

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 15 de janeiro de 2024.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.076.057,37	18,54%	503.623.885,64	0,61%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	718.685,22	4,33%	3.755.106.041,15	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	403.454,59	2,43%	1.661.635.333,21	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	71.175,13	0,43%	5.947.143.642,03	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	215.549,89	1,30%	8.254.253.931,25	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.397.930,80	8,43%	1.220.487.574,87	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.136.533,16	12,88%	4.240.209.456,14	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.834.900,15	11,06%	7.342.301.496,88	0,02%	7º I b
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	75.962,95	0,46%	32.353.129.524,43	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	907.851,55	5,47%	15.331.819.820,88	0,01%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1.268.437,65	7,64%	2.989.973.548,90	0,04%	7º III a
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	107.564,51	0,65%	217.531.840,57	0,05%	8º I
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	111.416,12	0,67%	318.520.475,19	0,03%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	649.701,95	3,92%	1.312.877.349,58	0,05%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	764.979,80	4,61%	1.826.911.890,36	0,04%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	522.819,18	3,15%	423.061.697,41	0,12%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	202.698,56	1,22%	2.036.420.590,68	0,01%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	426.454,21	2,57%	99.945.010,60	0,43%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	388.483,84	2,34%	1.566.821.792,54	0,02%	10º I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	609.280,93	3,67%	651.439.716,40	0,09%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	702.518,90	4,23%	1.134.087.211,23	0,06%	10º I

Investimentos

\$ 16.592.456,46

Disponibilidades Financeiras

\$ 6.601,22

Total Carteira

\$ 16.599.057,68

Governança (Pró Gestão)

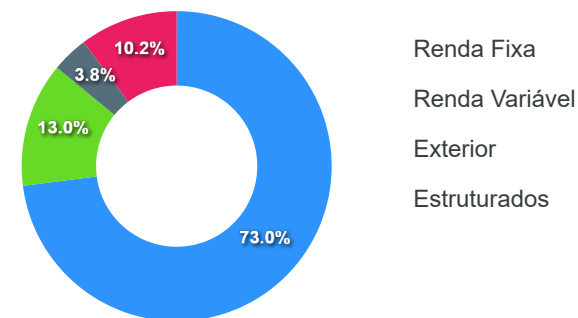
NIVEL 2 22/06/2025

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	59,85%	9.930.249,26 40,15% 6.662.207,20
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	13,12%	2.176.289,20 56,88% 9.438.430,32
8º I - Fundos de Ações	40,00%	13,00%	2.156.481,56 27,00% 4.480.501,02
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,79%	629.152,77 6,21% 1.030.092,88
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	10,25%	1.700.283,67 -0,25% -41.038,02

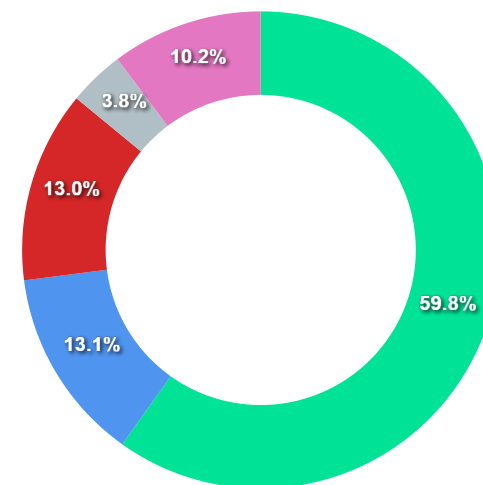
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 2 22/06/2025

Segmentos



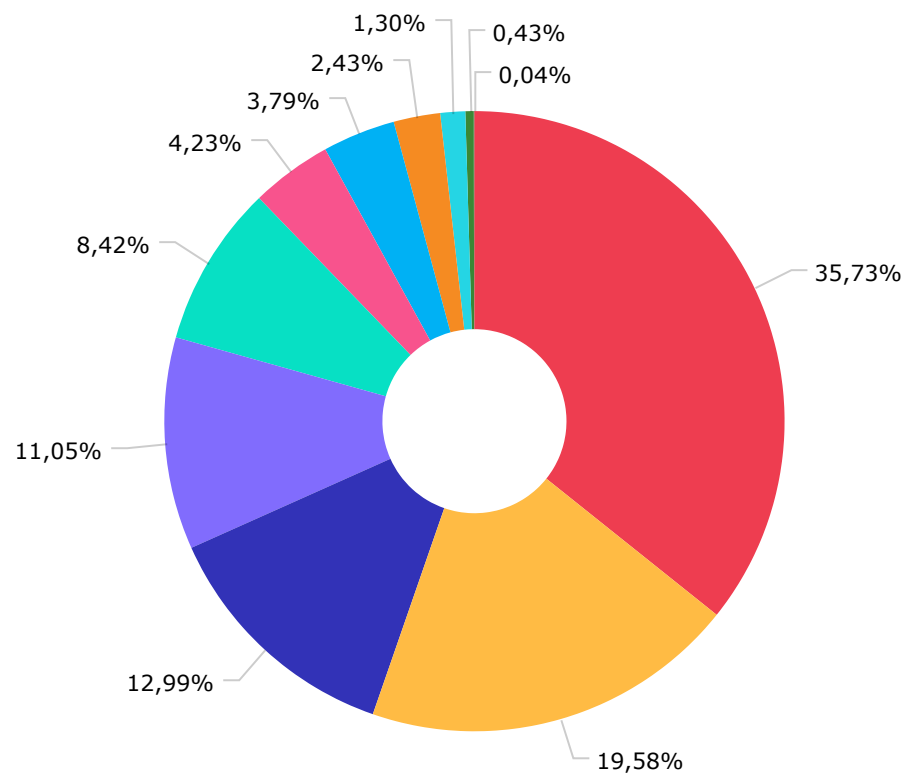
Artigos



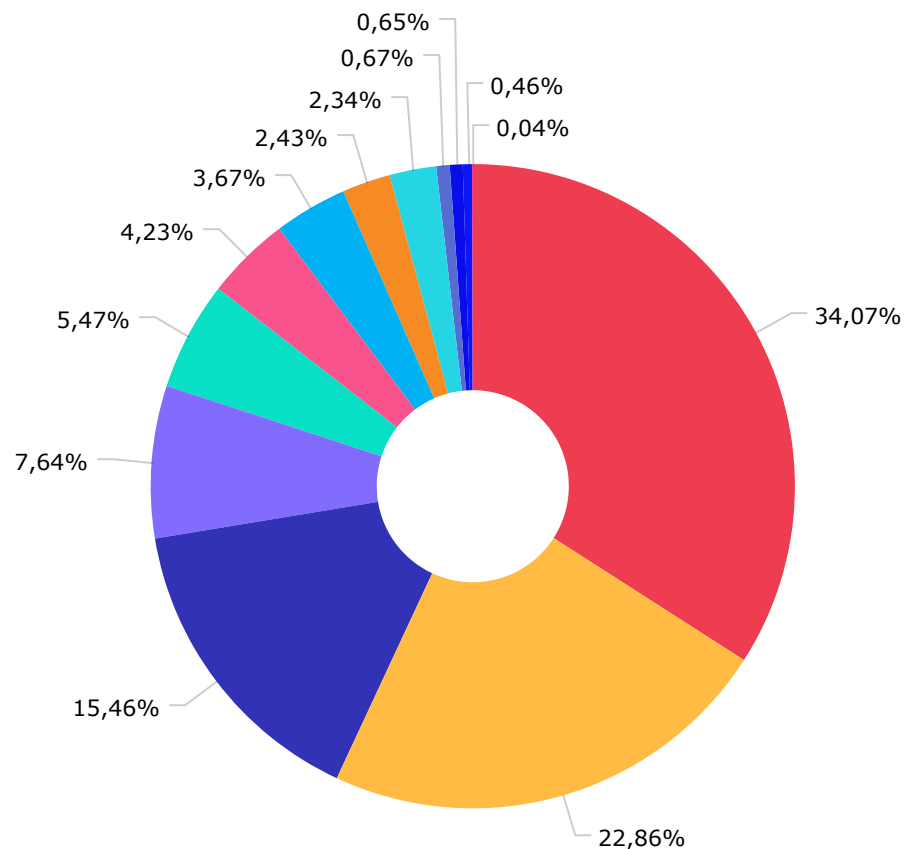
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	16.592.456,46	8º I - Fundos de Ações	13,00%	0,00%	20,00%	30,00%	2.821.255,38
7º I b - FI 100% Títulos TN	59,85%	0,00%	45,00%	100,00%	6.662.207,20	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	4.977.736,94
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	16.592.456,46	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.659.245,65
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	829.622,82	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.659.245,65
7º III a - FI Referenciados RF	13,12%	0,00%	16,00%	60,00%	7.779.184,68	9º III - Ações - BDR Nível I	3,79%	0,00%	5,00%	10,00%	1.030.092,88
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	9.955.473,88	10º I - Fundos Multimercados	10,25%	0,00%	7,00%	10,00%	-41.038,02
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	3.318.491,29	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	829.622,82
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	829.622,82	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	829.622,82
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	829.622,82	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	829.622,82
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	829.622,82	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	829.622,82

