

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

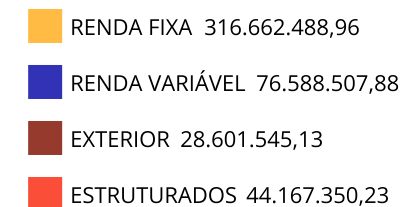
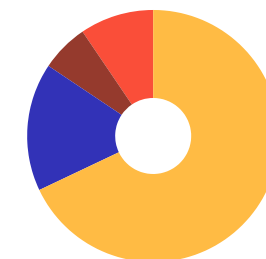
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|-----------|---------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 41.061.773,81 | 8,81% | 515 | 0,92% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P... | D+0 | 1795 dias | 10.135.072,86 | 2,17% | 189 | 1,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | Não Inf... | Não há | 20.202.346,34 | 4,34% | 180 | 1,22% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 86.343,85 | 0,02% | 901 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 7.073.455,60 | 1,52% | 723 | 0,17% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 16.684.739,51 | 3,58% | 5.846 | 8,76% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | D+1 | Não há | 14.550.497,73 | 3,12% | 88 | 0,99% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO... | D+0 | Não há | 23.997.525,36 | 5,15% | 216 | 0,82% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 1.317.370,56 | 0,28% | 980 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0 | Não há | 17.567.757,88 | 3,77% | 1.126 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM... | D+0 | Não há | 1.680.995,00 | 0,36% | 352 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 80.974.240,68 | 17,38% | 1.004 | 0,53% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 3.745.529,20 | 0,80% | 416 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R... | D+0 | Não há | 46.382.193,71 | 9,95% | 470 | 1,53% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL | D+0 | | 10.497.831,69 | 2,25% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV |
| MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | D+1 | Não há | 11.673.176,10 | 2,50% | 3.754 | 2,64% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' |
| SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | D+1 du | Não há | 9.031.639,08 | 1,94% | 813 | 4,09% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 7.880.139,80 | 1,69% | 3.044 | 0,59% | Artigo 8º, Inciso I |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 7.599.109,64 | 1,63% | 441 | 3,72% | Artigo 8º, Inciso I |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES | D+3 du ... | Não há | 6.291.198,92 | 1,35% | 621 | 0,94% | 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 |
|---|------------|----------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+32 | Não há | 10.274.888,71 | 2,20% | 39 | 0,71% | Artigo 8º, Inciso I |
| OCCAM FIC AÇÕES | D+4 ou ... | Não há | 9.004.633,40 | 1,93% | 1.398 | 0,94% | Artigo 8º, Inciso I |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | D+4 | Não há | 14.538.136,04 | 3,12% | 2.068 | 4,53% | Artigo 8º, Inciso I |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | D+32 | Não há | 9.119.179,07 | 1,96% | 49 | 0,58% | Artigo 8º, Inciso I |
| TARPON WAHOO FIC AÇÕES | D+32 | Não há | 6.793.248,31 | 1,46% | 159 | 4,17% | Artigo 8º, Inciso I |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+3 du ... | Não há | 5.087.973,99 | 1,09% | 1.861 | 0,50% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI... | D+5 du | Não há | 866.653,12 | 0,19% | 57 | 0,17% | Artigo 9º, Inciso II |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR... | D+6 du | Não há | 2.194.984,63 | 0,47% | 44 | 1,82% | Artigo 9º, Inciso II |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME... | D+5 | Não há | 6.603.594,12 | 1,42% | 8.888 | 1,01% | Artigo 9º, Inciso II |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+5 | Não há | 9.045.998,29 | 1,94% | 405 | 1,24% | Artigo 9º, Inciso III |
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+5 | Não há | 9.890.314,97 | 2,12% | 70.194 | 0,69% | Artigo 9º, Inciso III |
| BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO | D+1 du | Não há | 7.730.464,57 | 1,66% | 26.984 | 1,19% | Artigo 10º, Inciso I |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | D+2 du | Não há | 8.907.118,68 | 1,91% | 2.264 | 1,81% | Artigo 10º, Inciso I |
| ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO | D+32 | Não há | 5.644.738,88 | 1,21% | 155 | 2,40% | Artigo 10º, Inciso I |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA... | D+3 du | 25 meses | 5.383.938,51 | 1,16% | 21 | 2,43% | Artigo 10º, Inciso I |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 16.501.089,59 | 3,54% | 703 | 1,83% | Artigo 10º, Inciso I |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 466.019.892,20 | | | | |

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

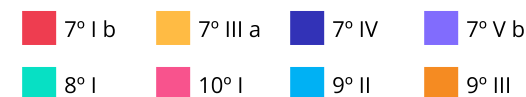
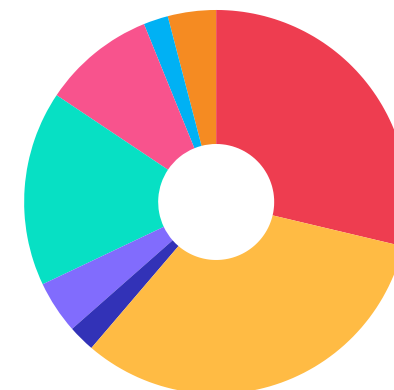
| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 50,00% | 233.009.946,10 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 133.791.755,06 | 28,71% | 15,00% | 20,00% | 75,00% | 215.723.164,09 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 46.601.989,22 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 151.668.087,03 | 32,55% | 20,00% | 30,50% | 60,00% | 127.943.848,29 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 9.320.397,84 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 10.497.831,69 | 2,25% | 0,00% | 3,00% | 20,00% | 82.706.146,75 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 5,00% | 20.704.815,18 | 4,44% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 2.596.179,43 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 316.662.488,96 | 67,95% | 35,00% | 68,50% | 222,00% | |



