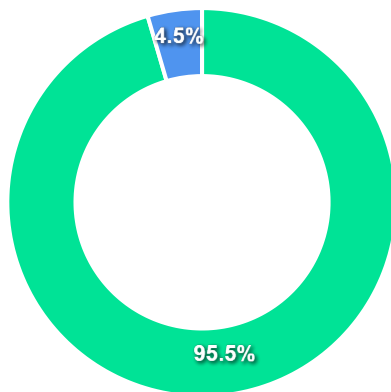
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,30%	14,47%	10,61%	14,47%	15,72%	12,70%	3,08%	6,50%
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



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.165.439,79	95.49%
Operação compromissada	55.056,98	4.51%
Valores a pagar/receber	-9,19	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	287.899,87	23,59	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	178.259,98	14,61	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	154.041,66	12,62	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	153.570,49	12,58	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	149.053,29	12,21	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	118.220,09	9,69	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	55.056,98	4,51	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	53.001,46	4,34	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/05/2033	26.161,00	2,14	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	21.503,35	1,76	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	12.957,44	1,06	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	10.771,17	0,88	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	32,82	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	25,97	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-67,98	-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
352

Patrimônio Líquido Fundo
1.551.038.458,72

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IRF-M

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.

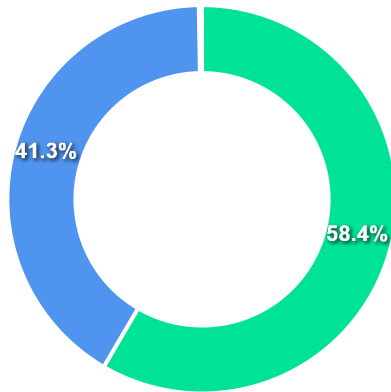
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,10%	9,56%	5,47%	9,56%	16,61%	18,51%	0,90%	1,90%
Benchmark	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	907.448,58	58.43%
Títulos Federais	641.516,86	41.30%
Valores a pagar/receber	2.073,02	0.13%
Derivativos	1.469,15	0.09%
Outros	655,40	0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	907.448,58	58,51	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2027	160.417,23	10,34	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2026	73.638,91	4,75	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	73.278,05	4,72	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	67.165,41	4,33	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026	58.374,63	3,76	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2025	47.622,57	3,07	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	40.487,67	2,61	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2024	38.703,43	2,50	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2025	36.932,90	2,38	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2031	19.228,47	1,24	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2033	14.463,26	0,93	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026	11.204,32	0,72	Títulos Federais
Outros Valores a receber	2.150,50	0,14	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	466,32	0,03	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF29	366,17	0,02	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF26	212,73	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF27	185,06	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31	184,79	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	150,49	0,01	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF33	147,57	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN25	102,16	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	100,80	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24	90,31	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24	45,93	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	36,96	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	33,68	0,00	Derivativos

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,10%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+1
Quantidade de Cotistas
118
Patrimônio Líquido Fundo
1.128.559.610,31

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IMA-B 5
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados
Política de Investimento
Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento.

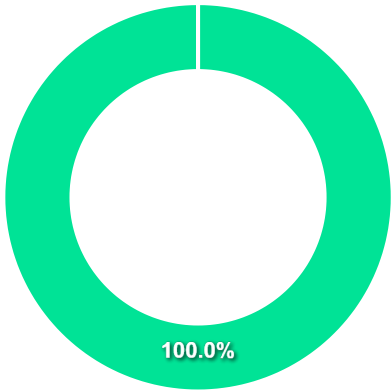
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,92%	2,49%	6,92%	10,00%	20,80%	0,89%	1,87%
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
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.128.624,09	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	67,34	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-136,83	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.128.624,09	100.01%
Valores a pagar/receber	-64,48	-0.01%

