

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

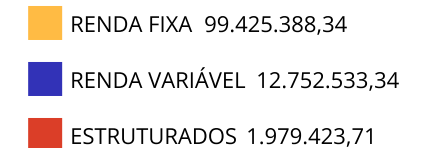
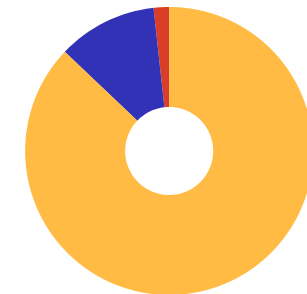
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.216.610,10	1,07%	664	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	12.019.580,24	10,53%	572	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.023.389,72	6,15%	1.136	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TESOUREIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	D+0	Não há	6.672.354,22	5,84%	89.313	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	2.609.544,56	2,29%	189	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	13.390.723,38	11,73%	773	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.718.675,96	14,65%	901	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.009.563,23	12,27%	927	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.135.938,17	5,37%	723	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	16.069.871,92	14,08%	1.126	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	368.360,69	0,32%	1.004	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	2.982.912,04	2,61%	31	1,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	207.864,11	0,18%	98	0,66%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.357.737,37	2,07%	3.732	0,85%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.278.625,85	2,87%	3.044	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.919.750,00	2,56%	443	2,04%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	210.081,30	0,18%	2.666	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.577.154,91	3,13%	17.026	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	409.183,91	0,36%	72	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.979.423,71	1,73%	95	1,53%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			114.157.345,39				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,05%	85,60%	97.718.687,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	79.796.379,58	69,90%	21,22%	29,29%	85,60%	17.922.308,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	19.421.144,65	17,01%	17,00%	27,90%	65,00%	54.781.129,85
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	22.831.469,08
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	207.864,11	0,18%	0,15%	0,20%	5,00%	5.500.003,16
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,80%	5,00%	5.707.867,27
Total Renda Fixa	100,00%	99.425.388,34	87,10%	38,37%	77,24%	266,20%	



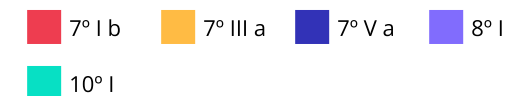
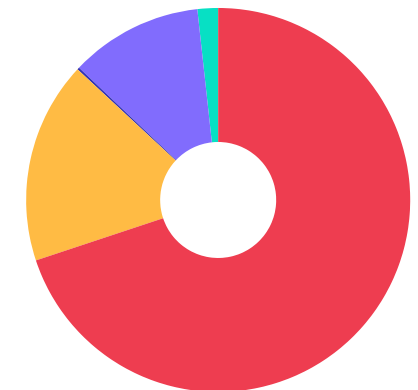
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	12.752.533,34	11,17%	10,00%	13,00%	25,00%	15.786.803,01
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.979.423,71	1,73%	1,50%	4,79%	10,00%	9.436.310,83
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	14.731.957,05	12,90%	11,50%	17,79%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	11.415.734,54
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	50.623.261,43	44,35	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.590.774,47	41,69	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.636.363,22	4,94	0,02
ITAÚ DTVM	3.577.154,91	3,13	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.982.912,04	2,61	0,03
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.919.750,00	2,56	0,03
ITAÚ UNIBANCO	409.183,91	0,36	0,00
ICATU VANGUARDA	210.081,30	0,18	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	207.864,11	0,18	0,08

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	85,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	79.796.379,58	69,90	21,22	85,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	19.421.144,65	17,01	17,00	65,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	207.864,11	0,18	0,15	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	12.752.533,34	11,17	10,00	25,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.979.423,71	1,73	1,50	10,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	6,60%	2,14%	6,60%	9,23%	19,78%	0,83%	0,03%
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%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	7,00%	2,57%	7,00%	10,18%	21,01%	0,88%	0,02%
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%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35%	11,24%	7,06%	11,24%	13,32%	17,31%	2,12%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB TESOUREO FIC RENDA FIXA SELIC LP	1,06%	6,37%	3,09%	6,37%	13,30%	22,96%	0,01%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,50%	-7,99%	-7,49%	-7,99%	0,83%	-59,45%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12%	6,42%	3,25%	6,42%	13,55%	23,98%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	6,44%	3,16%	6,44%	13,54%	23,74%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-

