

2023

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

Junho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	191.740.577,13	37,01%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.281.531,06	6,04%	5.696.060.085,44	0,55%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.490.450,98	2,99%	5.348.206.988,95	0,29%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	55.647.716,98	10,74%	7.342.301.496,88	0,76%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.192.674,73	2,74%	2.099.537.000,43	0,68%	7º I b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	95.842.635,02	18,50%	15.331.819.820,88	0,63%	7º III a
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.424.161,78	1,82%	278.166.195,78	3,39%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10.576.610,04	2,04%	1.325.173.539,32	0,80%	8º I
BB AGRO FIC AÇÕES	12.406.283,22	2,39%	379.064.629,52	3,27%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.681.322,10	2,45%	1.365.623.732,74	0,93%	8º I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9.563.204,33	1,85%	762.294.187,16	1,25%	8º I
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM...	6.035.809,25	1,16%	2.772.255.766,10	0,22%	8º II
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.056.142,98	1,75%	1.281.910.332,14	0,71%	9º III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.320.112,81	1,61%	726.616.425,21	1,15%	9º III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.970.928,74	1,15%	1.424.355.998,61	0,42%	9º III
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	6.601.416,50	1,27%	72.550.766,44	9,10%	10º I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	23.313.485,99	4,50%	821.675.560,44	2,84%	10º I

Investimentos

\$ 518.145.063,64

Disponibilidades Financeiras

\$ 4.820.006,84

Total Carteira

\$ 522.965.070,48

Governança (Pró Gestão)

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2040 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	5.000	4.284,507603	21.422.538,02
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.119,34733	8.238.694,66
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.119,34733	12.358.041,99
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.204,722982	4.204.722,98
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.280,992062	11.438.810,79
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.356,208956	34.100.403,71
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.500,457537	5.283.537,15
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.213,222998	8.426.446,00
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.161,277994	34.646.800,58
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.319,225632	198.684,38
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.369,689322	19.663.601,95
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.311,509597	21.557.547,98
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.141,893005	9.526.353,91
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7550%	154	4.379,175505	674.393,03

Investimentos

\$ 518.145.063,64

Disponibilidades Financeiras

\$ 4.820.006,84

Total Carteira

\$ 522.965.070,48

Governança (Pró Gestão)

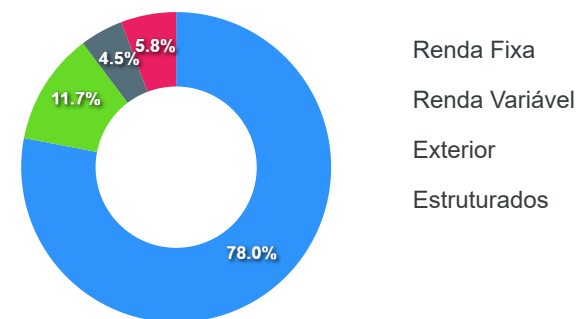


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	37,01%	191.740.577,13 62,99%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,51%	116.612.373,75 77,49%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	18,50%	95.842.635,02 41,50%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	10,55%	54.651.581,47 19,45%
8º II - ETF de Ações	30,00%	1,16%	6.035.809,25 28,84%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	4,51%	23.347.184,53 5,49%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,77%	29.914.902,49 4,23%

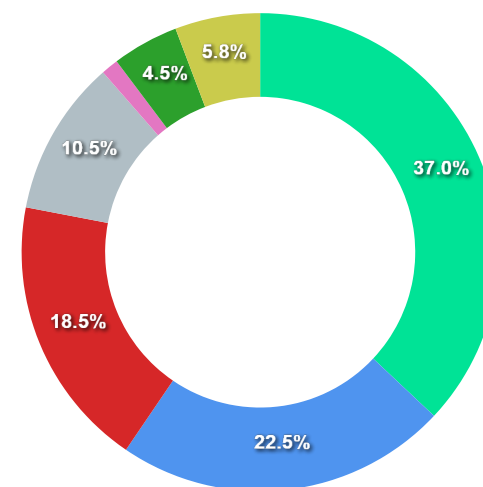
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

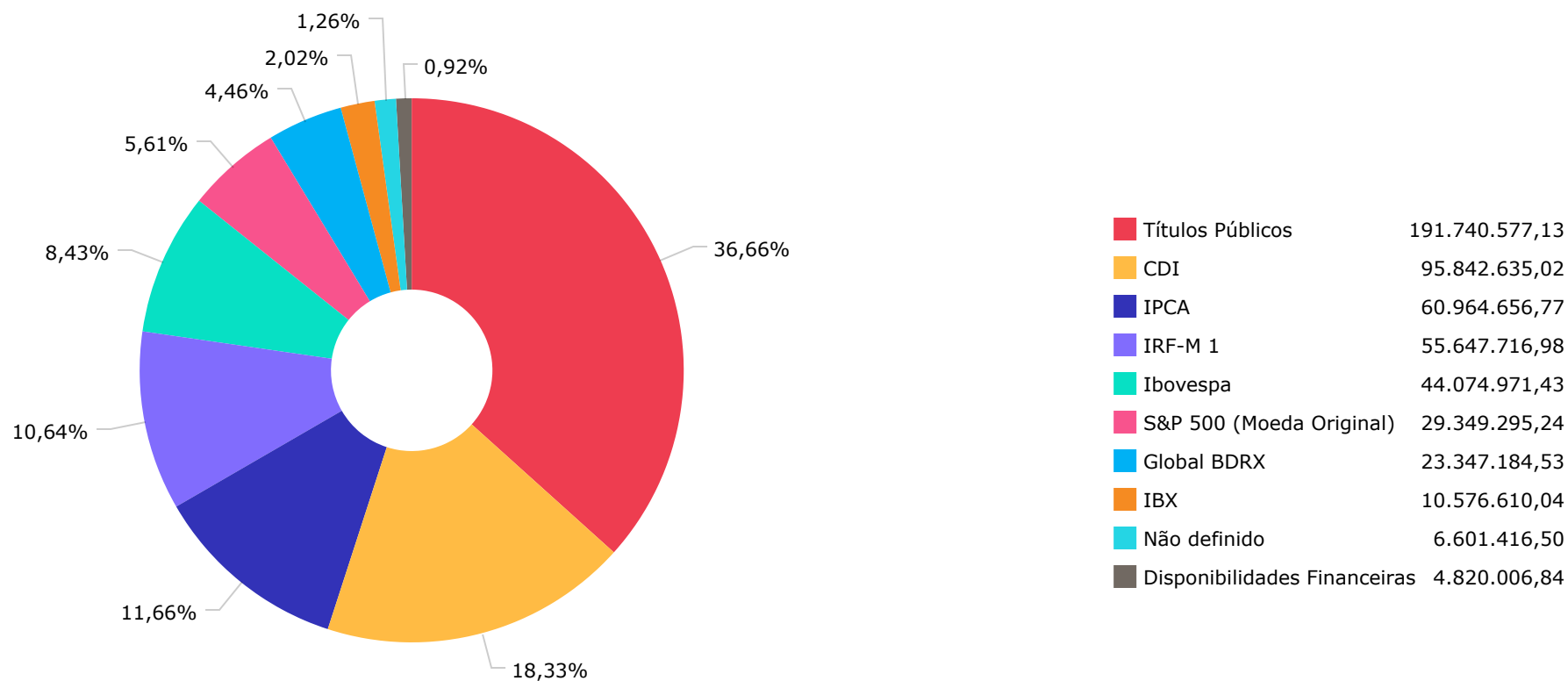


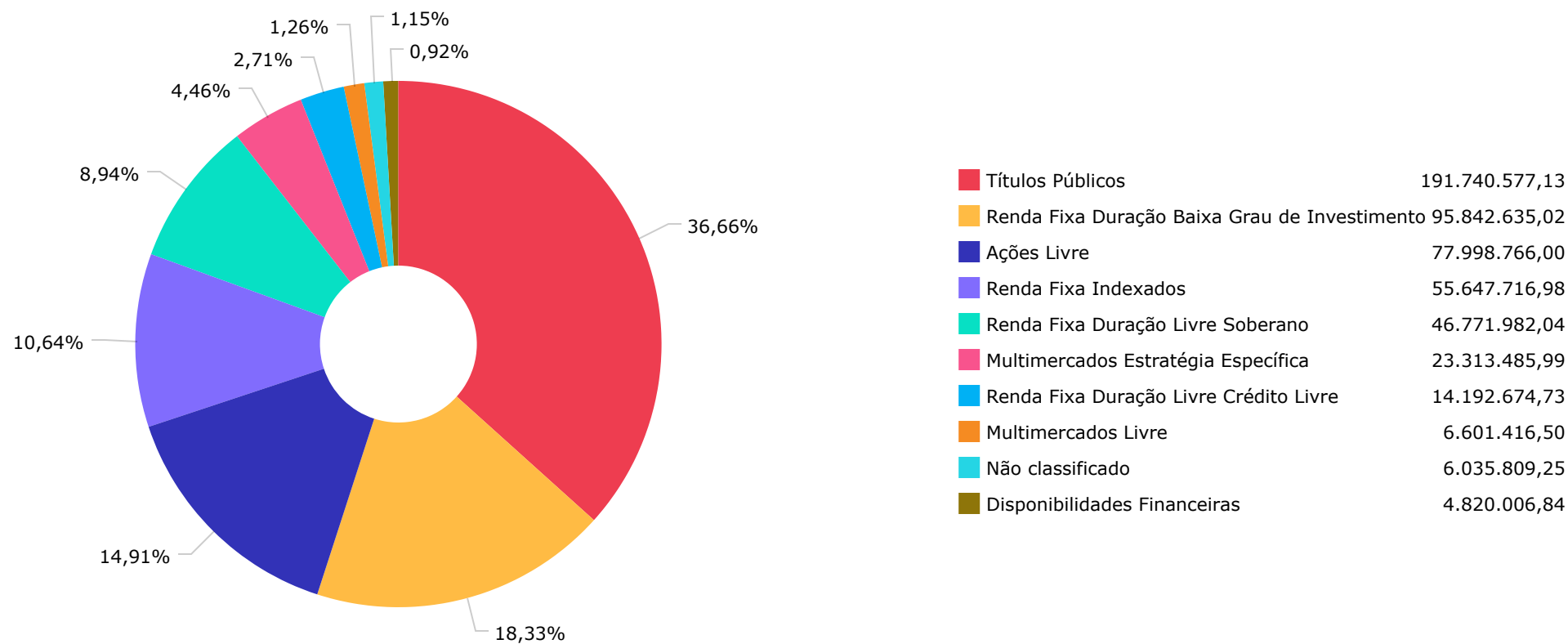
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	37,01%	0,00%	45,00%	100,00%	326.404.486,51
7º I b - FI 100% Títulos TN	22,51%	0,00%	10,00%	100,00%	401.532.689,89
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	518.145.063,64
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.907.253,18
7º III a - FI Referenciados RF	18,50%	0,00%	10,00%	60,00%	215.044.403,16
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	310.887.038,18
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	103.629.012,73
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.907.253,18
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	25.907.253,18
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.907.253,18

