

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

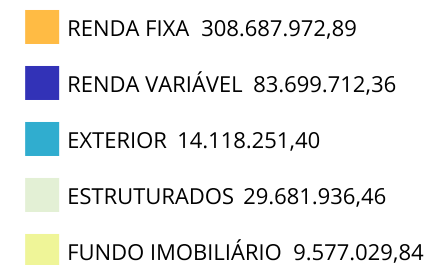
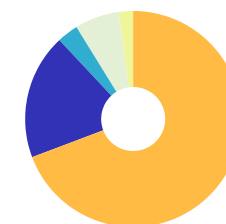
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|----------|---------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | 80.443.626,70 | 18,05% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1 | Não há | 24.682.997,47 | 5,54% | 942 | 0,38% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 20.362.642,08 | 4,57% | 783 | 0,36% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 6.507.458,03 | 1,46% | 773 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 22.609.313,93 | 5,07% | 901 | 0,38% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 166.748,35 | 0,04% | 1.186 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 563.516,66 | 0,13% | 352 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 64.110.306,41 | 14,38% | 714 | 0,44% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA | D+3 | Não há | 10.968.017,75 | 2,46% | 1.970 | 9,60% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 15.285.029,26 | 3,43% | 218 | 2,05% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 12.871.423,78 | 2,89% | 148 | 1,77% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 6.157.514,48 | 1,38% | 71 | 1,67% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 23.280.510,94 | 5,22% | 72 | 3,04% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX... | D+1 | Não há | 11.153.516,85 | 2,50% | 233 | 0,37% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1471 | Não há | 1.585.352,97 | 0,36% | 26 | 2,84% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1471 | Não há | 1.294.652,77 | 0,29% | 31 | 1,97% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 605.581,54 | 0,14% | 607 | 4,99% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1 | Não pos... | Não há | 3.467.646,64 | 0,78% | 8 | 18,34% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | D+1260 | 90 dias | 2.572.116,28 | 0,58% | 70 | 3,49% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 6.541.696,20 | 1,47% | 475 | 3,01% | Artigo 8º, Inciso I |

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | D+15 | Não há | 19.314.153,78 | 4,33% | 2.815 | 1,47% | Artigo 8º, Inciso I |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | D+3 | Não há | 20.934.051,95 | 4,70% | 270 | 6,55% | Artigo 8º, Inciso I |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 5.549.521,72 | 1,24% | 1.256 | 0,43% | Artigo 8º, Inciso I |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+32 | Não há | 12.504.811,19 | 2,81% | 21 | 2,20% | Artigo 8º, Inciso I |
| TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ... | D+32 | Não há | 17.410.953,52 | 3,91% | 31 | 1,86% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC... | D+5 du | Não há | 7.846.213,31 | 1,76% | 118 | 2,26% | Artigo 9º, Inciso II |
| BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 6.272.038,09 | 1,41% | 155 | 0,49% | Artigo 9º, Inciso III |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 17.705.109,58 | 3,97% | 653 | 1,56% | Artigo 10º, Inciso I |
| KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA | Não se ... | Não se aplica | 2.080.106,34 | 0,47% | | 0,00% | Artigo 10º, Inciso II |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | Não se ... | Não se aplica | 9.896.720,54 | 2,22% | | 0,00% | Artigo 10º, Inciso II |
| BR HOTÉIS FII - BRHT11B | Não se ... | Não se aplica | 6.942.777,18 | 1,56% | | 4,91% | Artigo 11º |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ... | Não se ... | Não se aplica | 1.329.031,66 | 0,30% | | 1,80% | Artigo 11º |
| HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11 | Não se ... | Não se aplica | 1.305.221,00 | 0,29% | | 0,06% | Artigo 11º |
| MULTI SHOPPINGS FII - SHOP11 | Não se ... | Não se aplica | 1.444.524,00 | 0,32% | | 1,43% | Desenquadrado - RV |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 445.764.902,95 | | | | |

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

| Artigos - Renda Fixa | Resolução Pró Gestão - Nivel 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|-----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 80.443.626,70 | 18,05% | 3,85% | 11,98% | 81,95% | 284.860.711,27 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 149.971.000,68 | 33,64% | 16,55% | 18,56% | 81,95% | 215.333.337,29 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 65,00% | 72.233.582,59 | 16,20% | 10,00% | 20,00% | 60,00% | 195.225.359,18 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 20,00% | 89.152.980,59 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' | 5,00% | 6.039.762,92 | 1,35% | 0,00% | 0,00% | 1,50% | 646.710,62 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 22.288.245,15 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 308.687.972,89 | 69,25% | 30,40% | 60,54% | 250,40% | |

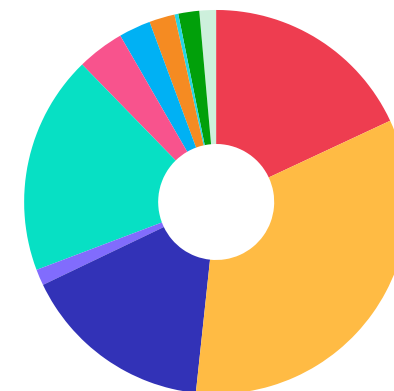


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

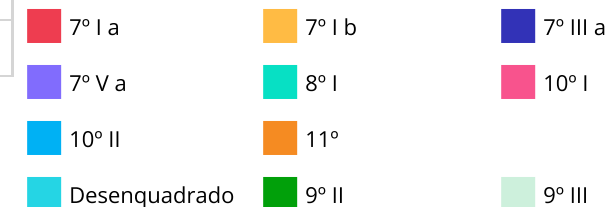


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2023)