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+0

Quantidade de Cotistas
980

Patrimônio Líquido Fundo
4.278.810.513,26

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

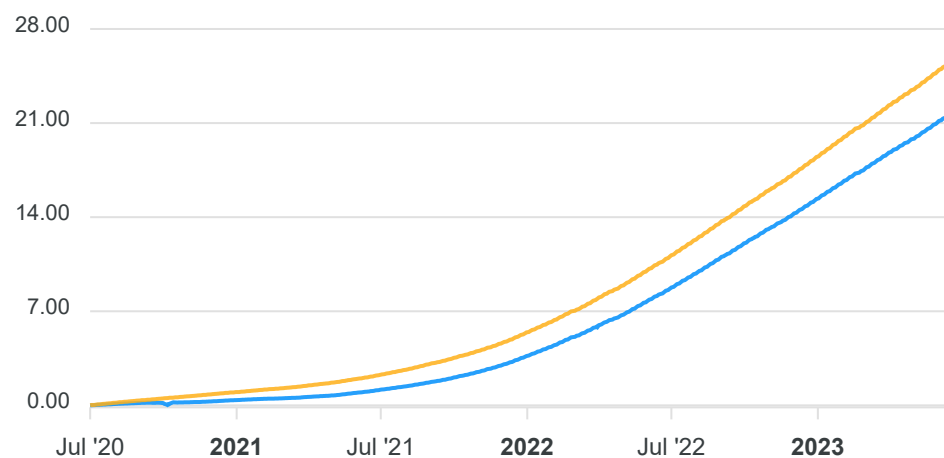
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Simples

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em fundos de investimento os quais investem, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

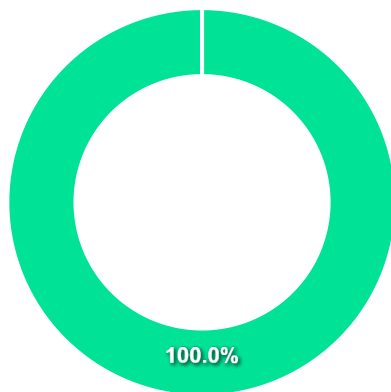
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,01%
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 BB TOP FI RENDA FIXA SIMPLES	4.279.009,18	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	7,04	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-23,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-169,79	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	4.279.009,18	100.01%
Valores a pagar/receber	-215,75	-0.01%

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+1

Quantidade de Cotistas
218

Patrimônio Líquido Fundo
746.954.336,58

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seu patrimônio líquido representado por ativos financeiros de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação diária da taxa de juros doméstica e/ou índice de preços.

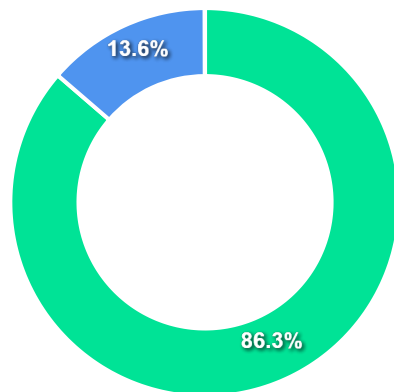
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,39%	11,31%	7,20%	11,31%	13,23%	17,29%	2,17%	4,57%
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	644.949,45	86.34%
Operação compromissada	101.739,50	13.62%
Derivativos	181,50	0.02%
Valores a pagar/receber	89,74	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	101.739,50	13,62	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	86.391,27	11,57	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	64.834,66	8,68	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	62.802,33	8,41	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	61.942,31	8,29	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	54.658,06	7,32	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	52.860,50	7,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	52.561,27	7,04	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	49.243,33	6,59	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	45.473,13	6,09	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	41.741,96	5,59	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	23.832,14	3,19	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	20.289,13	2,72	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	15.577,19	2,09	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	12.742,17	1,71	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/08/20...	96,70	0,01	Derivativos
Outras Disponibilidades	96,19	0,01	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (17/08/20...	35,27	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (17/05/20...	28,44	0,00	Derivativos
Outros Valores a receber	22,19	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/08/20...	18,27	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/05/20...	3,26	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa Selic	1,76	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	1,17	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,77	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAP FUTURO (15/08/20...	-0,45	0,00	Derivativos