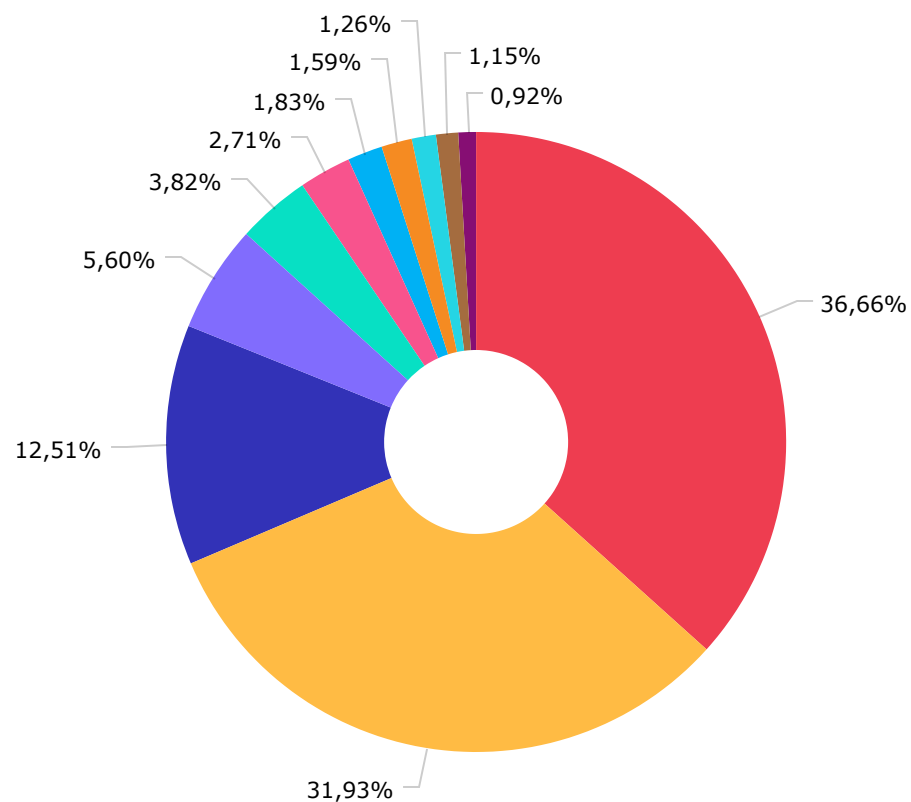
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	10,55%	0,00%	6,00%	30,00%	100.791.937,62
8º II - ETF de Ações	1,16%	0,00%	4,00%	30,00%	149.407.709,84
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	51.814.506,36
9º III - Ações - BDR Nível I	4,51%	0,00%	0,00%	10,00%	28.467.321,83
10º I - Fundos Multimercados	5,77%	0,00%	10,00%	10,00%	21.899.603,87
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.907.253,18
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.907.253,18
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	25.907.253,18
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	25.907.253,18

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	-0,80	5,34	0,36	5,34	13,83	26,24	1,59	3,36
CDI - BENCHMARK								
	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12	6,42	3,25	6,42	13,55	23,98	0,01	0,02
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	15,42
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,47	7,68	4,07	7,68	10,43	-0,84	6,71	14,13
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,06	7,46	2,43	7,46	6,61	-9,35	5,79	12,19
IBOVESPA - BENCHMARK								
	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87		
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10,33	11,33	19,32	11,33	16,60	-11,98	7,84	16,52
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,93	5,78	14,56	5,78	13,83	-18,28	8,64	18,20
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8,96	5,17	14,28	5,17	12,53	-7,54	7,42	15,63
BB AGRO FIC AÇÕES	5,85	0,53	8,15	0,53	7,13	-4,48	7,30	15,38
IBX - BENCHMARK								
	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8,96	9,59	15,93	9,59	13,67	-20,21	9,11	19,19
IPCA - BENCHMARK								
	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,10	8,26	4,86	8,26	14,59	18,86	0,90	1,89
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80	8,76	5,04	8,76	13,97	19,98	0,95	2,00
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22	10,28	5,91	10,28	12,95	23,06	1,33	2,80
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

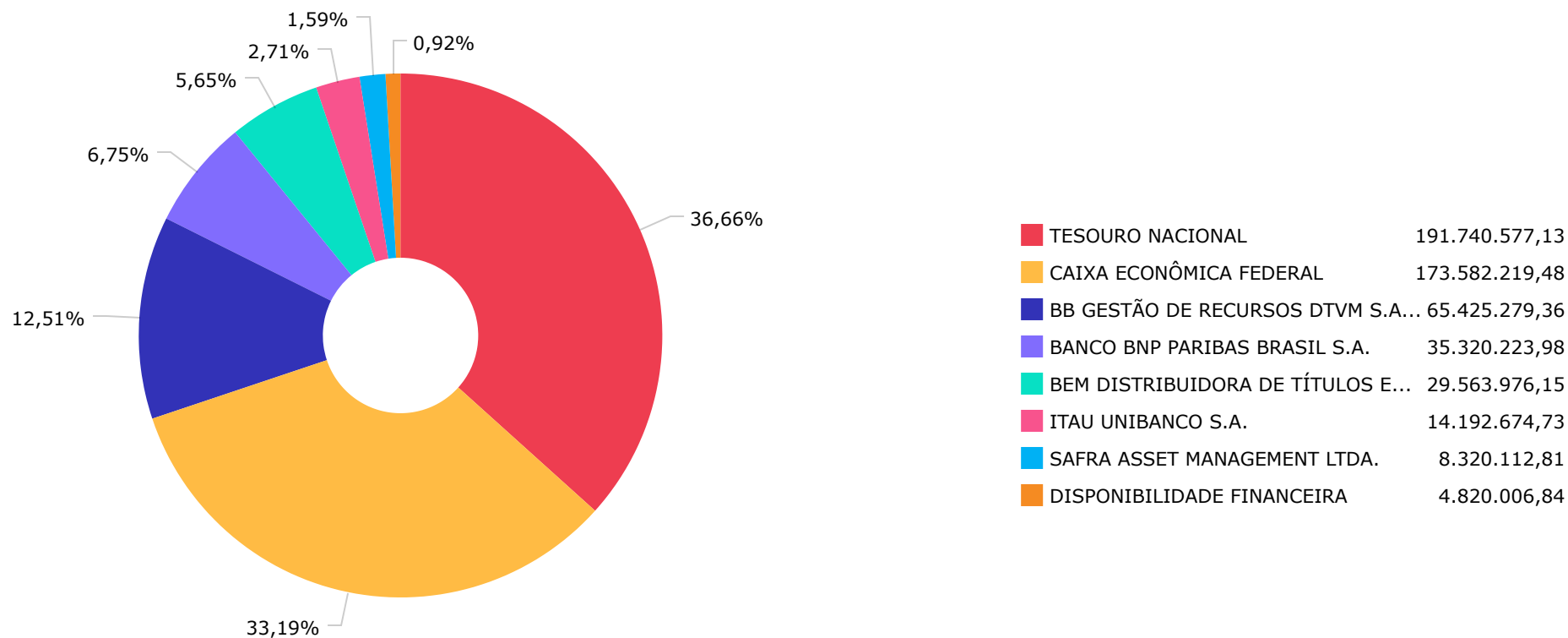
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	6,47	15,91	8,30	15,91	17,57	3,56		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6,98	20,06	10,37	20,06	28,23	20,74	5,04	10,60
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE ...	0,86	4,56	2,39	4,56	8,39	0,86	5,32	11,21







TESOIRO NACIONAL	191.740.577,13
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	166.980.802,98
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	65.425.279,36
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPA...	29.284.414,73
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	20.000.771,82
ITAU UNIBANCO S.A.	14.192.674,73
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	9.563.204,33
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	8.320.112,81
CAIXA DTVM	6.601.416,50
BLACKROCK BRASIL GESTORA DE IN...	6.035.809,25
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.820.006,84



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	463.430.876,81	2.843.780,71	2.813.000,00	470.292.989,11	6.831.331,59	6.831.331,59	1,47% ▲	1,47%	0,96%	0,96%	153,13%	2,19%
Fevereiro	470.292.989,11	63.855.148,07	69.307.042,43	465.055.927,45	214.832,70	7.046.164,29	0,05% ▲	1,52%	1,19%	2,16%	70,37%	1,85%
Março	465.055.927,45	33.017.672,44	9.766.775,99	493.343.301,82	5.036.477,92	12.082.642,21	1,03% ▲	2,57%	1,16%	3,34%	76,95%	1,73%
Abril	493.343.301,82	323.544,59	3.073.356,13	495.506.173,82	4.912.683,54	16.995.325,75	1,00% ▲	3,59%	0,96%	4,34%	82,72%	1,56%
Maio	495.506.173,82	9.749.120,47	2.974.200,00	508.212.262,97	5.931.168,68	22.926.494,43	1,18% ▲	4,81%	0,66%	5,02%	95,82%	1,52%
Junho	508.212.262,97	4.203.294,91	4.301.036,75	518.145.063,64	10.030.542,51	32.957.036,94	1,97% ▲	6,88%	0,33%	5,37%	128,12%	1,58%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	12.082.642,21	2,57%	3,34%
2º Trim	20.874.394,73	4,21%	1,96%
1º Sem	32.957.036,94	6,88%	5,37%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

