

2023

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

Junho

Análise dos Investimentos

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

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	527.678,86	2,90%	6.483.473.627,64	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.258.184,83	6,91%	5.638.426.224,35	0,02%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.223.449,07	6,72%	1.191.739.626,46	0,10%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.152.616,02	11,82%	6.493.608.770,37	0,03%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	128.555,76	0,71%	6.781.214.720,11	0,00%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	425.954,28	2,34%	188.237.769,14	0,23%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.448.439,70	29,93%	1.128.559.610,31	0,48%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	1.052.277,78	5,78%	369.070.369,54	0,29%	7º I b
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	2.083.994,11	11,45%	39.498.344,52	5,28%	7º I b
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.033.284,98	11,17%	6.942.662.276,99	0,03%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	292.522,24	1,61%	810.368.157,20	0,04%	8º I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	804.201,84	4,42%	276.527.312,93	0,29%	8º I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	775.321,55	4,26%	395.975.228,63	0,20%	9º III

Investimentos

\$ 18.206.481,02

Disponibilidades Financeiras

\$ 43.410,39

Total Carteira

\$ 18.249.891,41

Governança (Pró Gestão)

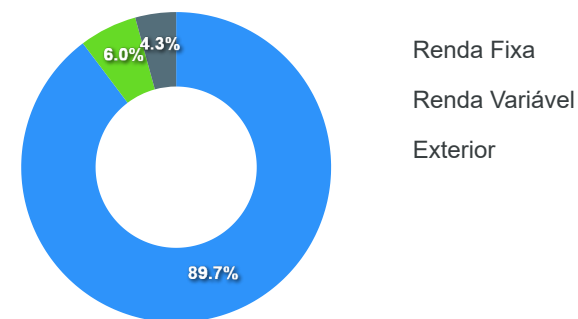


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	78,55%	14.301.150,41 21,45%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	11,17%	2.033.284,98 48,83%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	6,02%	1.096.724,08 23,98%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	4,26%	775.321,55 5,74%

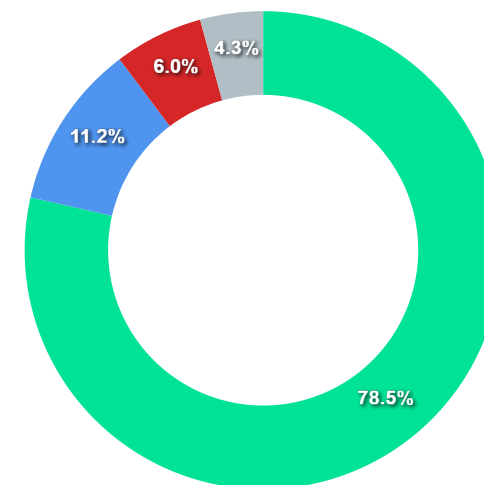
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



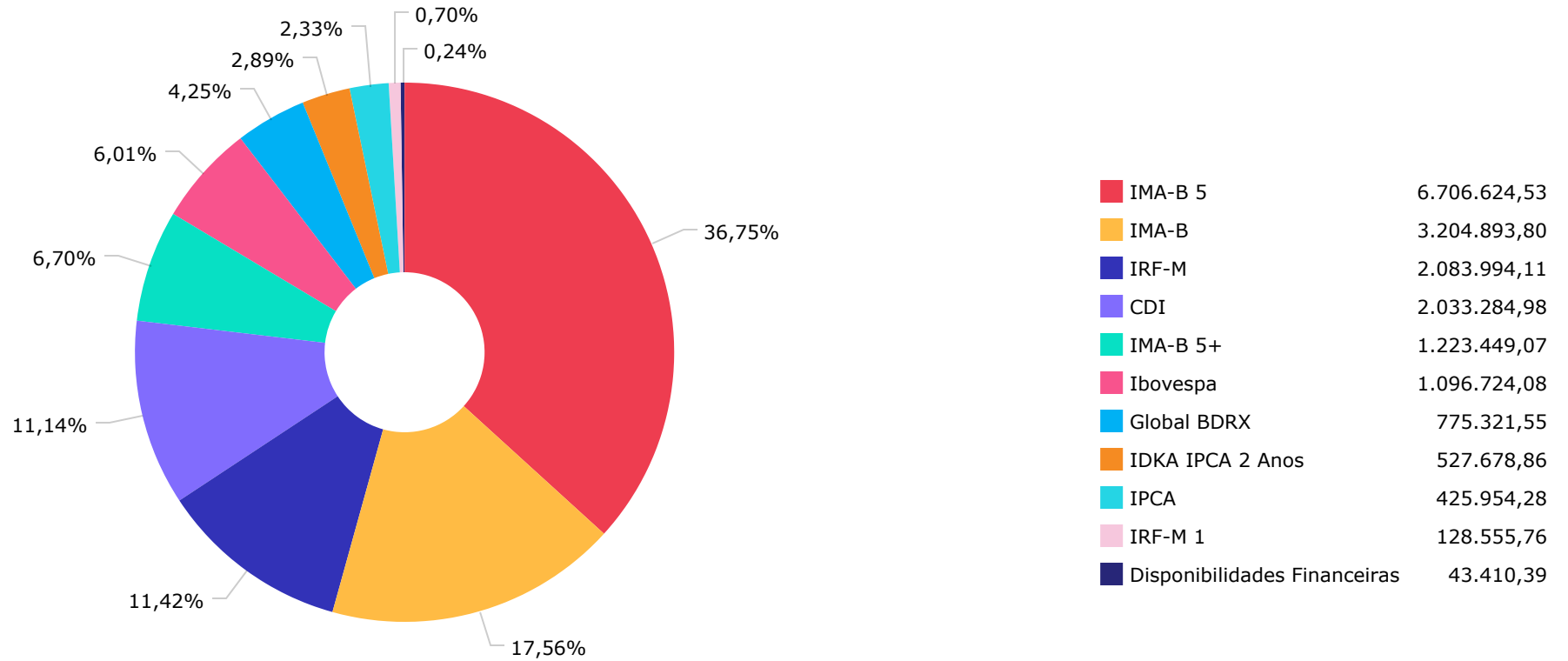
Artigos

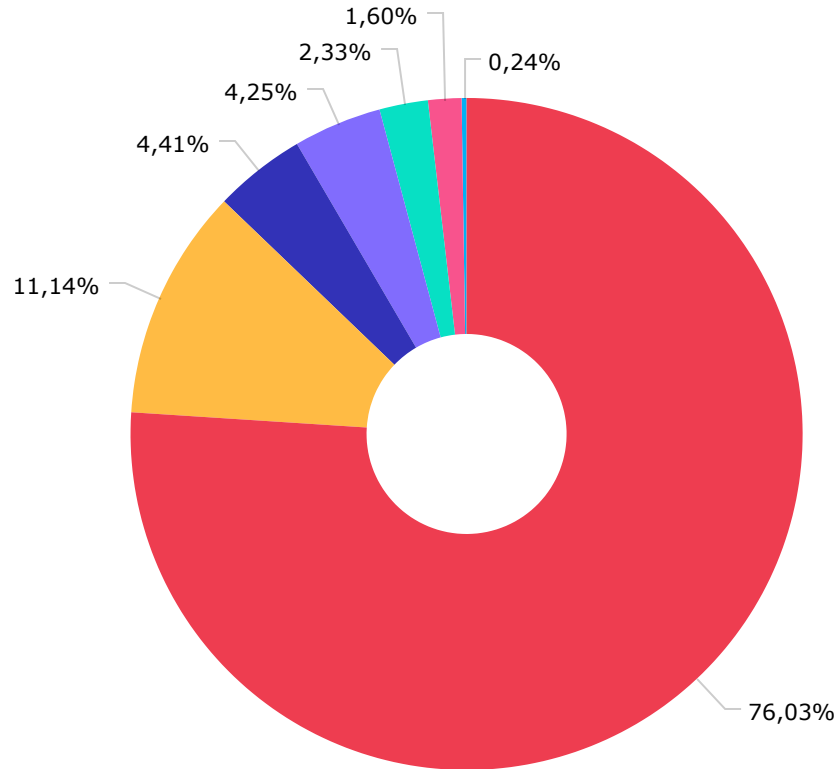


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	18.206.481,02	8° I - Fundos de Ações	6,02%	0,00%	10,00%	30,00%	4.365.220,23
7° I b - FI 100% Títulos TN	78,55%	0,00%	66,00%	100,00%	3.905.330,61	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	5.461.944,31
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	18.206.481,02	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.820.648,10
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	910.324,05	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.820.648,10
7° III a - FI Referenciados RF	11,17%	0,00%	10,00%	60,00%	8.890.603,63	9° III - Ações - BDR Nível I	4,26%	0,00%	7,00%	10,00%	1.045.326,55
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	10.923.888,61	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	1.820.648,10
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	3.641.296,20	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	910.324,05
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	910.324,05	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	910.324,05
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	910.324,05	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	910.324,05
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	910.324,05	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	910.324,05

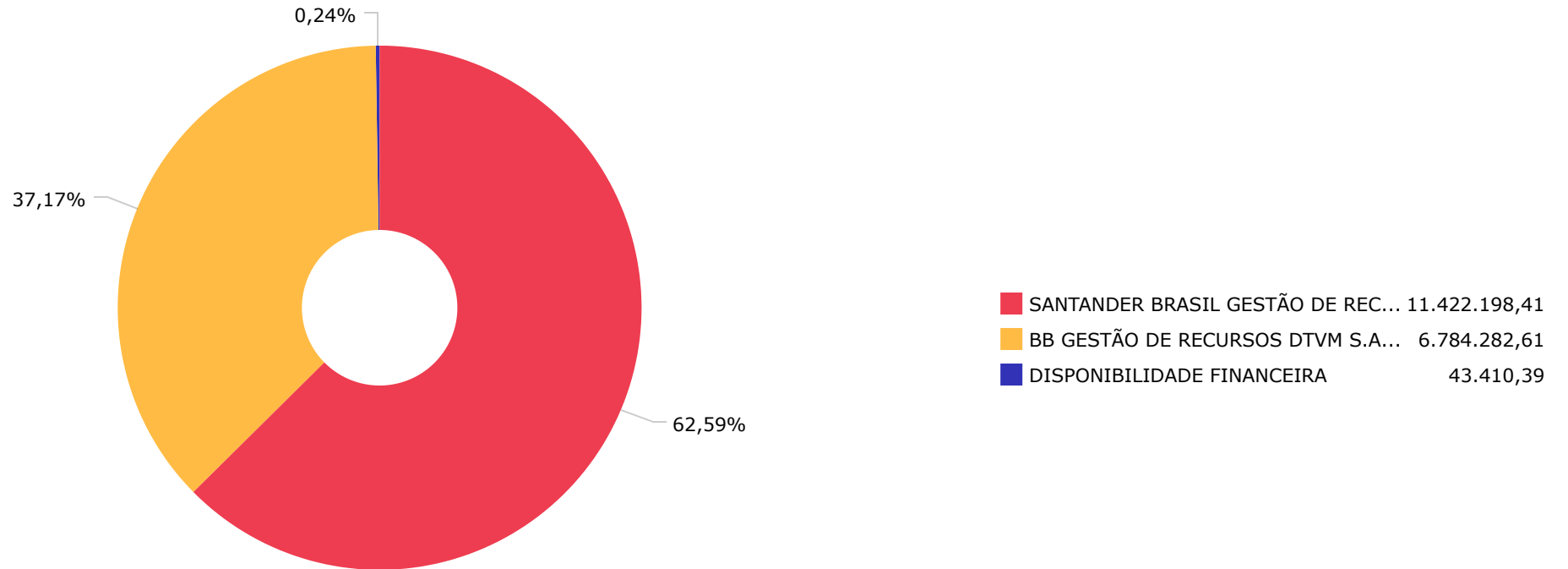
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08	6,45	3,13	6,45	13,44	23,27	0,01	0,01
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,48	15,14	5,90	15,14	14,44	0,60		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,88	12,69	5,59	12,69	16,08	5,21	5,19	10,93
IBOVESPA - BENCHMARK	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9,13	7,87	16,52	7,87	19,49	-8,25	7,46	15,71
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	7,60	16,00
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02	6,56	2,10	6,56	9,43	20,20	0,78	1,64
IMA-B - BENCHMARK	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37	11,28	7,11	11,28	13,29	17,23	2,15	4,52
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,37	11,22	7,05	11,22	13,24	17,23	2,16	4,55
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	6,99	2,56	6,99	10,05	20,76	0,90	1,89
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03	6,92	2,49	6,92	10,00	20,80	0,89	1,87
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,31	14,66	10,79	14,66	15,89	13,02	3,16	6,66
IPCA - BENCHMARK	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93	5,54	1,44	5,54	9,24	21,24	0,47	0,99

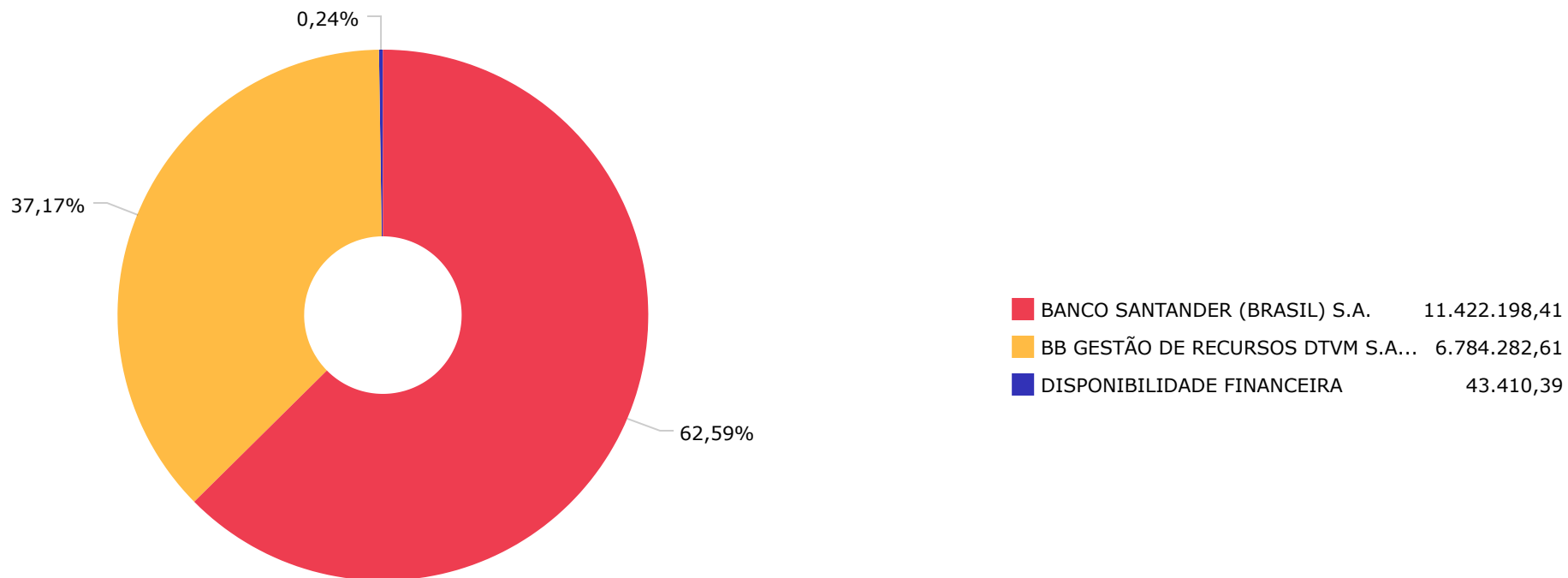
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M - BENCHMARK	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79		
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	1,16	6,45	3,12	6,45	13,38	21,09	0,11	0,22
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00		
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16	6,49	3,14	6,49	13,48	21,33	0,10	0,22





Renda Fixa Indexados	13.875.196,13
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	2.033.284,98
Ações Índice Ativo	804.201,84
Ações Livre	775.321,55
Não classificado	425.954,28
Ações Sustentabilidade/Governança	292.522,24
Disponibilidades Financeiras	43.410,39





Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	14.924.019,41	3.466.468,16	2.704.804,85	15.876.836,26	191.153,54	191.153,54	1,22% ▲	1,22%	0,94%	0,94%	129,79%	2,36%
Fevereiro	15.876.836,26	3.917.883,45	3.871.172,34	15.996.839,32	73.291,95	264.445,49	0,46% ▲	1,68%	1,18%	2,13%	78,87%	2,08%
Março	15.996.839,32	3.055.699,87	2.216.238,43	17.092.728,02	256.427,26	520.872,75	1,52% ▲	3,23%	1,14%	3,30%	97,88%	1,66%
Abril	17.092.728,02	1.808.789,64	1.700.000,00	17.427.240,10	225.722,44	746.595,19	1,31% ▲	4,59%	0,95%	4,28%	107,24%	1,53%
Mai	17.427.240,10	1.775.250,50	1.668.348,73	17.790.376,23	256.234,36	1.002.829,55	1,46% ▲	6,12%	0,64%	4,95%	123,64%	1,43%
Junho	17.790.376,23	2.364.837,84	2.313.067,26	18.206.481,02	364.334,21	1.367.163,76	2,04% ▲	8,28%	0,31%	5,28%	156,82%	1,64%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	520.872,75	3,23%	3,30%
2º Trim	846.291,01	4,89%	1,92%
1º Sem	1.367.163,76	8,28%	5,28%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

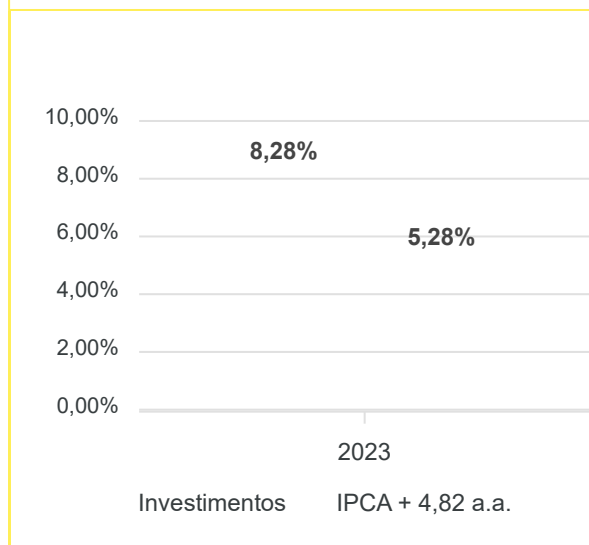
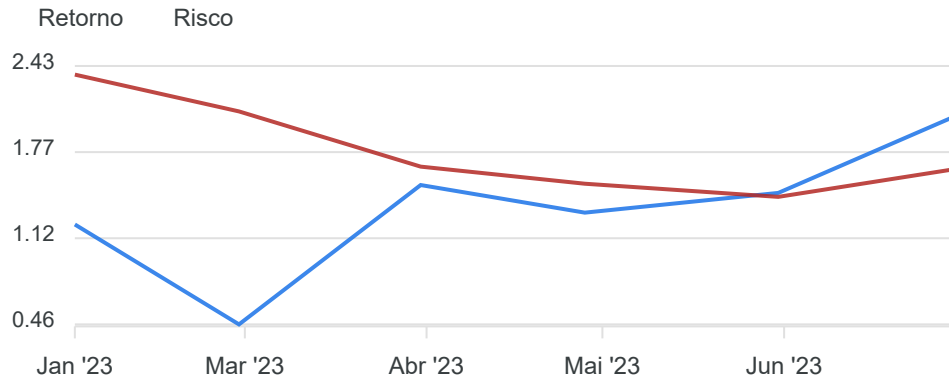
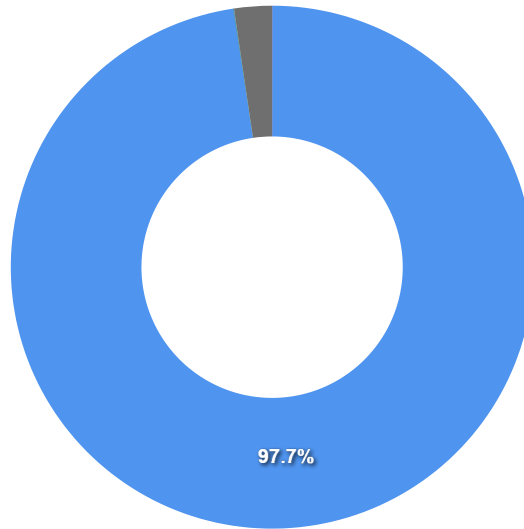


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 30/06/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	17.823.937,13	97,90
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	425.954,28	2,34
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	522.353,46	0,00	0,00	527.678,86	5.325,40	1,02% ▲	0,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.245.346,38	0,00	0,00	1.258.184,83	12.838,45	1,03% ▲	0,90%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.184.286,96	0,00	0,00	1.223.449,07	39.162,11	3,31% ▲	3,16%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.102.737,85	0,00	0,00	2.152.616,02	49.878,17	2,37% ▲	2,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	127.083,40	0,00	0,00	128.555,76	1.472,36	1,16% ▲	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	422.036,69	0,00	0,00	425.954,28	3.917,59	0,93% ▲	0,47%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.176.173,95	217.342,27	0,00	5.448.439,70	54.923,48	1,02% ▲	0,89%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	1.027.872,98	0,00	0,00	1.052.277,78	24.404,80	2,37% ▲	2,16%
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	2.060.132,10	0,00	0,00	2.083.994,11	23.862,01	1,16% ▲	0,11%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.177.525,79	2.147.495,57	2.313.067,26	2.033.284,98	21.330,88	0,49% ▲	0,01%
	16.045.549,56	2.364.837,84	2.313.067,26	16.334.435,39	237.115,25	1,47%	1,08%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	268.671,19	0,00	0,00	292.522,24	23.851,05	8,88% ▲	7,60%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	736.911,80	0,00	0,00	804.201,84	67.290,04	9,13% ▲	7,46%
-	1.005.582,99	0,00	0,00	1.096.724,08	91.141,09	9,06%	7,50%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	739.243,68	0,00	0,00	775.321,55	36.077,87	4,88% ▲	5,19%
	739.243,68	0,00	0,00	775.321,55	36.077,87	4,88%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	516.829,68	0,00	0,00	527.678,86	10.849,18	2,10% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.226.816,66	0,00	0,00	1.258.184,83	31.368,17	2,56% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.104.323,83	0,00	0,00	1.223.449,07	119.125,24	10,79% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.009.692,01	0,00	0,00	2.152.616,02	142.924,01	7,11% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	124.641,27	0,00	0,00	128.555,76	3.914,49	3,14% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	419.908,56	0,00	0,00	425.954,28	6.045,72	1,44% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	4.713.871,81	610.424,46	0,00	5.448.439,70	124.143,43	2,33% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	983.000,59	0,00	0,00	1.052.277,78	69.277,19	7,05% ▲
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	2.020.965,00	0,00	0,00	2.083.994,11	63.029,11	3,12% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.294.861,65	5.338.453,52	5.681.415,99	2.033.284,98	81.385,80	1,07% ▲
	15.414.911,06	5.948.877,98	5.681.415,99	16.334.435,39	652.062,34	4,16%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	253.382,22	0,00	0,00	292.522,24	39.140,02	15,45% ▲
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	690.168,59	0,00	0,00	804.201,84	114.033,25	16,52% ▲
	943.550,81	0,00	0,00	1.096.724,08	153.173,27	16,23%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	734.266,15	0,00	0,00	775.321,55	41.055,40	5,59% ▲
	734.266,15	0,00	0,00	775.321,55	41.055,40	5,59%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	495.184,22	0,00	0,00	527.678,86	32.494,64	6,56% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.175.988,49	0,00	0,00	1.258.184,83	82.196,34	6,99% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.066.989,38	0,00	0,00	1.223.449,07	156.459,69	14,66% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.934.417,03	0,00	0,00	2.152.616,02	218.198,99	11,28% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	120.717,42	0,00	0,00	128.555,76	7.838,34	6,49% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	415.428,08	0,00	12.134,52	425.954,28	22.660,72	5,45% ▲
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA	1.391.725,63	4.420.000,00	5.838.777,86	0,00	27.052,23	0,47% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	3.910.812,22	1.219.493,47	0,00	5.448.439,70	318.134,01	6,20% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	946.121,00	0,00	0,00	1.052.277,78	106.156,78	11,22% ▲
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	1.758.448,63	202.347,47	0,00	2.083.994,11	123.198,01	6,28% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	10.547.088,52	8.622.719,23	2.033.284,98	108.915,69	1,03% ▲
	13.215.832,10	16.388.929,46	14.473.631,61	16.334.435,39	1.203.305,44	7,95%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	274.638,56	0,00	0,00	292.522,24	17.883,68	6,51% ▲
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	745.513,85	0,00	0,00	804.201,84	58.687,99	7,87% ▲
	1.020.152,41	0,00	0,00	1.096.724,08	76.571,67	7,51%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	688.034,90	0,00	0,00	775.321,55	87.286,65	12,69% ▲
	688.034,90	0,00	0,00	775.321,55	87.286,65	12,69%