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,81	5,35	4,29	5,35	14,58	18,66	1,60	3,37
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,81	6,66	4,42	6,66	13,77	16,42	1,11	2,34
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12	6,42	3,25	6,42	13,55	23,98	0,01	0,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,30	7,10	3,67	7,10	13,07	25,65	0,28	0,60
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,85	5,11	2,48	5,11	10,63	17,47	0,00	0,00
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,48	15,14	5,90	15,14	14,44	0,60		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47	14,53	5,60	14,53	13,40	-1,43	6,60	13,89
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,11	-0,68	1,94	-0,68	1,21	-0,16	5,44	11,46
IBOVESPA - BENCHMARK	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87		
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	6,12	13,44	30,54	13,44	20,07	-11,00	10,07	21,21
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,94	10,59	13,93	10,59	19,01	5,54	6,93	14,59
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8,16	11,84	18,12	11,84	17,01	-3,57	7,14	15,03
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,27	-1,57	7,34	-1,57	13,35	-15,61	7,12	14,99
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,75	3,91	15,52	3,91	5,48	-28,99	7,86	16,55
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04	6,60	2,14	6,60	9,23	19,78	0,83	1,74
IMA-B - BENCHMARK	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35	11,24	7,06	11,24	13,32	17,31	2,12	4,47
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,37	11,20	7,03	11,20	13,18	17,03	2,17	4,56
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93	2,50	1,44	2,50	2,15	5,84	0,47	1,00
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32		

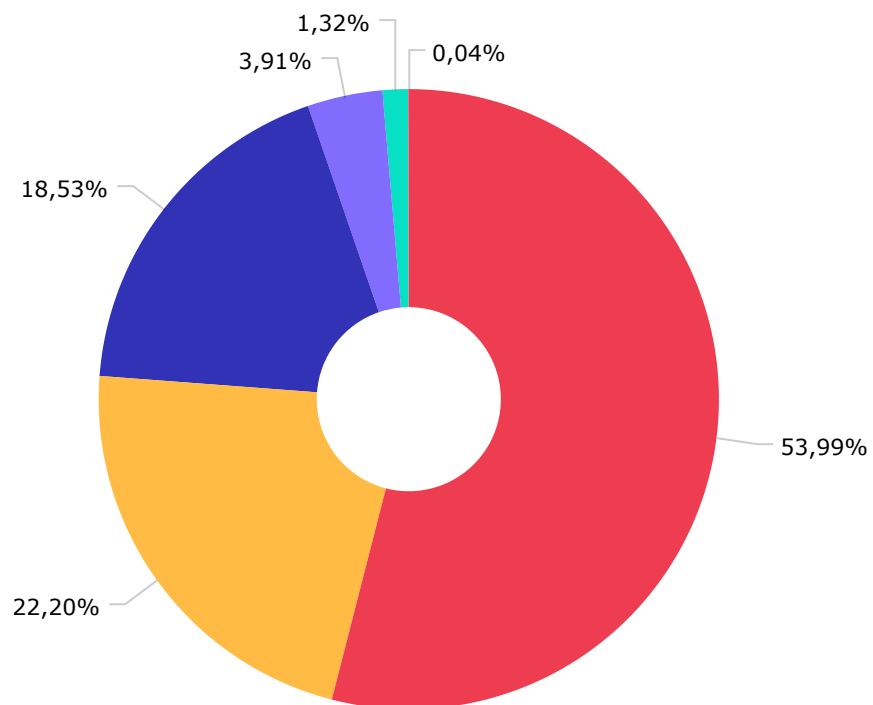
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03	7,00	2,57	7,00	10,18	21,01	0,88	1,86
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,30	14,47	10,61	14,47	15,72	12,70	3,08	6,50
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16	6,59	3,15	6,59	13,58	21,47	0,11	0,22
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	6,47	15,91	8,30	15,91	17,57	3,56		
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	6,99	20,07	10,36	20,07	28,33	20,88	5,06	10,66
IPCA + 5,00% AO ANO - BENCHMARK	0,33	5,37	2,00	5,41	8,32	27,25		
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94						0,47	1,00



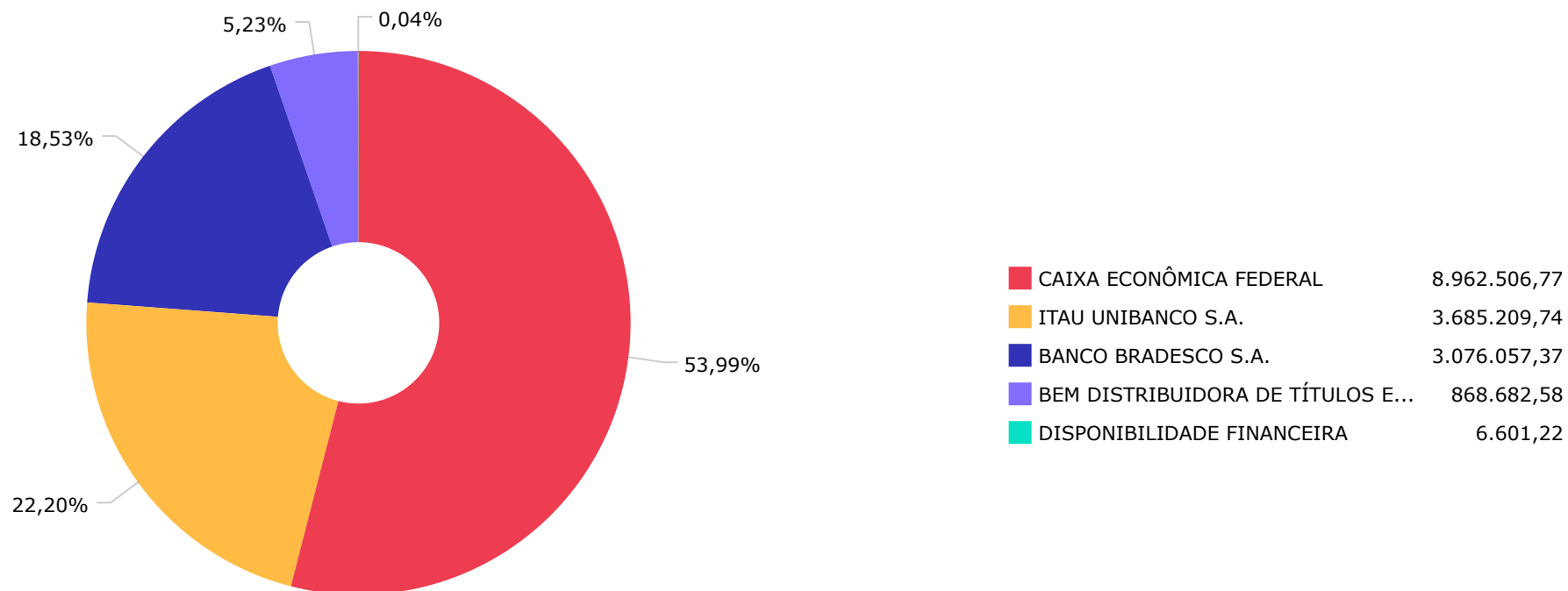
IMA-B	5.931.275,75
CDI	3.250.016,92
Ibovespa	2.156.481,56
IRF-M 1	1.834.900,15
IMA-B 5+	1.397.930,80
S&P 500 (Moeda Original)	702.518,90
Global BDRX	629.152,77
IPCA + 5,00% ao ano	403.454,59
IMA-B 5	215.549,89
IDKA IPCA 2 Anos	71.175,13
Disponibilidades Financeiras	6.601,22



Renda Fixa Indexados	5.656.089,13
Renda Fixa Duração Livre Soberano	3.794.742,59
Ações Livre	2.566.653,70
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	1.268.437,65
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	907.851,55
Multimercados Estratégia Específica	702.518,90
Multimercados Livre	609.280,93
Não classificado	403.454,59
Multimercados Macro	388.483,84
Ações Small Caps	111.416,12
Ações Dividendos	107.564,51
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	75.962,95
Disponibilidades Financeiras	6.601,22



CAIXA DTVM	8.962.506,77
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	3.685.209,74
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	3.076.057,37
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	649.701,95
4UM GESTÃO DE RECURSOS LTDA	218.980,63
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	6.601,22



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	17.157.693,27	1.403.917,70	1.642.722,81	17.178.621,59	259.733,43	259.733,43	1,51% ▲	1,51%	0,95%	0,95%	158,95%	3,34%
Fevereiro	17.178.621,59	2.042.259,41	2.529.356,57	16.586.363,71	-105.160,72	154.572,71	-0,61% ▼	0,89%	1,19%	2,15%	41,40%	3,24%
Março	16.586.363,71	2.244.568,00	2.259.325,23	16.683.511,46	111.904,98	266.477,69	0,67% ▲	1,57%	1,15%	3,32%	47,29%	2,70%
Abril	16.683.511,46	3.331.541,90	3.826.022,25	16.312.633,33	123.602,22	390.079,91	0,74% ▲	2,33%	0,95%	4,31%	54,06%	2,53%
Maio	16.312.633,33	5.670.106,38	6.093.812,67	16.118.992,86	230.065,82	620.145,73	1,41% ▲	3,77%	0,65%	4,99%	75,55%	1,96%
Junho	16.118.992,86	6.091.608,53	6.013.031,32	16.592.456,46	394.886,39	1.015.032,12	2,44% ▲	6,30%	0,32%	5,32%	118,42%	2,50%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	266.477,69	1,57%	3,32%
2º Trim	748.554,43	4,65%	1,93%
1º Sem	1.015.032,12	6,30%	5,32%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