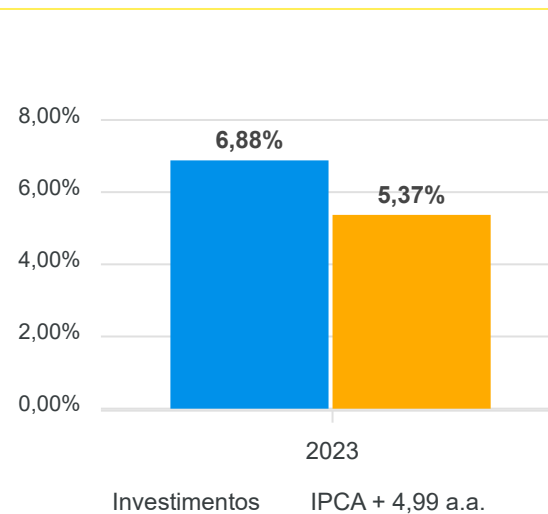


Gráfico Risco x Retorno

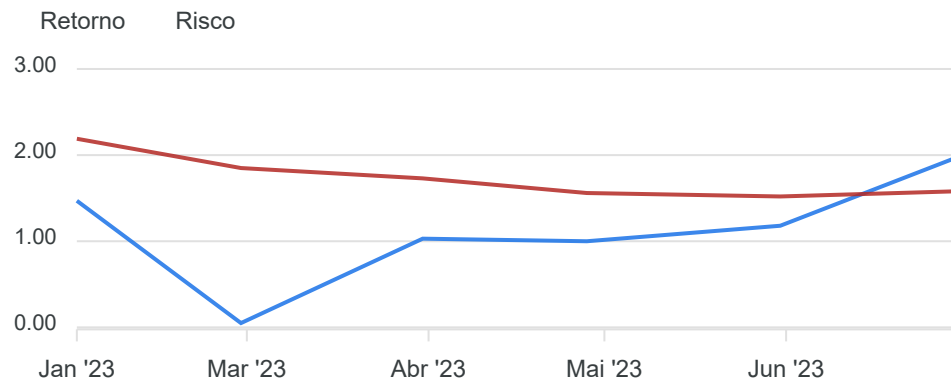
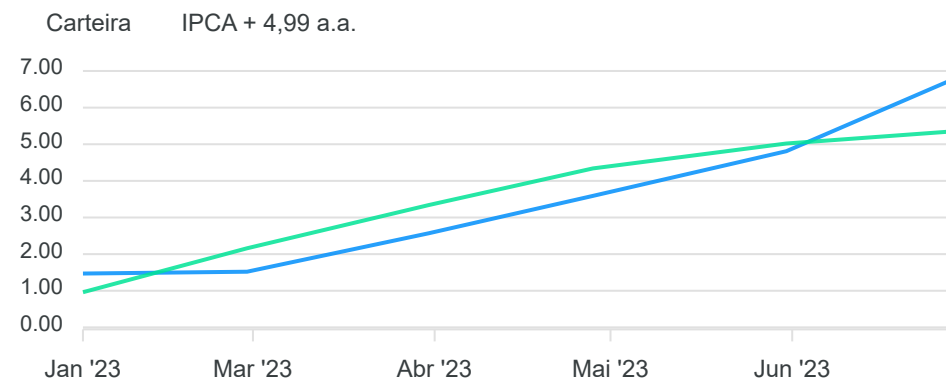
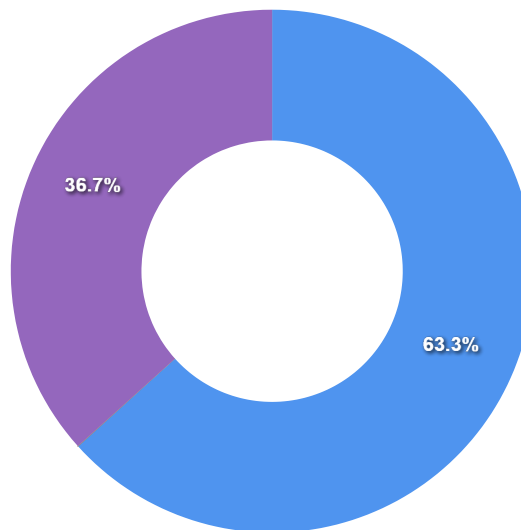


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/06/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	331.224.493,35	63,93
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	191.740.577,12	37,01
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	190.650.185,33	0,00	0,00	191.740.577,13	1.090.391,80	0,57% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.727.169,42	0,00	0,00	31.281.531,06	554.361,64	1,80% ▲	0,95%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	95.041.426,69	4.014.099,78	4.301.036,75	95.842.635,02	1.088.145,30	1,10% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.171.131,85	0,00	0,00	15.490.450,98	319.319,13	2,10% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	54.823.228,38	189.195,13	0,00	55.647.716,98	635.293,47	1,15% ▲	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	13.883.884,54	0,00	0,00	14.192.674,73	308.790,19	2,22% ▲	1,33%
	400.297.026,21	4.203.294,91	4.301.036,75	404.195.585,90	3.996.301,53	1,00%	0,17%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.573.213,02	0,00	0,00	9.424.161,78	850.948,76	9,93% ▲	8,64%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.706.680,06	0,00	0,00	10.576.610,04	869.929,98	8,96% ▲	9,11%
BB AGRO FIC AÇÕES	11.720.325,49	0,00	0,00	12.406.283,22	685.957,73	5,85% ▲	7,30%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	11.638.319,68	0,00	0,00	12.681.322,10	1.043.002,42	8,96% ▲	7,42%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE ...	5.984.495,25	0,00	0,00	6.035.809,25	51.314,00	0,86% ▲	5,32%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	8.668.038,56	0,00	0,00	9.563.204,33	895.165,77	10,33% ▲	7,84%
-	56.291.072,06	0,00	0,00	60.687.390,72	4.396.318,66	7,81%	7,74%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	6.654.540,25	0,00	0,00	6.601.416,50	-53.123,75	-0,80% ▼	1,59%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	21.792.866,55	0,00	0,00	23.313.485,99	1.520.619,44	6,98% ▲	5,04%
-	28.447.406,80	0,00	0,00	29.914.902,49	1.467.495,69	5,16%	4,28%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.925.023,39	0,00	0,00	9.056.142,98	131.119,59	1,47% ▲	6,71%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.324.953,84	0,00	0,00	8.320.112,81	-4.841,03	-0,06% ▼	5,79%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.926.780,67	0,00	0,00	5.970.928,74	44.148,07	0,74% ▲	7,32%
	23.176.757,90	0,00	0,00	23.347.184,53	170.426,63	0,74%	4,67%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.780.559,76	0,00	0,00	31.281.531,06	1.500.971,30	5,04% ▲
CAIXA BRASIL FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI LP	89.456.433,12	13.711.730,40	10.348.592,88	95.842.635,02	3.023.064,38	2,93% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	14.773.168,51	0,00	0,00	15.490.450,98	717.282,47	4,86% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	53.390.864,29	564.229,57	0,00	55.647.716,98	1.692.623,12	3,14% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	13.400.562,94	0,00	0,00	14.192.674,73	792.111,79	5,91% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	188.615.853,34	0,00	0,00	191.740.577,13	3.124.723,79	1,66% ▲
	389.417.441,96	14.275.959,97	10.348.592,88	404.195.585,90	10.850.776,85	2,76%