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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|---|---------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 76.588.507,88 | 16,43% | 10,00% | 15,00% | 30,00% | 63.217.459,78 |
| Artigo 8º, Inciso II | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 46.601.989,22 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 44.167.350,23 | 9,48% | 6,00% | 10,00% | 10,00% | 2.434.638,99 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 120.755.858,11 | 25,91% | 16,00% | 26,00% | 50,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2023 | | | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|----------------------|--------------|--|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso II | 10,00% | 9.665.231,87 | 2,07% | 0,00% | 2,00% | 10,00% | 36.936.757,35 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 18.936.313,26 | 4,06% | 0,00% | 3,50% | 10,00% | 27.665.675,96 |
| Total Exterior | 10,00% | 28.601.545,13 | 6,14% | 0,00% | 5,50% | 20,00% | |





Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM | 113.762.910,67 | 24,41 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 70.948.628,23 | 15,22 | - |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 46.382.193,71 | 9,95 | 0,01 |
| PORTO SEGURO INVESTIMENTOS | 23.997.525,36 | 5,15 | - |
| SOMMA INVESTIMENTOS | 23.569.775,12 | 5,06 | - |
| ICATU VANGUARDA | 22.329.478,39 | 4,79 | 0,04 |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT | 16.501.089,59 | 3,54 | 0,01 |
| TARPON INVESTIMENTOS | 15.912.427,38 | 3,41 | 0,22 |
| ITAÚ UNIBANCO | 14.550.497,73 | 3,12 | 0,00 |
| MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS | 11.673.176,10 | 2,50 | 0,10 |
| GUEPARDO INVESTIMENTOS | 10.274.888,71 | 2,20 | 0,22 |
| WESTERN ASSET | 9.890.314,97 | 2,12 | - |
| BANCO J. SAFRA S/A | 9.045.998,29 | 1,94 | 0,00 |
| OCCAM BRASIL | 9.004.633,40 | 1,93 | 0,08 |
| BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S... | 8.907.118,68 | 1,91 | 0,01 |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS | 7.880.139,80 | 1,69 | 0,03 |
| BRDESCO ASSET MANAGEMENT | 7.730.464,57 | 1,66 | 0,00 |
| BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT | 7.599.109,64 | 1,63 | 0,01 |
| XP ASSET MANAGEMENT | 6.603.594,12 | 1,42 | - |
| CLARITAS INVESTIMENTOS | 6.291.198,92 | 1,35 | 0,07 |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS | 5.383.938,51 | 1,16 | 0,06 |
| TRUXT INVESTIMENTOS | 5.087.973,99 | 1,09 | 0,03 |

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 ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 50,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 133.791.755,06 | 28,71 | 15,00 | 75,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 151.668.087,03 | 32,55 | 20,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 20.704.815,18 | 4,44 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 76.588.507,88 | 16,43 | 10,00 | 30,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 9.665.231,87 | 2,07 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 18.936.313,26 | 4,06 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 44.167.350,23 | 9,48 | 6,00 | 10,00 |
| 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 |
|--|-------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| 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% | 0,03% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,05% | 7,04% | 2,55% | 7,04% | 10,23% | 21,32% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 1,04% | 6,94% | 2,50% | 6,94% | 10,04% | 20,89% | 0,89% | 0,02% |
| 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% | 0,04% |
| IRF-M (Benchmark) | 2,12% | 9,62% | 5,52% | 9,62% | 16,74% | 18,79% | - | - |
| ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP | 3,36% | 13,44% | 9,26% | 13,44% | 20,65% | 13,38% | 2,12% | 0,07% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,09% | 9,44% | 5,43% | 9,44% | 16,38% | 18,13% | 0,90% | 0,03% |
| CDI (Benchmark) | 1,07% | 6,50% | 3,15% | 6,50% | 13,54% | 23,37% | - | - |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES | 0,99% | 5,64% | 2,77% | 5,64% | 11,68% | 19,63% | 0,00% | 0,00% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 1,09% | 6,44% | 3,16% | 6,44% | 13,54% | 23,74% | 0,01% | 0,00% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 1,00% | 5,98% | 2,90% | 5,98% | 12,44% | 20,85% | 0,01% | 0,00% |
| SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 1,04% | 3,65% | 3,17% | 3,65% | 11,37% | 22,63% | 0,18% | 0,02% |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,15% | 6,37% | 3,26% | 6,37% | 13,60% | 24,20% | 0,02% | 0,00% |
| PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,11% | 6,47% | 3,15% | 6,47% | 13,57% | 23,84% | 0,03% | 0,00% |



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 |
|---|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|----------|------------------|
| MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | -0,02% | 1,10% | 1,05% | 1,10% | 8,40% | 19,45% | 0,91% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 1,16% | 6,50% | 3,32% | 6,50% | 13,62% | 24,11% | 0,03% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1,12% | 6,42% | 3,25% | 6,42% | 13,55% | 23,98% | 0,01% | 0,00% |
| IPCA (Benchmark) | -0,08% | 2,87% | 0,76% | 2,87% | 3,16% | 15,42% | - | - |
| LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,95% | 9,20% | 3,88% | 9,20% | 10,92% | - | 1,44% | 0,03% |
| Não definido (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,94% | - | - | - | - | - | 0,47% | - |