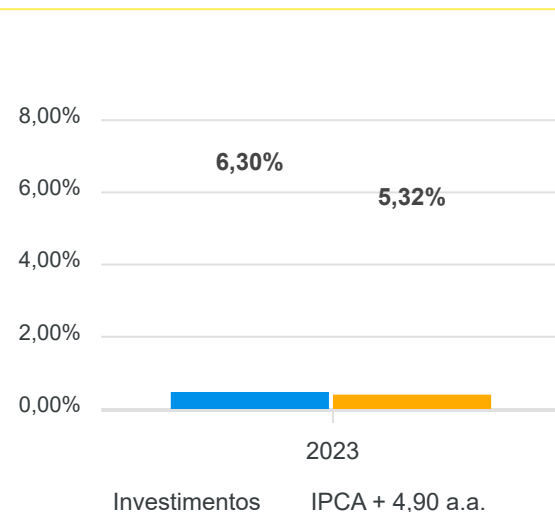
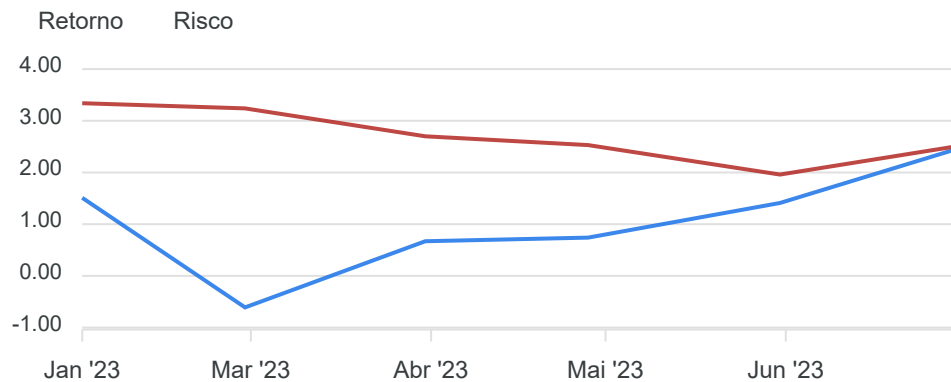
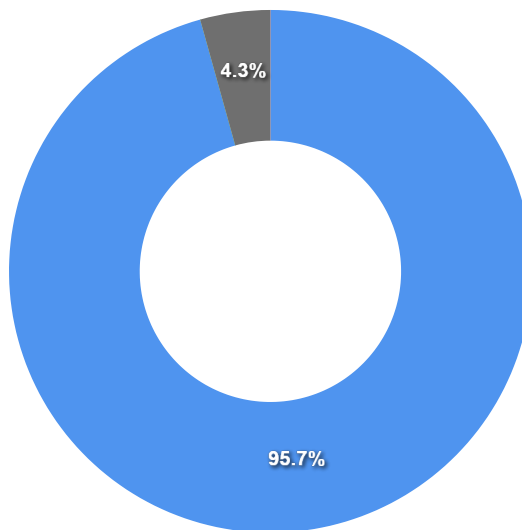


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 30/06/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	15.880.372,46	95,67
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	718.685,22	4,33
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



RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENTA FIXA	2.396.492,56	0,00	2.402.852,51	0,00	6.359,95	0,27% ▲	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	712.052,73	0,00	0,00	718.685,22	6.632,49	0,93% ▲	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	399.701,54	0,00	0,00	403.454,59	3.753,05	0,94% ▲	0,47%
CAIXA BRASIL FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI LP	250.945,89	650.000,00	0,00	907.851,55	6.905,66	0,77% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	2.078.079,21	0,00	2.019.050,56	71.175,13	12.146,48	0,58% ▲	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	213.349,08	0,00	0,00	215.549,89	2.200,81	1,03% ▲	0,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	665.997,70	700.000,00	0,00	1.397.930,80	31.933,10	2,34% ▲	3,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	986.227,99	1.115.737,51	0,00	2.136.533,16	34.567,66	1,64% ▲	2,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	2.832.046,63	0,00	1.025.000,00	1.834.900,15	27.853,52	0,98% ▲	0,11%
CAIXA PRÁTICO FIC RENTA FIXA CURTO PRAZO	23.493,92	595.871,02	544.670,25	75.962,95	1.268,26	0,20% ▲	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENTA FIXA LP	1.252.186,57	0,00	0,00	1.268.437,65	16.251,08	1,30% ▲	0,28%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENTA FIXA	0,00	3.030.000,00	0,00	3.076.057,37	46.057,37	1,52% ▲	2,17%
	11.810.573,82	6.091.608,53	5.991.573,32	12.106.538,46	195.929,43	1,64%	1,39%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	100.585,77	0,00	0,00	107.564,51	6.978,74	6,94% ▲	6,93%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	104.987,56	0,00	0,00	111.416,12	6.428,56	6,12% ▲	10,07%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	600.684,79	0,00	0,00	649.701,95	49.017,16	8,16% ▲	7,14%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	726.711,00	0,00	0,00	764.979,80	38.268,80	5,27% ▲	7,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	485.231,83	0,00	0,00	522.819,18	37.587,35	7,75% ▲	7,86%
-	2.018.200,95	0,00	0,00	2.156.481,56	138.280,61	6,85%	7,45%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	381.565,65	0,00	0,00	388.483,84	6.918,19	1,81% ▲	1,11%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	598.435,11	0,00	0,00	609.280,93	10.845,82	1,81% ▲	1,60%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	656.627,14	0,00	0,00	702.518,90	45.891,76	6,99% ▲	5,06%
-	1.636.627,90	0,00	0,00	1.700.283,67	63.655,77	3,89%	2,92%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	20.599,68	0,00	21.458,00	0,00	858,32	4,17% ▲	14,96%
-	20.599,68	0,00	21.458,00	0,00	858,32	4,17%	0,00%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	201.754,17	0,00	0,00	202.698,56	944,39	0,47% ▲	6,60%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	431.236,34	0,00	0,00	426.454,21	-4.782,13	-1,11% ▼	5,44%
	632.990,51	0,00	0,00	629.152,77	-3.837,74	-0,61%	2,13%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	3.183.251,45	0,00	3.236.601,22	0,00	53.349,77	1,68% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	3.030.000,00	0,00	3.076.057,37	46.057,37	1,52% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	733.691,99	0,00	745.343,08	0,00	11.651,09	1,59% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	708.488,20	0,00	0,00	718.685,22	10.197,02	1,44% ▲
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	400.000,00	0,00	403.454,59	3.454,59	0,86% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	245.762,79	650.000,00	0,00	907.851,55	12.088,76	1,35% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.055.852,09	0,00	2.019.050,56	71.175,13	34.373,60	1,67% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.495.977,46	0,00	1.298.467,34	215.549,89	18.039,77	1,21% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	621.976,16	700.000,00	0,00	1.397.930,80	75.954,64	5,75% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	178.133,74	1.915.737,51	0,00	2.136.533,16	42.661,91	2,04% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.403.909,15	1.947.083,86	1.582.457,01	1.834.900,15	66.364,15	1,98% ▲
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	20.527,18	5.650.435,44	5.607.761,84	75.962,95	12.762,17	0,23% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1.223.586,99	0,00	0,00	1.268.437,65	44.850,66	3,67% ▲
	11.871.157,20	14.293.256,81	14.489.681,05	12.106.538,46	431.805,50	3,64%