Cenário Econômico

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

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

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

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

Retorno dos Fundos de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 07 de julho de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	942
Patrimônio Líquido Fundo	6.483.473.627,64

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IDKA IPCA 2 Anos
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

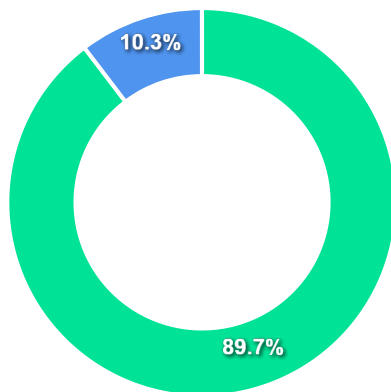
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	1,64%
Benchmark	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 783
Patrimônio Líquido Fundo 5.638.426.224,35

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B 5
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

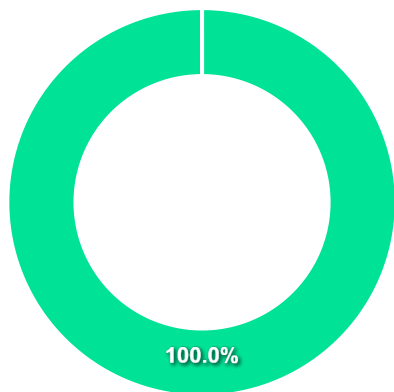
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,99%	2,56%	6,99%	10,05%	20,76%	0,90%	1,89%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	5.638.499,75	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,64	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,12	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-44,75	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-54,69	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.638.499,75	100.00%
Valores a pagar/receber	-93,39	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+2
Quantidade de Cotistas	237
Patrimônio Líquido Fundo	1.191.739.626,46

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B 5+
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

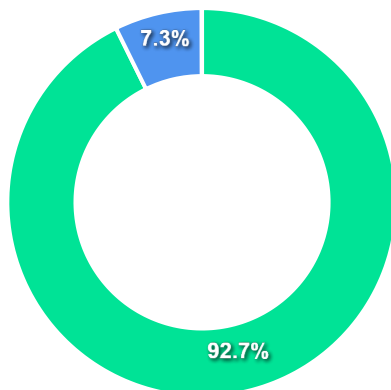
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,31%	14,66%	10,79%	14,66%	15,89%	13,02%	3,16%	6,66%
Benchmark	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 572
Patrimônio Líquido Fundo 6.493.608.770,37

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

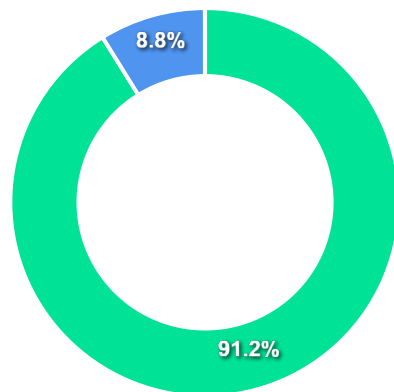
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	4,52%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.920.421,52	91.17%
Operação compromissada	572.459,19	8.82%
Derivativos	645,60	0.01%
Valores a pagar/receber	179,78	0.00%

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,10%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	1.136
Patrimônio Líquido Fundo	6.781.214.720,11

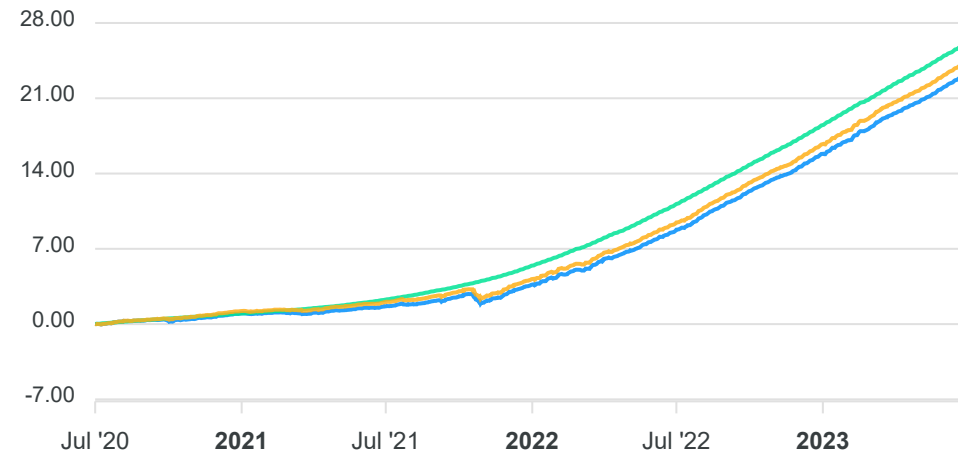
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IRF-M 1
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais.

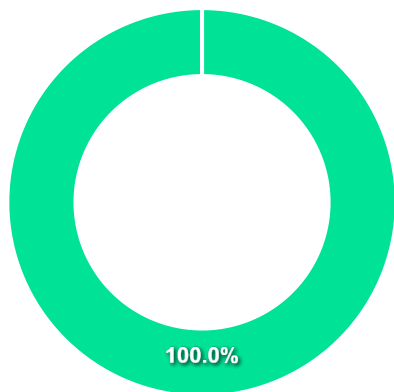
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	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
Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.781.242,31	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	26,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,78	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 / Ajuste de Cota Negativa	0,02	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.781.242,31	100.00%
Valores a pagar/receber	59,35	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 140
Patrimônio Líquido Fundo 188.237.769,14

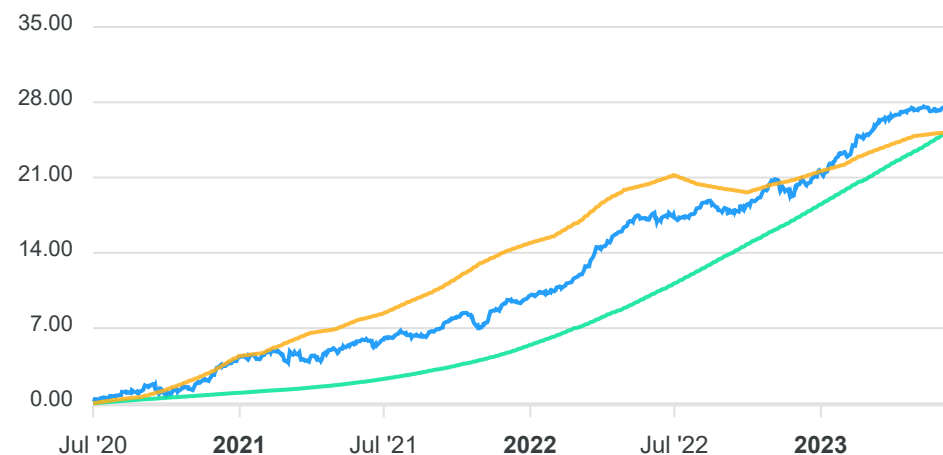
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IPCA
Classificação ANBIMA Não classificado
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

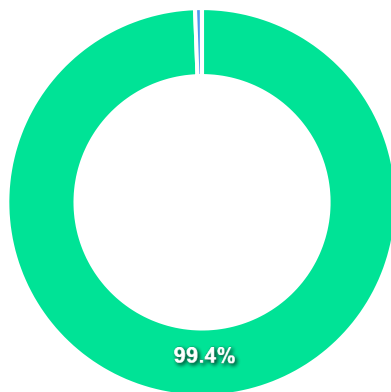
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,93%	5,54%	1,44%	5,54%	9,24%	21,24%	0,47%	0,99%
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	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	187.155,01	99,42	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.049,30	0,56	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	29,16	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	16,64	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	6,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,62	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-0,97	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	-1,20	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-1,56	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-2,26	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-5,48	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-8,45	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	187.155,01	99.42%
Operação compromissada	1.049,30	0.56%
Valores a pagar/receber	33,46	0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

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

PERFIL DO FUNDO

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

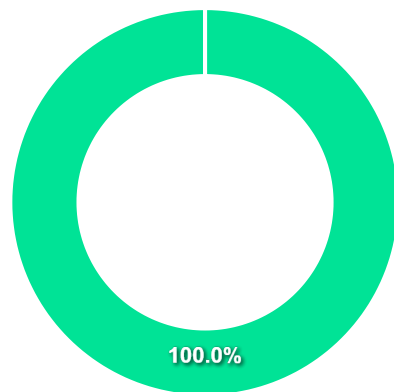
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,92%	2,49%	6,92%	10,00%	20,80%	0,89%	1,87%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.128.624,09	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	67,34	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-136,83	-0,01	Valores a pagar/receber

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance 20,00%
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 62
Patrimônio Líquido Fundo 369.070.369,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa.

COMPARATIVO

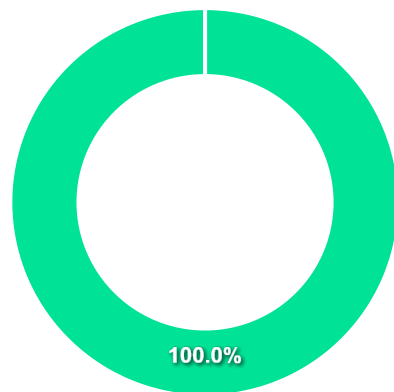
📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,22%	7,05%	11,22%	13,24%	17,23%	2,16%	4,55%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	369.088,10	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	35,24	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-57,97	-0,02	Valores a pagar/receber



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	369.088,10	100.00%
Valores a pagar/receber	-17,73	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,40%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 19
Patrimônio Líquido Fundo 39.498.344,52

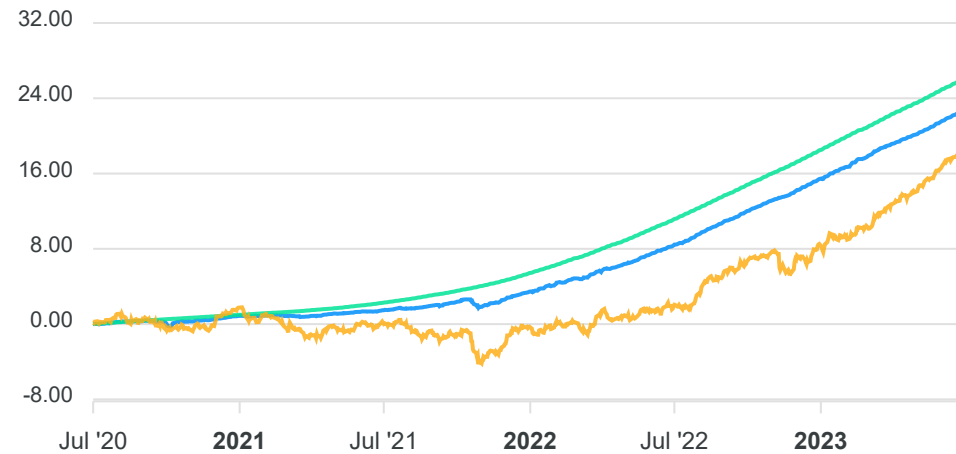
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IRF-M
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em renda fixa e fundos de investimento em índice de renda fixa que invistam apenas em títulos públicos e operações compromissadas lastradas nesses títulos.

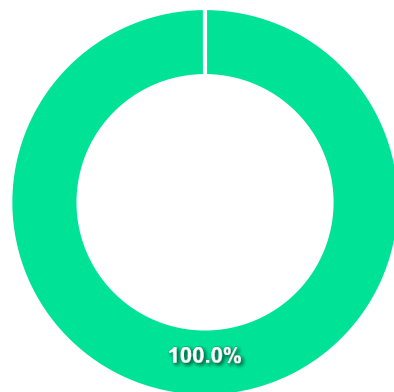
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,45%	3,12%	6,45%	13,38%	21,09%	0,11%	0,22%
Benchmark	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	39.492,70	99,99	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	17,72	0,04	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-17,07	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	39.492,70	99.99%
Valores a pagar/receber	5,65	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	679
Patrimônio Líquido Fundo	6.942.662.276,99

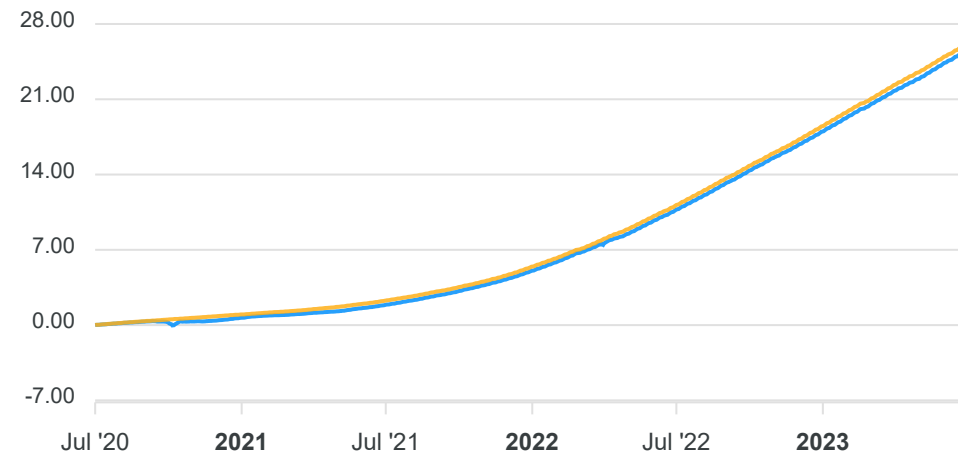
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark	CDI
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Baixa Soberano
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais investem em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas nestes títulos.

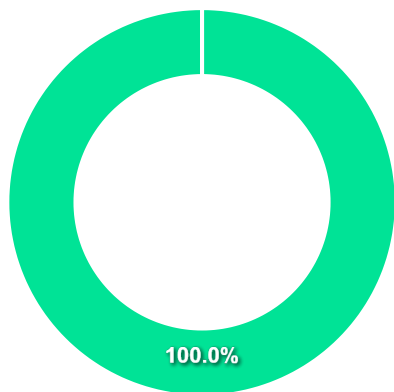
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,08%	6,45%	3,13%	6,45%	13,44%	23,27%	0,01%	0,01%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	6.943.772,95	98,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	49,31	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.164,98	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.943.772,95	100.02%
Valores a pagar/receber	-1.110,67	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
1,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
1.354

Patrimônio Líquido Fundo
810.368.157,20

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Sustentabilidade/Governança

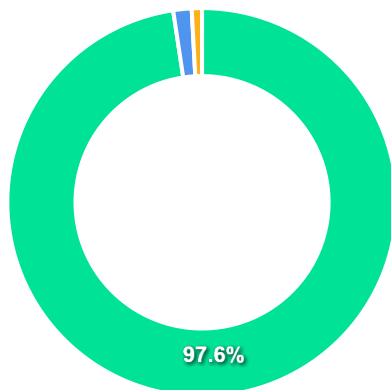
Política de Investimento
Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,88%	6,51%	15,45%	6,51%	17,05%	-11,63%	7,60%	16,00%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	791.214,26	97.64%
Valores a pagar/receber	12.350,47	1.52%
Operação compromissada	6.886,00	0.85%
Derivativos	-72,47	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	73.845,36	9,11	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	48.520,74	5,99	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	48.190,63	5,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	44.142,16	5,45	Ações
B3 ON NM - B3SA3	32.352,19	3,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	28.576,55	3,53	Ações
ELETOBRAS ON N1 - ELET3	26.990,25	3,33	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	24.486,74	3,02	Ações
BRADERCO PN N1 - BBDC4	21.281,83	2,63	Ações
WEG ON NM - WEGE3	19.897,27	2,46	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	19.577,30	2,42	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	17.504,49	2,16	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	11.435,76	1,41	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	9.321,49	1,15	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	8.252,57	1,02	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	8.041,77	0,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	7.885,78	0,97	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	7.567,14	0,93	Ações
BRADERCO ON N1 - BBDC3	7.448,17	0,92	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	7.217,58	0,89	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7.203,26	0,89	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	6.974,99	0,86	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	6.886,00	0,85	Operação compromissada
JBS ON NM - JBSS3	6.577,22	0,81	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BPAC11	6.469,27	0,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	6.449,66	0,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RDOR3	6.443,66	0,80	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,75%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+4
Quantidade de Cotistas 33
Patrimônio Líquido Fundo 276.527.312,93

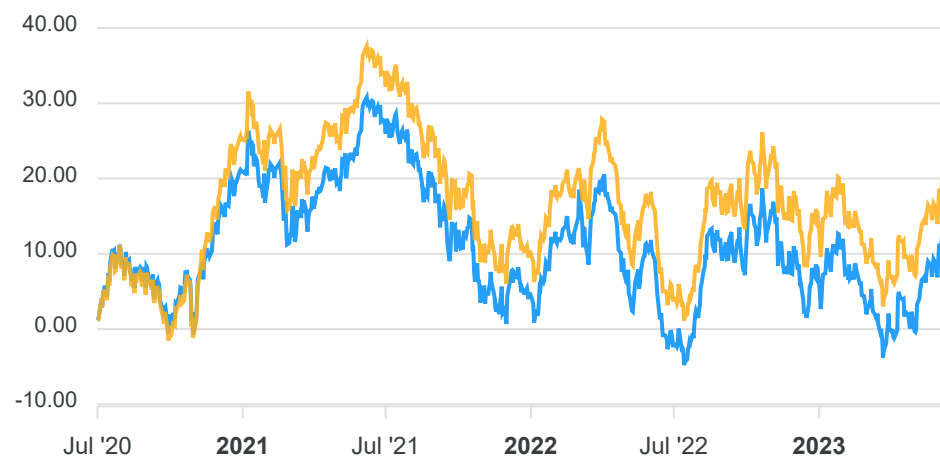
PERFIL DO FUNDO

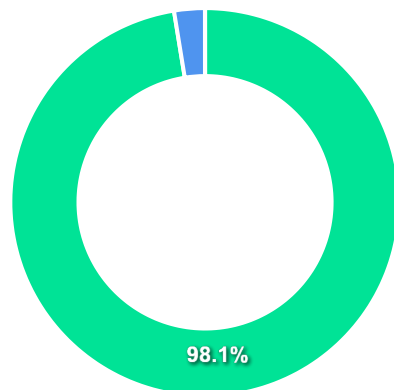
Enquadramento Resolução Artigo 8º, Inciso I
Benchmark Ibovespa
Classificação ANBIMA Ações Índice Ativo
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III.

COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	9,13%	7,87%	16,52%	7,87%	19,49%	-8,25%	7,46%	15,71%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	262.909,51	98.09%
Operação compromissada	6.877,20	2.57%
Fundos de Investimento	13,49	0.01%
Outros	6,83	0.00%
Derivativos	-112,74	-0.04%
Valores a pagar/receber	-1.675,81	-0.63%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	38.111,58	14,22	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	17.615,42	6,57	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	15.960,49	5,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	13.680,42	5,10	Ações
B3 ON NM - B3SA3	12.807,89	4,78	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	10.102,81	3,77	Ações
ELETRORBRAS ON N1 - ELET3	9.253,34	3,45	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	8.213,45	3,06	Ações
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2026	6.877,20	2,57	Operação compromissada
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	6.459,90	2,41	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	6.399,62	2,39	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	6.208,18	2,32	Ações
ASSAI ON NM - ASAI3	4.777,00	1,78	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	4.477,45	1,67	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.413,14	1,65	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	4.319,25	1,61	Ações
HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	4.073,67	1,52	Ações
JBS ON NM - JBSS3	3.964,15	1,48	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	3.895,63	1,45	Ações
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	3.882,54	1,45	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	3.633,78	1,36	Ações
WEG ON NM - WEGE3	3.511,63	1,31	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3.441,48	1,28	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	3.245,93	1,21	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	2.875,09	1,07	Ações
BEMOBI TECH ON NM - BMOB3	2.769,11	1,03	Ações
PETRORECSA ON NM - RECV3	2.709,99	1,01	Ações

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
10,00%

Disponibilidade de Resgate
D+2 du

Quantidade de Cotistas
22.263

Patrimônio Líquido Fundo
395.975.228,63

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
Global BDRX

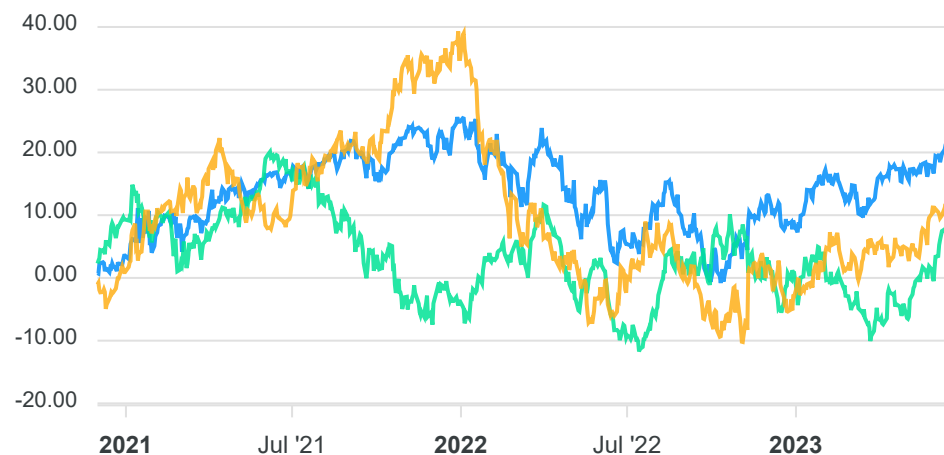
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP
AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I,
CNPJ: 39.272.928/0001-60.