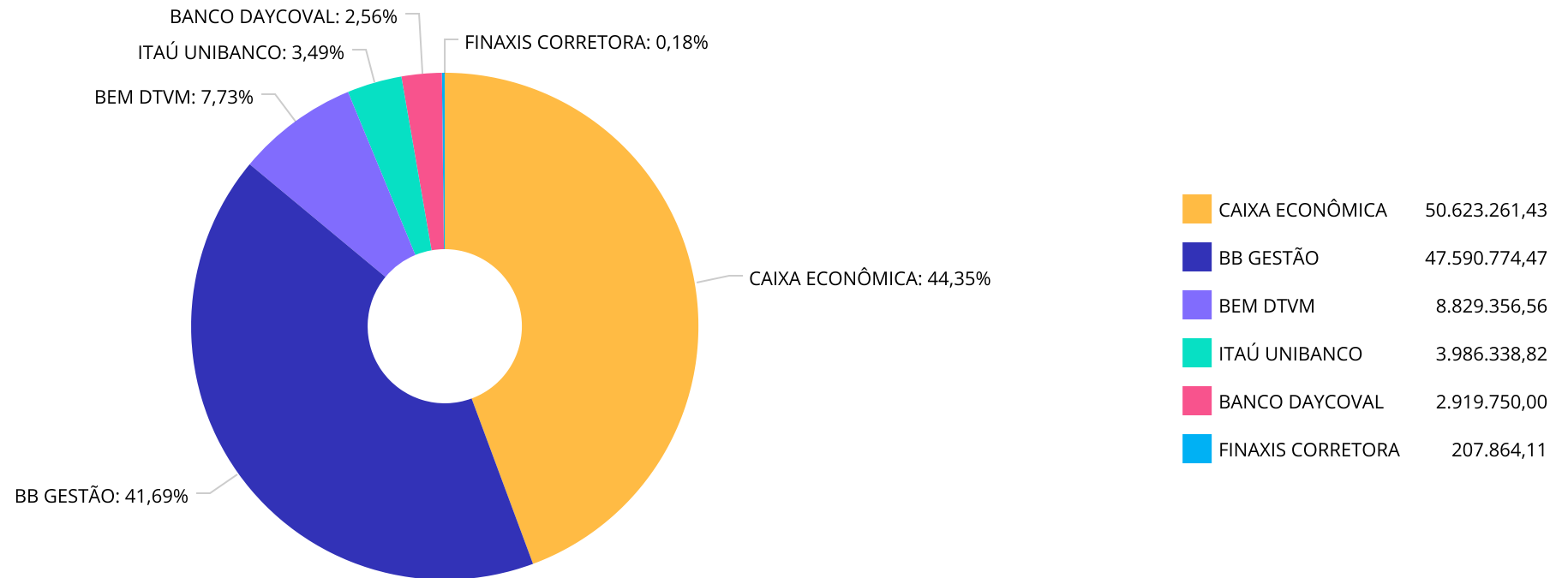
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	-0,57%	-	-	-	-	-	4,33%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	9,20%	3,88%	9,20%	10,92%	-	1,44%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	0,02%

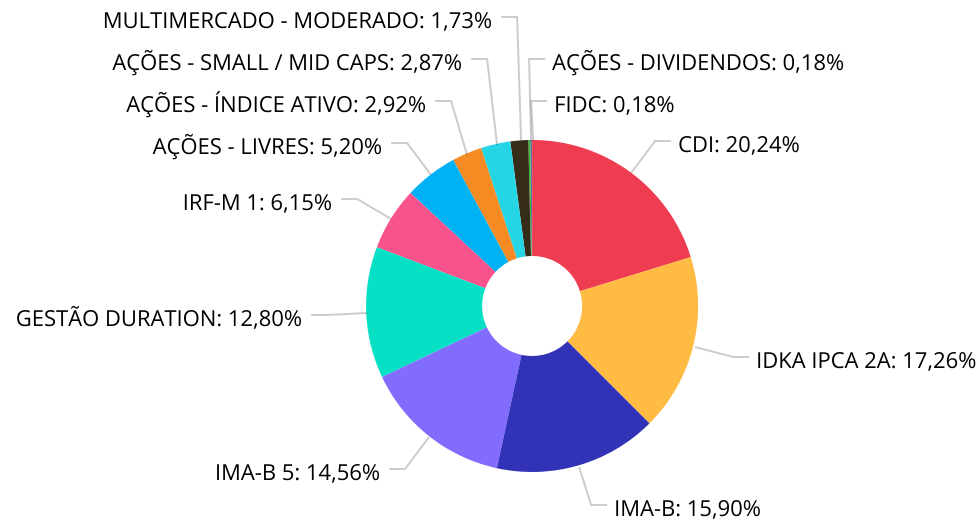
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,94%	6,56%	2,81%	6,56%	12,47%	19,07%	0,61%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	7,83%	3,22%	15,32%	3,22%	3,54%	-	7,95%	0,24%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,27%	-1,57%	7,34%	-1,57%	13,35%	-15,61%	7,12%	0,19%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,93%	5,78%	14,56%	5,78%	13,83%	-18,28%	8,64%	0,19%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	8,65%	3,42%	12,04%	3,42%	16,88%	-15,20%	7,79%	0,18%
IDIV (Benchmark)	8,78%	9,30%	13,95%	9,30%	17,73%	12,91%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,13%	4,29%	11,98%	4,29%	15,45%	-13,04%	6,62%	0,15%
SMLL (Benchmark)	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8,96%	9,59%	15,93%	9,59%	13,67%	-20,21%	9,11%	0,20%