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 definido (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 1,85% | 7,37% | 3,92% | 7,37% | - | - | 0,58% | - |
| CDI (Benchmark) | 1,07% | 6,50% | 3,15% | 6,50% | 13,54% | 23,37% | - | - |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 1,07% | 5,83% | 2,95% | 5,83% | 12,72% | 22,63% | 0,17% | 0,01% |
| BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO | 6,97% | 19,79% | 10,25% | 19,79% | 27,69% | 19,55% | 5,08% | 0,20% |
| Ibovespa (Benchmark) | 9,00% | 7,61% | 15,91% | 7,61% | 19,83% | -6,87% | - | - |
| OCCAM FIC AÇÕES | 10,15% | 4,56% | 11,89% | 4,56% | 13,86% | -8,85% | 8,32% | 0,18% |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 9,55% | 21,68% | 28,86% | 21,68% | 39,60% | 18,74% | 8,57% | 0,23% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 7,60% | 6,86% | 13,93% | 6,86% | 13,62% | -12,04% | 7,44% | 0,18% |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 9,41% | 5,70% | 18,28% | 5,70% | 14,93% | -17,85% | 8,79% | 0,24% |
| TARPON WAHOO FIC AÇÕES | 10,55% | 13,78% | 24,77% | 13,78% | 31,86% | 7,09% | 8,76% | 0,26% |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | 10,13% | 24,83% | 30,45% | 24,83% | 48,58% | 32,81% | 10,29% | 0,26% |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 7,96% | 1,86% | 14,48% | 1,86% | 12,06% | -17,44% | 7,92% | 0,18% |
| IBX (Benchmark) | 8,87% | 6,59% | 14,96% | 6,59% | 17,60% | -9,50% | - | - |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES | 8,31% | 5,68% | 15,19% | 5,68% | 14,70% | -5,92% | 7,76% | 0,19% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,05% | 7,04% | 2,55% | 7,04% | 10,23% | 21,32% | - | - |

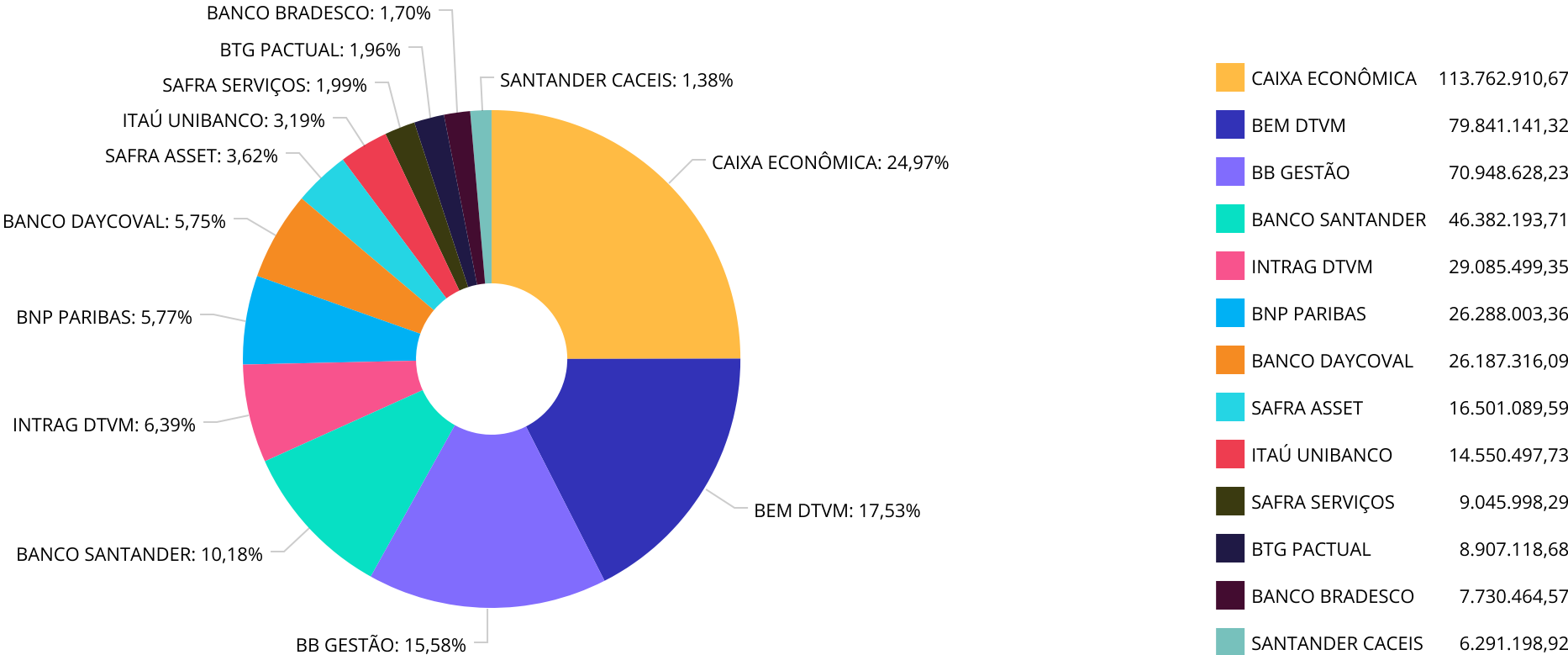
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO | 3,57% | 12,43% | 7,54% | 12,43% | 29,33% | 16,22% | 2,11% | 0,05% |
| S&P 500 (Benchmark) | 6,47% | 15,91% | 8,30% | 15,91% | 17,57% | 3,56% | - | - |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 7,07% | 20,38% | 10,59% | 20,38% | 34,24% | 27,00% | 5,06% | 0,19% |
| SMLL (Benchmark) | 8,17% | 13,26% | 25,16% | 13,26% | 19,79% | -27,64% | - | - |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 8,96% | 9,59% | 15,93% | 9,59% | 13,67% | -20,21% | 9,11% | 0,20% |