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução Pró Gestão - Nivel 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|---|--------------------------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 35,00% | 82.255.188,36 | 18,45% | 10,00% | 21,00% | 25,00% | 29.186.037,38 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 17.705.109,58 | 3,97% | 3,50% | 5,00% | 10,00% | 26.871.380,72 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 11.976.826,88 | 2,69% | 2,29% | 3,05% | 5,00% | 10.311.418,27 |
| Artigo 11º | 5,00% | 9.577.029,84 | 2,15% | 1,98% | 2,64% | 5,00% | 12.711.215,31 |
| Desenquadrado - RV | 0,00% | 1.444.524,00 | 0,32% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -1.444.524,00 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 35,00% | 122.958.678,66 | 27,58% | 17,77% | 31,69% | 45,00% | |



| Artigos - Exterior | Resolução Pró Gestão - Nivel 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2023 | | | GAP Superior |
|-----------------------|--------------------------------|----------------------|--------------|--|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso II | 10,00% | 7.846.213,31 | 1,76% | 0,00% | 1,77% | 10,00% | 36.730.276,99 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 6.272.038,09 | 1,41% | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 38.304.452,21 |
| Total Exterior | 10,00% | 14.118.251,40 | 3,17% | 0,00% | 6,77% | 20,00% | |





Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM | 93.957.343,38 | 21,08 | - |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL... | 80.443.626,70 | 18,05 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 66.602.706,90 | 14,94 | - |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT | 40.591.542,27 | 9,11 | 0,01 |
| TRÍGONO CAPITAL | 29.915.764,71 | 6,71 | 0,62 |
| ITAÚ UNIBANCO | 25.551.322,89 | 5,73 | 0,01 |
| FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA | 20.934.051,95 | 4,70 | - |
| CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS | 19.314.153,78 | 4,33 | 1,03 |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS | 12.982.540,10 | 2,91 | 5,09 |
| BRDESCO ASSET MANAGEMENT | 12.871.423,78 | 2,89 | 0,00 |
| DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT | 10.968.017,75 | 2,46 | 0,10 |
| KPTL | 9.896.720,54 | 2,22 | 2,76 |
| 4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA | 6.541.696,20 | 1,47 | 0,22 |
| NAVI CAPITAL | 5.549.521,72 | 1,24 | 0,38 |
| KINEA INVESTIMENTOS | 2.080.106,34 | 0,47 | 0,00 |
| RJI CORRETORA DE VALORES | 1.585.352,97 | 0,36 | 2,84 |
| CAPITÂNIA INVESTIMENTOS | 1.444.524,00 | 0,32 | - |
| ZION INVEST | 1.329.031,66 | 0,30 | - |
| HEDGE INVESTMENTS | 1.305.221,00 | 0,29 | 0,12 |
| PLURAL | 1.294.652,77 | 0,29 | - |
| INFINITY ASSET MANAGEMENT | 605.581,54 | 0,14 | - |

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2023 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 80.443.626,70 | 18,05 | 3,85 | 81,95 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 149.971.000,68 | 33,64 | 16,55 | 81,95 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 72.233.582,59 | 16,20 | 10,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 82.255.188,36 | 18,45 | 10,00 | 25,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 7.846.213,31 | 1,76 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 6.272.038,09 | 1,41 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 17.705.109,58 | 3,97 | 3,50 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso II | 11.976.826,88 | 2,69 | 2,29 | 5,00 |
| Artigo 11º | 9.577.029,84 | 2,15 | 1,98 | 5,00 |
| Artigo 12º | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark) | 0,56% | 6,84% | 2,66% | 6,84% | 11,38% | 34,59% | - | - |
| AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1 | -0,45% | -2,14% | -1,11% | -2,14% | -4,02% | - | - | - |
| 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% | 0,03% |
| 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% | 0,03% |
| IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark) | 0,48% | 6,35% | 2,42% | 6,35% | 10,35% | 32,11% | - | - |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | -0,38% | -1,05% | -0,99% | -1,05% | -0,38% | 3,65% | - | - |
| 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% | 0,00% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,05% | 7,04% | 2,55% | 7,04% | 10,23% | 21,32% | - | - |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 0,41% | 2,66% | 1,28% | 2,66% | 4,16% | 6,19% | 0,01% | 0,01% |
| DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA | 1,05% | 6,94% | 2,63% | 6,94% | 10,05% | 19,89% | 0,91% | 0,02% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1,03% | 6,99% | 2,56% | 6,99% | 10,05% | 20,76% | 0,90% | 0,02% |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | -0,23% | -5,57% | -0,65% | -5,57% | -20,54% | -28,03% | 0,89% | 0,14% |
| IMA-B (Benchmark) | 2,39% | 11,37% | 7,10% | 11,37% | 13,52% | 17,81% | - | - |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 2,57% | 11,73% | 7,47% | 11,73% | 12,55% | 16,53% | 2,29% | 0,05% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,39% | 11,31% | 7,20% | 11,31% | 13,23% | 17,29% | 2,17% | 0,04% |
| 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% | 0,03% |
| CDI (Benchmark) | 1,07% | 6,50% | 3,15% | 6,50% | 13,54% | 23,37% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP | 1,30% | 7,10% | 3,67% | 7,10% | 13,07% | 25,65% | 0,28% | 0,01% |
| ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP | 0,82% | 5,91% | 3,56% | 5,91% | 10,77% | 23,24% | 0,78% | 0,02% |
| VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP | -15,59% | -87,36% | -88,06% | -87,36% | -85,95% | -83,54% | 24,63% | 0,88% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,13% | 6,55% | 3,23% | 6,55% | 13,52% | 23,55% | 0,04% | 0,00% |
| IPCA (Benchmark) | -0,08% | 2,87% | 0,76% | 2,87% | 3,16% | 15,42% | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 2,11% | 8,26% | 4,86% | 8,26% | 14,59% | 18,86% | 0,90% | 0,02% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 2,01% | 9,45% | 5,68% | 9,45% | 14,37% | 19,80% | 1,19% | 0,03% |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA | 0,96% | 3,41% | 0,28% | 3,41% | 2,11% | -58,54% | - | - |
| MULTI SHOPPINGS FII - SHOP11 | - | - | - | - | - | - | 2,38% | - |
| Ibovespa (Benchmark) | 9,00% | 7,61% | 15,91% | 7,61% | 19,83% | -6,87% | - | - |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 7,30% | 10,75% | 15,08% | 10,75% | 30,39% | 21,43% | 7,99% | 0,21% |
| TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 3,83% | 5,75% | 13,75% | 5,75% | 20,97% | 2,64% | 4,12% | 0,22% |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 10,24% | 4,73% | 16,62% | 4,73% | 14,29% | -4,39% | 8,49% | 0,20% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 8,16% | 11,84% | 18,12% | 11,84% | 17,01% | -3,57% | 7,14% | 0,18% |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 8,13% | 12,14% | 19,64% | 12,14% | 23,39% | 4,80% | 7,11% | 0,17% |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES | 6,94% | 10,59% | 13,93% | 10,59% | 19,01% | 5,55% | 6,93% | 0,16% |
| IFIX (Benchmark) | 4,71% | 10,05% | 14,28% | 10,05% | 12,87% | 14,54% | - | - |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | 7,29% | -26,95% | -8,44% | -26,95% | -50,48% | 154,32% | 14,96% | 0,31% |
| HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11 | 4,91% | 14,60% | 19,46% | 14,60% | 25,78% | 8,49% | 5,13% | 0,24% |
| BR HOTÉIS FII - BRHT11B | -0,10% | -8,80% | -0,33% | -8,80% | -4,00% | -6,84% | 0,00% | 0,00% |
| IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark) | 0,75% | 8,05% | 3,23% | 8,05% | 13,95% | 40,88% | - | - |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | -0,15% | -0,87% | -0,43% | -0,87% | -8,46% | -10,13% | - | - |