RENDÁ VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	107.564,51	7.564,51	7,56% ▲
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	111.416,12	11.416,12	11,42% ▲
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.212.574,11	0,00	1.233.748,71	0,00	21.174,60	1,75% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	600.000,00	0,00	649.701,95	49.701,95	8,28% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	712.676,51	0,00	0,00	764.979,80	52.303,29	7,34% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	452.578,30	0,00	0,00	522.819,18	70.240,88	15,52% ▲
	2.377.828,92	800.000,00	1.233.748,71	2.156.481,56	212.401,35	8,93%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	372.043,21	0,00	0,00	388.483,84	16.440,63	4,42% ▲
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	584.205,86	0,00	0,00	609.280,93	25.075,07	4,29% ▲
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	636.586,13	0,00	0,00	702.518,90	65.932,77	10,36% ▲
	1.592.835,20	0,00	0,00	1.700.283,67	107.448,47	6,75%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	231.428,25	0,00	209.436,48	0,00	-21.991,77	-9,50% ▼
	231.428,25	0,00	209.436,48	0,00	-21.991,77	-9,50%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	191.943,90	0,00	0,00	202.698,56	10.754,66	5,60% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	418.317,99	0,00	0,00	426.454,21	8.136,22	1,94% ▲
	610.261,89	0,00	0,00	629.152,77	18.890,88	3,10%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	3.051.812,16	0,00	3.236.601,22	0,00	184.789,06	6,06% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	3.030.000,00	0,00	3.076.057,37	46.057,37	1,52% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	707.984,66	0,00	745.343,08	0,00	37.358,42	5,28% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	701.148,94	0,00	20.804,21	718.685,22	38.340,49	5,47% ▲
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	400.000,00	0,00	403.454,59	3.454,59	0,86% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.166,72	2.835.101,02	1.947.809,74	907.851,55	19.393,55	0,68% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	186.552,95	0,00	188.485,36	0,00	1.932,41	1,04% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.969.797,03	0,00	2.019.050,56	71.175,13	120.428,66	6,11% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.433.972,36	0,00	1.298.467,34	215.549,89	80.044,87	5,58% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	600.972,04	700.000,00	0,00	1.397.930,80	96.958,76	7,45% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	171.437,61	1.915.737,51	0,00	2.136.533,16	49.358,04	2,36% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.123.964,01	2.111.250,48	2.523.483,10	1.834.900,15	123.168,76	2,91% ▲
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	6.266,12	8.991.912,91	8.941.041,05	75.962,95	18.824,97	0,21% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1.184.337,88	0,00	0,00	1.268.437,65	84.099,77	7,10% ▲
	12.139.412,48	19.984.001,92	20.921.085,66	12.106.538,46	904.209,72	7,45%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	107.564,51	7.564,51	7,56% ▲
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	111.416,12	11.416,12	11,42% ▲
BRANCO SELECTION FIC AÇÕES	1.313.895,49	0,00	1.233.748,71	0,00	-80.146,78	-6,10% ▼
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	600.000,00	0,00	649.701,95	49.701,95	8,28% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	777.161,61	0,00	0,00	764.979,80	-12.181,81	-1,57% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	503.159,37	0,00	0,00	522.819,18	19.659,81	3,91% ▲
	2.594.216,47	800.000,00	1.233.748,71	2.156.481,56	-3.986,20	-0,15%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	364.220,90	0,00	0,00	388.483,84	24.262,94	6,66% ▲
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	578.330,82	0,00	0,00	609.280,93	30.950,11	5,35% ▲
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	585.098,43	0,00	0,00	702.518,90	117.420,47	20,07% ▲
	1.527.650,15	0,00	0,00	1.700.283,67	172.633,52	11,30%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	290.056,74	0,00	209.436,48	0,00	-80.620,26	-27,79% ▼
	290.056,74	0,00	209.436,48	0,00	-80.620,26	-27,79%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	176.982,98	0,00	0,00	202.698,56	25.715,58	14,53% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	429.374,45	0,00	0,00	426.454,21	-2.920,24	-0,68% ▼
	606.357,43	0,00	0,00	629.152,77	22.795,34	3,76%

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

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,20%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+1

Quantidade de Cotistas

86

Patrimônio Líquido Fundo

503.623.885,64

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark

IMA-B

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento

Aplica seus recursos, através de outros fundos, em oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

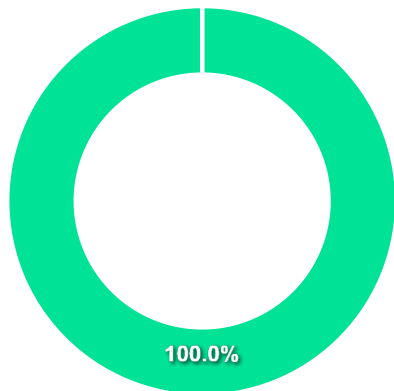
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,20%	7,03%	11,20%	13,18%	17,03%	2,17%	4,56%
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 Fundos / BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI FINANCEIR...	271.012,56	100,01	Outros
Outros Valores a receber	13,98	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-57,40	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	271.012,56	100.01%
Valores a pagar/receber	-33,43	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA DTVM
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
301
Patrimônio Líquido Fundo
3.755.106.041,15

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IMA-B
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento
Aplica seus recursos em um único ativo, uma NTN-B com vencimento em 2024.

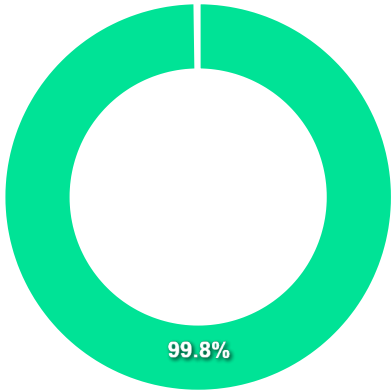
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,93%	2,50%	1,44%	2,50%	2,15%	5,84%	0,47%	1,00%
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
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	4.068.361,17	99,78	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2028	9.205,59	0,23	Operação compromissada
Outros Valores a receber	23,85	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,79	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-153,58	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.068.361,17	99.78%
Operação compromissada	9.205,59	0.23%
Valores a pagar/receber	-118,94	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

Taxa de Administração
 0,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 180

Patrimônio Líquido Fundo
 1.661.635.333,21

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IPCA + 5,00% ao ano

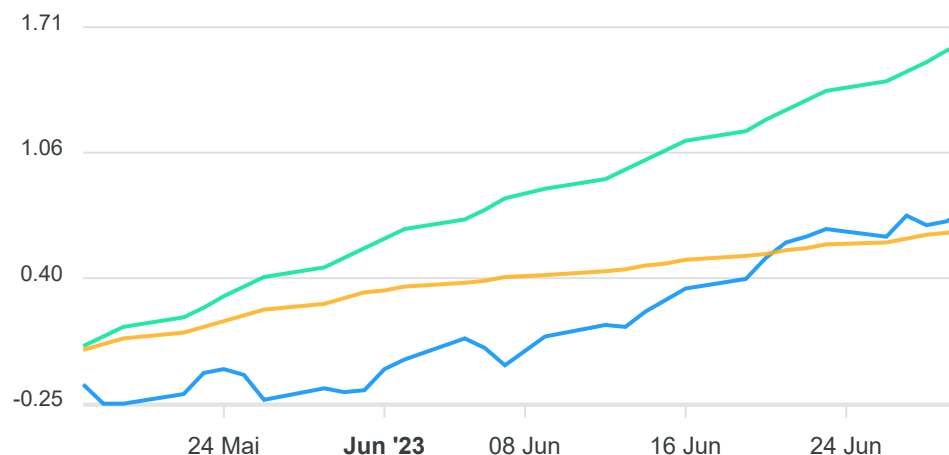
Classificação ANBIMA
 Não classificado

Política de Investimento
 Não informado

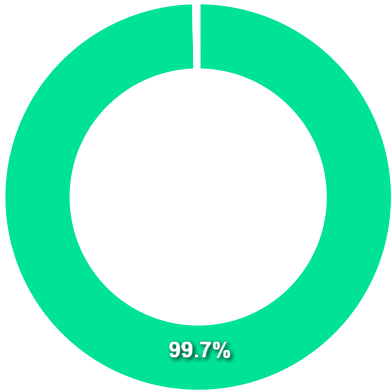
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,94%	-%	-%	-%	-%	-%	0,47%	1,00%
Benchmark	0,33%	5,37%	2,00%	5,41%	8,32%	27,25%		
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 (BRSTNCNTB096)	2.361.458,13	99,66	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2028	7.969,96	0,34	Operação compromissada
Outros Valores a receber	23,85	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,33	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-63,55	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.361.458,13	99.66%
Operação compromissada	7.969,96	0.34%
Valores a pagar/receber	-29,37	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 901

Patrimônio Líquido Fundo
 5.947.143.642,03

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IDKA IPKA 2 Anos

Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

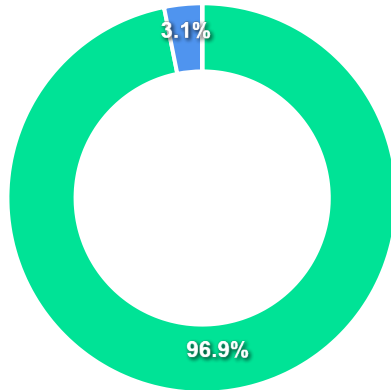
COMPARATIVO

30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	1.949.687,47	61,69	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	1.106.409,59	35,01	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2025	99.345,07	3,14	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/06/2030	3.946,51	0,12	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2029	1.100,50	0,03	Títulos Federais
Outros Valores a receber	19,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	11,13	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-35,05	0,00	Outros
Outros Valores a pagar	-220,45	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.061.144,07	96.86%
Operação compromissada	99.345,07	3.14%
Outros	-35,05	-0.00%
Valores a pagar/receber	-189,36	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 927

Patrimônio Líquido Fundo
 8.254.253.931,25

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IMA-B 5

Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

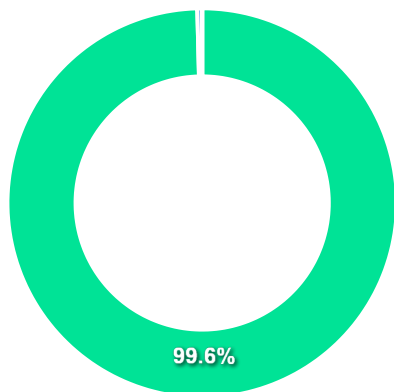
COMPARATIVO

30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.566.546,65	27,75	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	1.494.202,09	26,46	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	1.336.082,77	23,66	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	870.425,70	15,42	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029	333.510,32	5,91	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	22.554,72	0,40	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2026	12.800,06	0,23	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030	8.580,72	0,15	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.707,60	0,03	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	54,28	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	19,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-301,28	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.623.855,91	99.60%
Operação compromissada	22.554,72	0.40%
Valores a pagar/receber	-227,04	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

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.