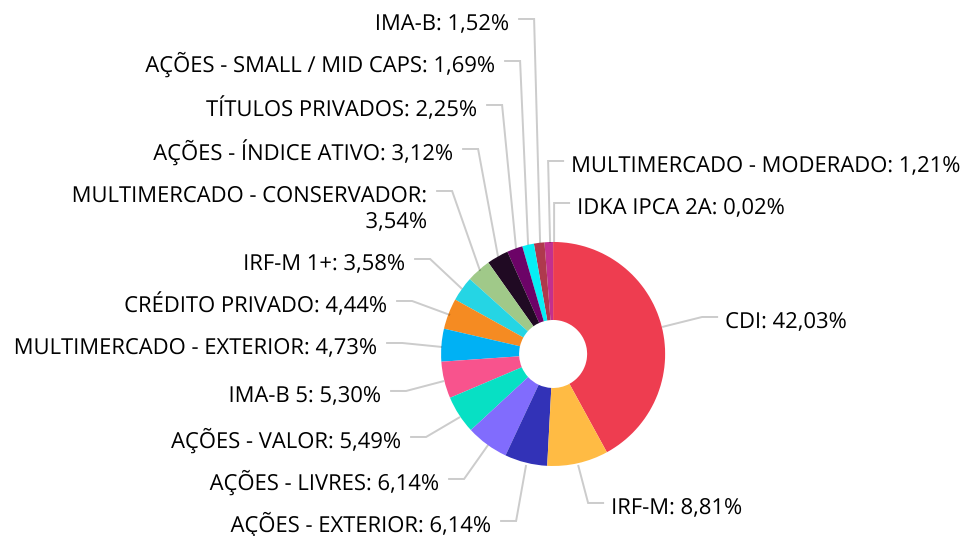
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | 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% | - | - |
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 0,74% | 19,93% | 7,14% | 19,93% | 19,35% | -9,43% | 7,32% | 17,625% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | -0,06% | 7,46% | 2,43% | 7,46% | 6,61% | -9,35% | 5,79% | 14,722% |
| MSCI WORLD (Benchmark) | 0,18% | 5,28% | 0,82% | 5,28% | 7,20% | -5,27% | - | - |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 0,56% | 21,72% | 5,61% | 21,72% | 25,89% | -30,09% | 7,68% | 21,264% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR... | -0,60% | -1,85% | -3,91% | -1,85% | 4,38% | -7,96% | 7,04% | 14,159% |
| MSCI ACWI (Benchmark) | -0,09% | 4,18% | 0,15% | 4,18% | 5,27% | -8,63% | - | - |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | -0,45% | 0,54% | -0,89% | 0,54% | 3,53% | -3,24% | 6,90% | 12,744% |

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



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

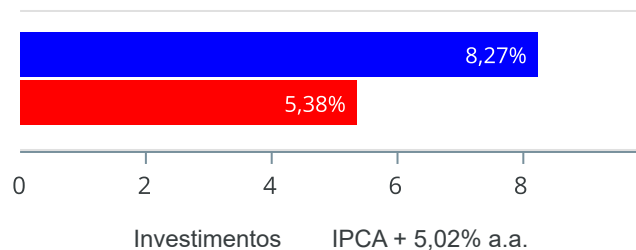


| | | | | | |
|------------------------------|----------------|------------------------|---------------|---------------------------|---------------|
| ■ CDI | 195.867.958,73 | ■ IRF-M | 41.061.773,81 | ■ AÇÕES - EXTERIOR | 28.601.545,13 |
| ■ AÇÕES - LIVRES | 28.599.511,01 | ■ AÇÕES - VALOR | 25.570.721,03 | ■ IMA-B 5 | 24.685.570,59 |
| ■ MULTIMERCADO - EXTERIOR | 22.021.521,76 | ■ CRÉDITO PRIVADO | 20.704.815,18 | ■ IRF-M 1+ | 16.684.739,51 |
| ■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 16.501.089,59 | ■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 14.538.136,04 | ■ TÍTULOS PRIVADOS | 10.497.831,69 |
| ■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS | 7.880.139,80 | ■ IMA-B | 7.073.455,60 | ■ MULTIMERCADO - MODERADO | 5.644.738,88 |
| ■ IDKA IPCA 2A | 86.343,85 | | | | |

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 | 412.396.291,87 | 15.444.363,04 | 10.882.802,49 | 424.062.538,44 | 7.104.686,02 | 7.104.686,02 | 1,70% | 1,70% | 0,96% | 0,96% | 177,35% | 2,84% |
| Fevereiro | 424.062.538,44 | 14.238.389,30 | 11.728.733,81 | 424.360.562,78 | -2.211.631,15 | 4.893.054,87 | -0,52% | 1,18% | 1,19% | 2,17% | 54,33% | 2,45% |
| Março | 424.360.562,78 | 37.577.193,22 | 34.989.554,38 | 429.774.024,83 | 2.825.823,21 | 7.718.878,08 | 0,66% | 1,85% | 1,16% | 3,35% | 55,08% | 2,65% |
| Abril | 429.774.024,83 | 12.021.049,97 | 9.025.429,94 | 437.723.128,58 | 4.953.483,72 | 12.672.361,80 | 1,14% | 3,01% | 0,96% | 4,35% | 69,29% | 2,47% |
| Mai | 437.723.128,58 | 100.065.323,81 | 97.067.701,76 | 450.830.850,91 | 10.110.100,28 | 22.782.462,08 | 2,29% | 5,38% | 0,66% | 5,04% | 106,75% | 2,58% |
| Junho | 450.830.850,91 | 16.181.157,17 | 13.451.670,13 | 466.019.892,20 | 12.459.554,25 | 35.242.016,33 | 2,75% | 8,27% | 0,33% | 5,38% | 153,70% | 2,40% |