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

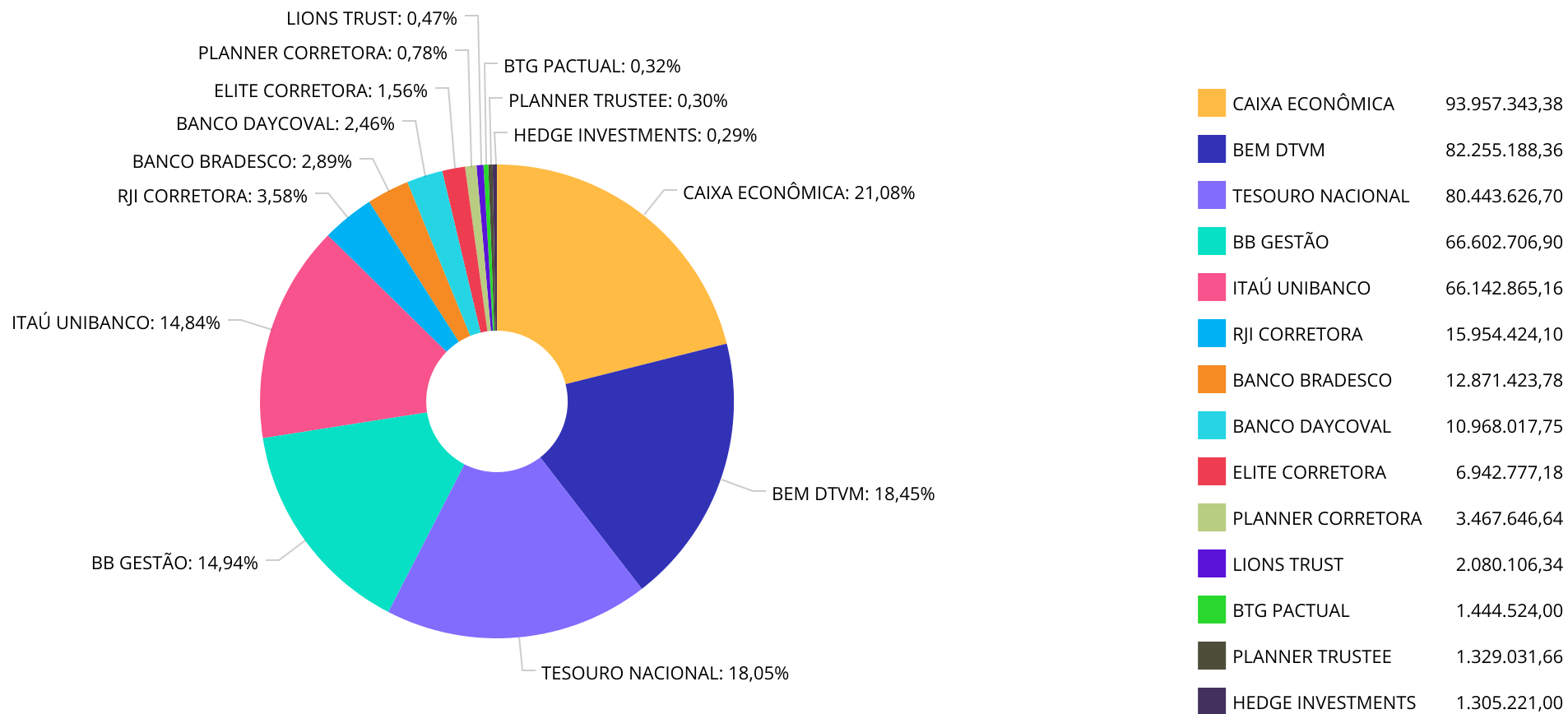
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark) | 6,47% | 15,91% | 8,30% | 15,91% | 17,57% | 3,56% | - | - |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 6,99% | 20,07% | 10,36% | 20,07% | 28,33% | 20,88% | 5,06% | 0,20% |