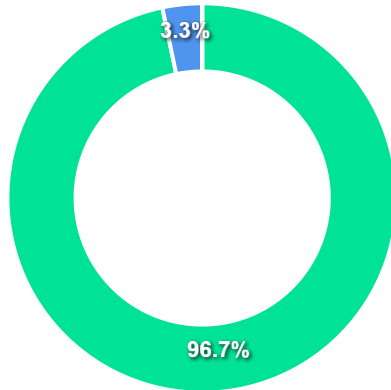
COMPARATIVO

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



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	152.685,48	21,92	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	126.390,33	18,14	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	103.129,81	14,81	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	80.160,96	11,51	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	74.678,19	10,72	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	55.706,48	8,00	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	45.223,26	6,49	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	35.750,99	5,13	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2025	22.875,98	3,28	Operação compromissada
Outros Valores a receber	17,80	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,84	0,00	Valores a pagar/receber
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	0,00	0,00	Títulos Federais
Outros Valores a pagar	-48,54	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	673.725,50	96.72%
Operação compromissada	22.875,98	3.28%
Valores a pagar/receber	-19,90	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 723

Patrimônio Líquido Fundo
 4.240.209.456,14

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IMA-B

Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

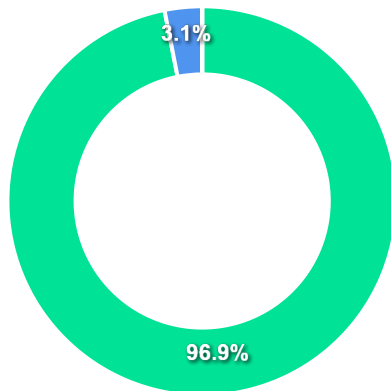
COMPARATIVO

30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.207.960,11	96.90%
Operação compromissada	70.760,70	3.11%
Valores a pagar/receber	-111,38	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	277.337,83	12,17	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	269.460,88	11,83	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	240.946,10	10,57	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	229.576,19	10,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	218.812,02	9,60	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	187.323,34	8,22	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	156.971,26	6,89	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	145.603,68	6,39	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	136.089,21	5,97	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	117.492,34	5,16	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	101.577,16	4,46	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2025	70.760,70	3,11	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	64.933,67	2,85	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029	60.146,08	2,64	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.690,35	0,07	Títulos Federais
Outros Valores a receber	19,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,49	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-141,82	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 1.186

Patrimônio Líquido Fundo
 7.342.301.496,88

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IRF-M 1

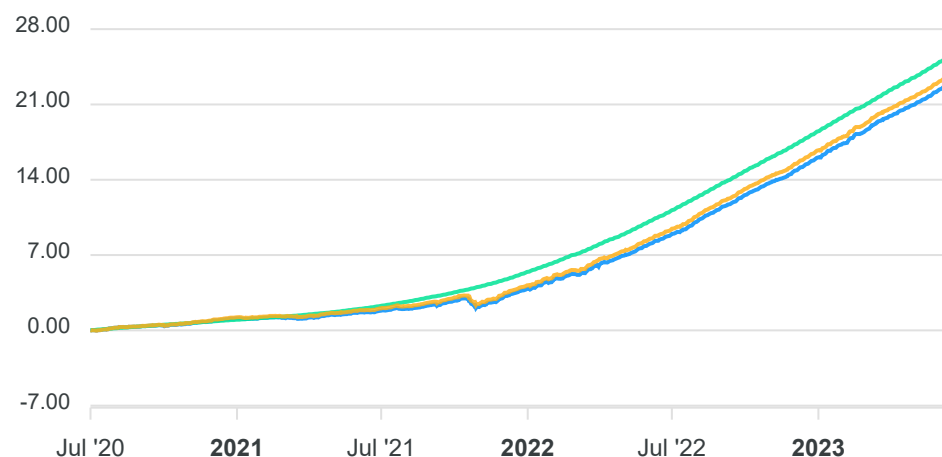
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

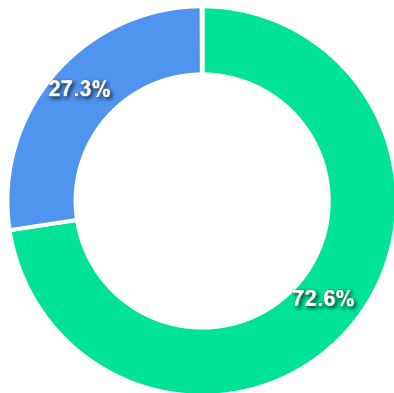
COMPARATIVO

30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	6.622.654,88	72.61%
Títulos Federais	2.494.298,27	27.35%
Valores a pagar/receber	4.185,17	0.05%
Derivativos	4,87	0.00%
Outros	-409,23	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2029	6.622.654,88	72,61	Operação compromissada
LTN - Venc.: 01/01/2026	922.447,38	10,11	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2025	734.810,52	8,06	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026	305.764,73	3,35	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	231.284,83	2,54	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2026	186.375,97	2,04	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027	86.206,60	0,95	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028	27.408,24	0,30	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	5.042,43	0,06	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	19,96	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF26	4,87	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-0,66	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-39,53	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-369,04	0,00	Outros
Outros Valores a pagar	-877,21	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

Taxa de Administração
 1,70%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 16.763

Patrimônio Líquido Fundo
 32.353.129.524,43

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 CDI

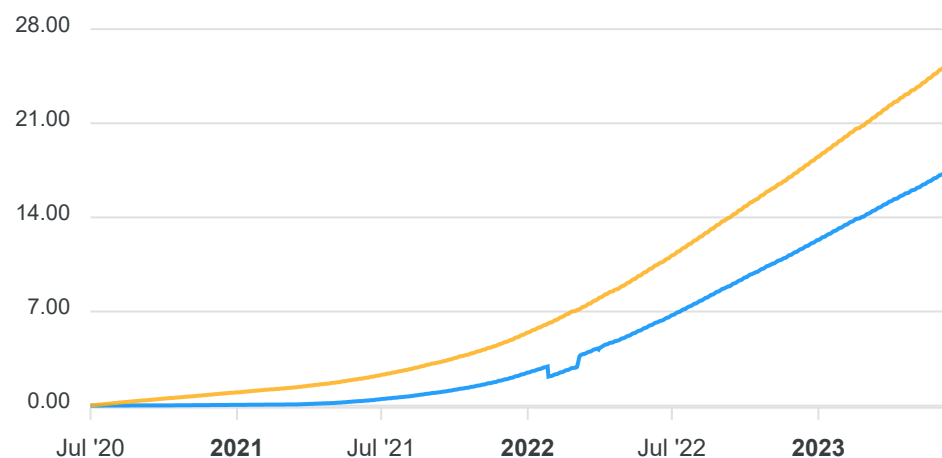
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Baixa Soberano

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimentos cujas carteiras sejam compostas por títulos públicos federais de até 375 dias e prazo médio da carteira inferior a 60 dias.

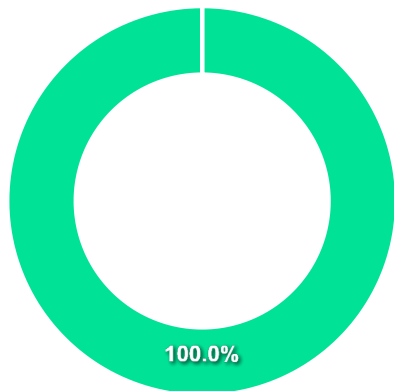
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,85%	5,11%	2,48%	5,11%	10,63%	17,47%	0,00%	0,00%
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 Fundos / CAIXA MASTER LIQUIDEZ II FUNDO DE INVEST...	8.092.413,14	100,02	Outros
Outros Valores a receber	20,03	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.584,02	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	8.092.413,14	100.02%
Valores a pagar/receber	-1.563,99	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.004

Patrimônio Líquido Fundo
15.331.819.820,88

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

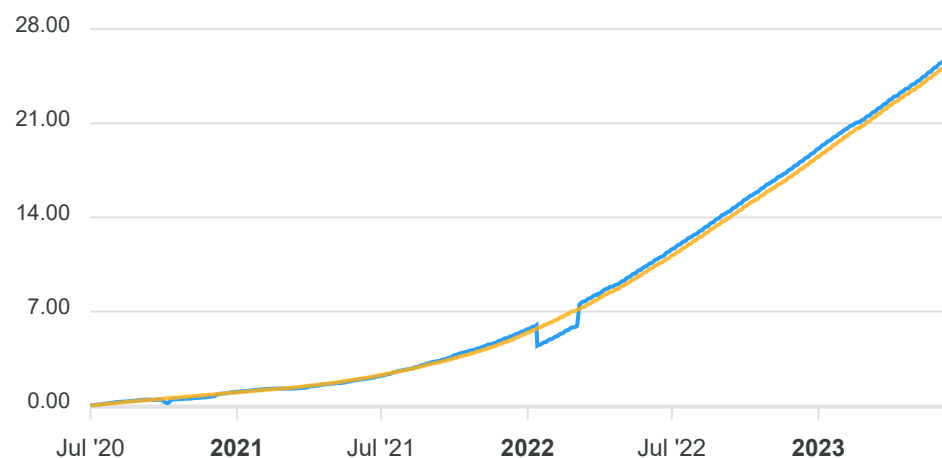
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em ativos financeiros que sejam considerados de baixo risco de crédito e classificados por agência de risco registrada na CVM.