RENDIA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.226.371,92	0,00	0,00	9.424.161,78	1.197.789,86	14,56% ▲
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.123.345,87	0,00	0,00	10.576.610,04	1.453.264,17	15,93% ▲
BB AGRO FIC AÇÕES	11.470.953,28	0,00	0,00	12.406.283,22	935.329,94	8,15% ▲
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	11.097.192,01	0,00	0,00	12.681.322,10	1.584.130,09	14,28% ▲
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE ...	5.894.695,75	0,00	0,00	6.035.809,25	141.113,50	2,39% ▲
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	8.014.956,98	0,00	0,00	9.563.204,33	1.548.247,35	19,32% ▲
	53.827.515,81	0,00	0,00	60.687.390,72	6.859.874,91	12,74%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	6.577.556,36	0,00	0,00	6.601.416,50	23.860,14	0,36% ▲
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	21.122.755,09	0,00	0,00	23.313.485,99	2.190.730,90	10,37% ▲
	27.700.311,45	0,00	0,00	29.914.902,49	2.214.591,04	7,99%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.701.893,07	0,00	0,00	9.056.142,98	354.249,91	4,07% ▲
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.123.046,82	0,00	0,00	8.320.112,81	197.065,99	2,43% ▲
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.573.092,71	0,00	0,00	5.970.928,74	397.836,03	7,14% ▲
	22.398.032,60	0,00	0,00	23.347.184,53	949.151,93	4,24%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.763.002,71	0,00	0,00	31.281.531,06	2.518.528,35	8,76% ▲
CAIXA BRASIL FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.429.116,66	107.952.666,89	21.797.368,87	95.842.635,02	4.258.220,34	3,76% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	14.308.489,15	0,00	0,00	15.490.450,98	1.181.961,83	8,26% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	65.922.577,32	6.039.894,30	20.006.000,00	55.647.716,98	3.691.245,36	5,13% ▲
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENTA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	19.610.880,82	0,00	19.678.498,14	0,00	67.617,32	0,34% ▲
ICATU VANGUARDA PLUS FI RENTA FIXA LP	23.363.218,19	0,00	23.476.477,81	0,00	113.259,62	0,48% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	12.869.842,58	0,00	0,00	14.192.674,73	1.322.832,15	10,28% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	185.162.072,57	0,00	3.277.066,48	191.740.577,13	9.855.571,04	5,32% ▲
	355.429.200,00	113.992.561,19	88.235.411,30	404.195.585,90	23.009.236,01	6,04%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.909.151,87	0,00	0,00	9.424.161,78	515.009,91	5,78% ▲
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.650.807,70	0,00	0,00	10.576.610,04	925.802,34	9,59% ▲
BB AGRO FIC AÇÕES	12.340.516,28	0,00	0,00	12.406.283,22	65.766,94	0,53% ▲
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.058.224,56	0,00	0,00	12.681.322,10	623.097,54	5,17% ▲
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE ...	5.772.825,00	0,00	0,00	6.035.809,25	262.984,25	4,56% ▲
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	8.589.627,76	0,00	0,00	9.563.204,33	973.576,57	11,33% ▲
	57.321.153,17	0,00	0,00	60.687.390,72	3.366.237,55	5,87%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	10.130.752,53	0,00	4.000.000,00	6.601.416,50	470.663,97	4,65% ▲
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	19.418.685,92	0,00	0,00	23.313.485,99	3.894.800,07	20,06% ▲
	29.549.438,45	0,00	4.000.000,00	29.914.902,49	4.365.464,04	14,77%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.409.859,91	0,00	0,00	9.056.142,98	646.283,07	7,68% ▲
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.742.748,11	0,00	0,00	8.320.112,81	577.364,70	7,46% ▲
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.978.477,17	0,00	0,00	5.970.928,74	992.451,57	19,93% ▲
	21.131.085,19	0,00	0,00	23.347.184,53	2.216.099,34	10,49%

Cenário Econômico

Repetindo o bom desempenho do mês anterior, o mês de junho foi muito positivo para as carteiras de investimento. O segmento de renda fixa teve um bom desempenho, principalmente nos fundos de atrelados a inflação, que continuam se beneficiando do fechamento da curva de juros. A renda variável teve o melhor desempenho para um mês neste ano e o IBOVESPA fechou em alta próxima dos 9%, trazendo o índice para o campo positivo no acumulado do ano. A exceção ficou com os fundos de investimento no exterior, com exposição cambial que fecharam no negativo com o fortalecimento do real frente ao dólar.

A inflação segue surpreendendo com dados inferiores as projeções do mercado. E as principais surpresas vieram da alimentação e combustíveis, destacando também para as surpresas baixistas mais favoráveis dos núcleos da inflação. Com esses indicadores, várias revisões de projeção estão sendo feitas pelo mercado, caindo o IPCA para próximo de 5% no acumulado ao final de 2023.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Na renda fixa, o fechamento em curso da curva de juros, tem propiciado bons retornos nas estratégias CDI e IMA's. Os Títulos Públicos Federais seguem apresentando remuneração bastante competitiva. Já na renda variável as projeções de mercado se confirmaram, e o desempenho das estratégias atreladas ao Ibovespa foi muito boa. A exceção ficou com os fundos de investimento no exterior, com exposição cambial, que não performaram adequadamente com o fortalecimento do real frente ao dólar.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 07 de julho de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,30%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+3

Quantidade de Cotistas
664

Patrimônio Líquido Fundo
5.696.060.085,44

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IPCA

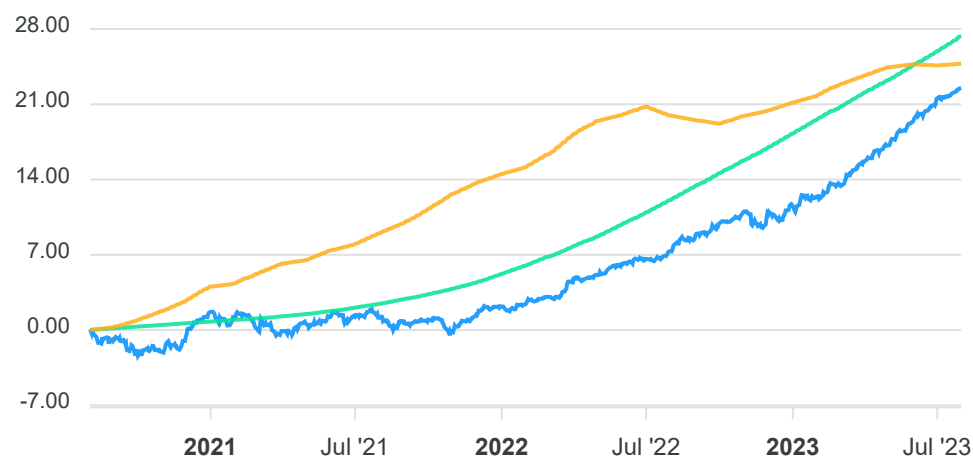
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe de Renda Fixa.

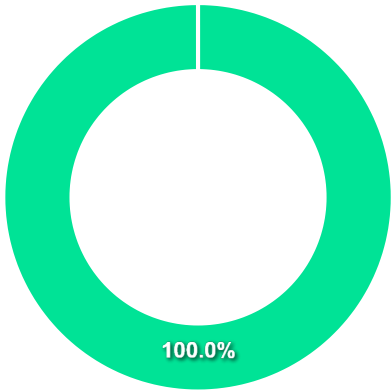
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	2,00%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP JUROS BRASIL FI RENDA FIXA LP	5.898.546,72	99,99	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	500,92	0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	25,79	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / PROV.AUDIT 28/06/24	0,27	0,00	Outros
Valores a pagar / Controladoria	-48,51	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-67,82	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.898.546,72	99.99%
Valores a pagar/receber	443,65	0.01%
Outros	0,23	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 773

Patrimônio Líquido Fundo
 5.348.206.988,95

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IPCA

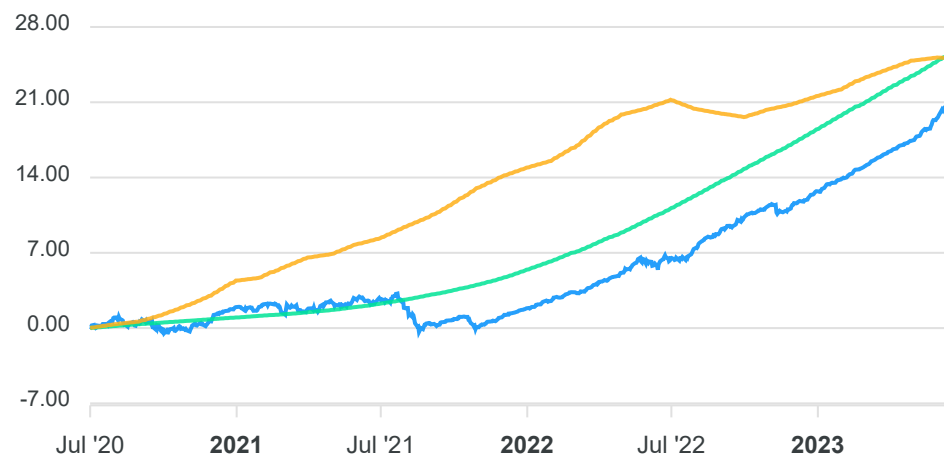
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA
 MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:
 10.948.555/0001-13.

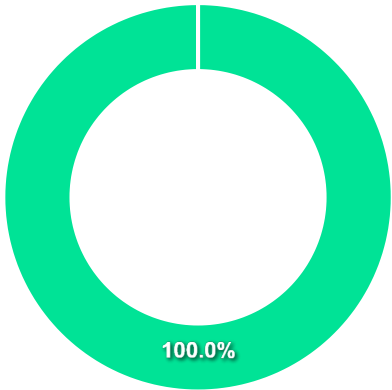
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,10%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	1,89%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA LP	5.462.598,32	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	23,78	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-565,00	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.462.598,32	100.01%
Valores a pagar/receber	-541,23	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 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

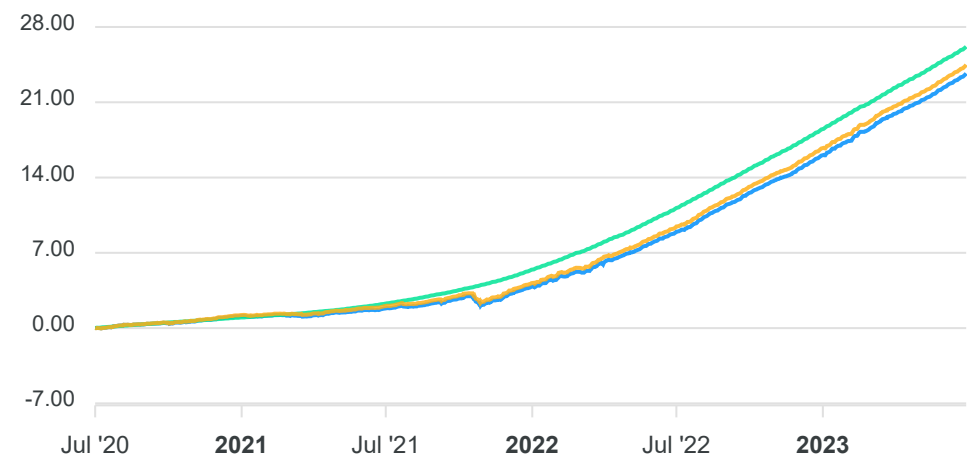
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