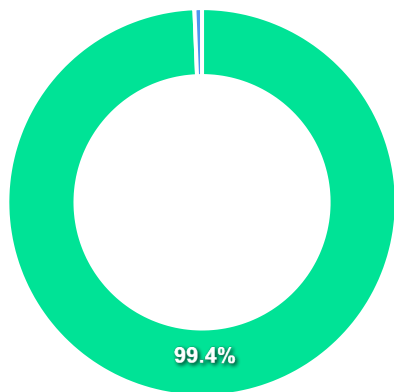
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,88%	12,69%	5,59%	12,69%	16,08%	5,21%	5,19%	10,93%
Benchmark	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BD...	382.376,18	96,57	Fundos de Investimento
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.112,55	2,81	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.538,05	0,64	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	688,52	0,17	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	22,05	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,74	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR a recolher	-2,44	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-2,90	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-3,32	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-46,32	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-703,85	-0,18	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	393.488,73	99.37%
Valores a pagar/receber	2.486,62	0.63%

Parecer do Comitê de Investimento

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

Aprovação do Conselho Fiscal

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

2023

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

Junho

Análise dos Investimentos

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

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	425.954,28	26,00%	188.237.769,14	0,23%	7º I b
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.212.037,41	74,00% ▲	6.942.662.276,99	0,02%	7º III a

Investimentos

\$ 1.637.991,69

Disponibilidades Financeiras

\$ 34.579,40

Total Carteira

\$ 1.672.571,09

Governança (Pró Gestão)

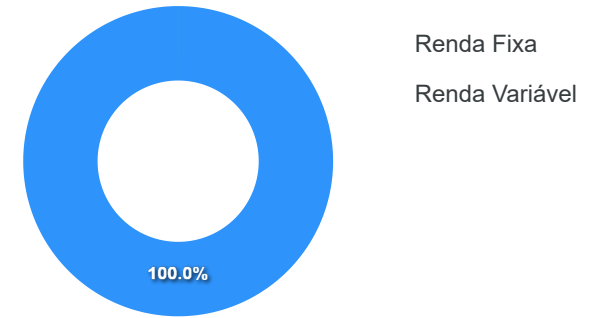


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	25,47%	425.954,28 74,53% 1.246.616,81
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	72,47%	1.212.037,41 -12,47% -208.494,76

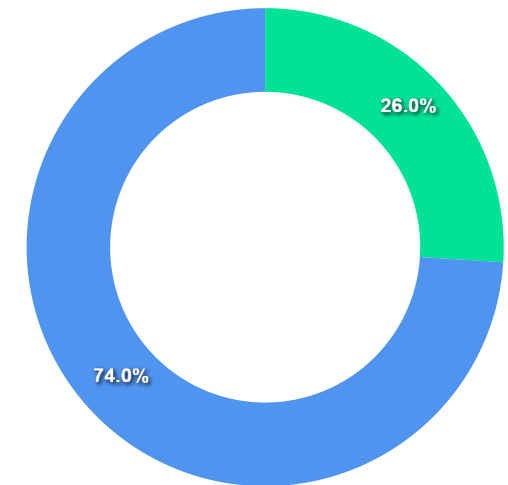
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



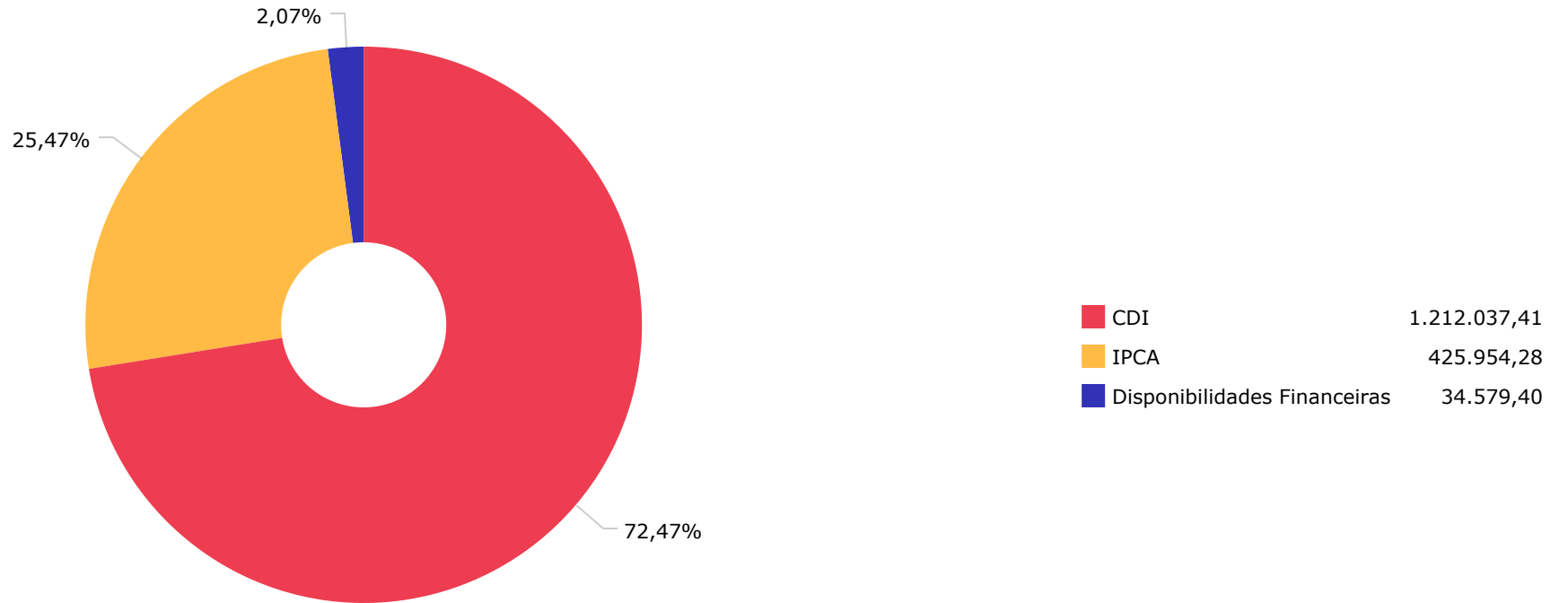
Artigos

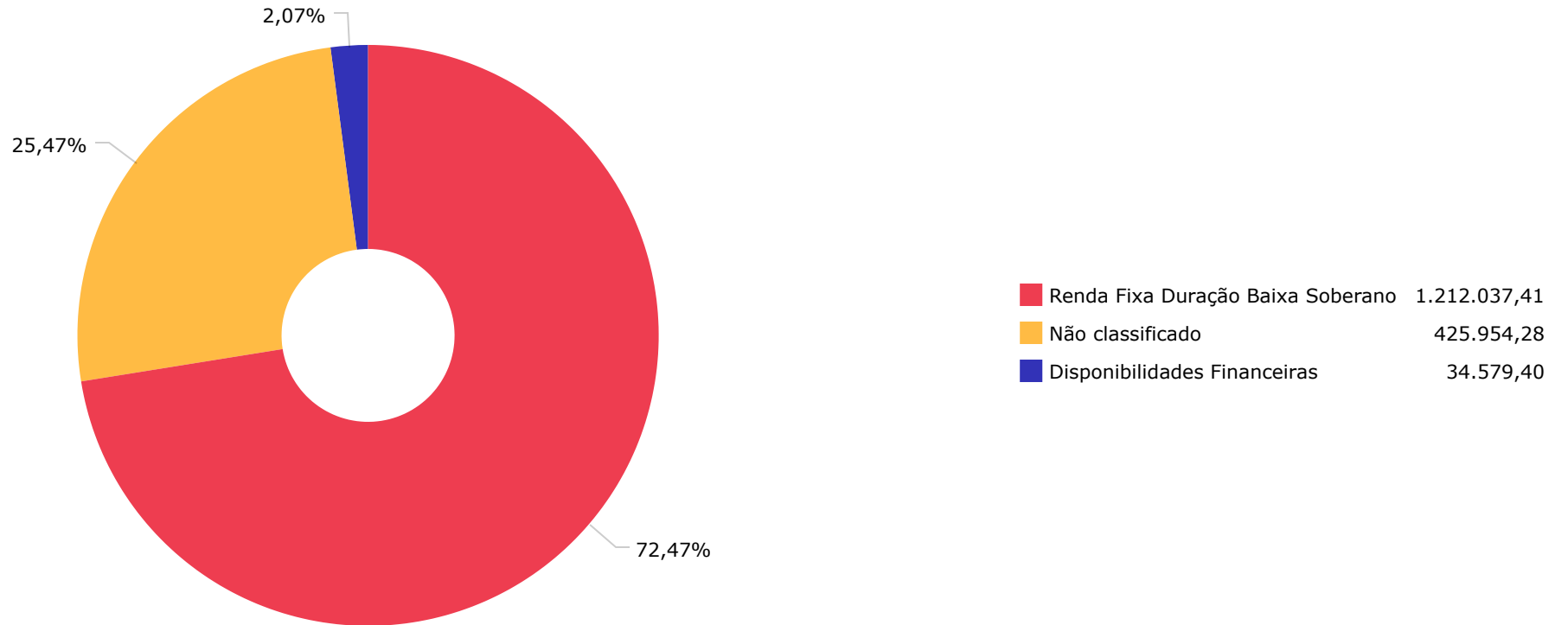


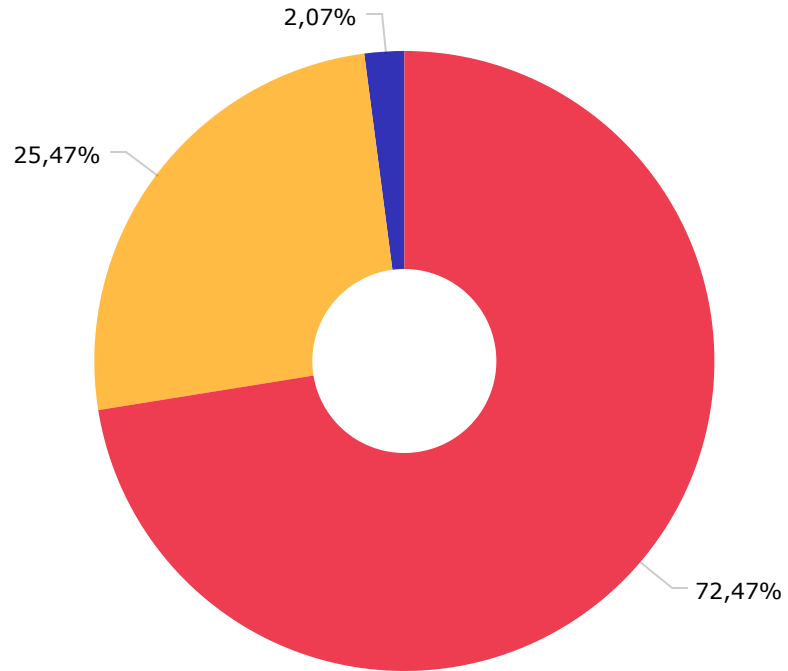
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	1.672.571,09	8º I - Fundos de Ações	0,00%	0,00%	10,00%	30,00%	501.771,33
7º I b - FI 100% Títulos TN	25,47%	0,00%	66,00%	100,00%	1.246.616,81	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	501.771,33
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.672.571,09	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	167.257,11
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	83.628,55	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	167.257,11
7º III a - FI Referenciados RF	72,47%	0,00%	10,00%	60,00%	-208.494,76	9º III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	7,00%	10,00%	167.257,11
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.003.542,65	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	167.257,11
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	334.514,22	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	83.628,55
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	83.628,55	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	83.628,55
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	83.628,55	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	83.628,55
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	83.628,55	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	83.628,55

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08	6,45	3,13	6,45	13,44	23,27	0,01	0,01
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,48	15,14	5,90	15,14	14,44	0,60		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,88	12,69	5,59	12,69	16,08	5,21	5,19	10,93
IBOVESPA - BENCHMARK	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9,13	7,87	16,52	7,87	19,49	-8,25	7,46	15,71
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	7,60	16,00
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02	6,56	2,10	6,56	9,43	20,20	0,78	1,64
IMA-B - BENCHMARK	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37	11,28	7,11	11,28	13,29	17,23	2,15	4,52
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,37	11,22	7,05	11,22	13,24	17,23	2,16	4,55
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	6,99	2,56	6,99	10,05	20,76	0,90	1,89
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03	6,92	2,49	6,92	10,00	20,80	0,89	1,87
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,31	14,66	10,79	14,66	15,89	13,02	3,16	6,66
IPCA - BENCHMARK	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93	5,54	1,44	5,54	9,24	21,24	0,47	0,99

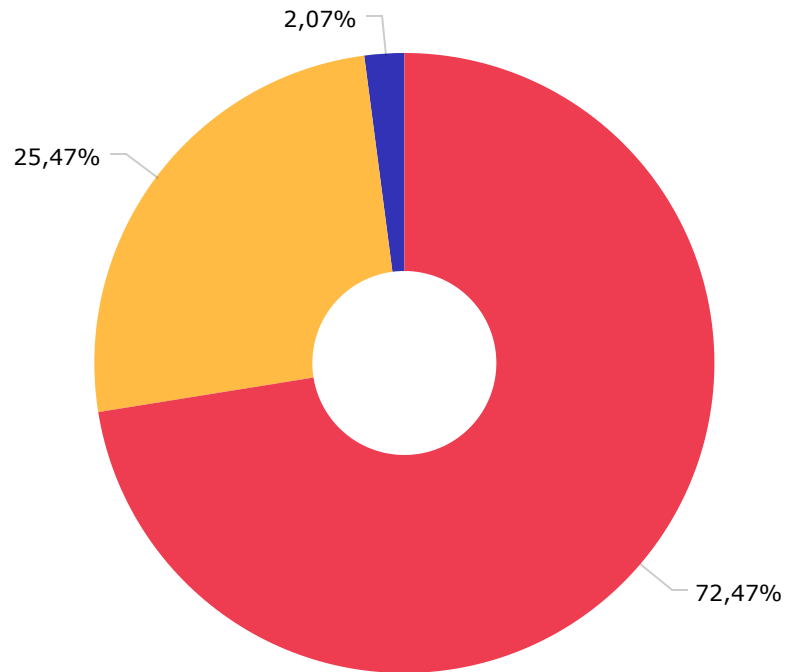
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M - BENCHMARK	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79		
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	1,16	6,45	3,12	6,45	13,38	21,09	0,11	0,22
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00		
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16	6,49	3,14	6,49	13,48	21,33	0,10	0,22







■ SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	1.212.037,41
■ BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	425.954,28
■ DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	34.579,40



■ BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	1.212.037,41
■ BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	425.954,28
■ DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	34.579,40

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	1.243.210,43	2.870.000,00	2.704.804,85	1.421.172,63	12.767,05	12.767,05	0,91% ▲	0,91%	0,94%	0,94%	96,81%	0,52%
Fevereiro	1.421.172,63	3.709.037,82	3.871.172,34	1.275.295,44	16.257,33	29.024,38	1,14% ▲	2,06%	1,18%	2,13%	96,71%	0,42%
Março	1.275.295,44	2.259.000,00	1.641.303,24	1.918.433,18	25.440,98	54.465,36	1,34% ▲	3,43%	1,14%	3,30%	103,94%	0,20%
Abril	1.918.433,18	1.690.957,95	1.700.000,00	1.929.463,05	20.071,92	74.537,28	1,05% ▲	4,51%	0,95%	4,28%	105,37%	0,12%
Mai	1.929.463,05	1.500.000,00	1.668.348,73	1.787.067,09	25.952,77	100.490,05	1,35% ▲	5,92%	0,64%	4,95%	119,60%	0,14%
Junho	1.787.067,09	2.147.495,57	2.313.067,26	1.637.991,69	16.496,29	116.986,34	0,92% ▲	6,90%	0,31%	5,28%	130,68%	0,13%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	54.465,36	3,43%	3,30%
2º Trim	62.520,98	3,35%	1,92%
1º Sem	116.986,34	6,90%	5,28%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

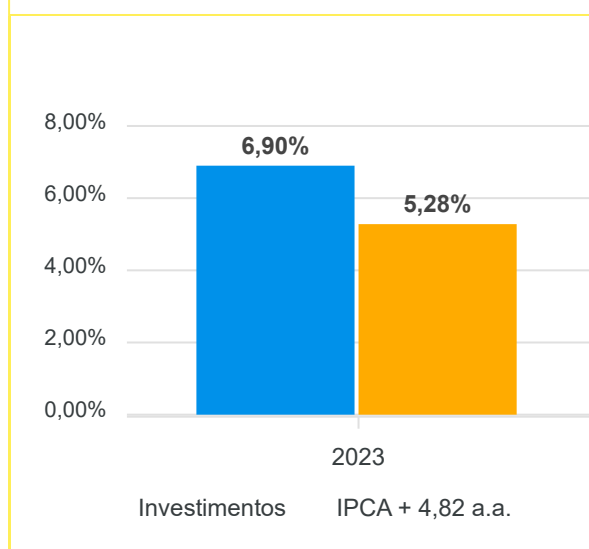


Gráfico Risco x Retorno

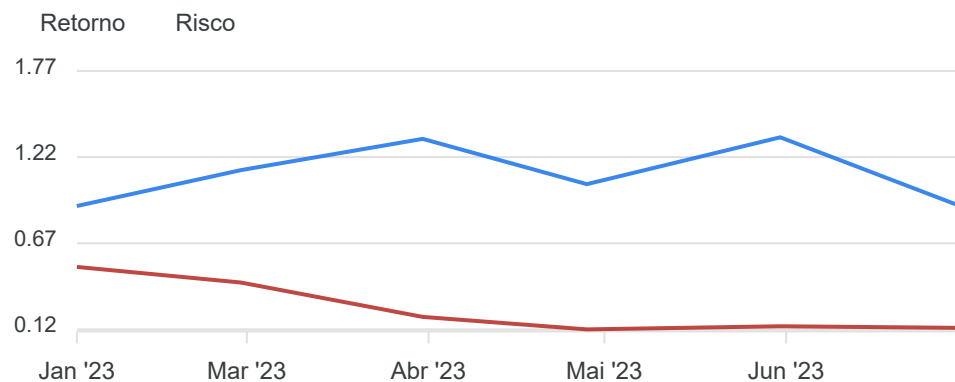
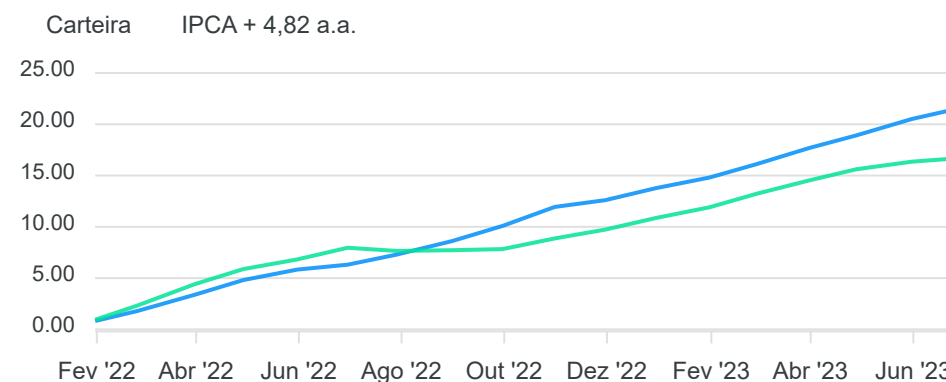
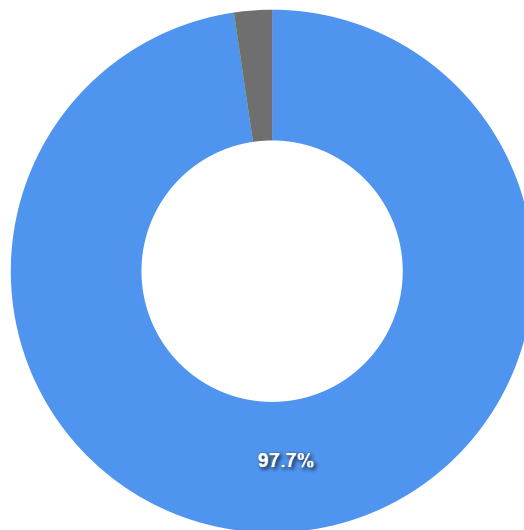


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/06/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	17.823.937,13	1.088,16
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	425.954,28	26,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	422.036,69	0,00	0,00	425.954,28	3.917,59	0,93% ▲	0,47%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.365.030,40	2.147.495,57	2.313.067,26	1.212.037,41	12.578,70	0,36% ▲	0,01%
	1.787.067,09	2.147.495,57	2.313.067,26	1.637.991,69	16.496,29	0,92%	0,13%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	419.908,56	0,00	0,00	425.954,28	6.045,72	1,44% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.498.524,62	5.338.453,52	5.681.415,99	1.212.037,41	56.475,26	0,83% ▲
	1.918.433,18	5.338.453,52	5.681.415,99	1.637.991,69	62.520,98	3,26%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	415.428,08	0,00	12.134,52	425.954,28	22.660,72	5,45% ▲
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA	827.782,35	4.420.000,00	5.263.842,67	0,00	16.060,32	0,31% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	9.756.491,34	8.622.719,23	1.212.037,41	78.265,30	0,80% ▲
	1.243.210,43	14.176.491,34	13.898.696,42	1.637.991,69	116.986,34	7,69%

Cenário Econômico

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

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

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

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

Retorno dos Fundos de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 07 de julho de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	942
Patrimônio Líquido Fundo	6.483.473.627,64

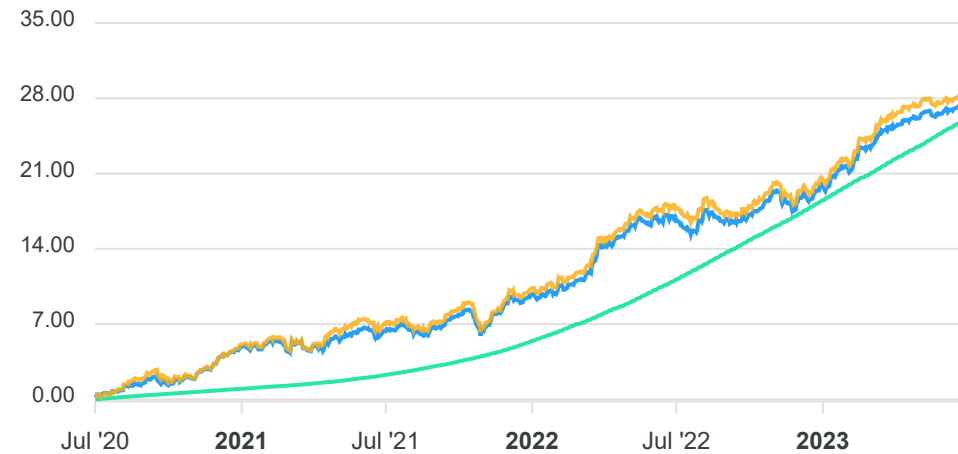
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IDKA IPCA 2 Anos
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

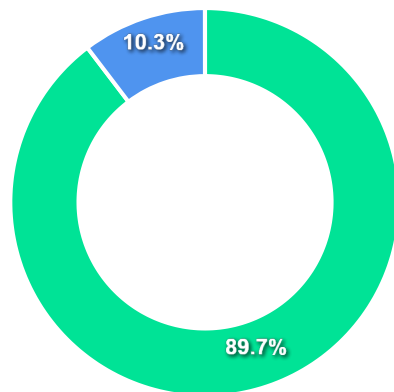
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	1,64%
Benchmark	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 783
Patrimônio Líquido Fundo 5.638.426.224,35