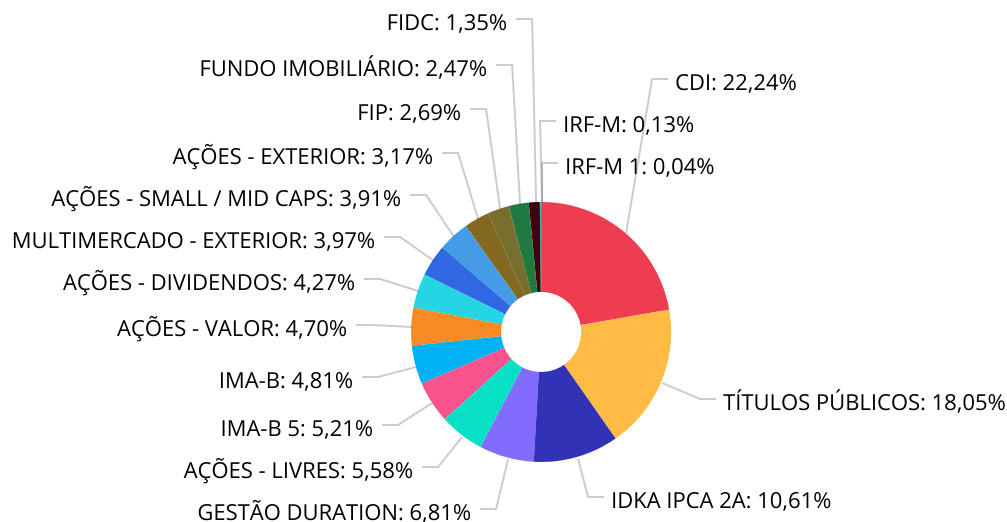
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 0,48% | 15,14% | 5,90% | 15,14% | 14,44% | 0,60% | - | - |
| BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1,47% | 7,68% | 4,07% | 7,68% | 10,43% | -0,84% | 6,71% | 15,073% |
| MSCI WORLD (Benchmark) | 0,18% | 5,28% | 0,82% | 5,28% | 7,20% | -5,27% | - | - |
| ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | 0,17% | 4,19% | 1,02% | 4,19% | 8,88% | -2,60% | 5,32% | 11,385% |

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



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



| | | | | | | | |
|----------------------|---------------|---------------------------|---------------|----------------------------|---------------|--------------------|---------------|
| ■ CDI | 99.149.915,74 | ■ TÍTULOS PÚBLICOS | 80.443.626,70 | ■ IDKA IPCA 2A | 47.292.311,40 | ■ GESTÃO DURATION | 30.346.899,56 |
| ■ AÇÕES - LIVRES | 24.863.675,50 | ■ IMA-B 5 | 23.242.647,82 | ■ IMA-B | 21.442.543,74 | ■ AÇÕES - VALOR | 20.934.051,95 |
| ■ AÇÕES - DIVIDENDOS | 19.046.507,39 | ■ MULTIMERCADO - EXTERIOR | 17.705.109,58 | ■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS | 17.410.953,52 | ■ AÇÕES - EXTERIOR | 14.118.251,40 |
| ■ FIP | 11.976.826,88 | ■ FUNDO IMOBILIÁRIO | 11.021.553,84 | ■ FIDC | 6.039.762,92 | ■ IRF-M | 563.516,66 |
| ■ IRF-M 1 | 166.748,35 | | | | | | |



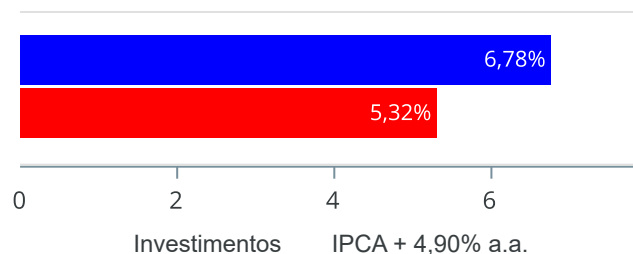
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2023)

| Títulos Públicos | Vencimento | Compra | Qtde | P.U. Compra | P.U. Atual | \$ Pago | \$ Atual | Marcação |
|--|------------|------------|-------|---------------|--------------|--------------|---------------|----------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2026 | 16/12/2022 | 2.493 | 4.010,609178 | 4.284,293039 | 9.998.448,68 | 10.680.742,55 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 20/09/2022 | 2.241 | 4.014,6620030 | 4.459,149933 | 8.996.857,55 | 9.992.955,00 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 16/12/2022 | 2.519 | 3969,777044 | 4.459,149933 | 9.999.868,37 | 11.232.598,68 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 23/05/2023 | 1.162 | 4.302,162327 | 4.329,648467 | 4.999.112,62 | 5.031.051,51 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 20/09/2022 | 1.117 | 4.028,4691720 | 4.505,338858 | 4.499.800,07 | 5.032.463,50 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 04/04/2023 | 2.101 | 4.046,620000 | 4.505,338858 | 8.501.948,62 | 9.465.716,94 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 04/04/2023 | 2.088 | 4.070,730000 | 4.442,059123 | 8.499.684,24 | 9.275.019,45 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2050 | 20/09/2022 | 872 | 4.009,3250770 | 4.534,498866 | 3.496.131,47 | 3.954.083,01 | Mercado |