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
1.126

Patrimônio Líquido Fundo
14.982.085.274,92

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

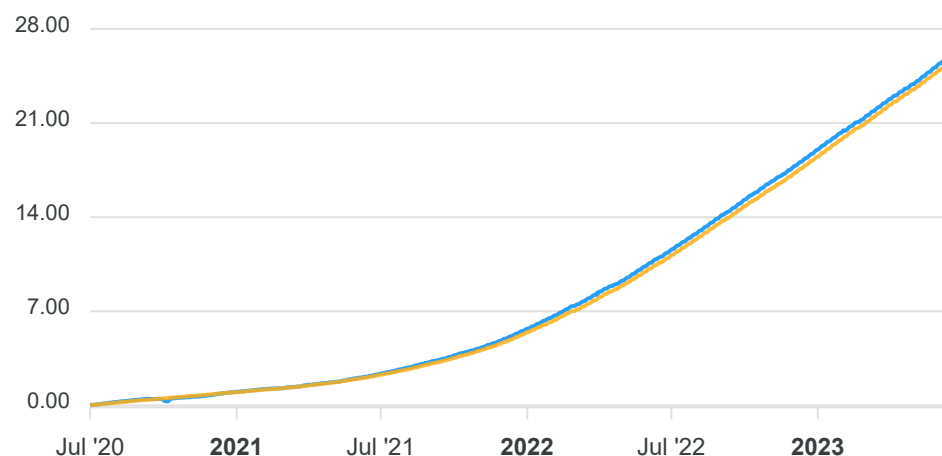
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento
Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em cotas de fundo investimento cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

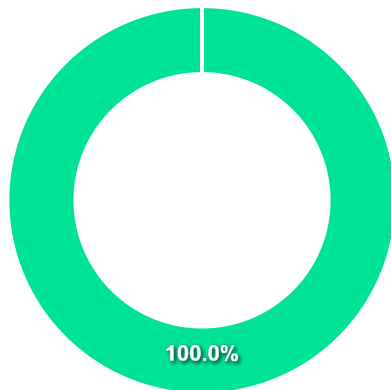
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,09%	6,44%	3,16%	6,44%	13,54%	23,74%	0,01%	0,02%
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 BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.982.209,84	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa Cetip	30,70	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	7,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,63	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-118,91	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	14.982.209,84	100.00%
Valores a pagar/receber	-80,25	-0.00%

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

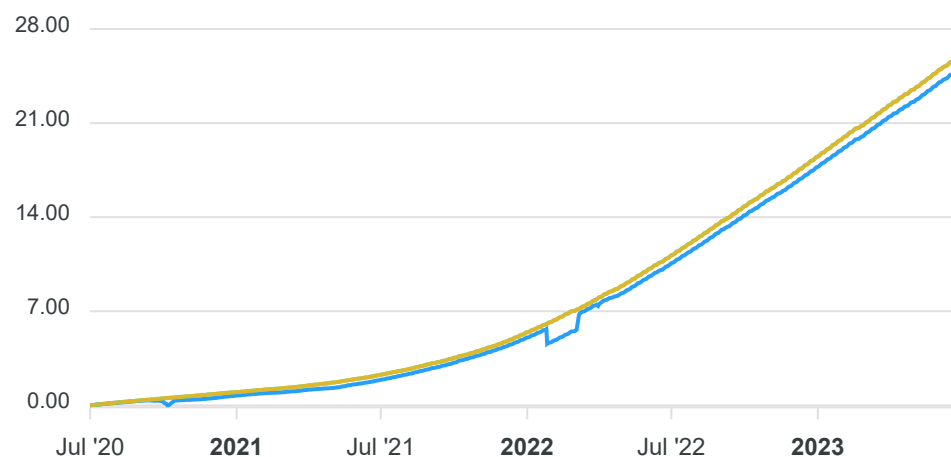
Política de Investimento

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.