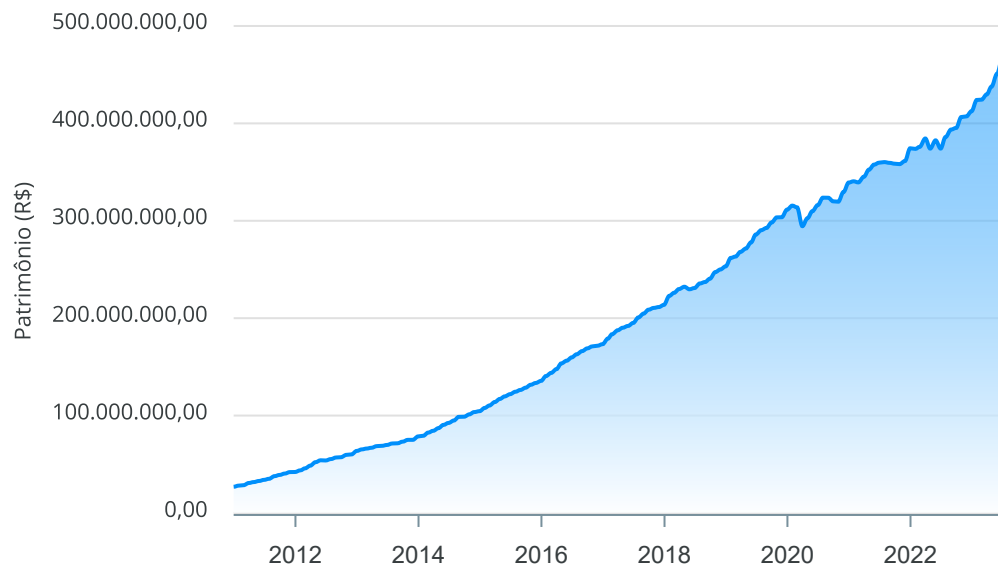
Investimentos x Meta de Rentabilidade



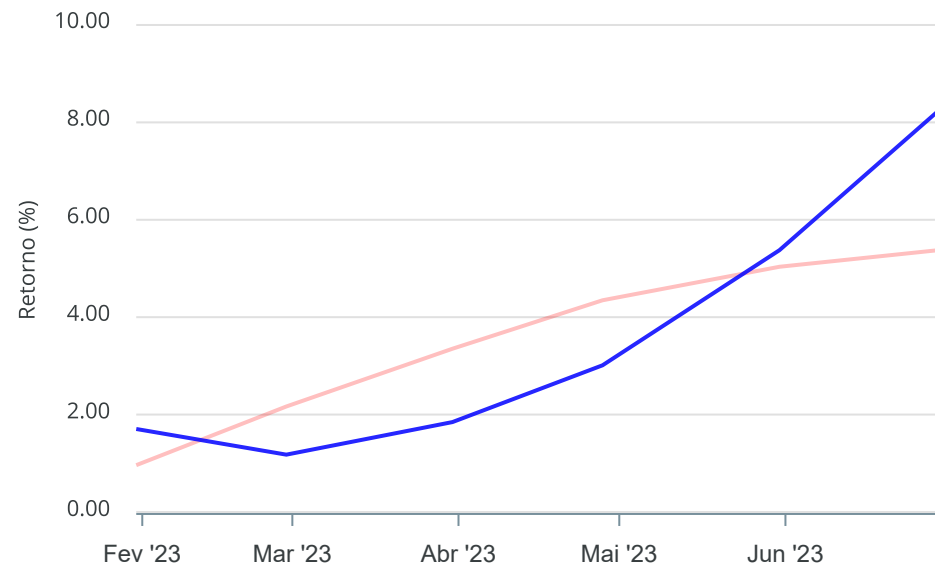
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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 |
|---|-----------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP | 16.143.080,09 | 0,00 | 0,00 | 16.684.739,51 | 541.659,42 | 3,36% | 3,36% | 2,12% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 40.220.078,41 | 0,00 | 0,00 | 41.061.773,81 | 841.695,40 | 2,09% | 2,09% | 0,90% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 3.702.688,01 | 0,00 | 0,00 | 3.745.529,20 | 42.841,19 | 1,16% | 1,16% | 0,03% |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF... | 45.855.526,72 | 0,00 | 0,00 | 46.382.193,71 | 526.666,99 | 1,15% | 1,15% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 80.081.026,91 | 0,00 | 0,00 | 80.974.240,68 | 893.213,77 | 1,12% | 1,12% | 0,01% |
| PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D... | 23.734.611,20 | 0,00 | 0,00 | 23.997.525,36 | 262.914,16 | 1,11% | 1,11% | 0,03% |
| SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 8.933.066,43 | 0,00 | 0,00 | 9.031.639,08 | 98.572,65 | 1,10% | 1,04% | 0,18% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 17.377.898,79 | 0,00 | 0,00 | 17.567.757,88 | 189.859,09 | 1,09% | 1,09% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 0,00 | 7.000.000,00 | 0,00 | 7.073.455,60 | 73.455,60 | 1,05% | 2,35% | 2,12% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 85.452,36 | 0,00 | 0,00 | 86.343,85 | 891,49 | 1,04% | 1,04% | 0,83% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 14.401.476,44 | 0,00 | 0,00 | 14.550.497,73 | 149.021,29 | 1,03% | 1,03% | 0,89% |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 20.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 20.202.346,34 | 202.346,34 | 1,01% | 0,94% | 0,47% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE... | 10.039.760,31 | 0,00 | 0,00 | 10.135.072,86 | 95.312,55 | 0,95% | 0,95% | 1,44% |
| LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL | 10.406.024,30 | 0,00 | 0,00 | 10.497.831,69 | 91.807,39 | 0,88% | - | - |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL... | 1.869.139,92 | 5.086.388,80 | 5.302.834,91 | 1.680.995,00 | 28.301,19 | 0,41% | 0,99% | 0,00% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 1.269.125,55 | 4.094.768,37 | 4.054.066,85 | 1.317.370,56 | 7.543,49 | 0,14% | 1,00% | 0,01% |
| MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 11.675.562,55 | 0,00 | 0,00 | 11.673.176,10 | -2.386,45 | -0,02% | -0,02% | 0,91% |
| Total Renda Fixa | 305.794.517,99 | 16.181.157,17 | 9.356.901,76 | 316.662.488,96 | 4.043.715,56 | 1,29% | | 0,46% |