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 425.261.125,84 | 4.823.416,27 | 6.359.480,19 | 431.031.040,68 | 7.305.978,76 | 7.305.978,76 | 1,72% | 1,72% | 0,95% | 0,95% | 180,71% | 3,86% |
| Fevereiro | 431.031.040,68 | 34.192.020,11 | 36.002.113,46 | 425.655.313,31 | -3.565.634,02 | 3.740.344,74 | -0,83% | 0,88% | 1,19% | 2,15% | 40,82% | 3,22% |
| Março | 425.655.313,31 | 5.429.819,96 | 6.443.923,89 | 426.287.192,85 | 1.645.983,47 | 5.386.328,21 | 0,39% | 1,27% | 1,15% | 3,32% | 38,12% | 3,66% |
| Abril | 426.287.192,85 | 22.431.692,43 | 23.529.177,78 | 428.521.462,07 | 3.331.754,57 | 8.718.082,78 | 0,78% | 2,06% | 0,95% | 4,31% | 47,77% | 3,38% |
| Mai | 428.521.462,07 | 32.081.828,36 | 33.140.858,52 | 434.568.526,24 | 7.106.094,33 | 15.824.177,11 | 1,66% | 3,75% | 0,65% | 4,99% | 75,22% | 3,77% |
| Junho | 434.568.526,24 | 56.125.154,43 | 57.618.361,09 | 445.764.902,95 | 12.689.583,37 | 28.513.760,48 | 2,92% | 6,78% | 0,32% | 5,32% | 127,42% | 2,68% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade





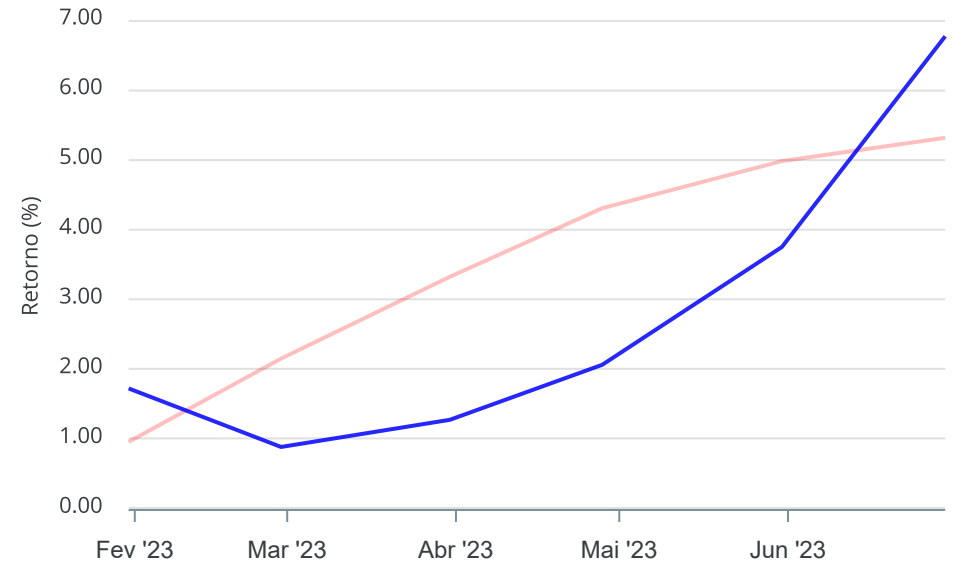
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-----------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | 78.170.484,27 | 0,00 | 0,00 | 80.443.626,70 | 2.273.142,43 | 2,91% | - | - |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 6.003.080,78 | 0,00 | 0,00 | 6.157.514,48 | 154.433,70 | 2,57% | 2,57% | 2,29% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 14.928.792,49 | 0,00 | 0,00 | 15.285.029,26 | 356.236,77 | 2,39% | 2,39% | 2,17% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 6.361.327,13 | 12.093,43 | 0,00 | 6.507.458,03 | 134.037,47 | 2,10% | 2,10% | 0,90% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 551.926,59 | 0,00 | 0,00 | 563.516,66 | 11.590,07 | 2,10% | 2,10% | 0,90% |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 12.617.995,16 | 0,00 | 0,00 | 12.871.423,78 | 253.428,62 | 2,01% | 2,01% | 1,19% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 11.010.619,32 | 0,00 | 0,00 | 11.153.516,85 | 142.897,53 | 1,30% | 1,30% | 0,28% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 164.839,56 | 0,00 | 0,00 | 166.748,35 | 1.908,79 | 1,16% | 1,16% | 0,11% |
| DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA | 10.853.891,26 | 0,00 | 0,00 | 10.968.017,75 | 114.126,49 | 1,05% | 1,05% | 0,91% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 22.375.873,92 | 0,00 | 0,00 | 22.609.313,93 | 233.440,01 | 1,04% | 1,04% | 0,83% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 20.154.862,80 | 0,00 | 0,00 | 20.362.642,08 | 207.779,28 | 1,03% | 1,03% | 0,90% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 24.433.893,43 | 0,00 | 0,00 | 24.682.997,47 | 249.104,04 | 1,02% | 1,02% | 0,78% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 51.539.979,78 | 19.114.640,78 | 7.235.115,65 | 64.110.306,41 | 690.801,50 | 0,98% | 1,13% | 0,04% |
| ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP | 23.090.329,46 | 0,00 | 0,00 | 23.280.510,94 | 190.181,48 | 0,82% | 0,82% | 0,78% |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.578.860,43 | 0,00 | 0,00 | 1.585.352,97 | 6.492,54 | 0,41% | 0,41% | 0,01% |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.297.612,73 | 0,00 | 0,00 | 1.294.652,77 | -2.959,96 | -0,23% | -0,23% | 0,89% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 2.581.904,30 | 0,00 | 0,00 | 2.572.116,28 | -9.788,02 | -0,38% | - | - |
| AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1 | 3.483.147,66 | 0,00 | 0,00 | 3.467.646,64 | -15.501,02 | -0,45% | - | - |
| VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP | 717.459,57 | 0,00 | 0,00 | 605.581,54 | -111.878,03 | -15,59% | -15,59% | 24,63% |
| Total Renda Fixa | 291.916.880,64 | 19.126.734,21 | 7.235.115,65 | 308.687.972,89 | 4.879.473,69 | 1,61% | | 0,79% |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 5.034.190,74 | 0,00 | 0,00 | 5.549.521,72 | 515.330,98 | 10,24% | 10,24% | 8,49% |
| DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | 8.802.178,65 | 0,00 | 9.673.765,38 | 0,00 | 871.586,73 | 9,90% | 8,65% | 7,79% |
| MULTINVEST FI AÇÕES | 9.200.761,81 | 0,00 | 9.983.125,38 | 0,00 | 782.363,57 | 8,50% | 8,73% | 7,00% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 11.654.206,46 | 0,00 | 0,00 | 12.504.811,19 | 850.604,73 | 7,30% | 7,30% | 7,99% |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ... | 1.238.709,12 | 0,00 | 0,00 | 1.329.031,66 | 90.322,54 | 7,29% | 7,29% | 14,96% |
| META VALOR FI AÇÕES | 12.459.084,55 | 0,00 | 13.211.310,57 | 0,00 | 752.226,02 | 6,04% | 5,76% | 8,92% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 6.959.793,34 | 9.800.000,00 | 0,00 | 17.705.109,58 | 945.316,24 | 5,64% | 6,99% | 5,06% |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 14.222.456,90 | 5.600.000,00 | 0,00 | 20.934.051,95 | 1.111.595,05 | 5,61% | 8,12% | 7,11% |
| HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11 | 1.244.182,90 | 0,00 | 8.685,50 | 1.305.221,00 | 69.723,60 | 5,60% | 4,91% | 5,13% |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES | 4.706.403,98 | 1.500.000,00 | 0,00 | 6.541.696,20 | 335.292,22 | 5,40% | 6,94% | 6,93% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 7.091.135,55 | 11.500.000,00 | 0,00 | 19.314.153,78 | 723.018,23 | 3,89% | 8,16% | 7,14% |
| TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO... | 11.887.024,58 | 5.000.000,00 | 0,00 | 17.410.953,52 | 523.928,94 | 3,10% | 3,83% | 4,12% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 10.005.055,86 | 0,00 | 10.235.188,88 | 0,00 | 230.133,02 | 2,30% | 7,00% | 5,04% |
| KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA | 2.060.393,22 | 0,00 | 0,00 | 2.080.106,34 | 19.713,12 | 0,96% | - | - |
| BR HOTÉIS FII - BRHT11B | 6.949.715,88 | 0,00 | 0,00 | 6.942.777,18 | -6.938,70 | -0,10% | -0,10% | 0,00% |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | 9.911.219,00 | 0,00 | 0,00 | 9.896.720,54 | -14.498,46 | -0,15% | - | - |
| MULTI SHOPPINGS FII - SHOP11 | 1.465.767,00 | 0,00 | 0,00 | 1.444.524,00 | -21.243,00 | -1,45% | -1,45% | 2,38% |
| Total Renda Variável | 124.892.279,54 | 33.400.000,00 | 43.112.075,71 | 122.958.678,66 | 7.778.474,83 | 4,91% | | 6,04% |