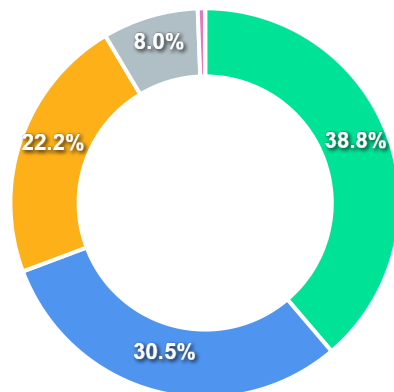
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,12%	6,42%	3,25%	6,42%	13,55%	23,98%	0,01%	0,02%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Privados	9.716.180,20	38.77%
Operação compromissada	7.649.300,74	30.52%
Títulos Federais	5.551.875,93	22.15%
Debêntures	1.992.597,80	7.95%
Outros	150.689,68	0.60%
Valores a pagar/receber	3.243,60	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2027	7.649.300,74	30,52	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2027	1.913.631,26	7,64	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	1.353.398,81	5,40	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028	818.801,91	3,27	Títulos Federais
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	718.989,19	2,87	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2026	655.528,66	2,62	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	505.945,61	2,02	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	495.391,92	1,98	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-9...	495.339,17	1,98	Títulos Privados
Letra Financeira - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305...	419.953,84	1,68	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2026	412.275,30	1,64	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	394.889,01	1,58	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - ...	360.628,01	1,44	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	334.082,66	1,33	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001...	331.699,88	1,32	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Ve...	317.890,92	1,27	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	306.097,22	1,22	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2028	279.592,55	1,12	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	268.404,24	1,07	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	259.567,91	1,04	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Ve...	238.437,00	0,95	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	226.382,36	0,90	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	226.095,54	0,90	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-9...	139.243,94	0,56	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - ...	133.121,32	0,53	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	131.857,27	0,53	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	128.748,10	0,51	Títulos Privados

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

Taxa de Administração
 0,50%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 233

Patrimônio Líquido Fundo
 2.989.973.548,90

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
 CDI

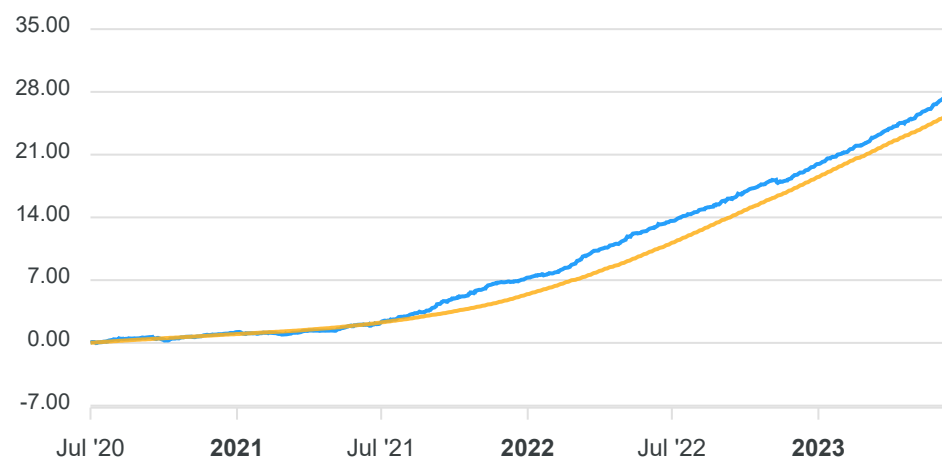
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento
 classificados como Renda Fixa.

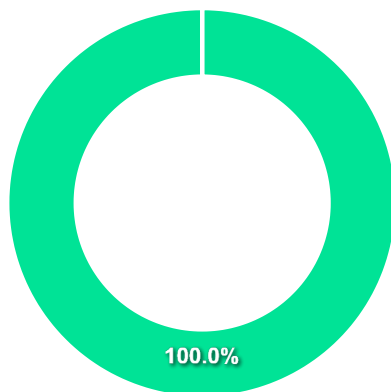
COMPARATIVO

 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,30%	7,10%	3,67%	7,10%	13,07%	25,65%	0,28%	0,60%
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 Fundos / ITAÚ INSTITUCIONAL JANEIRO RENDA FIXA LO...	615.615,78	29,73	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ INSTITUCIONAL ALVORADA RF LP FIF - ...	569.314,88	27,50	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ LEGEND INSTITUCIONAL RENDA FIXA LON...	433.993,71	20,96	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ AURORA YIELD PLUS INSTITUCIONAL FIF...	251.906,32	12,17	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ INSTITUCIONAL ARTAX RENDA FIXA LONG...	140.669,47	6,79	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ DELTA II INSTITUCIONAL FUNDO DE INV...	50.878,08	2,46	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	7.308,76	0,35	Outros
Outros Valores a receber	6.515,78	0,31	Valores a pagar/receber
Cotas de Fundos / ITAÚ GOLF RENDA FIXA LONGO PRAZO INSTITU...	1.576,92	0,08	Outros
Outras Disponibilidades	53,25	0,00	Valores a pagar/receber
Cotas de Fundos / ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS RENDA FIXA LO...	25,25	0,00	Outros
Outros Valores a pagar	-7.474,49	-0,36	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	2.071.289,16	100.04%
Valores a pagar/receber	-905,46	-0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
LTDA

Gestão
4UM GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
475

Patrimônio Líquido Fundo
217.531.840,57

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Dividendos

Política de Investimento
Aplica, preponderantemente, em ações de companhias abertas pagadoras de bons dividendos com base em uma gestão ativa e uma diversificação adequada de sua carteira.

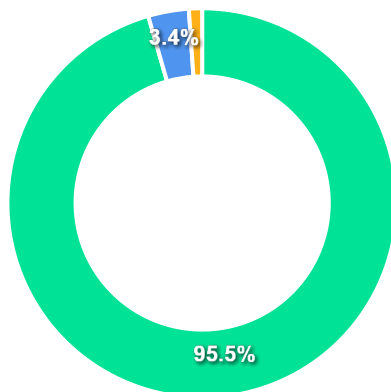
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	6,94%	10,59%	13,93%	10,59%	19,01%	5,54%	6,93%	14,59%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	283.671,39	95.53%
Operação compromissada	10.022,75	3.38%
Valores a pagar/receber	3.249,15	1.09%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
PETROBRAS PN - PETR4	10.364,00	3,49	Ações
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2027	10.022,75	3,38	Operação compromissada
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CMIG4	9.865,02	3,32	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - GGBR4	8.920,13	3,00	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	8.054,60	2,71	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBAS3	7.911,27	2,66	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	7.731,22	2,60	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	7.536,86	2,54	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	7.381,79	2,49	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	7.034,79	2,37	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	6.907,97	2,33	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	6.840,22	2,30	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CPLE6	6.723,35	2,26	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CMIN3	6.708,18	2,26	Ações
VALE ON N1 - VALE3	6.362,19	2,14	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBSE3	6.094,61	2,05	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TIMS3	6.063,35	2,04	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - JBSS3	5.966,54	2,01	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VIVT3	5.827,97	1,96	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TAEE11	5.508,90	1,86	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	5.454,80	1,84	Ações
SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	5.341,17	1,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CXSE3	5.234,99	1,76	Ações
SANEPAR UNT N2 - SAPR11	5.113,25	1,72	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - FLRY3	4.780,80	1,61	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	4.469,49	1,51	Ações
WHIRLPOOL PN - WHRL4	4.386,52	1,48	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
 LTDA