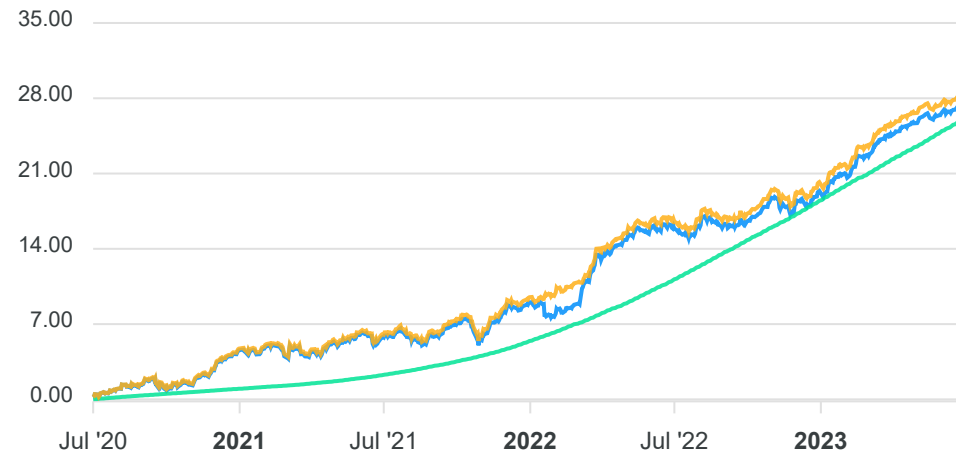
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B 5
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

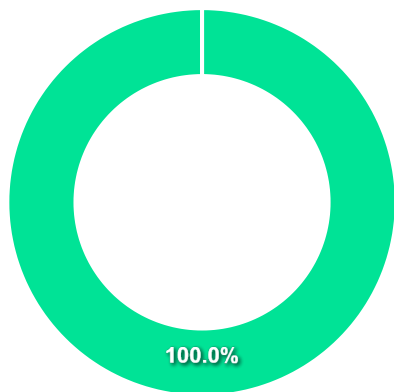
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,99%	2,56%	6,99%	10,05%	20,76%	0,90%	1,89%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	5.638.499,75	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,64	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,12	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-44,75	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-54,69	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.638.499,75	100.00%
Valores a pagar/receber	-93,39	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+2
Quantidade de Cotistas	237
Patrimônio Líquido Fundo	1.191.739.626,46

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B 5+
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

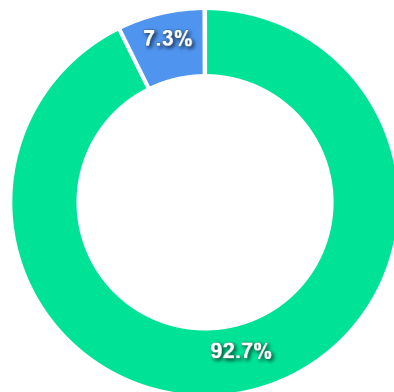
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,31%	14,66%	10,79%	14,66%	15,89%	13,02%	3,16%	6,66%
Benchmark	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	572
Patrimônio Líquido Fundo	6.493.608.770,37

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

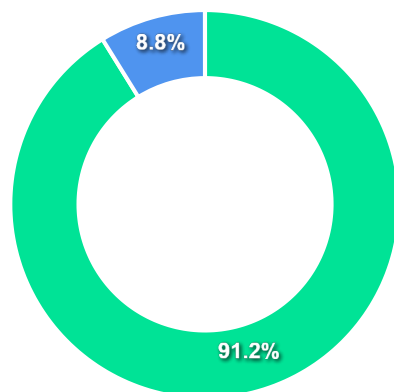
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	4,52%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.920.421,52	91.17%
Operação compromissada	572.459,19	8.82%
Derivativos	645,60	0.01%
Valores a pagar/receber	179,78	0.00%

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,10%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	1.136
Patrimônio Líquido Fundo	6.781.214.720,11

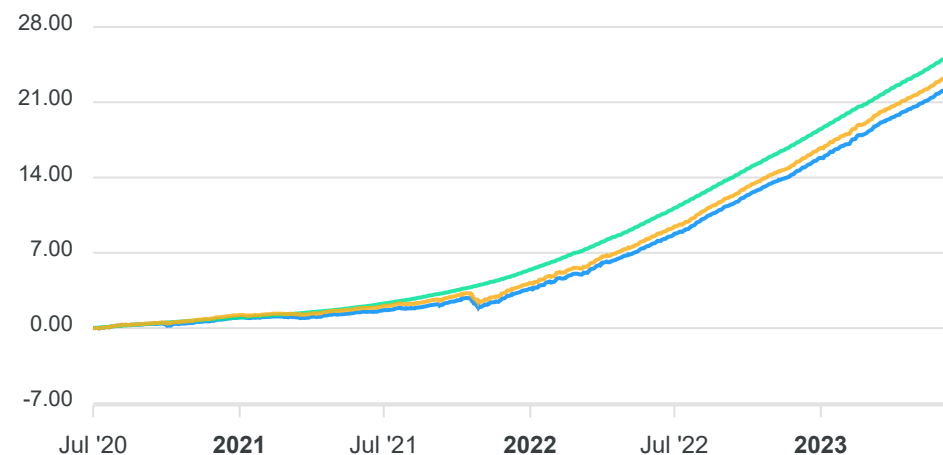
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IRF-M 1
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais.

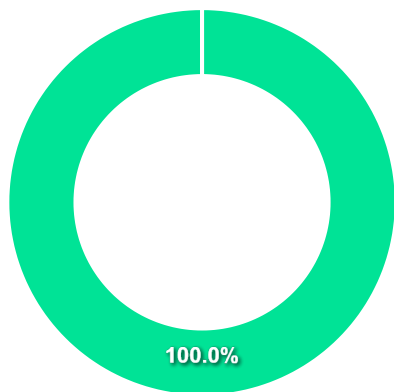
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	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
Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.781.242,31	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	26,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,78	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 / Ajuste de Cota Negativa	0,02	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.781.242,31	100.00%
Valores a pagar/receber	59,35	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 140
Patrimônio Líquido Fundo 188.237.769,14

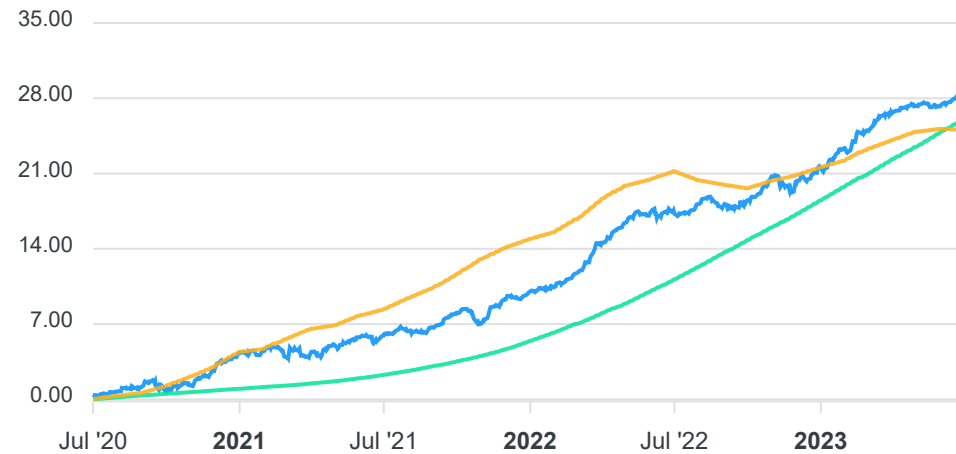
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IPCA
Classificação ANBIMA Não classificado
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

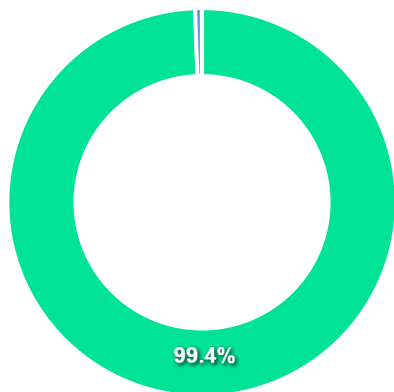
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,93%	5,54%	1,44%	5,54%	9,24%	21,24%	0,47%	0,99%
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	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	187.155,01	99,42	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.049,30	0,56	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	29,16	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	16,64	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	6,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,62	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-0,97	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	-1,20	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-1,56	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-2,26	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-5,48	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-8,45	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	187.155,01	99.42%
Operação compromissada	1.049,30	0.56%
Valores a pagar/receber	33,46	0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

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

PERFIL DO FUNDO

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

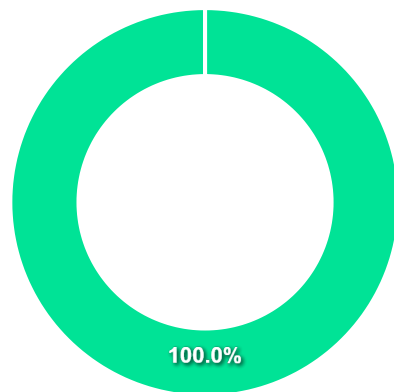
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,92%	2,49%	6,92%	10,00%	20,80%	0,89%	1,87%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.128.624,09	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	67,34	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-136,83	-0,01	Valores a pagar/receber

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance 20,00%
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 62
Patrimônio Líquido Fundo 369.070.369,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa.

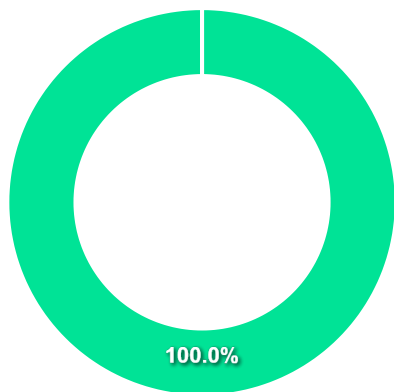
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,22%	7,05%	11,22%	13,24%	17,23%	2,16%	4,55%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	369.088,10	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	35,24	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-57,97	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	369.088,10	100.00%
Valores a pagar/receber	-17,73	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,40%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 19
Patrimônio Líquido Fundo 39.498.344,52

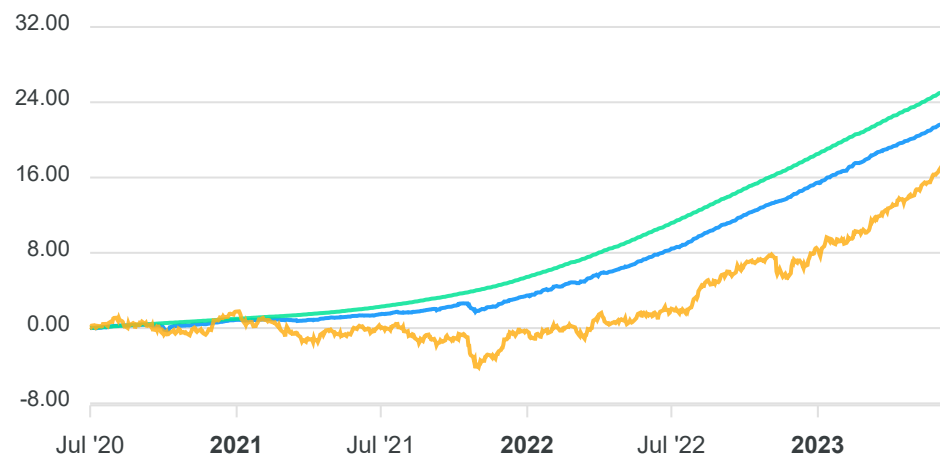
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IRF-M
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em renda fixa e fundos de investimento em índice de renda fixa que invistam apenas em títulos públicos e operações compromissadas lastradas nesses títulos.

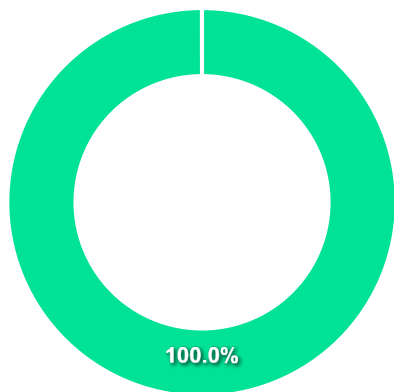
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,45%	3,12%	6,45%	13,38%	21,09%	0,11%	0,22%
Benchmark	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	39.492,70	99,99	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	17,72	0,04	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-17,07	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	39.492,70	99.99%
Valores a pagar/receber	5,65	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	679
Patrimônio Líquido Fundo	6.942.662.276,99

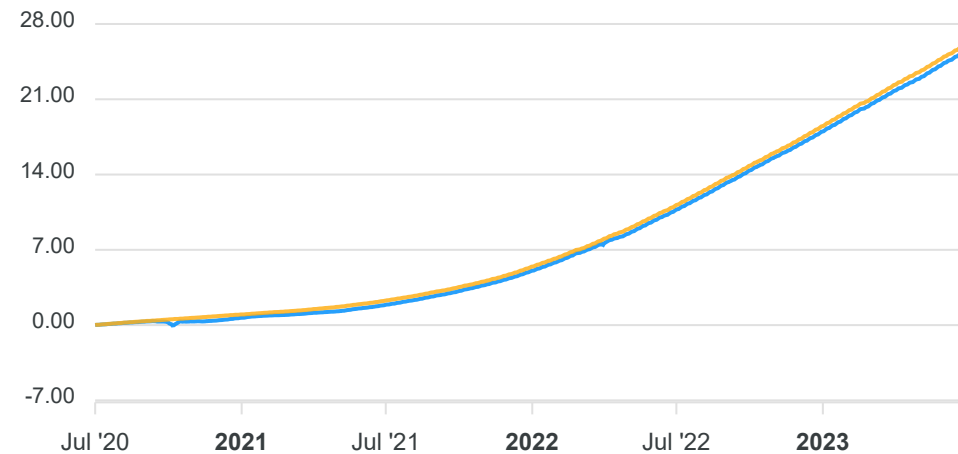
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark	CDI
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Baixa Soberano
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais investem em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas nestes títulos.

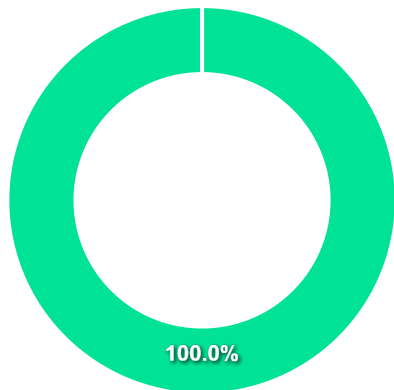
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,08%	6,45%	3,13%	6,45%	13,44%	23,27%	0,01%	0,01%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	6.943.772,95	98,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	49,31	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.164,98	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.943.772,95	100.02%
Valores a pagar/receber	-1.110,67	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	1.354
Patrimônio Líquido Fundo	810.368.157,20

PERFIL DO FUNDO

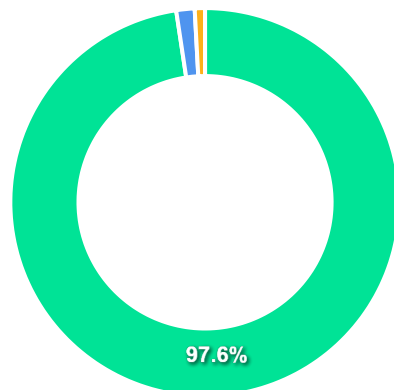
Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Sustentabilidade/Governança
Política de Investimento	Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,88%	6,51%	15,45%	6,51%	17,05%	-11,63%	7,60%	16,00%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	791.214,26	97.64%
Valores a pagar/receber	12.350,47	1.52%
Operação compromissada	6.886,00	0.85%
Derivativos	-72,47	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	73.845,36	9,11	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	48.520,74	5,99	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	48.190,63	5,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	44.142,16	5,45	Ações
B3 ON NM - B3SA3	32.352,19	3,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	28.576,55	3,53	Ações
ELETOBRAS ON N1 - ELET3	26.990,25	3,33	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	24.486,74	3,02	Ações
BRADERCO PN N1 - BBDC4	21.281,83	2,63	Ações
WEG ON NM - WEGE3	19.897,27	2,46	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	19.577,30	2,42	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	17.504,49	2,16	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	11.435,76	1,41	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	9.321,49	1,15	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	8.252,57	1,02	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	8.041,77	0,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	7.885,78	0,97	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	7.567,14	0,93	Ações
BRADERCO ON N1 - BBDC3	7.448,17	0,92	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	7.217,58	0,89	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7.203,26	0,89	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	6.974,99	0,86	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	6.886,00	0,85	Operação compromissada
JBS ON NM - JBSS3	6.577,22	0,81	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BPAC11	6.469,27	0,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	6.449,66	0,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RDOR3	6.443,66	0,80	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,75%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	33
Patrimônio Líquido Fundo	276.527.312,93

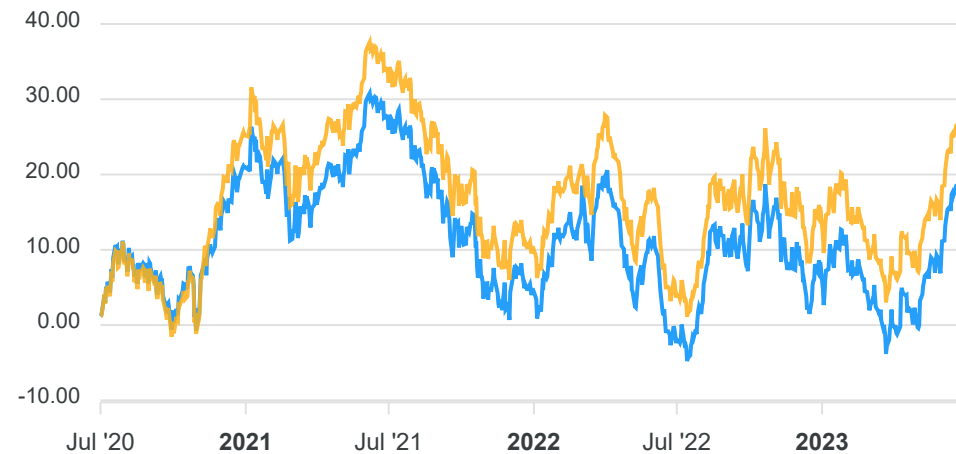
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Índice Ativo
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III.

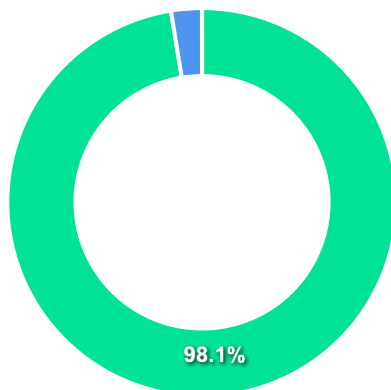
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	9,13%	7,87%	16,52%	7,87%	19,49%	-8,25%	7,46%	15,71%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	262.909,51	98.09%
Operação compromissada	6.877,20	2.57%
Fundos de Investimento	13,49	0.01%
Outros	6,83	0.00%
Derivativos	-112,74	-0.04%
Valores a pagar/receber	-1.675,81	-0.63%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	38.111,58	14,22	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	17.615,42	6,57	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	15.960,49	5,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	13.680,42	5,10	Ações
B3 ON NM - B3SA3	12.807,89	4,78	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	10.102,81	3,77	Ações
ELETRORBRAS ON N1 - ELET3	9.253,34	3,45	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	8.213,45	3,06	Ações
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2026	6.877,20	2,57	Operação compromissada
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	6.459,90	2,41	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	6.399,62	2,39	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	6.208,18	2,32	Ações
ASSAI ON NM - ASAI3	4.777,00	1,78	Ações
VIBRA ON NM - VBRR3	4.477,45	1,67	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.413,14	1,65	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	4.319,25	1,61	Ações
HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	4.073,67	1,52	Ações
JBS ON NM - JBSS3	3.964,15	1,48	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	3.895,63	1,45	Ações
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	3.882,54	1,45	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	3.633,78	1,36	Ações
WEG ON NM - WEGE3	3.511,63	1,31	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3.441,48	1,28	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	3.245,93	1,21	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	2.875,09	1,07	Ações
BEMOBI TECH ON NM - BMOB3	2.769,11	1,03	Ações
PETRORECSA ON NM - RECV3	2.709,99	1,01	Ações

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
10,00%

Disponibilidade de Resgate
D+2 du

Quantidade de Cotistas
22.263

Patrimônio Líquido Fundo
395.975.228,63

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
Global BDRX

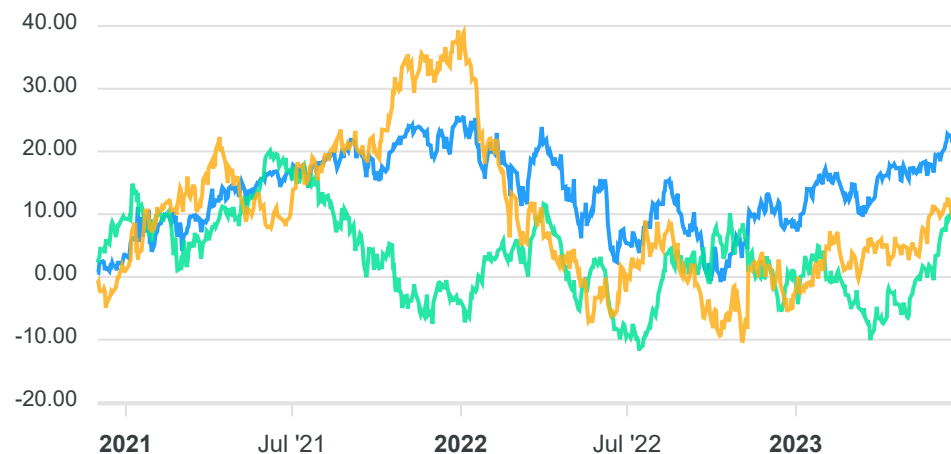
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP
AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I,
CNPJ: 39.272.928/0001-60.