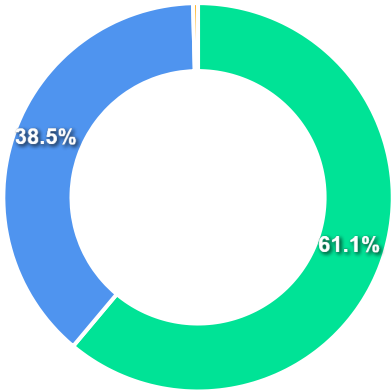
COMPARATIVO

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. (%)
Títulos Federais	6.347.730,12	61.09%
Operação compromissada	4.000.703,93	38.50%
Valores a pagar/receber	42.672,53	0.41%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2025	4.000.703,93	37,99	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2026	1.364.087,55	12,95	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024	1.269.212,58	12,05	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2024	1.093.352,40	10,38	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	933.245,27	8,86	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027	620.115,77	5,89	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	466.817,36	4,43	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	439.810,58	4,18	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	85.825,15	0,81	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	75.263,48	0,71	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	44.612,24	0,42	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	29,29	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.969,00	-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
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.

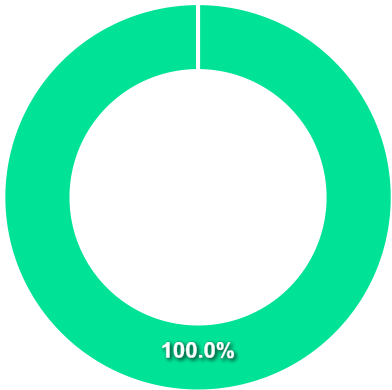
COMPARATIVO

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...	1.330.411,45	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	29,14	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-74,38	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.330.411,45	100.00%
Valores a pagar/receber	-45,24	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4

Quantidade de Cotistas
 21.542

Patrimônio Líquido Fundo
 592.169.733,93

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 IDIV

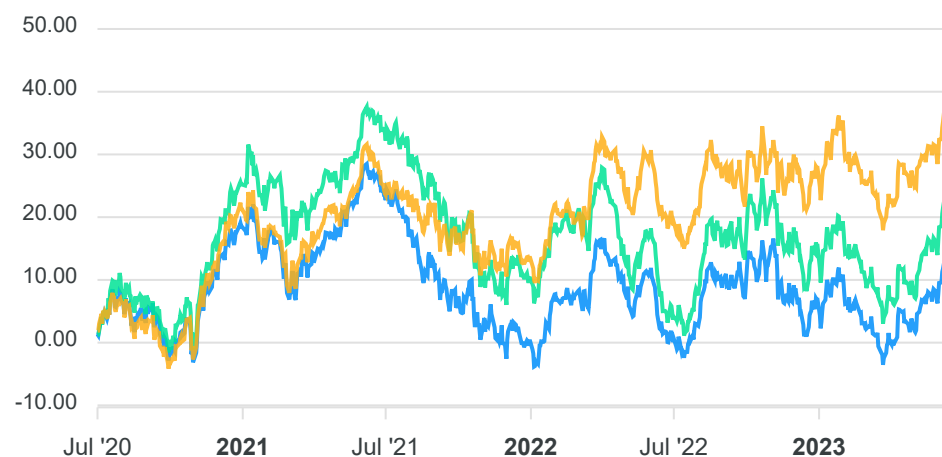
Classificação ANBIMA
 Ações Dividendos

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento em ações.

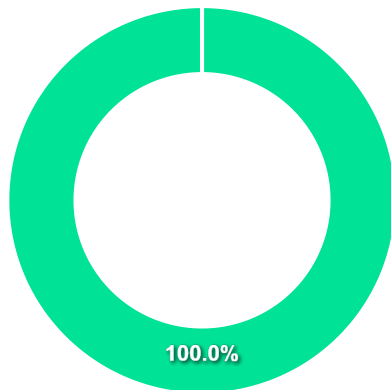
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	7,90%	7,28%	14,22%	7,28%	14,52%	-7,08%	6,96%	14,65%
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



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP DIVIDENDOS FIAÇÕES	592.209,77	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	0,17	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,03	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-4,20	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-11,38	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-47,00	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	592.209,77	100.01%
Valores a pagar/receber	-62,33	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4