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 |
|--|-----------------------|-------------|---------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| TARPON WAHOO FIC AÇÕES | 6.145.209,41 | 0,00 | 0,00 | 6.793.248,31 | 648.038,90 | 10,55% | 10,55% | 8,76% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 3.715.414,36 | 0,00 | 4.094.768,37 | 0,00 | 379.354,01 | 10,21% | 8,96% | 7,42% |
| OCCAM FIC AÇÕES | 8.175.176,05 | 0,00 | 0,00 | 9.004.633,40 | 829.457,35 | 10,15% | 10,15% | 8,32% |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | 8.280.769,06 | 0,00 | 0,00 | 9.119.179,07 | 838.410,01 | 10,12% | 10,12% | 10,29% |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 9.379.137,54 | 0,00 | 0,00 | 10.274.888,71 | 895.751,17 | 9,55% | 9,55% | 8,57% |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 4.650.392,95 | 0,00 | 0,00 | 5.087.973,99 | 437.581,04 | 9,41% | 9,41% | 8,79% |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 7.231.995,47 | 0,00 | 0,00 | 7.880.139,80 | 648.144,33 | 8,96% | 8,96% | 9,11% |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES | 5.808.591,42 | 0,00 | 0,00 | 6.291.198,92 | 482.607,50 | 8,31% | 8,31% | 7,76% |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 13.466.809,95 | 0,00 | 0,00 | 14.538.136,04 | 1.071.326,09 | 7,96% | 7,96% | 7,92% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 7.062.632,60 | 0,00 | 0,00 | 7.599.109,64 | 536.477,04 | 7,60% | 7,60% | 7,44% |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 8.318.668,07 | 0,00 | 0,00 | 8.907.118,68 | 588.450,61 | 7,07% | 7,07% | 5,06% |
| BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO | 7.226.779,37 | 0,00 | 0,00 | 7.730.464,57 | 503.685,20 | 6,97% | 6,97% | 5,08% |
| ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO | 5.450.040,66 | 0,00 | 0,00 | 5.644.738,88 | 194.698,22 | 3,57% | 3,57% | 2,11% |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 5.286.375,00 | 0,00 | 0,00 | 5.383.938,51 | 97.563,51 | 1,85% | 1,85% | 0,58% |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 16.326.405,73 | 0,00 | 0,00 | 16.501.089,59 | 174.683,86 | 1,07% | 1,07% | 0,17% |
| Total Renda Variável | 116.524.397,64 | 0,00 | 4.094.768,37 | 120.755.858,11 | 8.326.228,84 | 7,15% | | 6,26% |

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 |
|---|----------------------|-------------|-------------|----------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 9.817.187,57 | 0,00 | 0,00 | 9.890.314,97 | 73.127,40 | 0,74% | 0,74% | 7,32% |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT... | 6.566.630,78 | 0,00 | 0,00 | 6.603.594,12 | 36.963,34 | 0,56% | 0,56% | 7,68% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 9.051.261,68 | 0,00 | 0,00 | 9.045.998,29 | -5.263,39 | -0,06% | -0,06% | 5,79% |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 2.204.956,87 | 0,00 | 0,00 | 2.194.984,63 | -9.972,24 | -0,45% | -0,45% | 6,90% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME... | 871.898,38 | 0,00 | 0,00 | 866.653,12 | -5.245,26 | -0,60% | -0,60% | 7,04% |
| Total Exterior | 28.511.935,28 | 0,00 | 0,00 | 28.601.545,13 | 89.609,85 | 0,31% | | 6,88% |