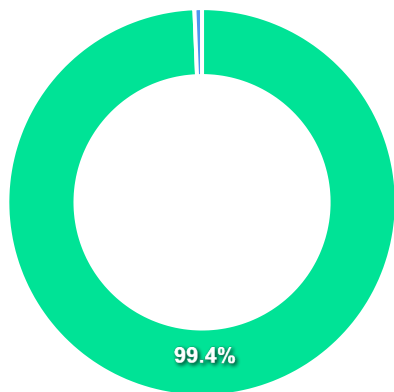
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,88%	12,69%	5,59%	12,69%	16,08%	5,21%	5,19%	10,93%
Benchmark	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BD...	382.376,18	96,57	Fundos de Investimento
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.112,55	2,81	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.538,05	0,64	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	688,52	0,17	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	22,05	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,74	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR a recolher	-2,44	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-2,90	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-3,32	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-46,32	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-703,85	-0,18	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	393.488,73	99.37%
Valores a pagar/receber	2.486,62	0.63%

Parecer do Comitê de Investimento

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

Aprovação do Conselho Fiscal

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

2023

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

Junho

Análise dos Investimentos

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

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	527.678,86	3,69%	6.483.473.627,64	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.258.184,83	8,80%	5.638.426.224,35	0,02%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.223.449,07	8,56%	1.191.739.626,46	0,10%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.152.616,02	15,06%	6.493.608.770,37	0,03%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	128.555,76	0,90%	6.781.214.720,11	0,00%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	4.630.079,44	32,39%	1.128.559.610,31	0,41%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	114.250,29	0,80%	369.070.369,54	0,03%	7º I b
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	2.083.994,11	14,58%	39.498.344,52	5,28%	7º I b
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	301.834,31	2,11%	6.942.662.276,99	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	292.522,24	2,05%	810.368.157,20	0,04%	8º I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	804.201,84	5,63%	276.527.312,93	0,29%	8º I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	775.321,55	5,42%	395.975.228,63	0,20%	9º III

Investimentos

\$ 14.292.688,32

Disponibilidades Financeiras

\$ 5.526,11

Total Carteira

\$ 14.298.214,43

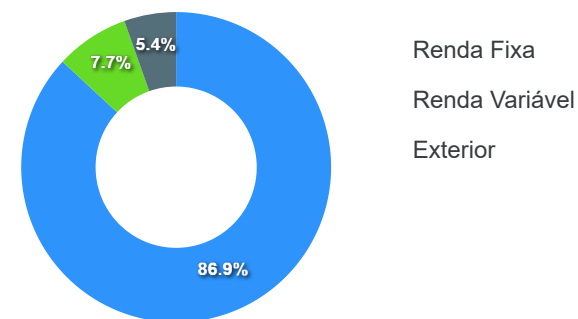
Governança (Pró Gestão)


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	84,76%	12.118.808,38 15,24%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	2,11%	301.834,31 57,89%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	7,67%	1.096.724,08 22,33%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	5,42%	775.321,55 4,58%

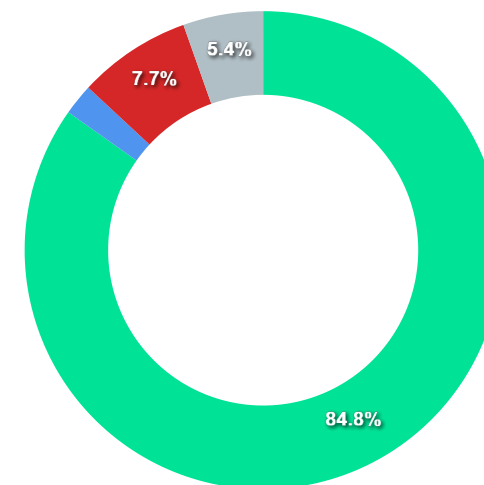
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



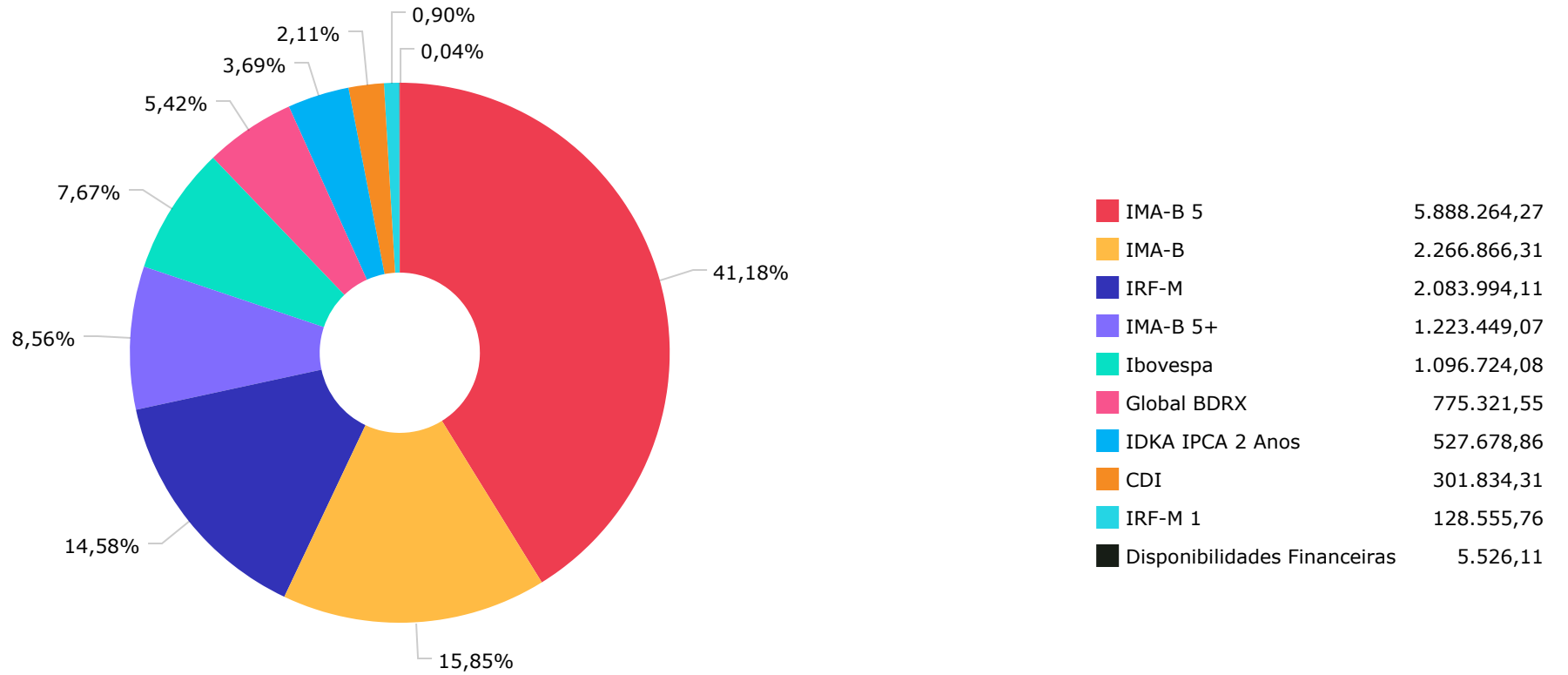
Artigos

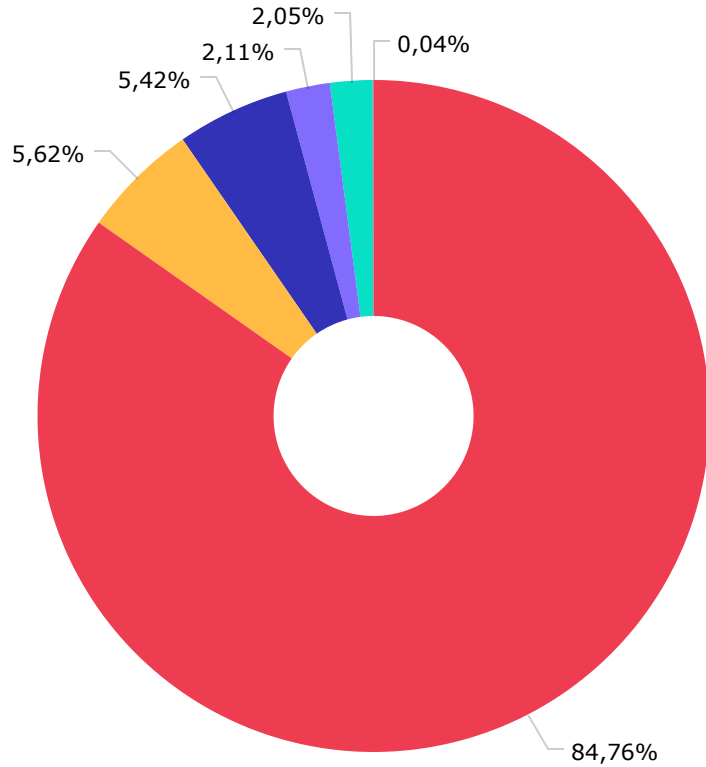


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	14.298.214,43	8° I - Fundos de Ações	7,67%	0,00%	10,00%	30,00%	3.192.740,25
7° I b - FI 100% Títulos TN	84,76%	0,00%	66,00%	100,00%	2.179.406,05	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	4.289.464,33
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	14.298.214,43	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.429.821,44
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	714.910,72	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.429.821,44
7° III a - FI Referenciados RF	2,11%	0,00%	10,00%	60,00%	8.277.094,35	9° III - Ações - BDR Nível I	5,42%	0,00%	7,00%	10,00%	654.499,89
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	8.578.928,66	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	1.429.821,44
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	2.859.642,89	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	714.910,72
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	714.910,72	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	714.910,72
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	714.910,72	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	714.910,72
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	714.910,72	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	714.910,72

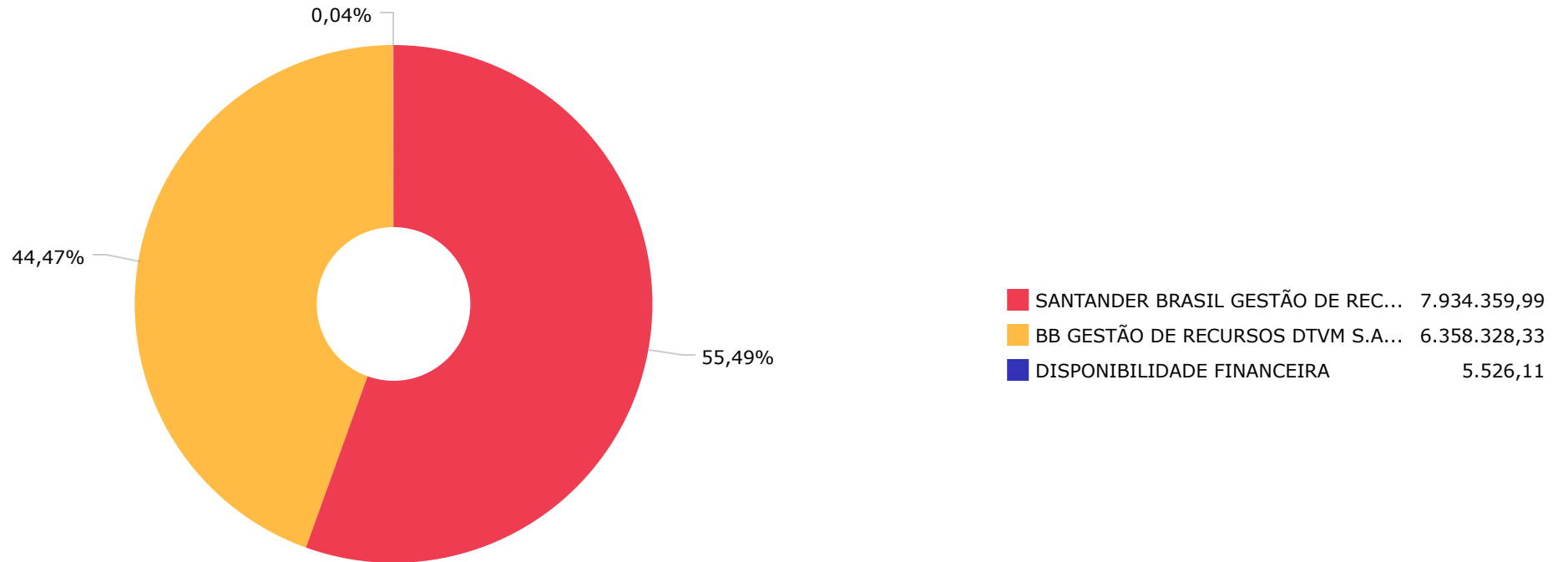
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08	6,45	3,13	6,45	13,44	23,27	0,01	0,01
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,48	15,14	5,90	15,14	14,44	0,60		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,88	12,69	5,59	12,69	16,08	5,21	5,19	10,93
IBOVESPA - BENCHMARK	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9,13	7,87	16,52	7,87	19,49	-8,25	7,46	15,71
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	7,60	16,00
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02	6,56	2,10	6,56	9,43	20,20	0,78	1,64
IMA-B - BENCHMARK	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37	11,28	7,11	11,28	13,29	17,23	2,15	4,52
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,37	11,22	7,05	11,22	13,24	17,23	2,16	4,55
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	6,99	2,56	6,99	10,05	20,76	0,90	1,89
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03	6,92	2,49	6,92	10,00	20,80	0,89	1,87
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,31	14,66	10,79	14,66	15,89	13,02	3,16	6,66
IPCA - BENCHMARK	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93	5,54	1,44	5,54	9,24	21,24	0,47	0,99

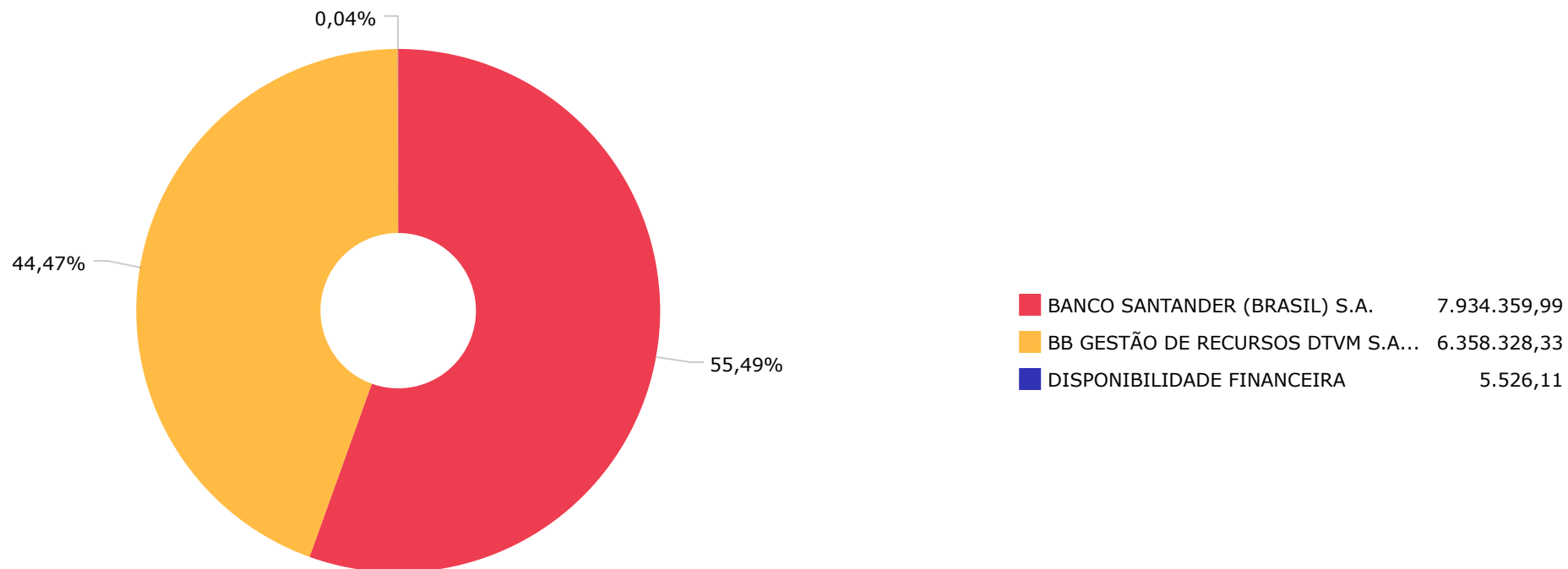
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M - BENCHMARK	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79		
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	1,16	6,45	3,12	6,45	13,38	21,09	0,11	0,22
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00		
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16	6,49	3,14	6,49	13,48	21,33	0,10	0,22





Renda Fixa Indexados	12.118.808,38
Ações Índice Ativo	804.201,84
Ações Livre	775.321,55
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	301.834,31
Ações Sustentabilidade/Governança	292.522,24
Disponibilidades Financeiras	5.526,11





Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	11.650.169,89	596.468,16	0,00	12.411.822,64	165.184,59	165.184,59	1,35% ▲	1,35%	0,94%	0,94%	143,62%	2,68%
Fevereiro	12.411.822,64	208.845,63	0,00	12.653.404,08	32.735,81	197.920,40	0,26% ▲	1,61%	1,18%	2,13%	75,59%	2,34%
Março	12.653.404,08	296.699,87	87.122,16	13.055.017,83	192.036,04	389.956,44	1,49% ▲	3,13%	1,14%	3,30%	94,85%	1,99%
Abril	13.055.017,83	117.831,69	0,00	13.349.916,79	177.067,27	567.023,71	1,34% ▲	4,51%	0,95%	4,28%	105,37%	1,84%
Mai	13.349.916,79	215.250,50	0,00	13.763.131,90	197.964,61	764.988,32	1,46% ▲	6,04%	0,64%	4,95%	122,02%	1,69%
Junho	13.763.131,90	217.342,27	0,00	14.292.688,32	312.214,15	1.077.202,47	2,23% ▲	8,41%	0,31%	5,28%	159,28%	1,88%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	389.956,44	3,13%	3,30%
2º Trim	687.246,03	5,12%	1,92%
1º Sem	1.077.202,47	8,41%	5,28%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

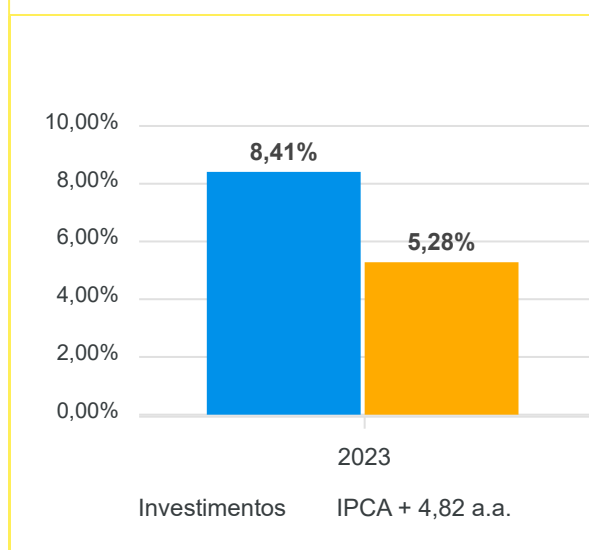


Gráfico Risco x Retorno

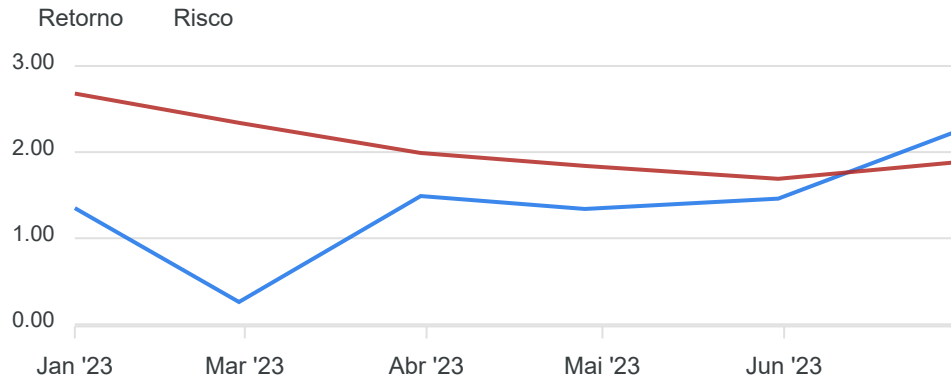
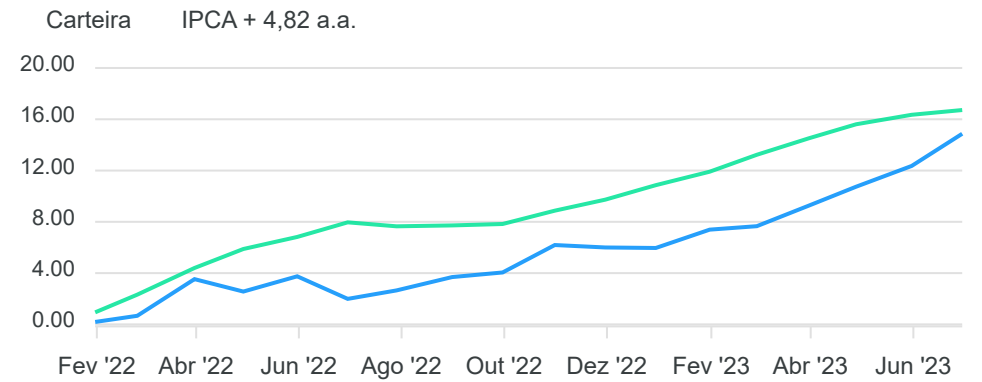
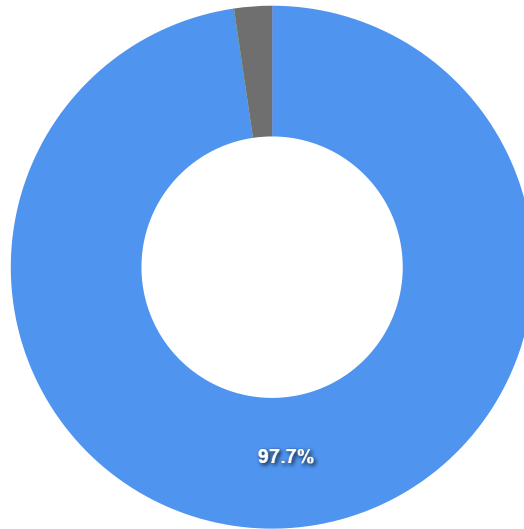


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/06/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	17.823.937,13	124,71
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	425.954,28	2,98
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	522.353,46	0,00	0,00	527.678,86	5.325,40	1,02% ▲	0,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.245.346,38	0,00	0,00	1.258.184,83	12.838,45	1,03% ▲	0,90%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.184.286,96	0,00	0,00	1.223.449,07	39.162,11	3,31% ▲	3,16%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.102.737,85	0,00	0,00	2.152.616,02	49.878,17	2,37% ▲	2,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	127.083,40	0,00	0,00	128.555,76	1.472,36	1,16% ▲	0,10%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	4.366.146,92	217.342,27	0,00	4.630.079,44	46.590,25	1,02% ▲	0,89%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	111.600,55	0,00	0,00	114.250,29	2.649,74	2,37% ▲	2,16%
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	2.060.132,10	0,00	0,00	2.083.994,11	23.862,01	1,16% ▲	0,11%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	298.617,61	0,00	0,00	301.834,31	3.216,70	1,08% ▲	0,01%
	12.018.305,23	217.342,27	0,00	12.420.642,69	184.995,19	1,51%	1,18%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	268.671,19	0,00	0,00	292.522,24	23.851,05	8,88% ▲	7,60%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	736.911,80	0,00	0,00	804.201,84	67.290,04	9,13% ▲	7,46%
-	1.005.582,99	0,00	0,00	1.096.724,08	91.141,09	9,06%	7,50%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	739.243,68	0,00	0,00	775.321,55	36.077,87	4,88% ▲	5,19%
	739.243,68	0,00	0,00	775.321,55	36.077,87	4,88%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	516.829,68	0,00	0,00	527.678,86	10.849,18	2,10% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.226.816,66	0,00	0,00	1.258.184,83	31.368,17	2,56% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.104.323,83	0,00	0,00	1.223.449,07	119.125,24	10,79% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.009.692,01	0,00	0,00	2.152.616,02	142.924,01	7,11% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	124.641,27	0,00	0,00	128.555,76	3.914,49	3,14% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	3.974.524,95	550.424,46	0,00	4.630.079,44	105.130,03	2,32% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	106.728,57	0,00	0,00	114.250,29	7.521,72	7,05% ▲
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	2.020.965,00	0,00	0,00	2.083.994,11	63.029,11	3,12% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	292.678,90	0,00	0,00	301.834,31	9.155,41	3,13% ▲
	11.377.200,87	550.424,46	0,00	12.420.642,69	493.017,36	4,13%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	253.382,22	0,00	0,00	292.522,24	39.140,02	15,45% ▲
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	690.168,59	0,00	0,00	804.201,84	114.033,25	16,52% ▲
	943.550,81	0,00	0,00	1.096.724,08	153.173,27	16,23%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	734.266,15	0,00	0,00	775.321,55	41.055,40	5,59% ▲
	734.266,15	0,00	0,00	775.321,55	41.055,40	5,59%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	495.184,22	0,00	0,00	527.678,86	32.494,64	6,56% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.175.988,49	0,00	0,00	1.258.184,83	82.196,34	6,99% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.066.989,38	0,00	0,00	1.223.449,07	156.459,69	14,66% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.934.417,03	0,00	0,00	2.152.616,02	218.198,99	11,28% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	120.717,42	0,00	0,00	128.555,76	7.838,34	6,49% ▲
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA	85.456,51	0,00	87.122,16	0,00	1.665,65	1,95% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	3.202.056,51	1.159.493,47	0,00	4.630.079,44	268.529,46	6,16% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	102.724,39	0,00	0,00	114.250,29	11.525,90	11,22% ▲
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	1.758.448,63	202.347,47	0,00	2.083.994,11	123.198,01	6,28% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	290.597,18	0,00	301.834,31	11.237,13	3,87% ▲
	9.941.982,58	1.652.438,12	87.122,16	12.420.642,69	913.344,15	7,94%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	274.638,56	0,00	0,00	292.522,24	17.883,68	6,51% ▲
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	745.513,85	0,00	0,00	804.201,84	58.687,99	7,87% ▲
	1.020.152,41	0,00	0,00	1.096.724,08	76.571,67	7,51%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	688.034,90	0,00	0,00	775.321,55	87.286,65	12,69% ▲
	688.034,90	0,00	0,00	775.321,55	87.286,65	12,69%