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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| BB AÇÕES ESG IS FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 2.580.119,42 | 3.598.420,22 | 0,00 | 6.272.038,09 | 93.498,45 | 1,51% | 1,47% | 6,71% |
| ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A... | 7.833.215,87 | 0,00 | 0,00 | 7.846.213,31 | 12.997,44 | 0,17% | 0,17% | 5,32% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 7.346.030,77 | 0,00 | 7.271.169,73 | 0,00 | -74.861,04 | -1,02% | 0,47% | 6,60% |
| Total Exterior | 17.759.366,06 | 3.598.420,22 | 7.271.169,73 | 14.118.251,40 | 31.634,85 | 0,15% | | 5,94% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | 52.433.988,98 | 22.000.744,22 | 683.308,73 | 80.443.626,70 | 6.692.202,23 | 8,99% | - |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 52.917.522,11 | 30.726.214,40 | 21.429.183,79 | 64.110.306,41 | 1.895.753,69 | 2,27% | 3,23% |
| ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP | 28.340.182,63 | 0,00 | 6.000.000,00 | 23.280.510,94 | 940.328,31 | 3,32% | 3,56% |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 12.179.592,00 | 0,00 | 0,00 | 12.871.423,78 | 691.831,78 | 5,68% | 5,68% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 19.854.975,16 | 0,00 | 0,00 | 20.362.642,08 | 507.666,92 | 2,56% | 2,56% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 24.175.510,40 | 0,00 | 0,00 | 24.682.997,47 | 507.487,07 | 2,10% | 2,10% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 22.136.541,66 | 0,00 | 0,00 | 22.609.313,93 | 472.772,27 | 2,14% | 2,14% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 10.759.139,94 | 0,00 | 0,00 | 11.153.516,85 | 394.376,91 | 3,67% | 3,67% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 14.891.121,41 | 0,00 | 15.285.029,26 | 393.907,85 | 2,65% | 7,20% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 6.184.458,52 | 22.174,97 | 0,00 | 6.507.458,03 | 300.824,54 | 4,85% | 4,86% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ... | 14.606.554,73 | 0,00 | 14.891.121,41 | 0,00 | 284.566,68 | 1,95% | 3,22% |
| DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA | 10.687.013,95 | 0,00 | 0,00 | 10.968.017,75 | 281.003,80 | 2,63% | 2,63% |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 0,00 | 6.000.000,00 | 0,00 | 6.157.514,48 | 157.514,48 | 2,63% | 7,47% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 17.504.320,44 | 0,00 | 17.001.631,60 | 563.516,66 | 60.827,82 | 0,35% | 5,47% |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.565.271,70 | 0,00 | 0,00 | 1.585.352,97 | 20.081,27 | 1,28% | 1,28% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 161.654,44 | 0,00 | 0,00 | 166.748,35 | 5.093,91 | 3,15% | 3,15% |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.303.070,44 | 0,00 | 0,00 | 1.294.652,77 | -8.417,67 | -0,65% | -0,65% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 2.597.830,36 | 0,00 | 0,00 | 2.572.116,28 | -25.714,08 | -0,99% | -0,99% |
| AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1 | 3.506.545,71 | 0,00 | 0,00 | 3.467.646,64 | -38.899,07 | -1,11% | -1,11% |
| VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP | 5.072.347,60 | 0,00 | 0,00 | 605.581,54 | -4.466.766,06 | -88,06% | -88,06% |