Gestão
 4UM GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+20

Quantidade de Cotistas
 758

Patrimônio Líquido Fundo
 318.520.475,19

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

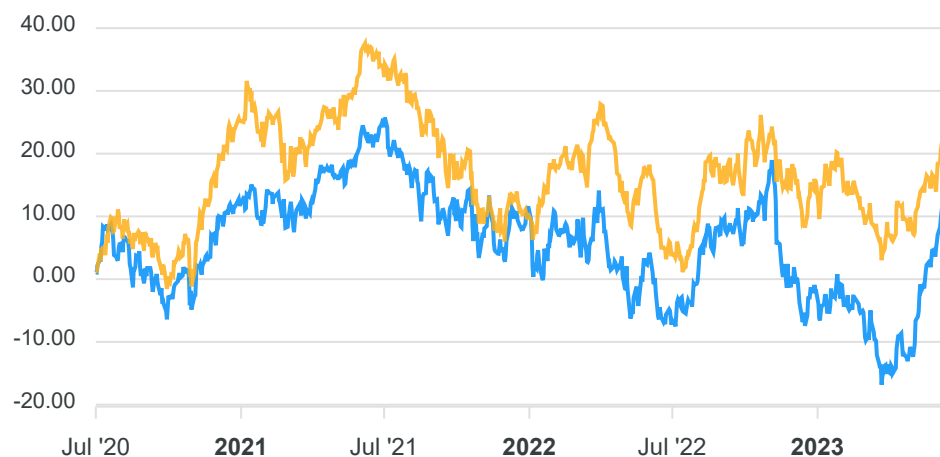
Classificação ANBIMA
 Ações Small Caps

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, em ações de emissão de
 companhias abertas de baixa e média capitalização de mercado e
 expressivo potencial de valorização no longo prazo, com base em
 uma gestão ativa e uma diversificação adequada de sua carteira.

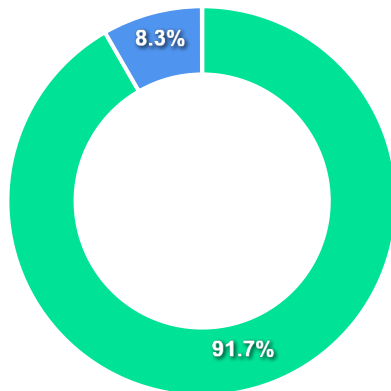
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	6,12%	13,44%	30,54%	13,44%	20,07%	-11,00%	10,07%	21,21%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	375.698,43	91.68%
Operação compromissada	34.007,39	8.30%
Valores a pagar/receber	98,11	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALID ON NM - VLID3	60.309,18	14,72	Ações
BEMOBI TECH ON NM - BMOB3	60.122,67	14,67	Ações
LOG COM PROPON NM - LOGG3	47.017,99	11,47	Ações
VITTIA ON NM - VITT3	41.458,55	10,12	Ações
RANDON PART PN N1 - RAPT4	34.919,97	8,52	Ações
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2028	34.007,39	8,30	Operação compromissada
TUPY ON NM - TUPY3	31.919,91	7,79	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EZTC3	23.501,60	5,73	Ações
EZTEC ON NM - EZTC3	23.366,61	5,70	Ações
OCEANPACT ON NM - OPCT3	19.560,80	4,77	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TUPY3	15.531,82	3,79	Ações
UNICASA ON NM - UCAS3	6.452,48	1,57	Ações
RODOBENSIMOB ON NM - RDNI3	4.267,25	1,04	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RAPT4	4.079,30	1,00	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VLID3	1.253,13	0,31	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - LOGG3	1.109,44	0,27	Ações
Outros Valores a receber	985,86	0,24	Valores a pagar/receber
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BMOB3	623,51	0,15	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VITT3	204,20	0,05	Ações
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-897,75	-0,22	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
 LTDA

Gestão
 CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+15

Quantidade de Cotistas
 2.815

Patrimônio Líquido Fundo
 1.312.877.349,58

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

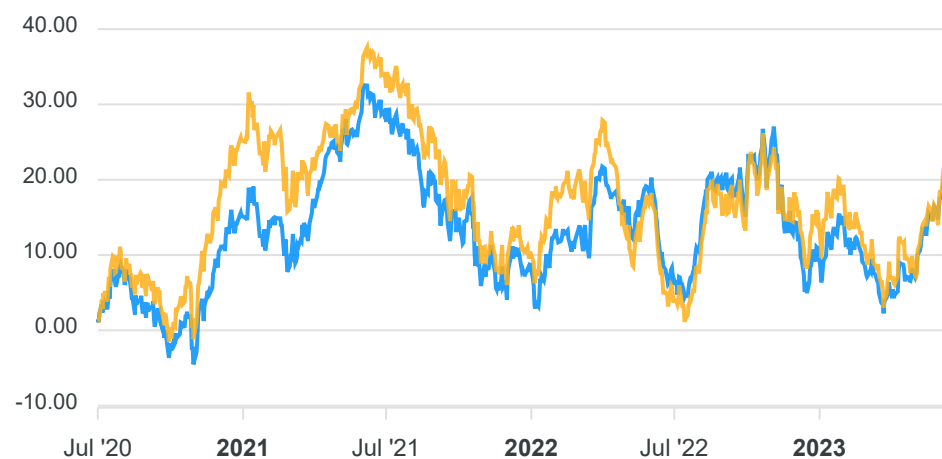
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

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

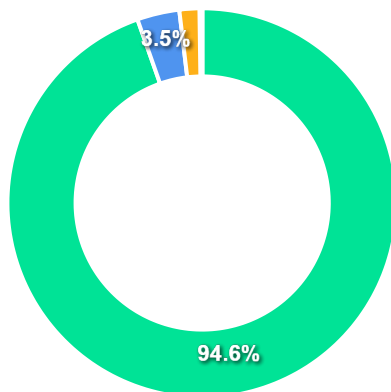
COMPARATIVO

30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	998.134,98	94.61%
Operação compromissada	37.042,89	3.51%
Valores a pagar/receber	17.479,06	1.66%
Títulos Federais	1.613,84	0.15%
Derivativos	760,94	0.07%
Brazilian Depositary Receipts	0,18	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SBSP3	37.933,87	3,60	Ações
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2027	37.042,89	3,51	Operação compromissada
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBSE3	35.304,04	3,35	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TAEE11	34.767,73	3,30	Ações
NEOENERGIA ON ATZ NM - NEOE3	34.208,00	3,24	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CMIG4	31.235,91	2,96	Ações
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	26.975,72	2,56	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ELET3	26.334,15	2,50	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CPFE3	23.944,73	2,27	Ações
3TENTOS ON NM - TTEN3	22.719,65	2,15	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CXSE3	22.111,53	2,10	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BRFS3	21.427,26	2,03	Ações
JBS ON NM - JBSS3	19.004,71	1,80	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	17.392,81	1,65	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ISAE4	16.802,74	1,59	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CPLE6	16.420,35	1,56	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PSSA3	15.801,34	1,50	Ações
Outros Valores a receber	15.604,56	1,48	Valores a pagar/receber
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	15.364,57	1,46	Ações
PORTO SEGURO ON NM - PSSA3	15.344,64	1,45	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - KLBN11	15.271,14	1,45	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ABEV3	14.662,48	1,39	Ações
VALID ON NM - VLID3	14.651,12	1,39	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - JBSS3	13.897,37	1,32	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MRFG3	13.141,42	1,25	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EGIE3	13.091,68	1,24	Ações
TEGMA ON NM - TGMA3	12.789,67	1,21	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

Taxa de Administração
 1,90%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+24

Quantidade de Cotistas
 17.026

Patrimônio Líquido Fundo
 1.502.509.907,38

Patrimônio Líquido Master
 1.826.911.890,36

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

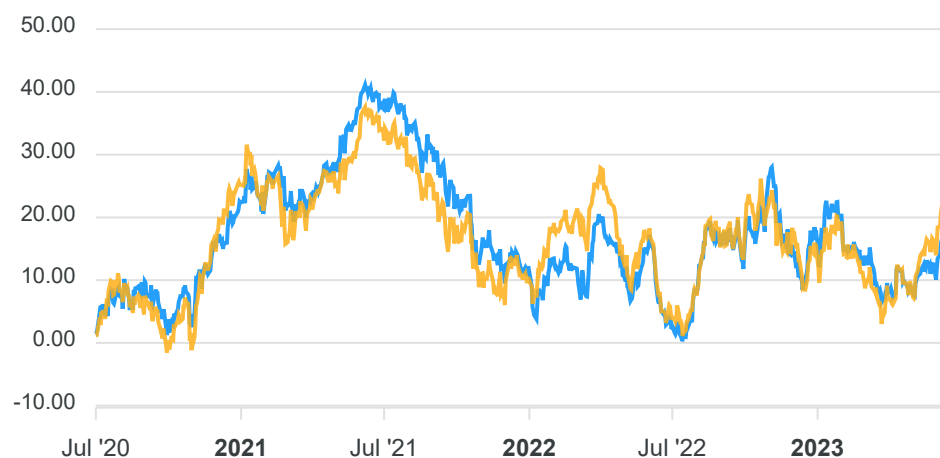
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