Cenário Econômico

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

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

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

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

Retorno dos Fundos de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 07 de julho de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	942
Patrimônio Líquido Fundo	6.483.473.627,64

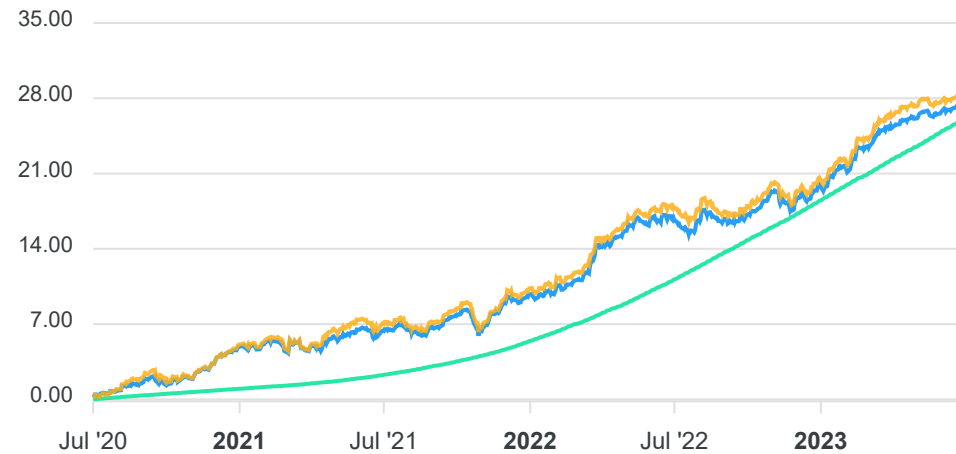
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IDKA IPCA 2 Anos
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

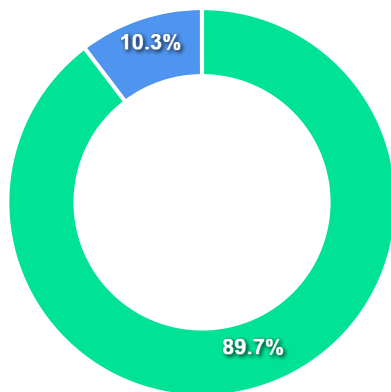
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	1,64%
Benchmark	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 783
Patrimônio Líquido Fundo 5.638.426.224,35

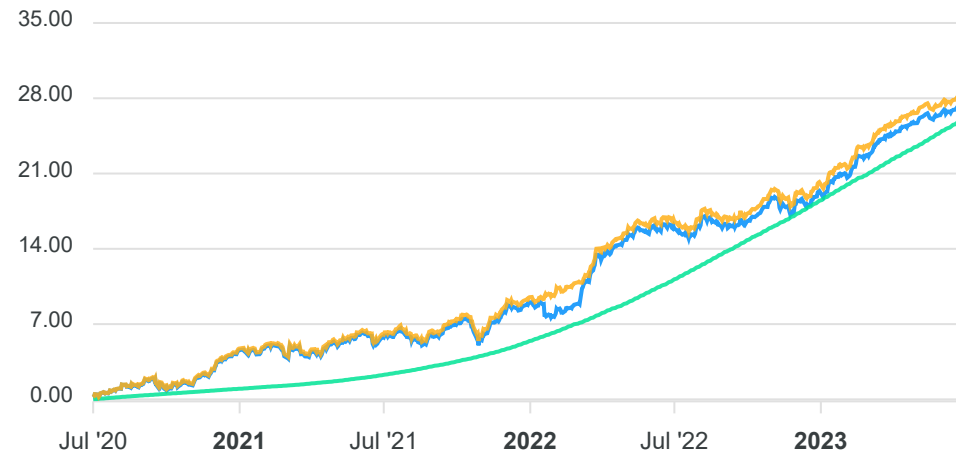
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B 5
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

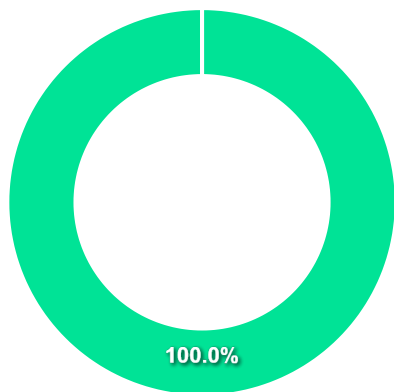
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,99%	2,56%	6,99%	10,05%	20,76%	0,90%	1,89%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	5.638.499,75	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,64	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,12	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-44,75	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-54,69	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.638.499,75	100.00%
Valores a pagar/receber	-93,39	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+2
Quantidade de Cotistas	237
Patrimônio Líquido Fundo	1.191.739.626,46

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B 5+
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

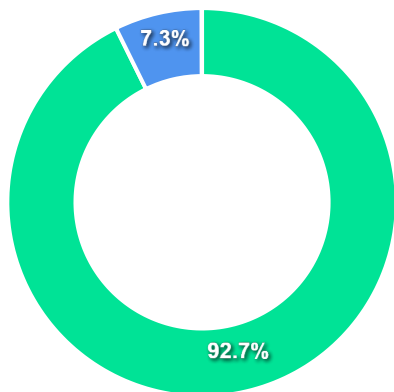
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,31%	14,66%	10,79%	14,66%	15,89%	13,02%	3,16%	6,66%
Benchmark	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	572
Patrimônio Líquido Fundo	6.493.608.770,37

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

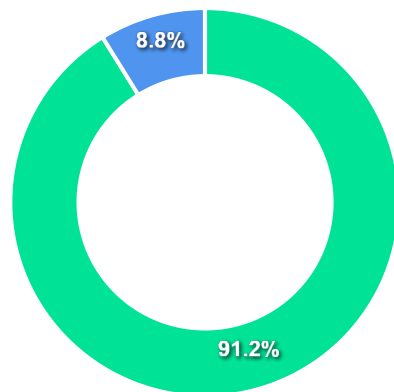
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	4,52%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.920.421,52	91.17%
Operação compromissada	572.459,19	8.82%
Derivativos	645,60	0.01%
Valores a pagar/receber	179,78	0.00%

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,10%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	1.136
Patrimônio Líquido Fundo	6.781.214.720,11

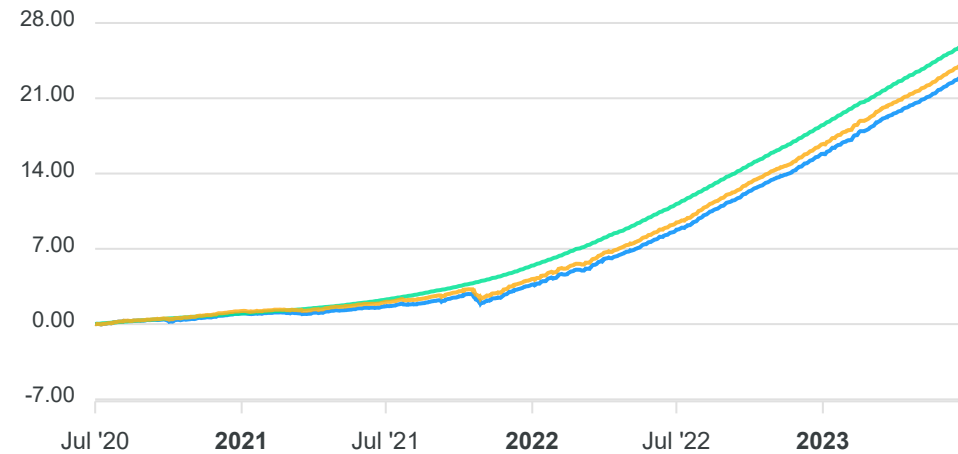
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IRF-M 1
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais.

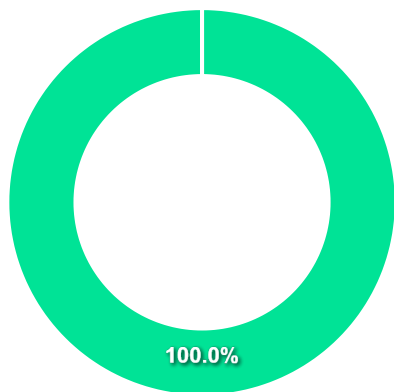
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	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
Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.781.242,31	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	26,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,78	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 / Ajuste de Cota Negativa	0,02	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.781.242,31	100.00%
Valores a pagar/receber	59,35	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 140
Patrimônio Líquido Fundo 188.237.769,14

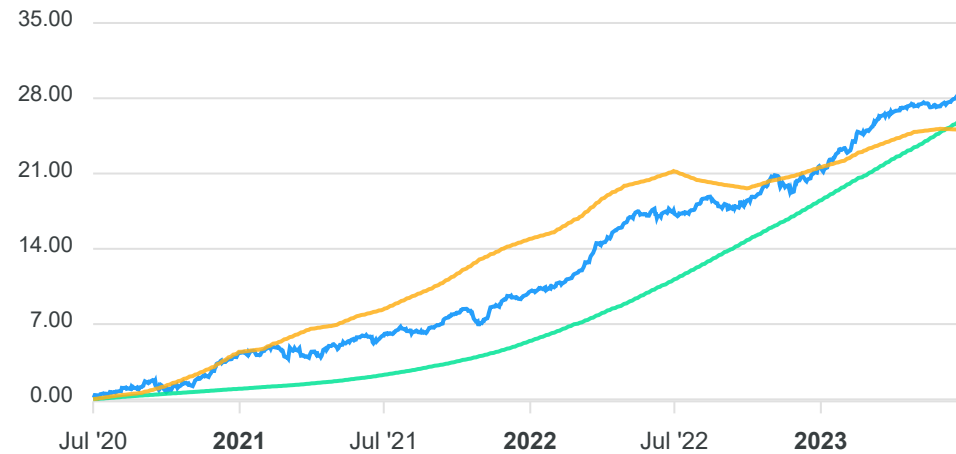
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IPCA
Classificação ANBIMA Não classificado
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

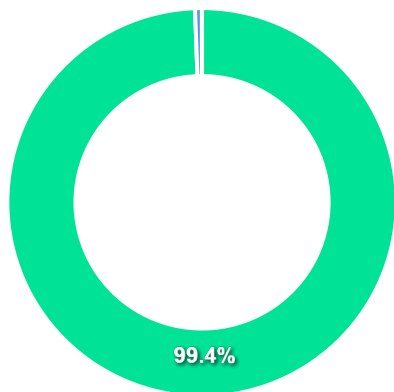
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,93%	5,54%	1,44%	5,54%	9,24%	21,24%	0,47%	0,99%
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	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	187.155,01	99,42	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.049,30	0,56	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	29,16	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	16,64	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	6,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,62	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-0,97	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	-1,20	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-1,56	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-2,26	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-5,48	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-8,45	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	187.155,01	99.42%
Operação compromissada	1.049,30	0.56%
Valores a pagar/receber	33,46	0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

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

PERFIL DO FUNDO

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

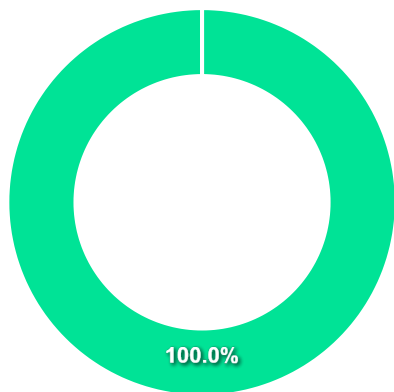
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,92%	2,49%	6,92%	10,00%	20,80%	0,89%	1,87%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.128.624,09	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	67,34	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-136,83	-0,01	Valores a pagar/receber

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance 20,00%
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 62
Patrimônio Líquido Fundo 369.070.369,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa.

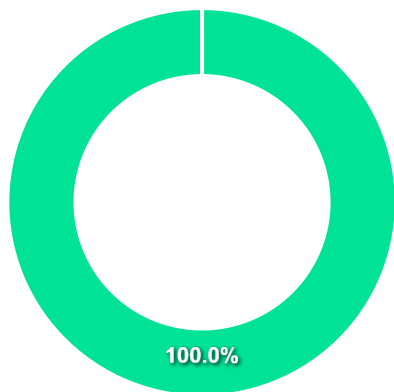
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,22%	7,05%	11,22%	13,24%	17,23%	2,16%	4,55%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	369.088,10	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	35,24	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-57,97	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	369.088,10	100.00%
Valores a pagar/receber	-17,73	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,40%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 19
Patrimônio Líquido Fundo 39.498.344,52

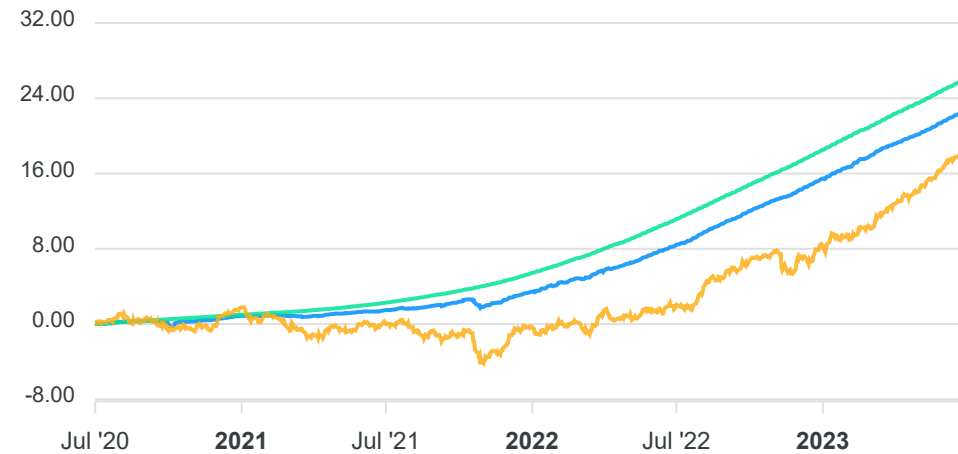
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IRF-M
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em renda fixa e fundos de investimento em índice de renda fixa que invistam apenas em títulos públicos e operações compromissadas lastradas nesses títulos.

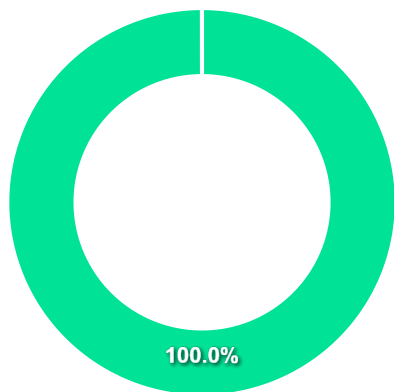
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,45%	3,12%	6,45%	13,38%	21,09%	0,11%	0,22%
Benchmark	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	39.492,70	99,99	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	17,72	0,04	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-17,07	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	39.492,70	99.99%
Valores a pagar/receber	5,65	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 679
Patrimônio Líquido Fundo 6.942.662.276,99

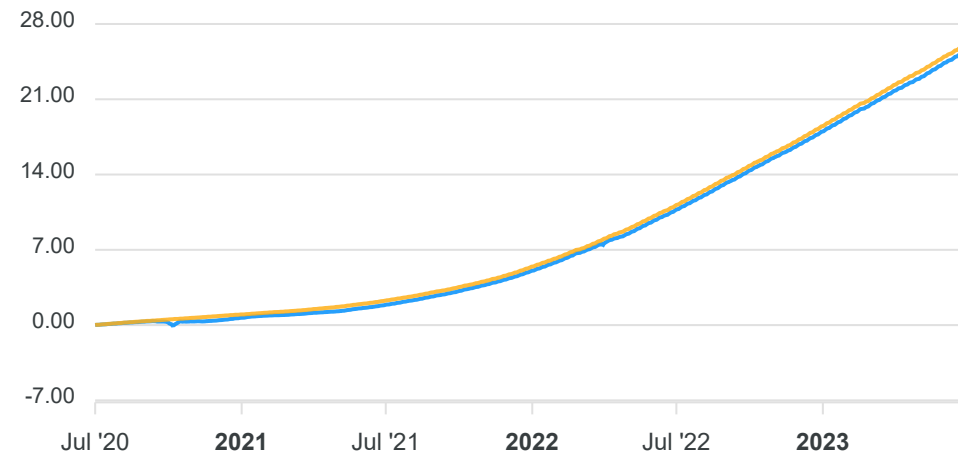
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark CDI
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Baixa Soberano
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais investem em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas nestes títulos.

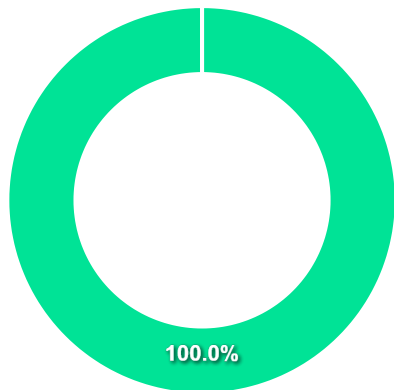
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,08%	6,45%	3,13%	6,45%	13,44%	23,27%	0,01%	0,01%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	6.943.772,95	98,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	49,31	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.164,98	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.943.772,95	100.02%
Valores a pagar/receber	-1.110,67	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	1.354
Patrimônio Líquido Fundo	810.368.157,20

PERFIL DO FUNDO

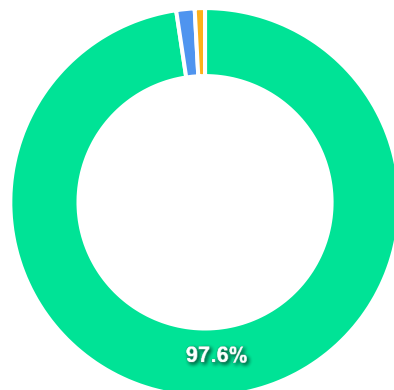
Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Sustentabilidade/Governança
Política de Investimento	Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,88%	6,51%	15,45%	6,51%	17,05%	-11,63%	7,60%	16,00%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	791.214,26	97.64%
Valores a pagar/receber	12.350,47	1.52%
Operação compromissada	6.886,00	0.85%
Derivativos	-72,47	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	73.845,36	9,11	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	48.520,74	5,99	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	48.190,63	5,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	44.142,16	5,45	Ações
B3 ON NM - B3SA3	32.352,19	3,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	28.576,55	3,53	Ações
ELETOBRAS ON N1 - ELET3	26.990,25	3,33	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	24.486,74	3,02	Ações
BRADERCO PN N1 - BBDC4	21.281,83	2,63	Ações
WEG ON NM - WEGE3	19.897,27	2,46	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	19.577,30	2,42	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	17.504,49	2,16	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	11.435,76	1,41	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	9.321,49	1,15	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	8.252,57	1,02	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	8.041,77	0,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	7.885,78	0,97	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	7.567,14	0,93	Ações
BRADERCO ON N1 - BBDC3	7.448,17	0,92	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	7.217,58	0,89	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7.203,26	0,89	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	6.974,99	0,86	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	6.886,00	0,85	Operação compromissada
JBS ON NM - JBSS3	6.577,22	0,81	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BPAC11	6.469,27	0,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	6.449,66	0,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RDOR3	6.443,66	0,80	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,75%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	33
Patrimônio Líquido Fundo	276.527.312,93

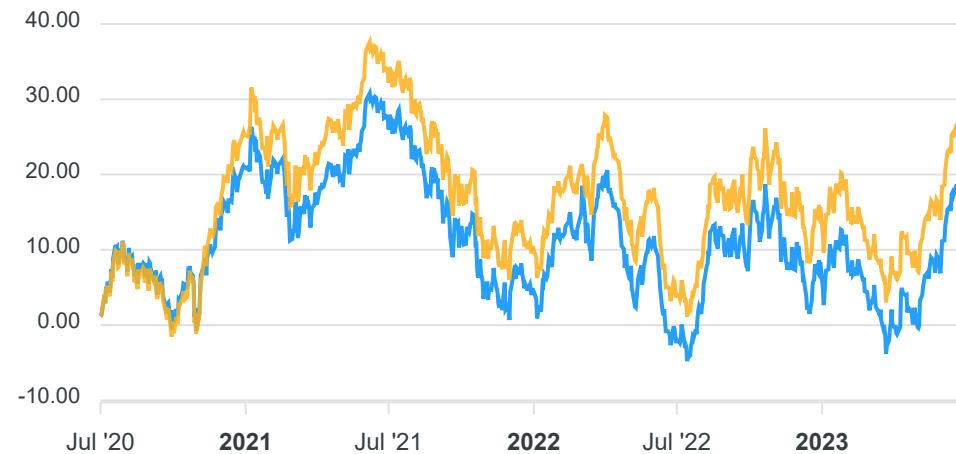
PERFIL DO FUNDO

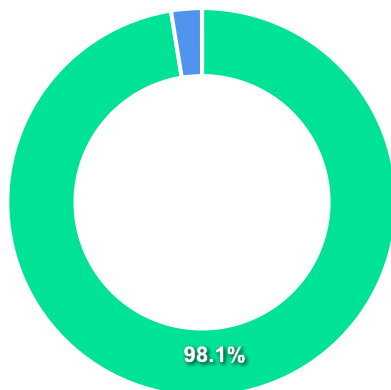
Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Índice Ativo
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III.

COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	9,13%	7,87%	16,52%	7,87%	19,49%	-8,25%	7,46%	15,71%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	262.909,51	98.09%
Operação compromissada	6.877,20	2.57%
Fundos de Investimento	13,49	0.01%
Outros	6,83	0.00%
Derivativos	-112,74	-0.04%
Valores a pagar/receber	-1.675,81	-0.63%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	38.111,58	14,22	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	17.615,42	6,57	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	15.960,49	5,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	13.680,42	5,10	Ações
B3 ON NM - B3SA3	12.807,89	4,78	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	10.102,81	3,77	Ações
ELETRORBRAS ON N1 - ELET3	9.253,34	3,45	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	8.213,45	3,06	Ações
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2026	6.877,20	2,57	Operação compromissada
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	6.459,90	2,41	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	6.399,62	2,39	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	6.208,18	2,32	Ações
ASSAI ON NM - ASAI3	4.777,00	1,78	Ações
VIBRA ON NM - VBRR3	4.477,45	1,67	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.413,14	1,65	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	4.319,25	1,61	Ações
HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	4.073,67	1,52	Ações
JBS ON NM - JBSS3	3.964,15	1,48	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	3.895,63	1,45	Ações
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	3.882,54	1,45	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	3.633,78	1,36	Ações
WEG ON NM - WEGE3	3.511,63	1,31	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3.441,48	1,28	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	3.245,93	1,21	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	2.875,09	1,07	Ações
BEMOBI TECH ON NM - BMOB3	2.769,11	1,03	Ações
PETRORECSA ON NM - RECV3	2.709,99	1,01	Ações

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	10,00%
Disponibilidade de Resgate	D+2 du
Quantidade de Cotistas	22.263
Patrimônio Líquido Fundo	395.975.228,63

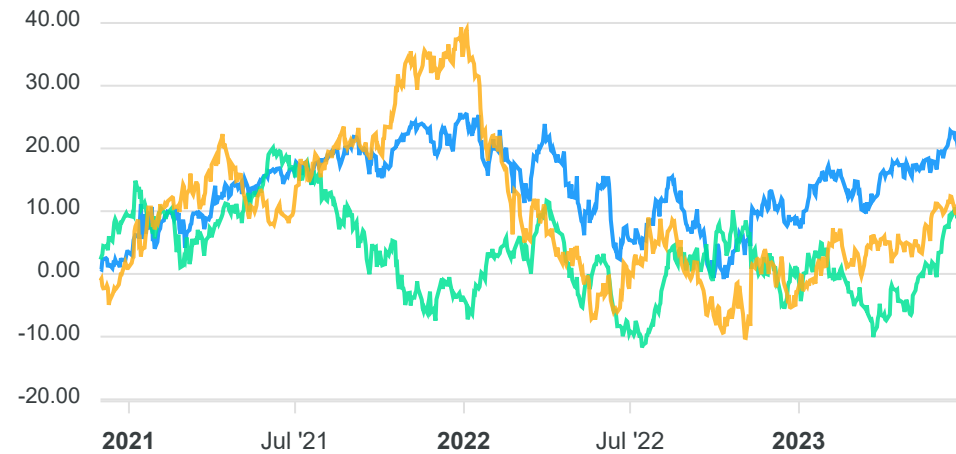
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 9º, Inciso III
Benchmark	Global BDRX
Classificação ANBIMA	Ações Livre
Política de Investimento	Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I, CNPJ: 39.272.928/0001-60.