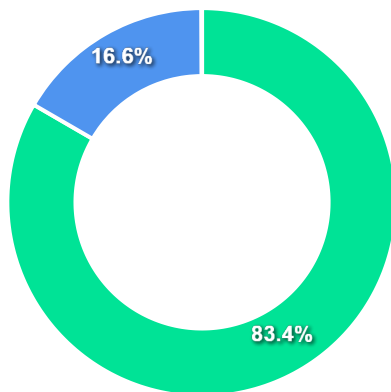
COMPARATIVO

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



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2025	6.178.686,46	83,39	Operação compromissada
LTN - Venc.: 01/01/2024	1.014.720,72	13,70	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2024	130.407,44	1,76	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	81.518,36	1,10	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	3.486,29	0,05	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	955,27	0,01	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24	395,89	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	335,13	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24	188,77	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	12,77	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	0,00	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-451,05	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	6.178.686,46	83.38%
Títulos Federais	1.226.646,52	16.55%
Valores a pagar/receber	3.990,52	0.05%
Derivativos	919,79	0.01%
Outros	12,77	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 0,40%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 208

Patrimônio Líquido Fundo
 2.099.537.000,43

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 IPCA

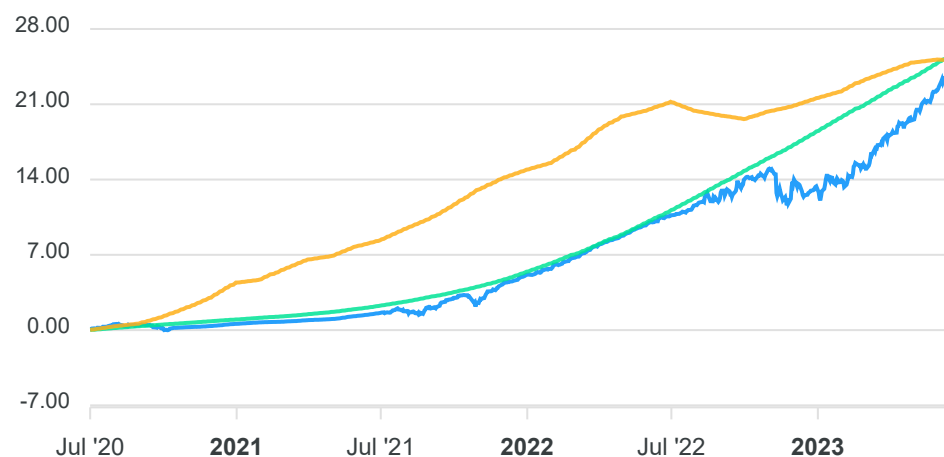
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre

Política de Investimento
 Alocar preponderante em cotas de fundos de investimento de renda fixa atrelados ao IMA e seus sub-índices, podendo alocar também em fundos de investimento de renda fixa que seguem o CDI.

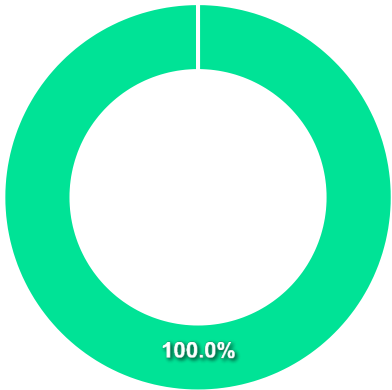
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	2,80%
Benchmark	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	2.139.443,57	99,80	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.225,85	0,20	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	754,22	0,04	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-729,60	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.143.669,42	100.00%
Valores a pagar/receber	94,62	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 1.004

Patrimônio Líquido Fundo
 15.331.819.820,88

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
 CDI

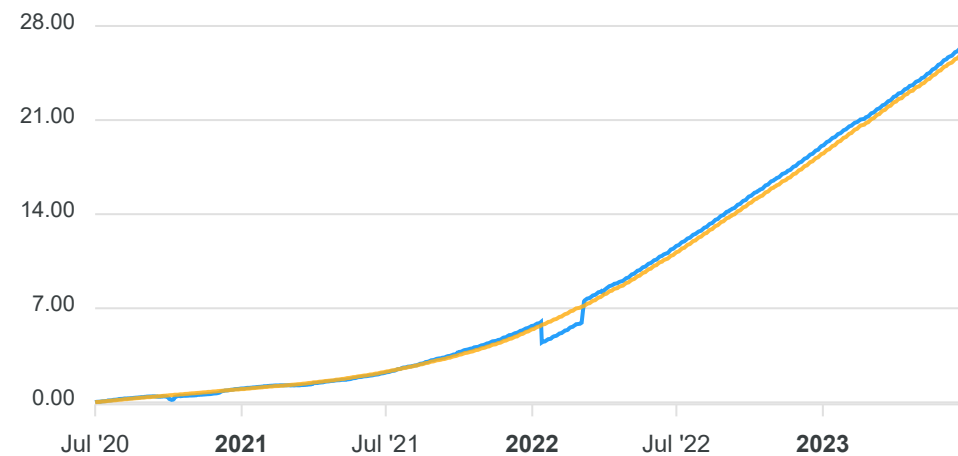
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

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.

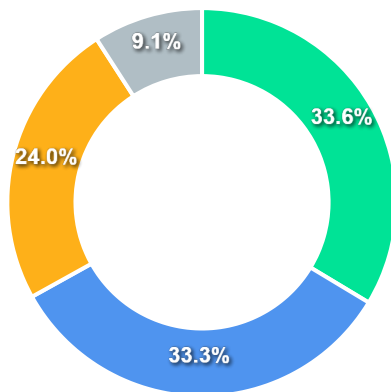
COMPARATIVO

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. (%)
Operação compromissada	5.000.827,89	33.64%
Títulos Privados	4.947.904,03	33.28%
Títulos Federais	3.564.923,37	23.98%
Debêntures	1.354.320,83	9.11%
Valores a pagar/receber	-376,95	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2026	5.000.827,89	33,64	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2024	1.039.414,45	6,99	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	901.484,35	6,06	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	723.145,35	4,86	Títulos Federais
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	451.256,24	3,04	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	441.620,58	2,97	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	237.079,59	1,59	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2028	219.024,14	1,47	Títulos Federais
LFT	216.282,73	1,45	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	178.633,92	1,20	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	177.568,48	1,19	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	175.338,88	1,18	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	166.132,16	1,12	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	143.104,84	0,96	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	126.498,35	0,85	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	125.179,88	0,84	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	124.157,07	0,84	Títulos Privados
Debêntures - PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS (33.000.16...	115.284,77	0,78	Debêntures
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	108.478,62	0,73	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	108.242,74	0,73	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	102.439,57	0,69	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2029	92.900,58	0,62	Títulos Federais
Debênture Simples - BSA316	90.368,24	0,61	Debêntures
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) -...	90.212,60	0,61	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	88.367,82	0,59	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2024	87.981,26	0,59	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	79.721,18	0,54	Títulos Federais

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
LTDA

Gestão
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
3.732

Patrimônio Líquido Fundo
274.216.355,62

Patrimônio Líquido Master
278.166.195,78

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

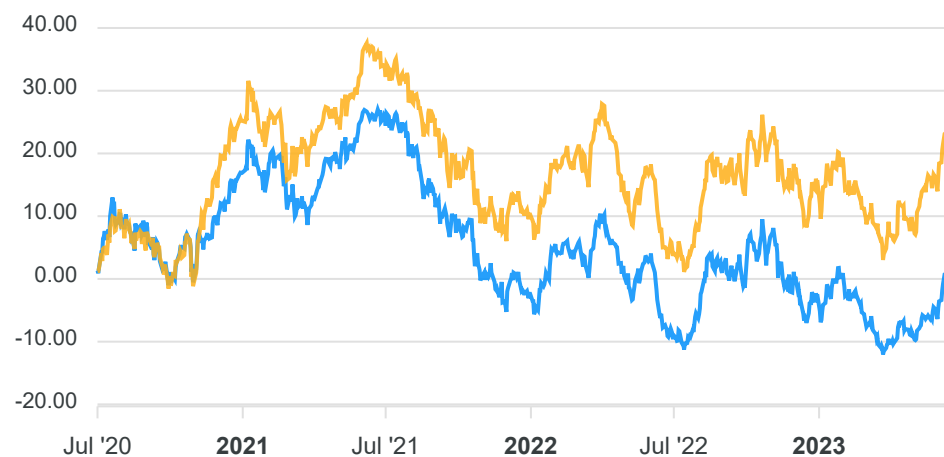
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do AZ
QUEST MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 11.977.607/0001-42.

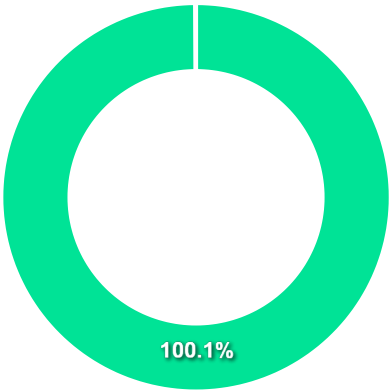
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	9,93%	5,78%	14,56%	5,78%	13,83%	-18,28%	8,64%	18,20%
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 AZ QUEST MASTER FI AÇÕES	286.467,01	100,15	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	529,98	0,19	Valores a pagar/receber
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2024	234,97	0,08	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.180,84	-0,41	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	286.467,01	100.15%
Operação compromissada	234,97	0.08%
Valores a pagar/receber	-649,86	-0.23%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
LTDA

Gestão
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+30

Quantidade de Cotistas
3.044

Patrimônio Líquido Fundo
847.790.569,11

Patrimônio Líquido Master
1.325.173.539,32

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
IBX

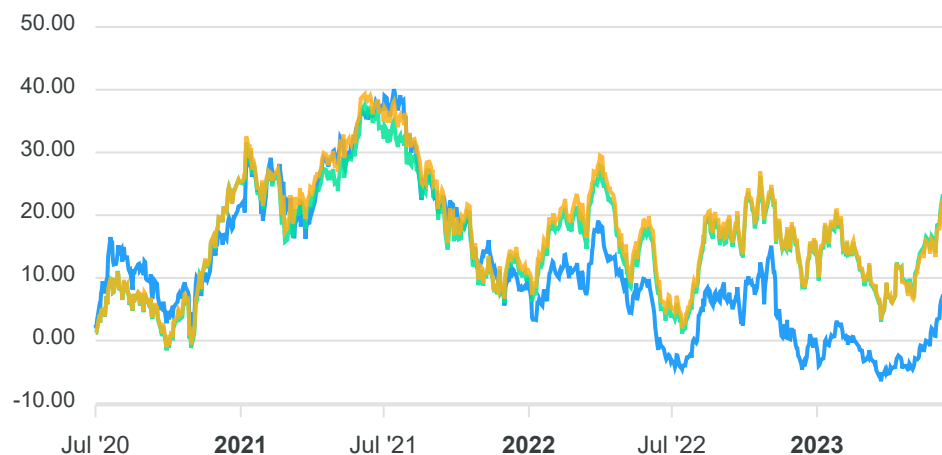
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do AZ
QUEST SMALL MID CAPS MASTER FI AÇÕES, CNPJ:
11.403.884/0001-41.