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

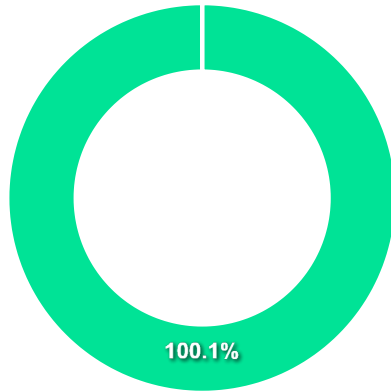
COMPARATIVO

 30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de Fundos / ITAÚ DUNAMIS MASTER FUNDO DE INVESTIMENT...	1.118.959,77	99,87	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ CAIXA AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO F...	2.839,43	0,25	Outros
Outros Valores a receber	1.560,80	0,14	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	70,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-3.024,27	-0,27	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	1.121.799,20	100.12%
Valores a pagar/receber	-1.393,47	-0.12%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

Taxa de Administração
 2,50%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+24

Quantidade de Cotistas
 83

Patrimônio Líquido Fundo
 341.230.820,46

Patrimônio Líquido Master
 423.061.697,41

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

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

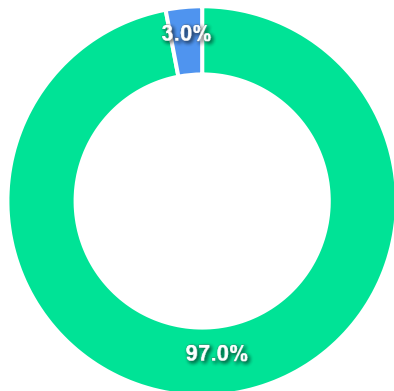
COMPARATIVO

 30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ PHOENIX RESP LIMITADA FIF AÇÕES	67.710,75	96,80	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	2.211,32	3,16	Valores a pagar/receber
Cotas de ITAÚ CAIXA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	134,20	0,19	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	30,00	0,04	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-138,32	-0,20	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	67.844,95	96.99%
Valores a pagar/receber	2.103,00	3.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

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.

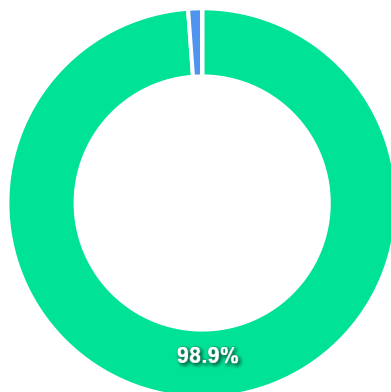
COMPARATIVO

 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	2.324.949,05	98.89%
Outros	27.209,94	1.16%
Valores a pagar/receber	-1.095,45	-0.05%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Brazilian Depositary Receipt - BDR - NVDC34	256.808,43	10,92	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - MSFT34	226.024,87	9,61	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - AAPL34	201.569,97	8,57	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - AMZO34	148.034,61	6,30	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - M1TA34	97.112,61	4,13	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - AVGO34	80.343,89	3,42	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - TSMC34	72.124,23	3,07	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - GOGL35	68.020,83	2,89	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - GOGL34	67.089,00	2,85	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - TSLA34	64.769,83	2,75	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - JPMC34	49.146,74	2,09	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - WALM34	46.563,01	1,98	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - LILY34	41.849,69	1,78	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - ORCL34	39.435,69	1,68	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - MSCD34	31.718,42	1,35	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - NFLX34	30.711,40	1,31	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - EXXO34	28.656,70	1,22	Brazilian Depositary Rece...
Cotas de Fundos / CAIXA MASTER CONSERVADOR FIF RENDA FIXA ...	27.209,94	1,16	Outros
Brazilian Depositary Receipt - BDR - COWC34	25.380,67	1,08	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - HOME34	24.522,44	1,04	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - ABBV34	22.490,94	0,96	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - PGCO34	22.456,05	0,96	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - BOAC34	22.265,81	0,95	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - P2LT34	21.323,60	0,91	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - BABA34	20.053,68	0,85	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - TMCO34	18.363,56	0,78	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipt - BDR - COCA34	18.214,36	0,77	Brazilian Depositary Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

Taxa de Administração
 1,90%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+3

Quantidade de Cotistas
 2.070

Patrimônio Líquido Fundo
 99.945.010,60

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
 Global BDRX

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

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

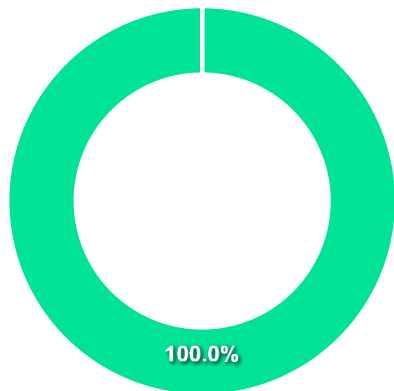
COMPARATIVO

30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	101.171,84	99,55	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	496,44	0,49	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	193,09	0,19	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	50,00	0,05	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-280,39	-0,28	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	101.668,28	100.04%
Valores a pagar/receber	-37,30	-0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
5.716

Patrimônio Líquido Fundo
1.566.821.792,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
CDI

Classificação ANBIMA
Multimercados Macro

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

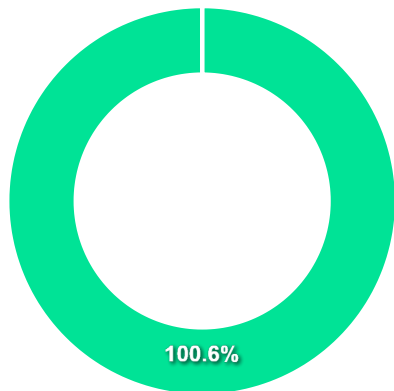
COMPARATIVO

30/06/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de Fundos / CAIXA MASTER HEDGE II FUNDO DE INVESTIME...	677.416,59	76,09	Outros
Cotas de Fundos / CAIXA MASTER HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO...	181.681,29	20,41	Outros
Cotas de Fundos / CAIXA MASTER TPF FUNDO DE INVESTIMENTO F...	36.849,56	4,14	Outros
Outros Valores a receber	17,80	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-5.609,08	-0,63	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	895.947,43	100.63%
Valores a pagar/receber	-5.591,29	-0.63%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA DTVM

Taxa de Administração
 1,50%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+15

Quantidade de Cotistas
 117

Patrimônio Líquido Fundo
 250.856.847,83

Patrimônio Líquido Master
 651.439.716,40

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
 CDI

Classificação ANBIMA
 Multimercados Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas do CAIXA MASTER ESTRATÉGIA
 LIVRE FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 34.660.200/0001-92.

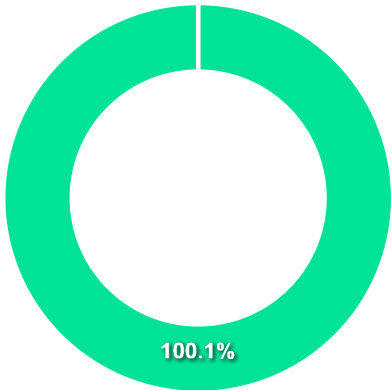
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,81%	5,35%	4,29%	5,35%	14,58%	18,66%	1,60%	3,37%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de Fundos / CAIXA MASTER ESTRATÉGIA LIVRE FUNDO DE I...	125.208,54	97,65	Outros
Cotas de Fundos / CAIXA MASTER TPF FUNDO DE INVESTIMENTO F...	3.168,89	2,47	Outros
Outros Valores a receber	7,23	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-166,62	-0,13	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	128.377,43	100.12%
Valores a pagar/receber	-159,39	-0.12%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 653

Patrimônio Líquido Fundo
 1.134.087.211,23

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
 S&P 500 (Moeda Original)

Classificação ANBIMA
 Multimercados Estratégia Específica

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem, principalmente, em ativos que tenham como principal fator de risco a variação do preço do índice S&P 500.

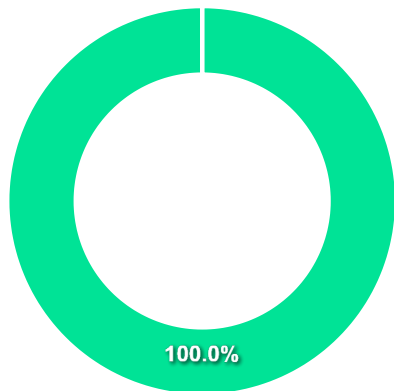
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	6,99%	20,07%	10,36%	20,07%	28,33%	20,88%	5,06%	10,66%
Benchmark	6,47%	15,91%	8,30%	15,91%	17,57%	3,56%		
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 Fundos / ITAÚ ESTRATÉGIA S&P500® FUNDO DE INVESTI...	795.714,69	99,52	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	4.050,21	0,51	Outros
Outras Disponibilidades	70,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	19,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-295,86	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	799.764,90	100.03%
Valores a pagar/receber	-205,91	-0.03%

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÕES DO MUNICÍPIO DE SANTO ANTÔNIO DE PÁDUA - RJ** 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 **FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÕES DO MUNICÍPIO DE SANTO ANTÔNIO DE PÁDUA - RJ** 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 **FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÕES DO MUNICÍPIO DE SANTO ANTÔNIO DE PÁDUA - RJ** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