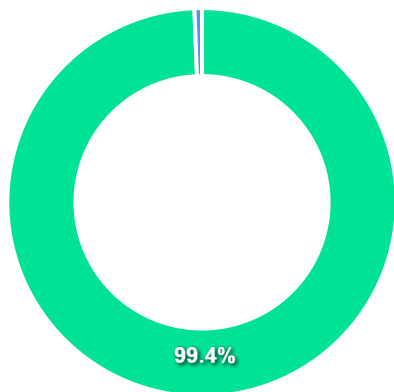
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,88%	12,69%	5,59%	12,69%	16,08%	5,21%	5,19%	10,93%
Benchmark	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BD...	382.376,18	96,57	Fundos de Investimento
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.112,55	2,81	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.538,05	0,64	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	688,52	0,17	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	22,05	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,74	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR a recolher	-2,44	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-2,90	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-3,32	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-46,32	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-703,85	-0,18	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	393.488,73	99.37%
Valores a pagar/receber	2.486,62	0.63%

Parecer do Comitê de Investimento

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

Aprovação do Conselho Fiscal

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

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
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	818.360,26	35,96%	1.128.559.610,31	0,07%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	938.027,49	41,22%	369.070.369,54	0,25%	7º I b
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	519.413,26	22,82% ▲	6.942.662.276,99	0,01%	7º III a

Investimentos

\$ 2.275.801,01

Disponibilidades Financeiras

\$ 3.304,88

Total Carteira

\$ 2.279.105,89

Governança (Pró Gestão)

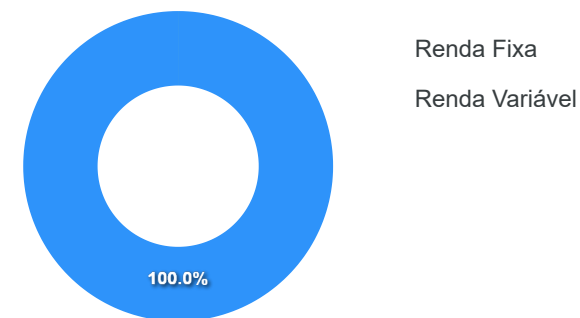


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	77,06%	1.756.387,75 22,94% 522.718,14
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	22,79%	519.413,26 37,21% 848.050,27

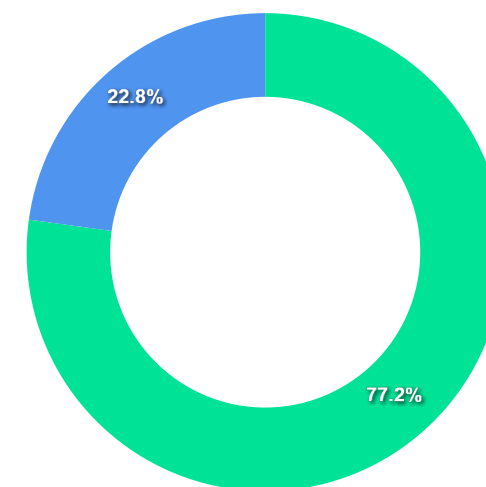
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



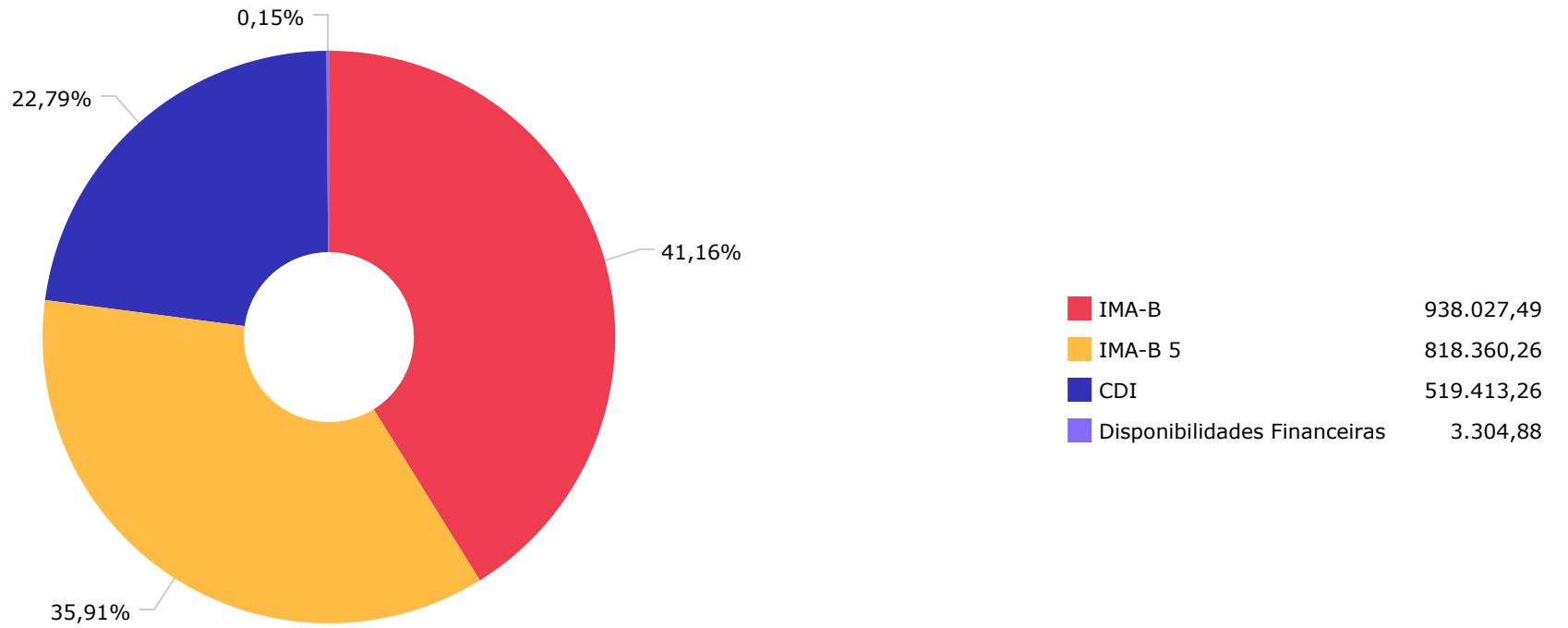
Artigos

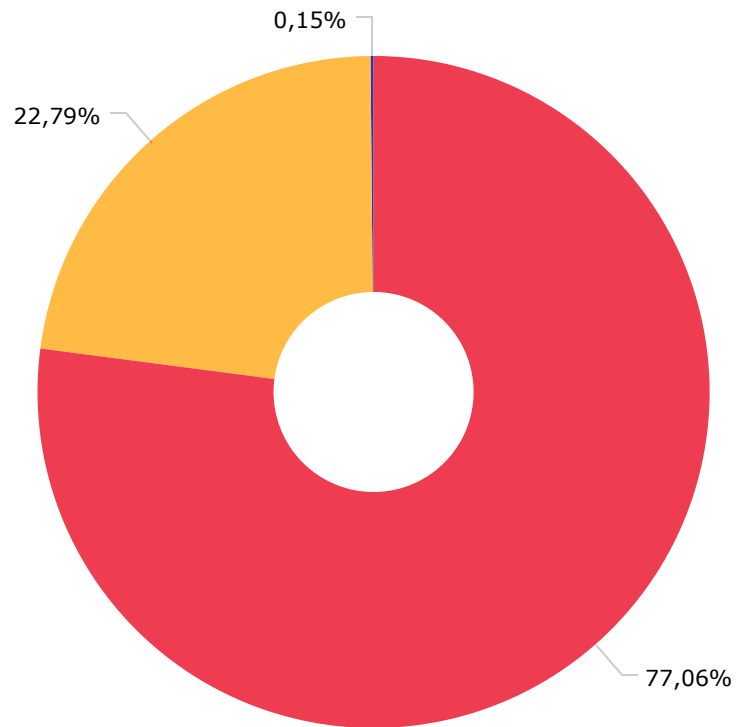


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	2.279.105,89	8º I - Fundos de Ações	0,00%	0,00%	10,00%	30,00%	683.731,77
7º I b - FI 100% Títulos TN	77,06%	0,00%	66,00%	100,00%	522.718,14	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	683.731,77
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.279.105,89	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	227.910,59
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.955,29	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	227.910,59
7º III a - FI Referenciados RF	22,79%	0,00%	10,00%	60,00%	848.050,27	9º III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	7,00%	10,00%	227.910,59
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.367.463,53	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	227.910,59
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	455.821,18	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.955,29
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	113.955,29	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.955,29
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	113.955,29	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	113.955,29
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	113.955,29	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.955,29

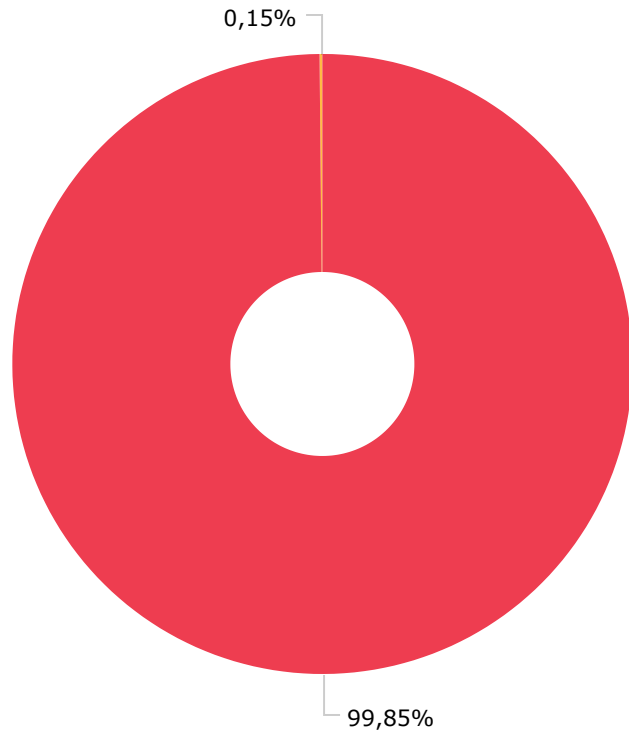
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37		
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08	6,45	3,13	6,45	13,44	23,27	0,01	0,01
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,48	15,14	5,90	15,14	14,44	0,60		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,88	12,69	5,59	12,69	16,08	5,21	5,19	10,93
IBOVESPA - BENCHMARK	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9,13	7,87	16,52	7,87	19,49	-8,25	7,46	15,71
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	7,60	16,00
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02	6,56	2,10	6,56	9,43	20,20	0,78	1,64
IMA-B - BENCHMARK	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37	11,28	7,11	11,28	13,29	17,23	2,15	4,52
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,37	11,22	7,05	11,22	13,24	17,23	2,16	4,55
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	6,99	2,56	6,99	10,05	20,76	0,90	1,89
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03	6,92	2,49	6,92	10,00	20,80	0,89	1,87
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,31	14,66	10,79	14,66	15,89	13,02	3,16	6,66
IPCA - BENCHMARK	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93	5,54	1,44	5,54	9,24	21,24	0,47	0,99

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M - BENCHMARK	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79		
SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA	1,16	6,45	3,12	6,45	13,38	21,09	0,11	0,22
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00		
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16	6,49	3,14	6,49	13,48	21,33	0,10	0,22

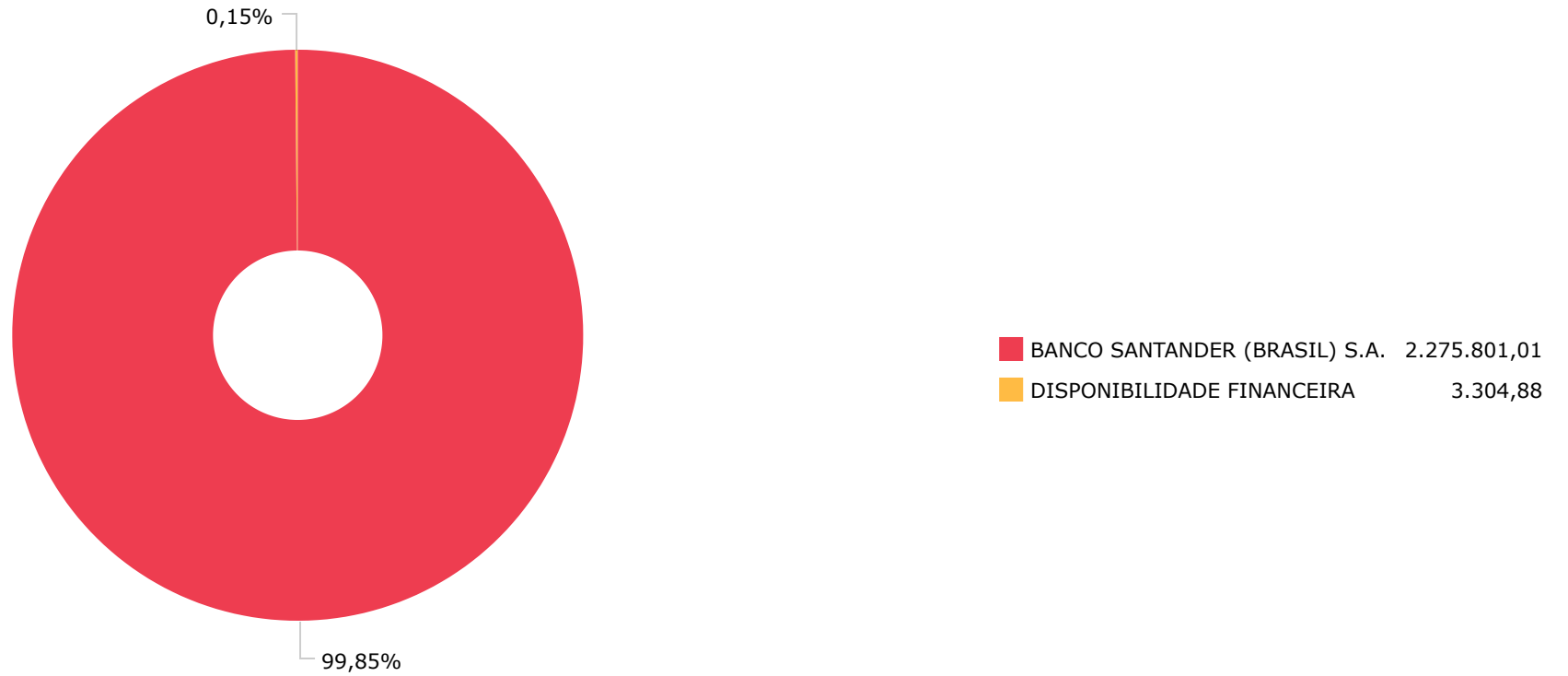




Renda Fixa Indexados	1.756.387,75
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	519.413,26
Disponibilidades Financeiras	3.304,88



■ SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC... 2.275.801,01
■ DISPONIBILIDADE FINANCEIRA 3.304,88



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	2.030.639,09	0,00	0,00	2.043.840,99	13.201,90	13.201,90	0,65% ▲	0,65%	0,94%	0,94%	69,15%	1,69%
Fevereiro	2.043.840,99	0,00	0,00	2.068.139,80	24.298,81	37.500,71	1,19% ▲	1,85%	1,18%	2,13%	86,85%	1,47%
Março	2.068.139,80	500.000,00	487.813,03	2.119.277,01	38.950,24	76.450,95	1,87% ▲	3,75%	1,14%	3,30%	113,64%	0,98%
Abril	2.119.277,01	0,00	0,00	2.147.860,26	28.583,25	105.034,20	1,35% ▲	5,15%	0,95%	4,28%	120,33%	0,91%
Mai	2.147.860,26	60.000,00	0,00	2.240.177,24	32.316,98	137.351,18	1,46% ▲	6,69%	0,64%	4,95%	135,15%	0,86%
Junho	2.240.177,24	0,00	0,00	2.275.801,01	35.623,77	172.974,95	1,59% ▲	8,39%	0,31%	5,28%	158,90%	1,21%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	76.450,95	3,75%	3,30%
2º Trim	96.524,00	4,47%	1,92%
1º Sem	172.974,95	8,39%	5,28%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

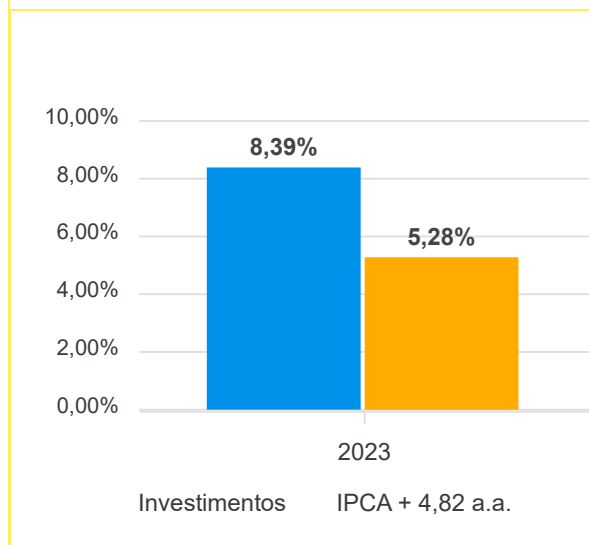


Gráfico Risco x Retorno

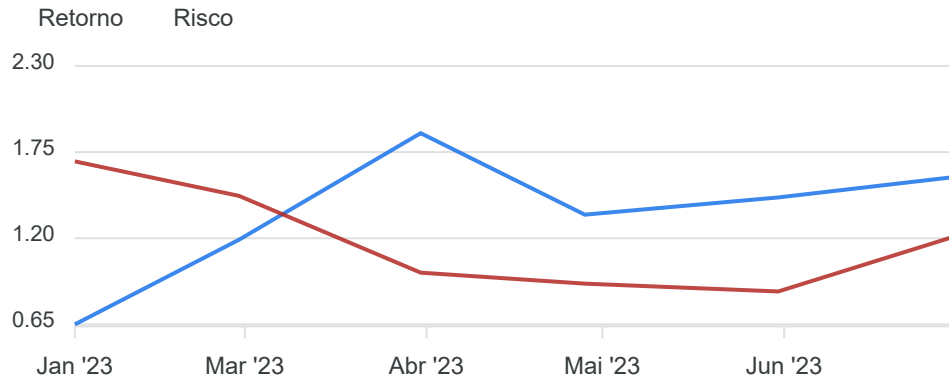
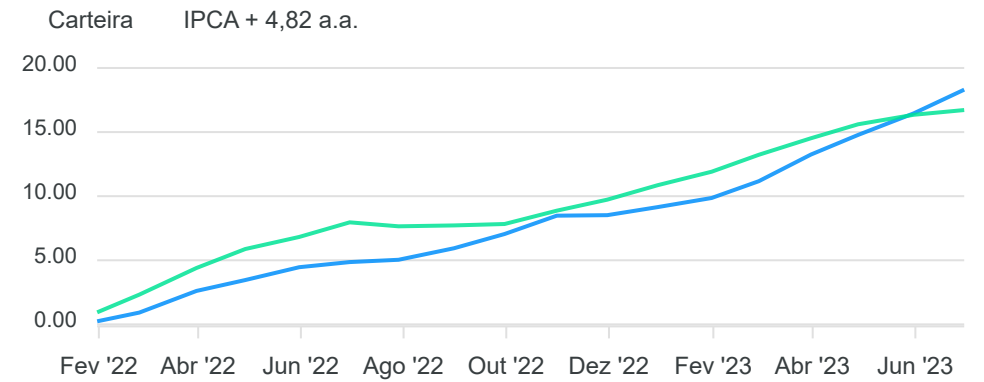
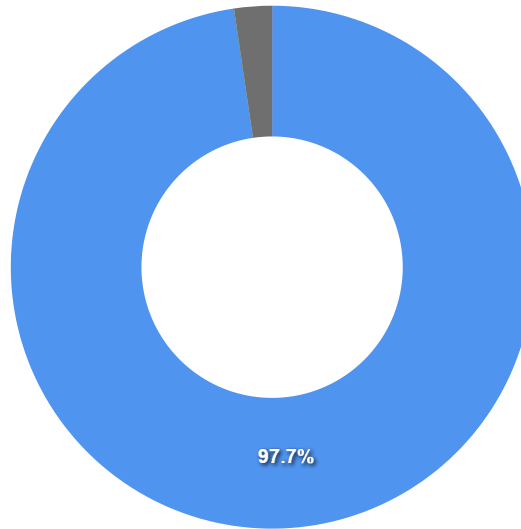


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/06/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	17.823.937,13	783,19
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	425.954,28	18,72
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	810.027,03	0,00	0,00	818.360,26	8.333,23	1,03% ▲	0,89%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	916.272,43	0,00	0,00	938.027,49	21.755,06	2,37% ▲	2,16%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	513.877,78	0,00	0,00	519.413,26	5.535,48	1,08% ▲	0,01%
	2.240.177,24	0,00	0,00	2.275.801,01	35.623,77	1,59%	1,21%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	739.346,86	60.000,00	0,00	818.360,26	19.013,40	2,38% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	876.272,02	0,00	0,00	938.027,49	61.755,47	7,05% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	503.658,13	0,00	0,00	519.413,26	15.755,13	3,13% ▲
	2.119.277,01	60.000,00	0,00	2.275.801,01	96.524,00	4,43%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA	478.486,77	0,00	487.813,03	0,00	9.326,26	1,95% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	708.755,71	60.000,00	0,00	818.360,26	49.604,55	6,45% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	843.396,61	0,00	0,00	938.027,49	94.630,88	11,22% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	500.000,00	0,00	519.413,26	19.413,26	3,88% ▲
	2.030.639,09	560.000,00	487.813,03	2.275.801,01	172.974,95	8,23%

Cenário Econômico

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

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

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

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

Retorno dos Fundos de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 07 de julho de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	942
Patrimônio Líquido Fundo	6.483.473.627,64