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|-------------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|-------------|------------|
| Total Renda Fixa | 285.986.520,77 | 73.640.255,00 | 60.005.245,53 | 308.687.972,89 | 9.066.442,65 | 3,03% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|--------------|------------|
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 12.853.609,46 | 5.600.000,00 | 0,00 | 20.934.051,95 | 2.480.442,49 | 13,44% | 19,64% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 10.866.017,80 | 0,00 | 0,00 | 12.504.811,19 | 1.638.793,39 | 15,08% | 15,08% |
| TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO... | 14.868.614,94 | 5.000.000,00 | 3.842.203,40 | 17.410.953,52 | 1.384.541,98 | 6,97% | 13,75% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 6.493.481,34 | 11.500.000,00 | 0,00 | 19.314.153,78 | 1.320.672,44 | 7,34% | 18,12% |
| MULTINVEST FI AÇÕES | 8.743.348,80 | 0,00 | 9.983.125,38 | 0,00 | 1.239.776,58 | 14,18% | 14,42% |
| META VALOR FI AÇÕES | 11.997.952,53 | 0,00 | 13.211.310,57 | 0,00 | 1.213.358,04 | 10,11% | 9,82% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 6.747.372,42 | 9.800.000,00 | 0,00 | 17.705.109,58 | 1.157.737,16 | 7,00% | 10,36% |
| DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | 8.536.014,19 | 0,00 | 9.673.765,38 | 0,00 | 1.137.751,19 | 13,33% | 12,04% |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 4.758.461,89 | 0,00 | 0,00 | 5.549.521,72 | 791.059,83 | 16,62% | 16,62% |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES | 4.417.609,34 | 1.500.000,00 | 0,00 | 6.541.696,20 | 624.086,86 | 10,55% | 13,93% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 9.694.812,66 | 0,00 | 10.235.188,88 | 0,00 | 540.376,22 | 5,57% | 10,43% |
| HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11 | 1.092.576,00 | 0,00 | 25.757,00 | 1.305.221,00 | 238.402,00 | 21,82% | 19,46% |
| KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA | 2.074.399,00 | 0,00 | 40.631,52 | 2.080.106,34 | 46.338,86 | 2,23% | 0,28% |
| BR HOTÉIS FII - BRHT11B | 6.965.480,86 | 0,00 | 0,00 | 6.942.777,18 | -22.703,68 | -0,33% | -0,33% |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | 9.939.126,58 | 0,00 | 0,00 | 9.896.720,54 | -42.406,04 | -0,43% | -0,43% |
| MULTI SHOPPINGS FII - SHOP11 | 1.528.956,00 | 0,00 | 0,00 | 1.444.524,00 | -84.432,00 | -5,52% | - |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ... | 1.451.612,25 | 0,00 | 0,00 | 1.329.031,66 | -122.580,59 | -8,44% | -8,44% |
| Total Renda Variável | 123.029.446,06 | 33.400.000,00 | 47.011.982,13 | 122.958.678,66 | 13.541.214,73 | 8,66% | |