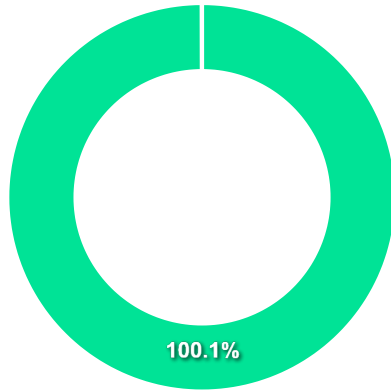
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,96%	9,59%	15,93%	9,59%	13,67%	-20,21%	9,11%	19,19%
Benchmark	8,87%	6,59%	14,96%	6,59%	17,60%	-9,50%		
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 AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FIC AÇÕES	868.946,26	100,14	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	357,83	0,04	Valores a pagar/receber
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	320,10	0,04	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.871,66	-0,22	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	868.946,26	100.14%
Operação compromissada	320,10	0.04%
Valores a pagar/receber	-1.512,83	-0.17%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+2 du

Quantidade de Cotistas
 4.867

Patrimônio Líquido Fundo
 342.392.350,57

Patrimônio Líquido Master
 379.064.629,52

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

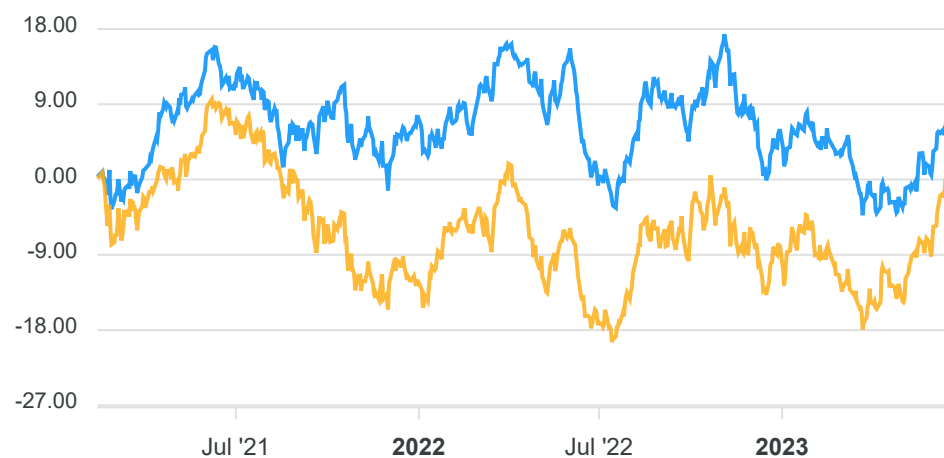
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do BB TOP
 AÇÕES AGRO FI AÇÕES, CNPJ: 40.054.367/0001-02.

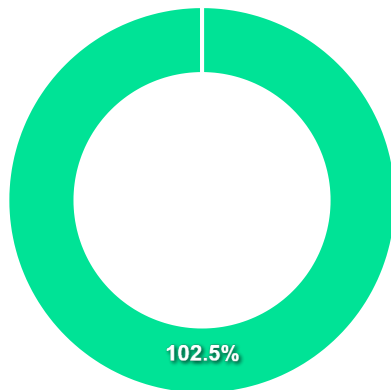
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,85%	0,53%	8,15%	0,53%	7,13%	-4,48%	7,30%	15,38%
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 BB TOP AÇÕES AGRO FIAÇÕES	356.109,95	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,17	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-4,67	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-14,13	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Performance Negativa	-8.804,57	-2,47	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	356.109,95	102.54%
Valores a pagar/receber	-8.826,96	-2.54%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
1,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+3

Quantidade de Cotistas
21.398

Patrimônio Líquido Fundo
1.365.623.732,74

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

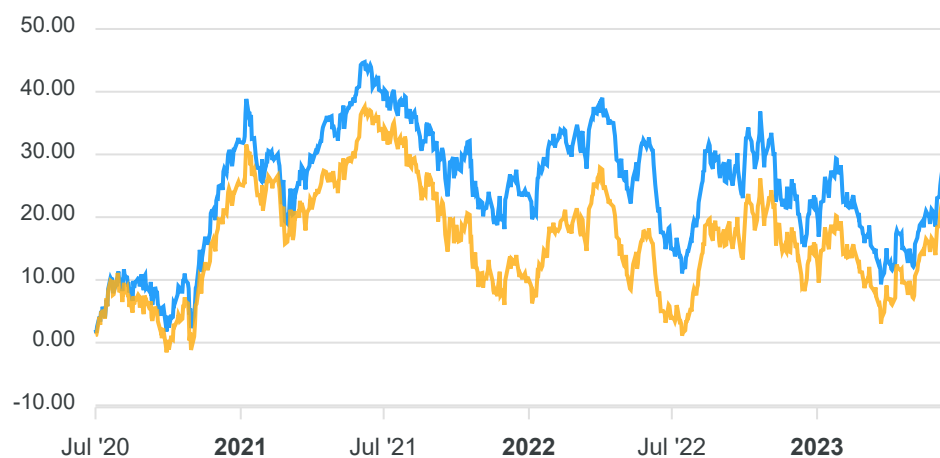
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento que apresentem carteira composta por ações emitidas por empresas brasileiras e seus proventos, títulos públicos federais e contratos de índices futuros.

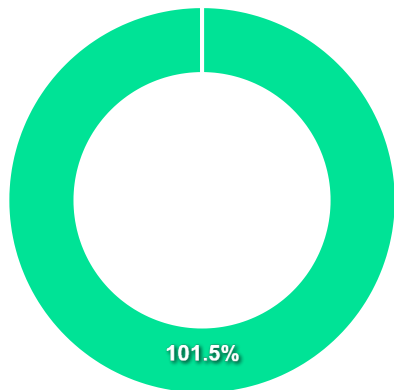
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,96%	5,17%	14,28%	5,17%	12,53%	-7,54%	7,42%	15,63%
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 BB QUANTITATIVO FI AÇÕES	1.409.446,48	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,67	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,86	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-14,68	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-55,93	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Performance Negativa	-21.308,91	-1,51	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.409.446,48	101.54%
Valores a pagar/receber	-21.373,71	-1.54%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
 LTDA

Gestão
 VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
 1,97%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+4 du ou D+32

Quantidade de Cotistas
 38

Patrimônio Líquido Fundo
 762.294.187,16

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

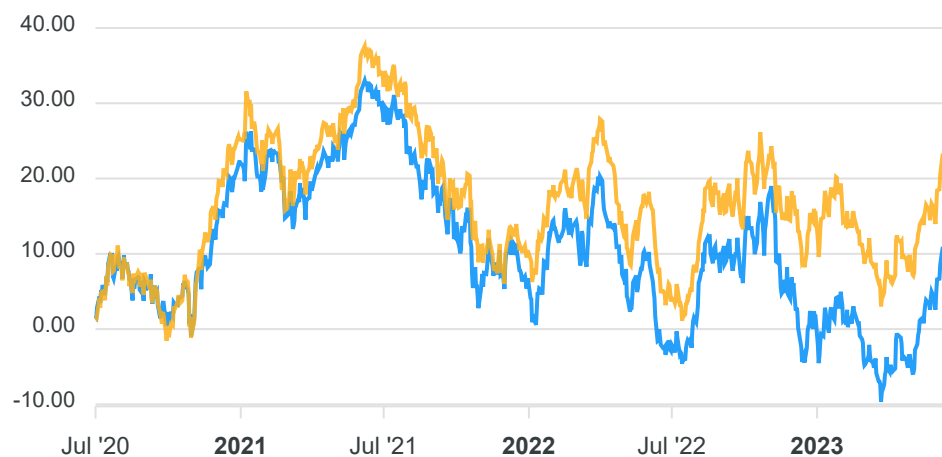
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de renda variável, podendo aplicar em outras classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de FI, negociados nos mercados interno e externo.