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 |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|--------------|------------|
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 81.425.419,59 | 0,00 | 3.000.000,00 | 80.974.240,68 | 2.548.821,09 | 3,13% | 3,25% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 30.154.993,48 | 9.000.000,00 | 0,00 | 41.061.773,81 | 1.906.780,33 | 4,87% | 5,43% |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF... | 44.919.171,41 | 0,00 | 0,00 | 46.382.193,71 | 1.463.022,30 | 3,26% | 3,26% |
| ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP | 15.270.848,93 | 0,00 | 0,00 | 16.684.739,51 | 1.413.890,58 | 9,26% | 9,26% |
| PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D... | 23.264.207,42 | 0,00 | 0,00 | 23.997.525,36 | 733.317,94 | 3,15% | 3,15% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 44.895.997,37 | 0,00 | 45.558.010,34 | 0,00 | 662.012,97 | 1,47% | 3,15% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 17.029.116,38 | 0,00 | 0,00 | 17.567.757,88 | 538.641,50 | 3,16% | 3,16% |
| LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL | 10.153.399,76 | 0,00 | 0,00 | 10.497.831,69 | 344.431,93 | 3,39% | - |
| SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 8.749.312,38 | 0,00 | 0,00 | 9.031.639,08 | 282.326,70 | 3,23% | 3,17% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 5.303.207,39 | 9.000.000,00 | 0,00 | 14.550.497,73 | 247.290,34 | 1,73% | 2,50% |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00 | 20.000.000,00 | 0,00 | 20.202.346,34 | 202.346,34 | 1,01% | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE... | 0,00 | 10.000.000,00 | 0,00 | 10.135.072,86 | 135.072,86 | 1,35% | 3,88% |
| MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 11.551.960,28 | 0,00 | 0,00 | 11.673.176,10 | 121.215,82 | 1,05% | 1,05% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 3.309.650,79 | 318.403,24 | 0,00 | 3.745.529,20 | 117.475,17 | 3,24% | 3,32% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL... | 2.225.754,98 | 40.540.359,34 | 41.159.213,88 | 1.680.995,00 | 74.094,56 | 0,17% | 2,77% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 0,00 | 7.000.000,00 | 0,00 | 7.073.455,60 | 73.455,60 | 1,05% | 7,06% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 66.174,40 | 26.708.768,37 | 25.482.809,24 | 1.317.370,56 | 25.237,03 | 0,09% | 2,90% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 332.755,79 | 0,00 | 250.000,00 | 86.343,85 | 3.588,06 | 1,08% | 2,14% |
| Total Renda Fixa | 298.651.970,35 | 122.567.530,95 | 115.450.033,46 | 316.662.488,96 | 10.893.021,12 | 3,56% | |

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 |
|--|-----------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|----------------------|---------------|------------|
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 7.973.520,46 | 0,00 | 0,00 | 10.274.888,71 | 2.301.368,25 | 28,86% | 28,86% |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | 6.990.738,29 | 0,00 | 0,00 | 9.119.179,07 | 2.128.440,78 | 30,45% | 30,45% |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 12.699.794,43 | 0,00 | 0,00 | 14.538.136,04 | 1.838.341,61 | 14,48% | 14,48% |
| TARPON WAHOO FIC AÇÕES | 5.444.709,25 | 0,00 | 0,00 | 6.793.248,31 | 1.348.539,06 | 24,77% | 24,77% |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 6.797.380,30 | 0,00 | 0,00 | 7.880.139,80 | 1.082.759,50 | 15,93% | 15,93% |
| OCCAM FIC AÇÕES | 5.035.304,21 | 3.000.000,00 | 0,00 | 9.004.633,40 | 969.329,19 | 12,06% | 11,89% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 6.669.876,25 | 0,00 | 0,00 | 7.599.109,64 | 929.233,39 | 13,93% | 13,93% |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 8.054.555,13 | 0,00 | 0,00 | 8.907.118,68 | 852.563,55 | 10,58% | 10,58% |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES | 5.461.805,99 | 0,00 | 0,00 | 6.291.198,92 | 829.392,93 | 15,19% | 15,19% |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 4.301.485,22 | 0,00 | 0,00 | 5.087.973,99 | 786.488,77 | 18,28% | 18,28% |
| BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO | 7.011.842,17 | 0,00 | 0,00 | 7.730.464,57 | 718.622,40 | 10,25% | 10,25% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 3.542.664,89 | 0,00 | 4.094.768,37 | 0,00 | 552.103,48 | 15,58% | 14,28% |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 16.027.591,61 | 0,00 | 0,00 | 16.501.089,59 | 473.497,98 | 2,95% | 2,95% |
| ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO | 5.248.904,86 | 0,00 | 0,00 | 5.644.738,88 | 395.834,02 | 7,54% | 7,54% |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 5.180.800,34 | 0,00 | 0,00 | 5.383.938,51 | 203.138,17 | 3,92% | 3,92% |
| Total Renda Variável | 106.440.973,40 | 3.000.000,00 | 4.094.768,37 | 120.755.858,11 | 15.409.653,08 | 14,08% | |

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 |
|---|----------------------|---------------------|-------------|----------------------|---------------------|--------------|------------|
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6.479.668,83 | 2.700.000,00 | 0,00 | 9.890.314,97 | 710.646,14 | 7,74% | 7,14% |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT... | 6.253.016,54 | 0,00 | 0,00 | 6.603.594,12 | 350.577,58 | 5,61% | 5,61% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 8.831.739,36 | 0,00 | 0,00 | 9.045.998,29 | 214.258,93 | 2,43% | 2,43% |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 2.214.743,71 | 0,00 | 0,00 | 2.194.984,63 | -19.759,08 | -0,89% | -0,89% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME... | 901.912,64 | 0,00 | 0,00 | 866.653,12 | -35.259,52 | -3,91% | -3,91% |
| Total Exterior | 24.681.081,08 | 2.700.000,00 | 0,00 | 28.601.545,13 | 1.220.464,05 | 4,46% | |