Quantidade de Cotistas
 10.685

Patrimônio Líquido Fundo
 337.897.308,55

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 SMLL

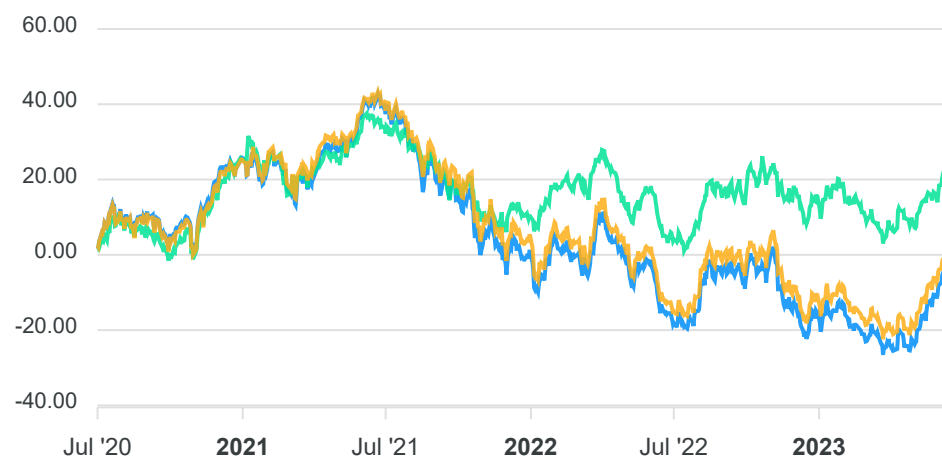
Classificação ANBIMA
 Ações Small Caps

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento em ações.

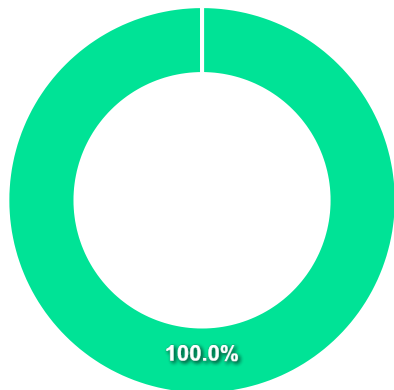
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	9,13%	14,75%	27,59%	14,75%	19,53%	-29,89%	10,66%	22,46%
Benchmark	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%		
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 BB TOP SMALL CAPS FIAÇÕES	337.918,39	100,01	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,29	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,13	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,03	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-4,20	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-7,28	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-26,82	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	337.918,39	100.01%
Valores a pagar/receber	-37,84	-0.01%

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
92

Patrimônio Líquido Fundo
424.732.955,32

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos financeiros de renda variável.

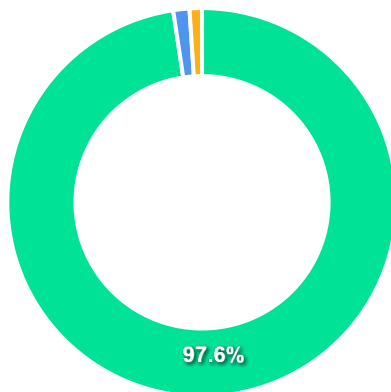
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,90%	7,32%	15,55%	7,32%	19,57%	-6,91%	7,35%	15,48%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	414.680,87	97.63%
Valores a pagar/receber	5.693,08	1.34%
Fundos de Investimento	4.373,61	1.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	52.309,82	12,32	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	27.547,11	6,49	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	27.220,61	6,41	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	19.984,95	4,71	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	17.101,30	4,03	Ações
B3 ON NM - B3SA3	16.909,45	3,98	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	16.199,87	3,81	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	14.167,03	3,34	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	13.637,16	3,21	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	10.701,00	2,52	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	9.767,80	2,30	Ações
WEG ON NM - WEGE3	9.609,49	2,26	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	7.777,59	1,83	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	7.277,43	1,71	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	7.241,14	1,70	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	6.952,92	1,64	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	6.489,95	1,53	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	6.281,35	1,48	Ações
Outros Valores a receber	6.216,72	1,46	Valores a pagar/receber
GERDAU PN N1 - GGBR4	5.532,75	1,30	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	5.448,24	1,28	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	4.434,72	1,04	Ações
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIA...	4.373,61	1,03	Fundos de Investimento
COSAN ON NM - CSAN3	4.222,75	0,99	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	4.173,40	0,98	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	4.147,98	0,98	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	4.060,82	0,96	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.