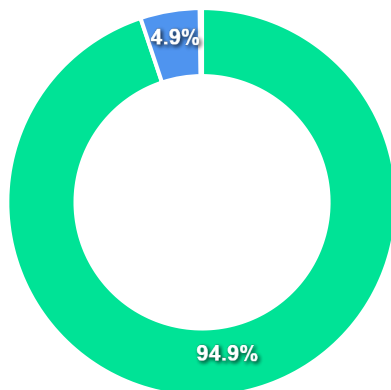
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	10,33%	11,33%	19,32%	11,33%	16,60%	-11,98%	7,84%	16,52%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	659.515,41	94.88%
Operação compromissada	34.163,72	4.92%
Valores a pagar/receber	1.404,77	0.20%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	59.596,11	8,57	Ações
VALE ON N1 - VALE3	49.668,11	7,15	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	45.821,48	6,59	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	44.180,10	6,36	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	43.700,05	6,29	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/2055	34.163,72	4,92	Operação compromissada
BTGP BANCO UNT - BPAC11	27.020,17	3,89	Ações
TOTVS ON NM - TOTS3	22.030,65	3,17	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	21.816,25	3,14	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	21.757,02	3,13	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	21.138,33	3,04	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	19.938,95	2,87	Ações
GRUPO NATURAON NM - NTCO3	17.743,72	2,55	Ações
DIRECIONAL ON NM - DIRR3	16.537,29	2,38	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BPAC11	16.245,35	2,34	Ações
CURY S.A. ON NM - CURY3	15.969,84	2,30	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	14.572,97	2,10	Ações
IGUATEMI S.AUNT N1 - IGTI11	14.126,37	2,03	Ações
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	14.019,99	2,02	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	13.274,55	1,91	Ações
ORIZON ON NM - ORVR3	12.729,19	1,83	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3	12.120,28	1,74	Ações
VAMOS ON NM - VAMO3	11.480,83	1,65	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - IGTI11	11.441,26	1,65	Ações
TIM ON NM - TIMS3	11.149,21	1,60	Ações
GRUPO MATEUSON NM - GMAT3	10.664,83	1,53	Ações
B3 ON NM - B3SA3	9.691,02	1,39	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão

BLACKROCK BRASIL GESTORA DE INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração

0,23%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+2

Quantidade de Cotistas

163.277

Patrimônio Líquido Fundo

2.772.255.766,10

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 8º, Inciso II

Benchmark

S&P 500 (Moeda Original)

Classificação ANBIMA

Não classificado

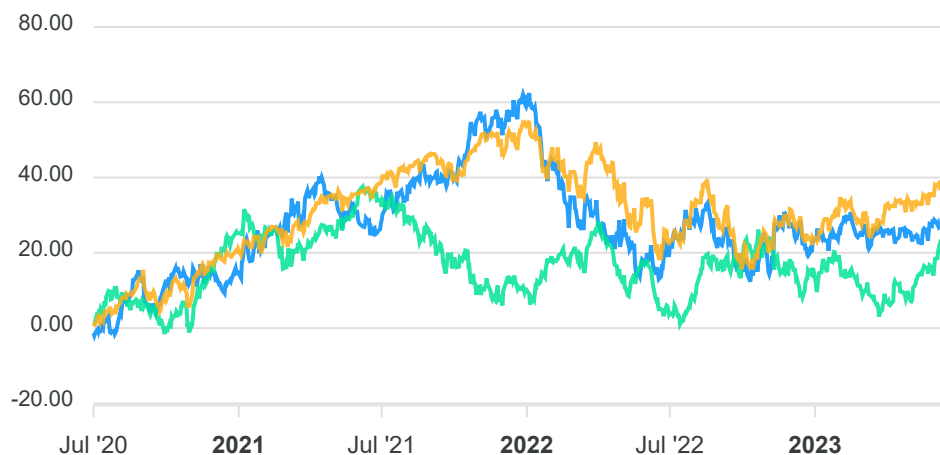
Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do ISHARES CORE S&P 500 ETF, fundo de índice constituído e organizado de acordo com as leis dos Estados Unidos da América, gerido pela BlackRock Fund Advisors.

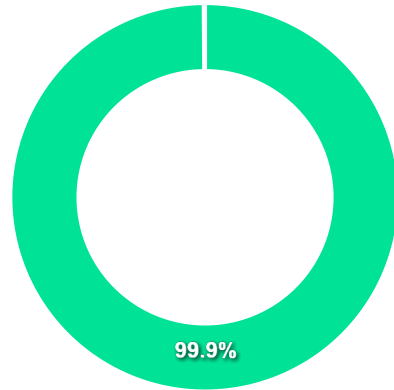
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,86%	4,56%	2,39%	4,56%	8,39%	0,86%	5,32%	11,21%
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 ISHARES CORE S&P 500 UCITS ETF - CSPX	2.944.570,00	99,89	Investimento no Exterior
Outras Disponibilidades	3.709,06	0,13	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	626,20	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.033,19	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Investimento no Exterior	2.944.570,00	99.89%
Valores a pagar/receber	3.302,07	0.11%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração
0,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4 du
Quantidade de Cotistas
155
Patrimônio Líquido Fundo
1.281.910.332,14

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III
Benchmark
Global BDRX
Classificação ANBIMA
Ações Livre
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil que atendam aos critérios da temática ESG.

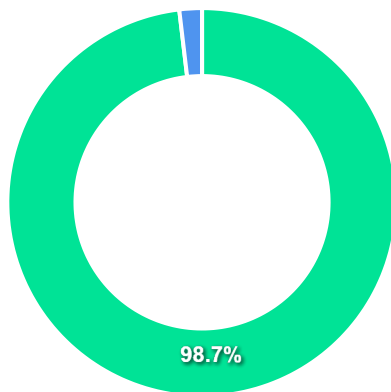
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,47%	7,68%	4,07%	7,68%	10,43%	-0,84%	6,71%	14,13%
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	1.286.513,28	98.71%
Operação compromissada	24.559,50	1.88%
Derivativos	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-7.694,93	-0.59%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
ISHARES ESG AWARE MSCI USA ETF - BEGU39	384.209,48	29,48	Brazilian Depositary Rece...
APPLE INC - AAPL34	118.688,45	9,11	Brazilian Depositary Rece...
MICROSOFT CORPORATIO - MSFT34	93.111,89	7,14	Brazilian Depositary Rece...
TESLA, INC - TSLA34	57.693,70	4,43	Brazilian Depositary Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	49.943,65	3,83	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	43.135,96	3,31	Brazilian Depositary Rece...
CHEVRON CORPORATIO - CHVX34	38.033,68	2,92	Brazilian Depositary Rece...
META PLATFORMS, INC - FBOK34	36.386,53	2,79	Brazilian Depositary Rece...
ADOBE IN - ADBE34	33.044,42	2,54	Brazilian Depositary Rece...
THE COCA-COLA COMPAN - COCA34	31.513,73	2,42	Brazilian Depositary Rece...
ACTIVISION BLIZZARD IN - ATVI34	30.107,85	2,31	Brazilian Depositary Rece...
JPMORGAN CHASE & CO - JPMC34	28.330,73	2,17	Brazilian Depositary Rece...
CISCO SYSTEMS, INC - CSCO34	27.491,09	2,11	Brazilian Depositary Rece...
WALMART INC - WALM34	25.922,94	1,99	Brazilian Depositary Rece...
COMCAST CORPORATIO - CMCS34	25.532,77	1,96	Brazilian Depositary Rece...
COSTCO WHOLESALE CORPORATION - COWC34	25.259,33	1,94	Brazilian Depositary Rece...
JOHNSON & JOHNSO - JNJB34	24.807,34	1,90	Brazilian Depositary Rece...
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	24.559,50	1,88	Operação compromissada
BROADCOM INC - AVGO34	22.976,45	1,76	Brazilian Depositary Rece...
PFIZER INC - PFIZ34	21.473,21	1,65	Brazilian Depositary Rece...
BERKSHIRE HATHAWAY INC - BERK34	19.532,25	1,50	Brazilian Depositary Rece...
Brazilian Depositary Receipts - BDR	17.539,43	1,35	Brazilian Depositary Rece...
ABBVIE INC - ABBV34	17.099,87	1,31	Brazilian Depositary Rece...
THE WALT DISNEY COMPAN - DISB34	16.445,78	1,26	Brazilian Depositary Rece...
COLGATE-PALMOLIVE COMPAN - COLG34	16.160,45	1,24	Brazilian Depositary Rece...
CHARTER COMMUNICATIONS INC - CHCM34	15.252,96	1,17	Brazilian Depositary Rece...
STARBUCKS CORPORATIO - SBUB34	9.398,40	0,72	Brazilian Depositary Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Gestão
 SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Taxa de Administração
 1,50%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+5

Quantidade de Cotistas
 405

Patrimônio Líquido Fundo
 726.616.425,21

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
 Global BDRX

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, em depósitos de valores mobiliários BDRs Nível 1, do setor de consumo.