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 |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|--------------|------------|
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 78.996.220,84 | 0,00 | 3.000.000,00 | 80.974.240,68 | 4.978.019,84 | 6,30% | 6,42% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 80.397.820,14 | 0,00 | 83.558.010,34 | 0,00 | 3.160.190,20 | 3,93% | 6,59% |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF... | 43.603.540,38 | 0,00 | 0,00 | 46.382.193,71 | 2.778.653,33 | 6,37% | 6,37% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 0,00 | 39.000.000,00 | 0,00 | 41.061.773,81 | 2.061.773,81 | 5,29% | 9,44% |
| ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP | 14.708.628,84 | 0,00 | 0,00 | 16.684.739,51 | 1.976.110,67 | 13,44% | 13,44% |
| PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D... | 18.057.835,92 | 4.500.000,00 | 0,00 | 23.997.525,36 | 1.439.689,44 | 6,38% | 6,47% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 12.037.112,78 | 4.500.000,00 | 0,00 | 17.567.757,88 | 1.030.645,10 | 6,23% | 6,44% |
| LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL | 0,00 | 10.000.000,00 | 0,00 | 10.497.831,69 | 497.831,69 | 4,98% | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 5.083.046,99 | 9.000.000,00 | 0,00 | 14.550.497,73 | 467.450,74 | 3,32% | 6,94% |
| SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 8.708.302,50 | 0,00 | 0,00 | 9.031.639,08 | 323.336,58 | 3,71% | 3,65% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 3.210.652,19 | 318.403,24 | 0,00 | 3.745.529,20 | 216.473,77 | 6,13% | 6,50% |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00 | 20.000.000,00 | 0,00 | 20.202.346,34 | 202.346,34 | 1,01% | - |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL... | 6.499.815,88 | 51.299.013,00 | 56.256.408,78 | 1.680.995,00 | 138.574,90 | 0,24% | 5,64% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE... | 0,00 | 10.000.000,00 | 0,00 | 10.135.072,86 | 135.072,86 | 1,35% | 9,20% |
| MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 11.546.432,69 | 0,00 | 0,00 | 11.673.176,10 | 126.743,41 | 1,10% | 1,10% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 0,00 | 7.000.000,00 | 0,00 | 7.073.455,60 | 73.455,60 | 1,05% | 11,24% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 58.507,85 | 31.210.060,27 | 29.986.705,02 | 1.317.370,56 | 35.507,46 | 0,11% | 5,98% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 318.827,11 | 0,00 | 250.000,00 | 86.343,85 | 17.516,74 | 5,49% | 6,60% |
| Total Renda Fixa | 283.226.744,11 | 186.827.476,51 | 173.051.124,14 | 316.662.488,96 | 19.659.392,48 | 6,62% | |

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 |
|--|-----------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|----------------------|---------------|------------|
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 8.444.287,28 | 0,00 | 0,00 | 10.274.888,71 | 1.830.601,43 | 21,68% | 21,68% |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | 7.305.113,75 | 0,00 | 0,00 | 9.119.179,07 | 1.814.065,32 | 24,83% | 24,83% |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 7.399.244,31 | 0,00 | 0,00 | 8.907.118,68 | 1.507.874,37 | 20,38% | 20,38% |
| BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO | 6.453.243,23 | 0,00 | 0,00 | 7.730.464,57 | 1.277.221,34 | 19,79% | 19,79% |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 15.591.801,03 | 0,00 | 0,00 | 16.501.089,59 | 909.288,56 | 5,83% | 5,83% |
| TARPON WAHOO FIC AÇÕES | 5.970.436,52 | 0,00 | 0,00 | 6.793.248,31 | 822.811,79 | 13,78% | 13,78% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 3.805.746,35 | 3.000.000,00 | 0,00 | 7.599.109,64 | 793.363,29 | 11,66% | 6,86% |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 7.190.367,58 | 0,00 | 0,00 | 7.880.139,80 | 689.772,22 | 9,59% | 9,59% |
| ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO | 5.020.852,90 | 0,00 | 0,00 | 5.644.738,88 | 623.885,98 | 12,43% | 12,43% |
| OCCAM FIC AÇÕES | 5.388.343,46 | 3.000.000,00 | 0,00 | 9.004.633,40 | 616.289,94 | 7,35% | 4,56% |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 5.014.331,67 | 0,00 | 0,00 | 5.383.938,51 | 369.606,84 | 7,37% | 7,37% |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES | 5.952.937,72 | 0,00 | 0,00 | 6.291.198,92 | 338.261,20 | 5,68% | 5,68% |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 4.813.478,48 | 0,00 | 0,00 | 5.087.973,99 | 274.495,51 | 5,70% | 5,70% |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 14.272.086,97 | 0,00 | 0,00 | 14.538.136,04 | 266.049,07 | 1,86% | 1,86% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 3.849.464,69 | 0,00 | 4.094.768,37 | 0,00 | 245.303,68 | 6,37% | 5,17% |
| Total Renda Variável | 106.471.735,94 | 6.000.000,00 | 4.094.768,37 | 120.755.858,11 | 12.378.890,54 | 11,42% | |

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 |
|---|-----------------------|---------------------|-----------------|----------------------|----------------------|--------------------|-------------------|
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 5.788.327,05 | 2.700.000,00 | 0,00 | 9.890.314,97 | 1.401.987,92 | 16,52% | 19,93% |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT... | 5.425.085,75 | 0,00 | 0,00 | 6.603.594,12 | 1.178.508,37 | 21,72% | 21,72% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 8.418.261,61 | 0,00 | 0,00 | 9.045.998,29 | 627.736,68 | 7,46% | 7,46% |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 2.183.171,79 | 0,00 | 0,00 | 2.194.984,63 | 11.812,84 | 0,54% | 0,54% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME... | 882.965,62 | 0,00 | 0,00 | 866.653,12 | -16.312,50 | -1,85% | -1,85% |
| Total Exterior | 22.697.811,82 | 2.700.000,00 | 0,00 | 28.601.545,13 | 3.203.733,31 | 12,61% | |

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 GESTÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.. 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.