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6.988.830,91 | 0,00 | 7.271.169,73 | 0,00 | 282.338,82 | 4,04% | 5,60% |
| BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.515.615,07 | 3.598.420,22 | 0,00 | 6.272.038,09 | 158.002,80 | 2,58% | 4,07% |
| ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A... | 7.766.780,04 | 0,00 | 0,00 | 7.846.213,31 | 79.433,27 | 1,02% | 1,02% |
| Total Exterior | 17.271.226,02 | 3.598.420,22 | 7.271.169,73 | 14.118.251,40 | 519.774,89 | 2,49% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | 37.404.621,34 | 36.001.745,10 | 1.784.641,40 | 80.443.626,70 | 8.821.901,66 | 12,02% | - |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 53.841.336,73 | 61.155.534,99 | 54.554.522,57 | 64.110.306,41 | 3.667.957,26 | 3,19% | 6,55% |
| ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP | 27.711.823,52 | 0,00 | 6.000.000,00 | 23.280.510,94 | 1.568.687,42 | 5,66% | 5,91% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 23.163.010,36 | 0,00 | 0,00 | 24.682.997,47 | 1.519.987,11 | 6,56% | 6,56% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 21.209.937,50 | 0,00 | 0,00 | 22.609.313,93 | 1.399.376,43 | 6,60% | 6,60% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 19.032.364,83 | 0,00 | 0,00 | 20.362.642,08 | 1.330.277,25 | 6,99% | 6,99% |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 11.759.752,00 | 0,00 | 0,00 | 12.871.423,78 | 1.111.671,78 | 9,45% | 9,45% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 30.605.424,80 | 0,00 | 31.002.632,48 | 563.516,66 | 960.724,34 | 3,14% | 9,56% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ... | 14.093.227,30 | 0,00 | 14.891.121,41 | 0,00 | 797.894,11 | 5,66% | 6,98% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 10.414.017,99 | 0,00 | 0,00 | 11.153.516,85 | 739.498,86 | 7,10% | 7,10% |
| DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA | 10.256.135,38 | 0,00 | 0,00 | 10.968.017,75 | 711.882,37 | 6,94% | 6,94% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 5.975.185,62 | 37.109,84 | 0,00 | 6.507.458,03 | 495.162,57 | 8,24% | 8,26% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 14.891.121,41 | 0,00 | 15.285.029,26 | 393.907,85 | 2,65% | 11,31% |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 0,00 | 6.000.000,00 | 0,00 | 6.157.514,48 | 157.514,48 | 2,63% | 11,73% |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.544.257,62 | 0,00 | 0,00 | 1.585.352,97 | 41.095,35 | 2,66% | 2,66% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 156.444,75 | 0,00 | 0,00 | 166.748,35 | 10.303,60 | 6,59% | 6,59% |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.370.994,08 | 0,00 | 61.406,71 | 1.294.652,77 | -14.934,60 | -1,09% | -5,57% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 2.599.492,66 | 0,00 | 0,00 | 2.572.116,28 | -27.376,38 | -1,05% | -1,05% |
| AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1 | 3.543.484,91 | 0,00 | 0,00 | 3.467.646,64 | -75.838,27 | -2,14% | -2,14% |
| VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP | 4.791.357,77 | 0,00 | 0,00 | 605.581,54 | -4.185.776,23 | -87,36% | -87,36% |



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|-------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|-------------|------------|
| Total Renda Fixa | 279.472.869,16 | 118.085.511,34 | 108.294.324,57 | 308.687.972,89 | 19.423.916,96 | 6,71% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO | 6.201.638,42 | 9.800.000,00 | 0,00 | 17.705.109,58 | 1.703.471,16 | 10,65% | 20,07% |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 13.713.020,37 | 5.600.000,00 | 0,00 | 20.934.051,95 | 1.621.031,58 | 8,39% | 12,14% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 8.908.792,67 | 0,00 | 10.235.188,88 | 0,00 | 1.326.396,21 | 14,89% | 20,17% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 11.291.492,22 | 0,00 | 0,00 | 12.504.811,19 | 1.213.318,97 | 10,75% | 10,75% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 6.857.949,28 | 11.500.000,00 | 0,00 | 19.314.153,78 | 956.204,50 | 5,21% | 11,84% |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES | 4.550.814,16 | 1.500.000,00 | 0,00 | 6.541.696,20 | 490.882,04 | 8,11% | 10,59% |
| DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | 9.247.494,10 | 0,00 | 9.673.765,38 | 0,00 | 426.271,28 | 4,61% | 3,42% |
| MULTINVEST FI AÇÕES | 9.696.340,64 | 0,00 | 9.983.125,38 | 0,00 | 286.784,74 | 2,96% | 3,17% |
| TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO... | 15.993.183,93 | 5.000.000,00 | 3.842.203,40 | 17.410.953,52 | 259.972,99 | 1,24% | 5,75% |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 5.298.916,91 | 0,00 | 0,00 | 5.549.521,72 | 250.604,81 | 4,73% | 4,73% |
| HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11 | 1.138.938,60 | 0,00 | 50.915,00 | 1.305.221,00 | 217.197,40 | 19,07% | 14,60% |
| BR HOTÉIS FII - BRHT11B | 7.219.914,96 | 0,00 | 491.280,50 | 6.942.777,18 | 214.142,72 | 2,97% | -8,80% |
| KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA | 2.011.592,36 | 0,00 | 40.631,52 | 2.080.106,34 | 109.145,50 | 5,43% | 3,41% |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | 9.983.153,62 | 0,00 | 0,00 | 9.896.720,54 | -86.433,08 | -0,87% | -0,87% |
| META VALOR FI AÇÕES | 13.468.958,56 | 0,00 | 13.211.310,57 | 0,00 | -257.647,99 | -1,91% | -2,17% |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ... | 1.819.354,02 | 0,00 | 0,00 | 1.329.031,66 | -490.322,36 | -26,95% | -26,95% |
| MULTI SHOPPINGS FII - SHOP11 | 1.980.697,32 | 0,00 | 0,00 | 1.444.524,00 | -536.173,32 | -27,07% | - |
| Total Renda Variável | 129.382.252,14 | 33.400.000,00 | 47.528.420,63 | 122.958.678,66 | 7.704.847,15 | 4,73% | |



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|---------------------|--------------|------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6.444.091,76 | 0,00 | 7.271.169,73 | 0,00 | 827.077,97 | 12,83% | 14,53% |
| ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A... | 7.530.721,07 | 0,00 | 0,00 | 7.846.213,31 | 315.492,24 | 4,19% | 4,19% |
| BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.431.191,71 | 3.598.420,22 | 0,00 | 6.272.038,09 | 242.426,16 | 4,02% | 7,68% |
| Total Exterior | 16.406.004,54 | 3.598.420,22 | 7.271.169,73 | 14.118.251,40 | 1.384.996,37 | 6,92% | |

Disclaimer

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

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

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

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

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

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

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

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