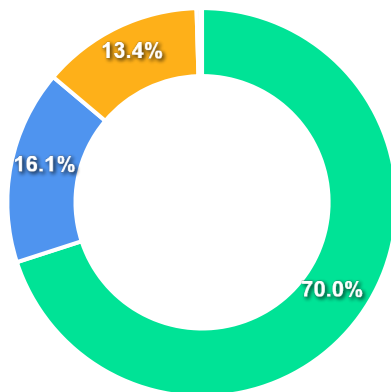
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,06%	7,46%	2,43%	7,46%	6,61%	-9,35%	5,79%	12,19%
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	548.686,74	70.01%
Títulos Privados	126.560,26	16.15%
Títulos Federais	104.921,74	13.39%
Derivativos	2.309,98	0.29%
Valores a pagar/receber	1.248,23	0.16%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	126.560,26	16,15	Títulos Privados
MICROSOFT CORPORATIO - MSFT34	54.119,26	6,91	Brazilian Depositary Rece...
LFT - Venc.: 01/09/2023	51.595,41	6,58	Títulos Federais
APPLE INC - AAPL34	45.424,02	5,80	Brazilian Depositary Rece...
UNITEDHEALTH GROUP INC - UNHH34	32.858,23	4,19	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	24.700,56	3,15	Brazilian Depositary Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	20.140,77	2,57	Brazilian Depositary Rece...
PEPSICO, INC - PEPB34	19.650,31	2,51	Brazilian Depositary Rece...
LFT - Venc.: 01/03/2024	18.978,70	2,42	Títulos Federais
JOHNSON & JOHNSO - JNJB34	18.397,34	2,35	Brazilian Depositary Rece...
AMERICAN EXPRESS COMPANY - AXPB34	17.556,37	2,24	Brazilian Depositary Rece...
COSTCO WHOLESALE CORPORATION - COWC34	17.121,75	2,18	Brazilian Depositary Rece...
BERKSHIRE HATHAWAY INC - BERK34	16.435,16	2,10	Brazilian Depositary Rece...
VISA INC - VISA34	16.335,45	2,08	Brazilian Depositary Rece...
MASTERCARD INCORPORATE - MSCD34	15.535,67	1,98	Brazilian Depositary Rece...
THERMO FISHER SCIENTIFIC, INC - TMOS34	15.375,26	1,96	Brazilian Depositary Rece...
COMCAST CORPORATIO - CMCS34	15.356,97	1,96	Brazilian Depositary Rece...
MCDONALDS CORP - MCDC34	15.332,63	1,96	Brazilian Depositary Rece...
Outros Valores a receber	14.561,53	1,86	Valores a pagar/receber
DANAHER CORPORATIO - DHER34	14.479,73	1,85	Brazilian Depositary Rece...
LFT - Venc.: 01/03/2026	13.827,53	1,76	Títulos Federais
ELI LILLY AND COMPAN - LILY34	13.602,93	1,74	Brazilian Depositary Rece...
MERCK & CO, INC - MRCK34	12.394,96	1,58	Brazilian Depositary Rece...
TARGET COR - TGTB34	12.352,60	1,58	Brazilian Depositary Rece...
FEDEX CORPORATIO - FDXB34	12.269,56	1,57	Brazilian Depositary Rece...
UNITED PARCEL SERVICE, INC - UPSS34	11.792,92	1,50	Brazilian Depositary Rece...
META PLATFORMS, INC - M1TA34	11.551,72	1,47	Brazilian Depositary Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão
 WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA

Taxa de Administração
 1,50%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+5

Quantidade de Cotistas
 70.194

Patrimônio Líquido Fundo
 1.424.355.998,61

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
 Global BDRX

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, por meio de gestão ativa, principalmente, em Brazilian Depositary Receipts, classificados como Nível I, que apresentem, na visão do administrador, grande potencial de apreciação e perspectiva de crescimento no longo prazo.

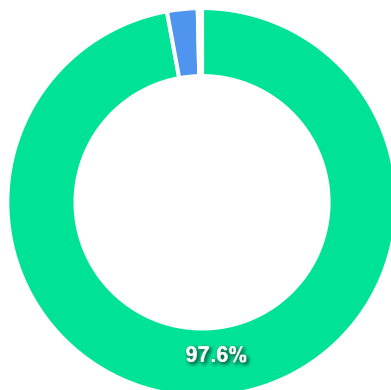
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,74%	19,93%	7,14%	19,93%	19,35%	-9,43%	7,32%	15,42%
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	1.345.163,93	97.55%
Fundos de Investimento	35.097,03	2.55%
Operação compromissada	4.139,58	0.30%
Títulos Federais	762,82	0.06%
Valores a pagar/receber	-6.266,92	-0.45%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
MICROSOFT CORPORATIO - MSFT34	119.687,40	8,68	Brazilian Depositary Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	87.378,66	6,34	Brazilian Depositary Rece...
VISA INC - VISA34	76.942,45	5,58	Brazilian Depositary Rece...
NVIDIA COR - NVDC34	67.670,32	4,91	Brazilian Depositary Rece...
APPLE INC - AAPL34	64.586,97	4,68	Brazilian Depositary Rece...
UNITEDHEALTH GROUP INC - UNHH34	57.223,60	4,15	Brazilian Depositary Rece...
META PLATFORMS, INC - M1TA34	43.892,75	3,18	Brazilian Depositary Rece...
THERMO FISHER SCIENTIFIC, INC - TMOS34	41.410,89	3,00	Brazilian Depositary Rece...
MONSTER BEVERAGE COR - M1NS34	39.596,50	2,87	Brazilian Depositary Rece...
WW GRAINGER IN - G1WW34	39.315,18	2,85	Brazilian Depositary Rece...
EATON CORP PLC - E1TN34	35.705,00	2,59	Brazilian Depositary Rece...
ZOETIS INC - Z1TS34	35.340,91	2,56	Brazilian Depositary Rece...
NETFLIX, INC - NFLX34	34.709,74	2,52	Brazilian Depositary Rece...
PALO ALTO NETWORKS INC - P2AN34	34.154,14	2,48	Brazilian Depositary Rece...
SALESFORCE, INC - SSFO34	33.704,46	2,44	Brazilian Depositary Rece...
NIKE INC - NIKE34	32.944,94	2,39	Brazilian Depositary Rece...
STRYKER CORP - S1YK34	29.165,37	2,12	Brazilian Depositary Rece...
S&P GLOBAL INC - SPGI34	27.922,12	2,02	Brazilian Depositary Rece...
RTX CORPORATIO - RYTT34	27.852,86	2,02	Brazilian Depositary Rece...
DEXCOM INC - D1EX34	27.675,14	2,01	Brazilian Depositary Rece...
UNITED PARCEL SERVICE, INC - UPSS34	26.879,89	1,95	Brazilian Depositary Rece...
INTUITIVE SURGICAL INC - I1SR34	26.210,01	1,90	Brazilian Depositary Rece...
MARSH & MCLENNAN COS INC - M1MC34	25.241,18	1,83	Brazilian Depositary Rece...
ALCON IN - A2LC34	25.017,49	1,81	Brazilian Depositary Rece...
PAYPAL HOLDINGS IN - PYPL34	24.800,87	1,80	Brazilian Depositary Rece...
EQUINIX IN - EQIX34	23.953,04	1,74	Brazilian Depositary Rece...
ADOBE IN - ADBE34	23.648,57	1,72	Brazilian Depositary Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão

CAIXA DTVM

Taxa de Administração

1,00%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+1 du

Quantidade de Cotistas

892

Patrimônio Líquido Fundo

72.550.766,44

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 10º, Inciso I

Benchmark

Não definido

Classificação ANBIMA

Multimercados Livre

Política de Investimento

Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA

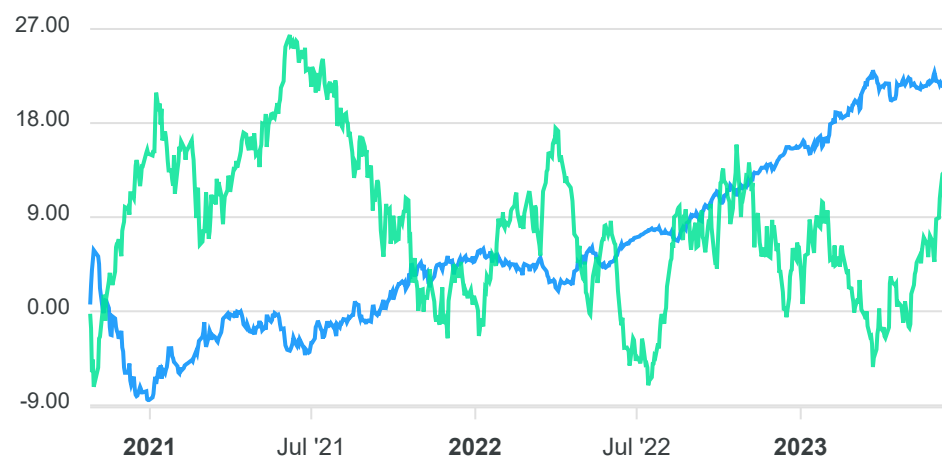
MASTER HEDGE FI MULTIMERCADO LP, CNPJ:

30.068.240/0001-99.

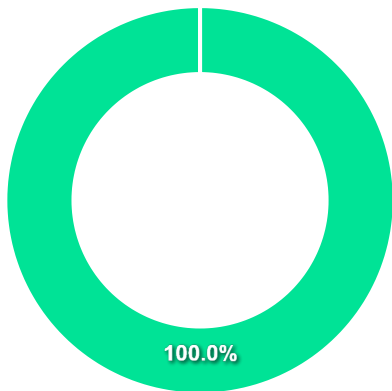
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,80%	5,34%	0,36%	5,34%	13,83%	26,24%	1,59%	3,36%
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 CAIXA MASTER HEDGE FI MULTIMERCADO LP	80.590,65	100,03	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	5,28	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-25,75	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	80.590,65	100.03%
Valores a pagar/receber	-20,47	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão

WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA

Taxa de Administração

1,00%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+1

Quantidade de Cotistas

23.779

Patrimônio Líquido Fundo

821.675.560,44

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 no mercado de renda variável, realizará operações de derivativos envolvendo contratos futuros referenciados em índices de ações, adotando o S&P500 como referencial para a seleção de investimentos.

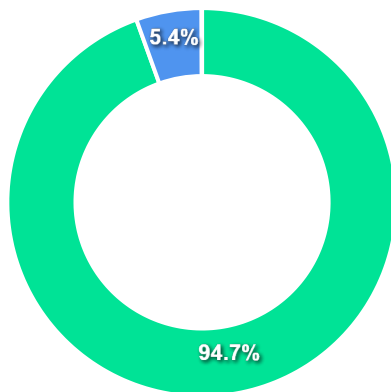
COMPARATIVO

30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	6,98%	20,06%	10,37%	20,06%	28,23%	20,74%	5,04%	10,60%
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
LFT - Venc.: 01/09/2025	290.853,57	33,70	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026	177.995,40	20,62	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	147.415,12	17,08	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027	128.395,51	14,88	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024	57.060,15	6,61	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	46.839,27	5,43	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2024	11.276,72	1,31	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	3.858,54	0,45	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas - ISPFUTU23	507,74	0,06	Derivativos
Outros Valores a receber	39,58	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,71	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.229,45	-0,14	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	816.855,01	94.65%
Operação compromissada	46.839,27	5.43%
Derivativos	507,74	0.06%
Valores a pagar/receber	-1.179,17	-0.14%