Gestão
 SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+3

Quantidade de Cotistas
 4.290

Patrimônio Líquido Fundo
 105.403.402,08

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Fundos de Mono Ação

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento os
 quais aplicam em ações de emissão da PETROBRAS.

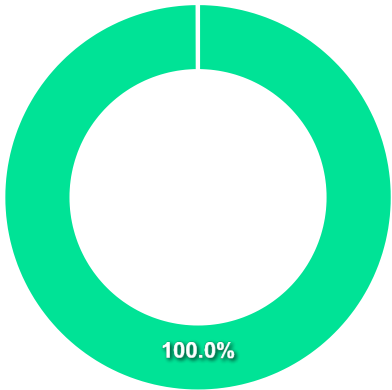
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	18,65%	34,39%	43,21%	34,39%	62,96%	126,65%	17,44%	36,72%
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 SANTANDER PETRO TOP FIAÇÕES	105.360,28	99,96	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	321,98	0,31	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-283,86	-0,27	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	105.360,28	99.96%
Valores a pagar/receber	43,12	0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,80%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+5

Quantidade de Cotistas

71

Patrimônio Líquido Fundo

117.821.298,92

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 9º, Inciso III

Benchmark

Global BDRX

Classificação ANBIMA

Ações Livre

Política de Investimento

Aplica seus recursos principalmente em BDRs nível I de empresas norte americanas de diversos setores econômicos, selecionadas aquelas com maior liquidez, através de uma gestão ativa de seu portfólio.

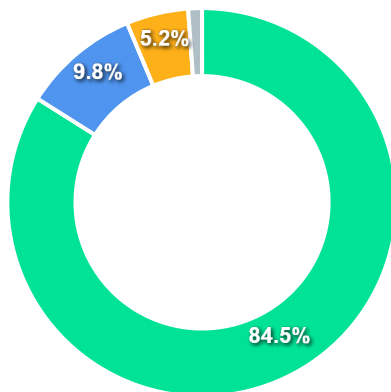
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,19%	6,42%	3,31%	6,42%	8,57%	-1,30%	5,69%	11,97%
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	99.513,63	84.46%
Investimento no Exterior	11.551,23	9.80%
Fundos de Investimento	6.099,09	5.18%
Operação compromissada	1.353,66	1.15%
Valores a pagar/receber	-696,31	-0.59%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Investimento no Exterior - BGIF US EQUI SEG POR	11.551,23	9,80	Investimento no Exterior
ISHARES CORE S&P TOTAL US STOCK MARKET ETF - BITO39	11.145,37	9,46	Brazilian Depositary Rece...
APPLE INC - AAPL34	7.661,56	6,50	Brazilian Depositary Rece...
MICROSOFT DRN - MSFT34	6.281,39	5,33	Brazilian Depositary Rece...
ISHARES CORE S&P 500 ETF - BIVB39	6.076,73	5,16	Brazilian Depositary Rece...
Cotas de ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE...	4.450,46	3,78	Fundos de Investimento
AMAZONCOM, INC - AMZO34	3.166,71	2,69	Brazilian Depositary Rece...
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	2.946,33	2,50	Brazilian Depositary Rece...
AIR PRODUCTS DRN - A1PD34	2.749,53	2,33	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	2.068,54	1,76	Brazilian Depositary Rece...
TESLA, INC - TSLA34	1.910,23	1,62	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET DRN C - GOGL35	1.813,34	1,54	Brazilian Depositary Rece...
BERKSHIRE DRN - BERK34	1.783,24	1,51	Brazilian Depositary Rece...
Cotas de ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE...	1.648,63	1,40	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2027	1.353,66	1,15	Operação compromissada
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	1.295,21	1,10	Brazilian Depositary Rece...
EXXON MOBIL DRN - EXXO34	1.290,95	1,10	Brazilian Depositary Rece...
JOHNSON DRN - JNJB34	1.240,36	1,05	Brazilian Depositary Rece...
JPMORGAN DRN - JPMC34	1.227,04	1,04	Brazilian Depositary Rece...
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MSFT34	1.193,53	1,01	Brazilian Depositary Rece...
VISA INC DRN - VISA34	1.129,96	0,96	Brazilian Depositary Rece...
LILLY DRN - LILY34	1.076,41	0,91	Brazilian Depositary Rece...
BROADCOM INC DRN - AVGO34	1.062,17	0,90	Brazilian Depositary Rece...
PROCTER & GAMBLE COMPANY - PGCO34	1.057,88	0,90	Brazilian Depositary Rece...
MASTERCARD DRN - MSCD34	958,37	0,81	Brazilian Depositary Rece...
THE HOME DEPOT, INC - HOME34	927,73	0,79	Brazilian Depositary Rece...
MERCK DRN - MRCK34	831,94	0,71	Brazilian Depositary Rece...