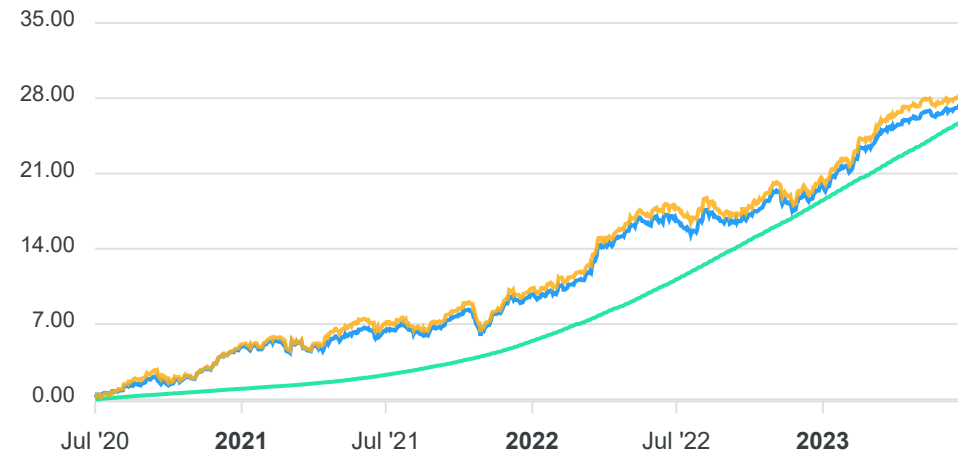
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IDKA IPCA 2 Anos
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

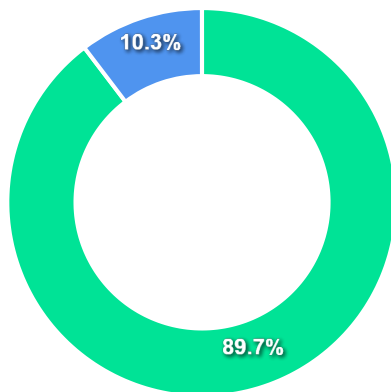
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	1,64%
Benchmark	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 783
Patrimônio Líquido Fundo 5.638.426.224,35

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B 5
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

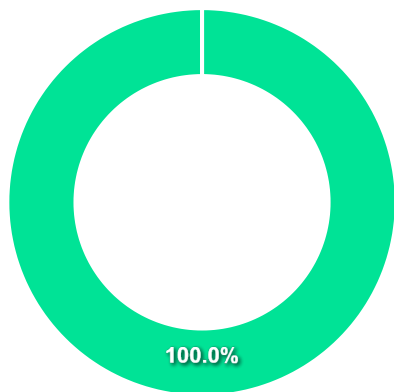
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,99%	2,56%	6,99%	10,05%	20,76%	0,90%	1,89%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	5.638.499,75	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,64	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,24	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,12	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-44,75	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-54,69	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.638.499,75	100.00%
Valores a pagar/receber	-93,39	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+2
Quantidade de Cotistas	237
Patrimônio Líquido Fundo	1.191.739.626,46

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B 5+
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

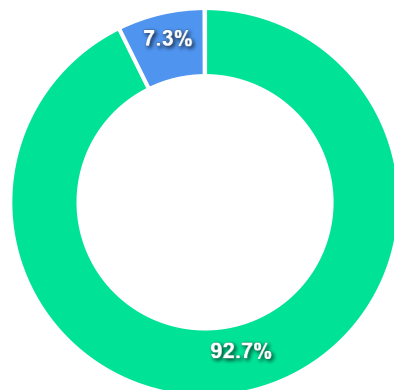
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,31%	14,66%	10,79%	14,66%	15,89%	13,02%	3,16%	6,66%
Benchmark	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	572
Patrimônio Líquido Fundo	6.493.608.770,37

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

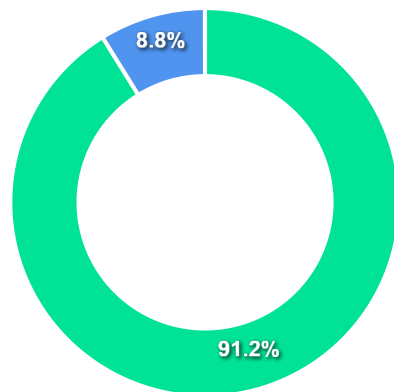
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	4,52%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.920.421,52	91.17%
Operação compromissada	572.459,19	8.82%
Derivativos	645,60	0.01%
Valores a pagar/receber	179,78	0.00%

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,10%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	1.136
Patrimônio Líquido Fundo	6.781.214.720,11

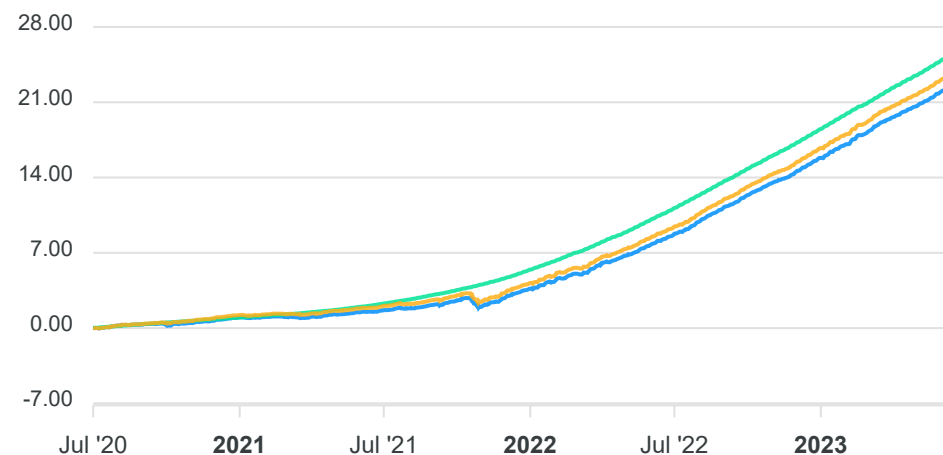
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IRF-M 1
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais.

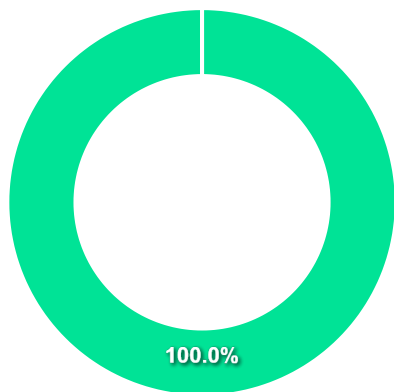
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	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
Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.781.242,31	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	26,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,78	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 / Ajuste de Cota Negativa	0,02	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.781.242,31	100.00%
Valores a pagar/receber	59,35	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 140
Patrimônio Líquido Fundo 188.237.769,14

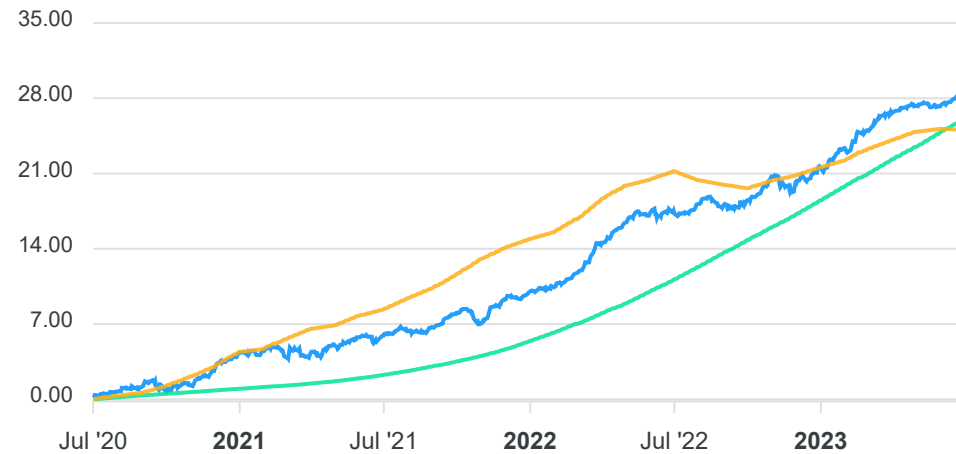
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IPCA
Classificação ANBIMA Não classificado
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

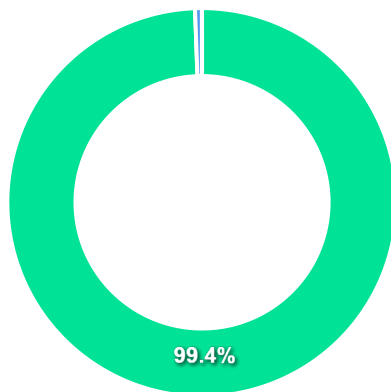
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,93%	5,54%	1,44%	5,54%	9,24%	21,24%	0,47%	0,99%
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	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	187.155,01	99,42	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.049,30	0,56	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	29,16	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	16,64	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	6,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,62	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-0,97	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	-1,20	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-1,56	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-2,26	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-5,48	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-8,45	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	187.155,01	99.42%
Operação compromissada	1.049,30	0.56%
Valores a pagar/receber	33,46	0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

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

PERFIL DO FUNDO

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

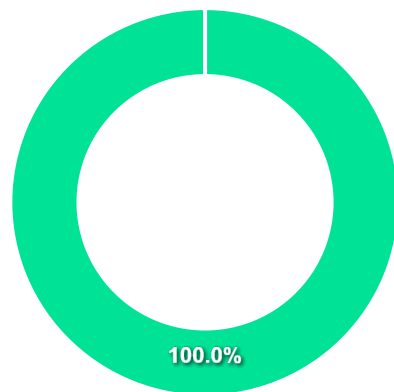
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	6,92%	2,49%	6,92%	10,00%	20,80%	0,89%	1,87%
Benchmark	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.128.624,09	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	67,34	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-136,83	-0,01	Valores a pagar/receber

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance 20,00%
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 62
Patrimônio Líquido Fundo 369.070.369,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa.

COMPARATIVO

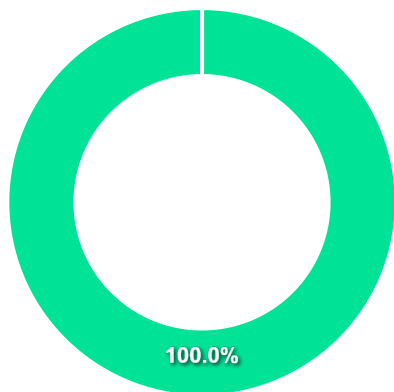
📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,37%	11,22%	7,05%	11,22%	13,24%	17,23%	2,16%	4,55%
Benchmark	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	369.088,10	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	35,24	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-57,97	-0,02	Valores a pagar/receber



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	369.088,10	100.00%
Valores a pagar/receber	-17,73	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,40%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 19
Patrimônio Líquido Fundo 39.498.344,52

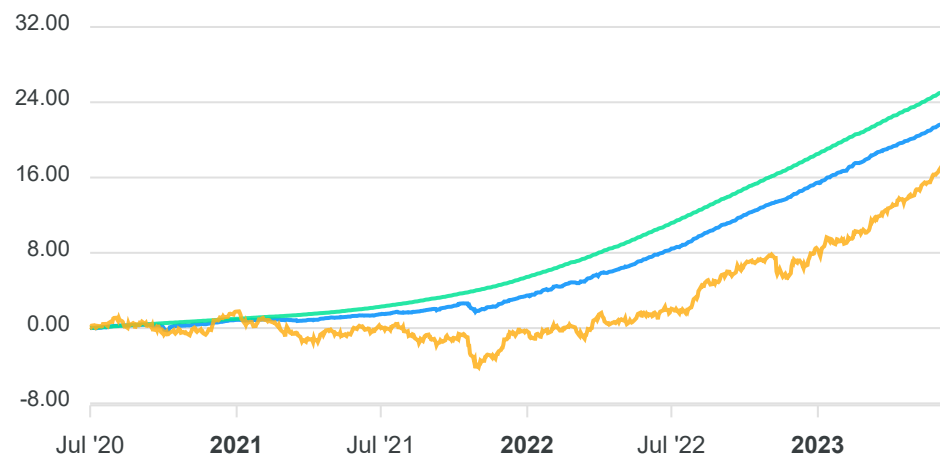
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IRF-M
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em renda fixa e fundos de investimento em índice de renda fixa que invistam apenas em títulos públicos e operações compromissadas lastradas nesses títulos.

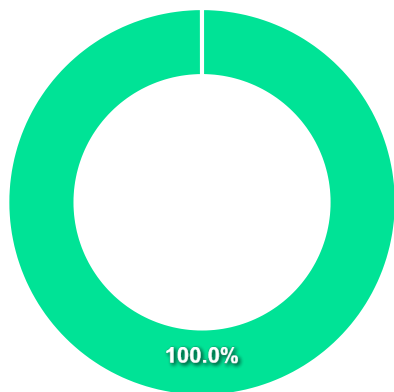
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	6,45%	3,12%	6,45%	13,38%	21,09%	0,11%	0,22%
Benchmark	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%		
CDI	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	39.492,70	99,99	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	17,72	0,04	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-17,07	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	39.492,70	99.99%
Valores a pagar/receber	5,65	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 679
Patrimônio Líquido Fundo 6.942.662.276,99

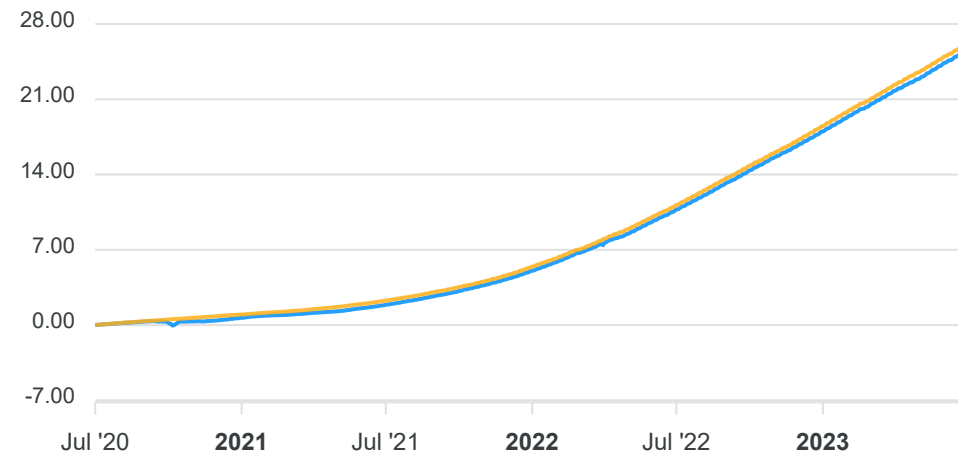
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark CDI
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Baixa Soberano
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais investem em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas nestes títulos.

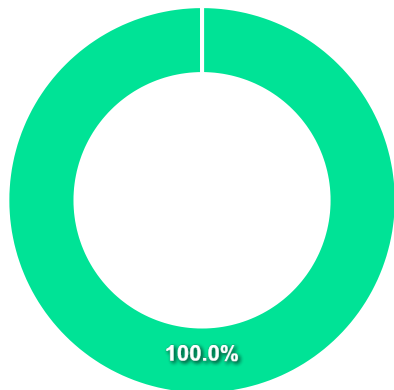
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,08%	6,45%	3,13%	6,45%	13,44%	23,27%	0,01%	0,01%
Benchmark	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	6.943.772,95	98,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	49,31	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.164,98	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.943.772,95	100.02%
Valores a pagar/receber	-1.110,67	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
1,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
1.354

Patrimônio Líquido Fundo
810.368.157,20

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

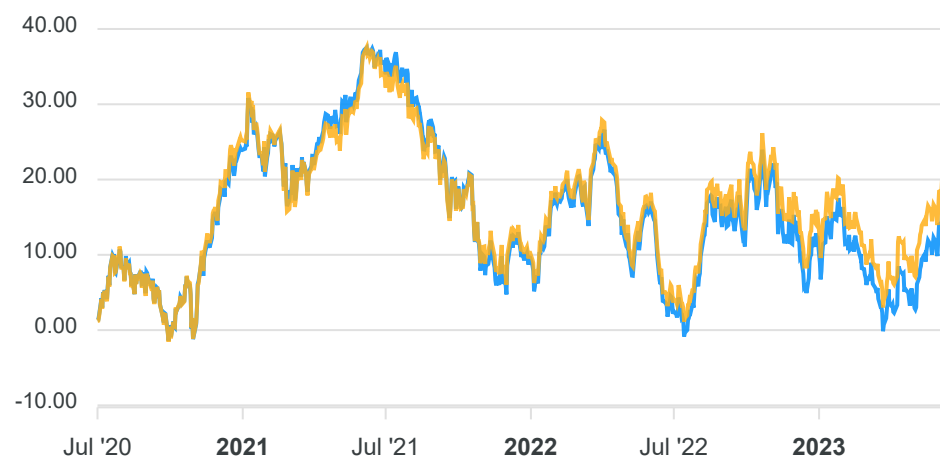
Classificação ANBIMA
Ações Sustentabilidade/Governança

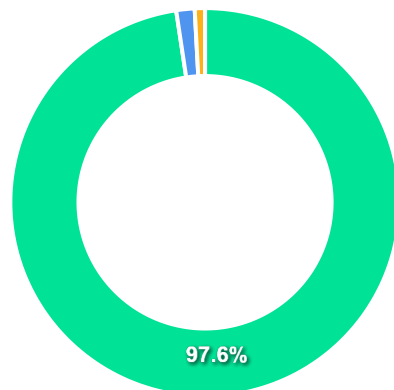
Política de Investimento
Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	8,88%	6,51%	15,45%	6,51%	17,05%	-11,63%	7,60%	16,00%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	791.214,26	97.64%
Valores a pagar/receber	12.350,47	1.52%
Operação compromissada	6.886,00	0.85%
Derivativos	-72,47	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	73.845,36	9,11	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	48.520,74	5,99	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	48.190,63	5,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	44.142,16	5,45	Ações
B3 ON NM - B3SA3	32.352,19	3,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	28.576,55	3,53	Ações
ELETOBRAS ON N1 - ELET3	26.990,25	3,33	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	24.486,74	3,02	Ações
BRADERCO PN N1 - BBDC4	21.281,83	2,63	Ações
WEG ON NM - WEGE3	19.897,27	2,46	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	19.577,30	2,42	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	17.504,49	2,16	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	11.435,76	1,41	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	9.321,49	1,15	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	8.252,57	1,02	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	8.041,77	0,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	7.885,78	0,97	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	7.567,14	0,93	Ações
BRADERCO ON N1 - BBDC3	7.448,17	0,92	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	7.217,58	0,89	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7.203,26	0,89	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	6.974,99	0,86	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	6.886,00	0,85	Operação compromissada
JBS ON NM - JBSS3	6.577,22	0,81	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BPAC11	6.469,27	0,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	6.449,66	0,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RDOR3	6.443,66	0,80	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,75%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	33
Patrimônio Líquido Fundo	276.527.312,93

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Índice Ativo
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III.

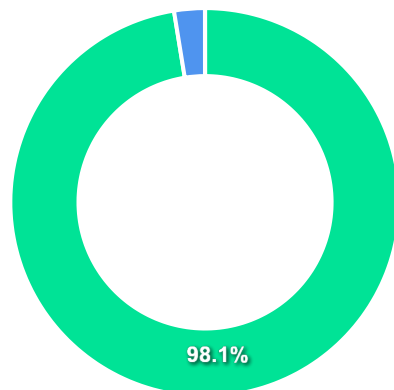
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	9,13%	7,87%	16,52%	7,87%	19,49%	-8,25%	7,46%	15,71%
Benchmark	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	262.909,51	98.09%
Operação compromissada	6.877,20	2.57%
Fundos de Investimento	13,49	0.01%
Outros	6,83	0.00%
Derivativos	-112,74	-0.04%
Valores a pagar/receber	-1.675,81	-0.63%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	38.111,58	14,22	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	17.615,42	6,57	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	15.960,49	5,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	13.680,42	5,10	Ações
B3 ON NM - B3SA3	12.807,89	4,78	Ações
BRADERCO PN N1 - BBDC4	10.102,81	3,77	Ações
ELETOBRAS ON N1 - ELET3	9.253,34	3,45	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	8.213,45	3,06	Ações
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2026	6.877,20	2,57	Operação compromissada
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	6.459,90	2,41	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	6.399,62	2,39	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	6.208,18	2,32	Ações
ASSAI ON NM - ASAI3	4.777,00	1,78	Ações
VIBRA ON NM - VBRR3	4.477,45	1,67	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.413,14	1,65	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	4.319,25	1,61	Ações
HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	4.073,67	1,52	Ações
JBS ON NM - JBSS3	3.964,15	1,48	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	3.895,63	1,45	Ações
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	3.882,54	1,45	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	3.633,78	1,36	Ações
WEG ON NM - WEGE3	3.511,63	1,31	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3.441,48	1,28	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	3.245,93	1,21	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	2.875,09	1,07	Ações
BEMOBI TECH ON NM - BMOB3	2.769,11	1,03	Ações
PETRORECSA ON NM - RECV3	2.709,99	1,01	Ações

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
10,00%

Disponibilidade de Resgate
D+2 du

Quantidade de Cotistas
22.263

Patrimônio Líquido Fundo
395.975.228,63

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
Global BDRX

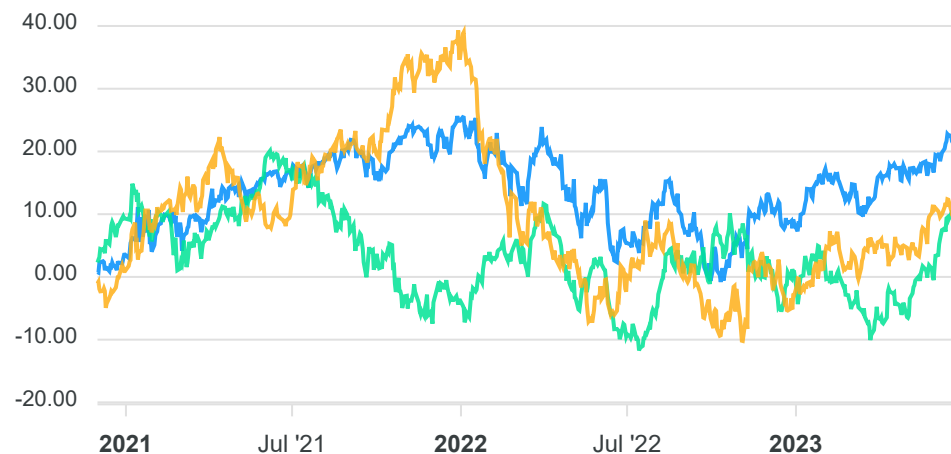
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP
AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I,
CNPJ: 39.272.928/0001-60.

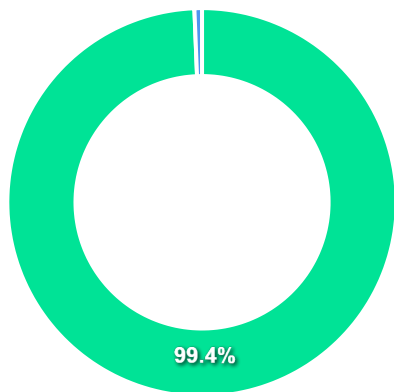
COMPARATIVO

📅 30/06/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,88%	12,69%	5,59%	12,69%	16,08%	5,21%	5,19%	10,93%
Benchmark	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%		
IBOVESPA	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BD...	382.376,18	96,57	Fundos de Investimento
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.112,55	2,81	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.538,05	0,64	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	688,52	0,17	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	22,05	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,74	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR a recolher	-2,44	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-2,90	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-3,32	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-46,32	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-703,85	-0,18	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	393.488,73	99.37%
Valores a pagar/receber	2.486,62	0.63%

Parecer do Comitê de Investimento

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

Aprovação do Conselho Fiscal

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