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.

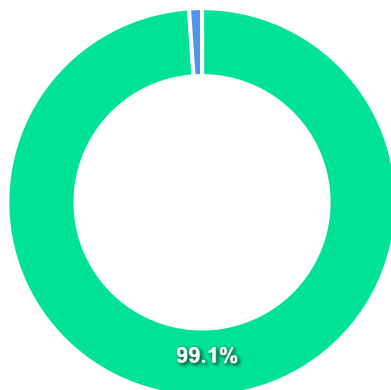
COMPARATIVO

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	2.017.559,64	99.09%
Fundos de Investimento	21.790,90	1.07%
Outros	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-3.305,54	-0.16%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
APPLE INC - AAPL34	245.184,17	12,04	Brazilian Depositary Rece...
MICROSOFT DRN - MSFT34	204.627,55	10,05	Brazilian Depositary Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	106.167,30	5,21	Brazilian Depositary Rece...
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	83.386,02	4,09	Brazilian Depositary Rece...
TESLA, INC - TSLA34	65.734,47	3,23	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET DRN C - GOGL35	56.764,97	2,79	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	56.684,29	2,78	Brazilian Depositary Rece...
GENERAL MOTORS COMPANY - GMCO34	55.344,11	2,72	Brazilian Depositary Rece...
META PLATFORMS, INC - M1TA34	50.920,05	2,50	Brazilian Depositary Rece...
TAIWANSMFAC DRN - TSMC34	42.267,18	2,08	Brazilian Depositary Rece...
LILLY DRN - LILY34	36.127,43	1,77	Brazilian Depositary Rece...
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	35.347,34	1,74	Brazilian Depositary Rece...
EXXON MOBIL DRN - EXXO34	35.226,45	1,73	Brazilian Depositary Rece...
JPMORGAN DRN - JPMC34	34.065,95	1,67	Brazilian Depositary Rece...
WALMART INC - WALM34	34.027,34	1,67	Brazilian Depositary Rece...
MASTERCARD DRN - MSCD34	29.946,75	1,47	Brazilian Depositary Rece...
BROADCOM INC DRN - AVGO34	28.687,83	1,41	Brazilian Depositary Rece...
PROCTER & GAMBLE COMPANY - PGCO34	28.375,67	1,39	Brazilian Depositary Rece...
THE HOME DEPOT, INC - HOME34	25.498,15	1,25	Brazilian Depositary Rece...
ORACLE DRN - ORCL34	25.350,01	1,24	Brazilian Depositary Rece...
CHEVRON DRN - CHVX34	24.086,84	1,18	Brazilian Depositary Rece...
MERCK DRN - MRCK34	23.797,17	1,17	Brazilian Depositary Rece...
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIA...	21.790,90	1,07	Fundos de Investimento
COCA COLA DRN - COCA34	21.017,66	1,03	Brazilian Depositary Rece...
TOYOTAMO DRN - TMC034	20.897,41	1,03	Brazilian Depositary Rece...
ABBVIE DRN - ABBV34	19.359,87	0,95	Brazilian Depositary Rece...
COSTCO WHOLESALE CORPORATION - COWC34	19.347,38	0,95	Brazilian Depositary Rece...

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **IPFM TAIACU PREF MUNC TAIACU - SP** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Junho/2023**, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **IPFM TAIACU PREF MUNC TAIACU - SP** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Junho/2023** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **IPFM TAIACU PREF MUNC TAIACU - SP** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