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



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

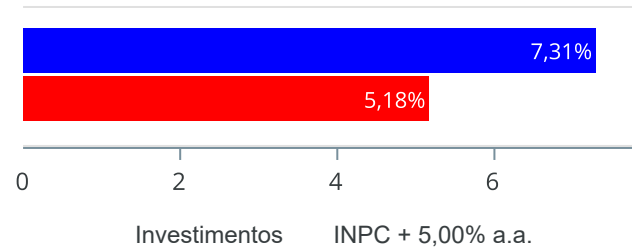


CDI	23.110.586,83	IDKA IPCA 2A	19.701.588,00	IMA-B	18.155.518,41	IMA-B 5	16.619.107,79
GESTÃO DURATION	14.607.333,48	IRF-M 1	7.023.389,72	AÇÕES - LIVRES	5.934.892,28	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.328.933,91
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	3.278.625,85	MULTIMERCADO - MODERADO	1.979.423,71	AÇÕES - DIVIDENDOS	210.081,30	FIDC	207.864,11

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	100.959.042,76	1.843.306,51	1.419.535,38	102.642.570,17	1.259.756,28	1.259.756,28	1,24%	1,24%	0,89%	0,89%	139,80%	2,06%
Fevereiro	102.642.570,17	6.159.882,18	5.423.152,79	103.681.821,81	302.522,25	1.562.278,53	0,29%	1,54%	1,12%	2,02%	76,16%	1,74%
Março	103.681.821,81	2.110.830,05	1.418.484,24	105.401.033,70	1.026.866,08	2.589.144,61	0,98%	2,54%	1,09%	3,13%	81,04%	1,42%
Abril	105.401.033,70	2.109.743,01	1.414.532,84	107.058.039,51	961.795,64	3.550.940,25	0,91%	3,47%	0,88%	4,04%	85,82%	1,32%
Mai	107.058.039,51	5.248.681,63	3.082.796,58	110.987.242,23	1.763.317,67	5.314.257,92	1,61%	5,14%	0,79%	4,86%	105,70%	1,30%
Junho	110.987.242,23	2.238.911,32	1.518.421,49	114.019.167,70	2.311.435,64	7.625.693,56	2,07%	7,31%	0,31%	5,18%	141,11%	1,76%

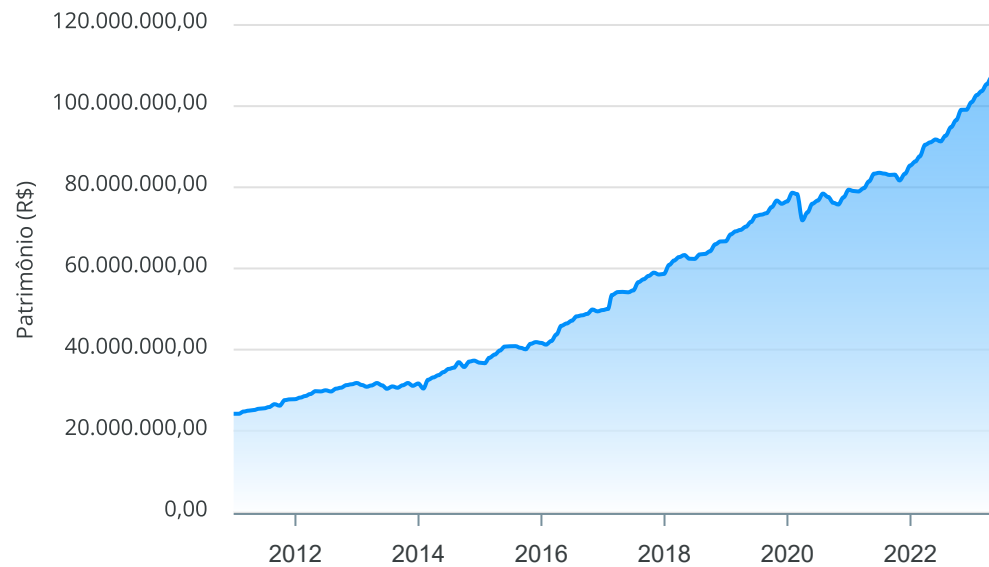
Investimentos x Meta de Rentabilidade



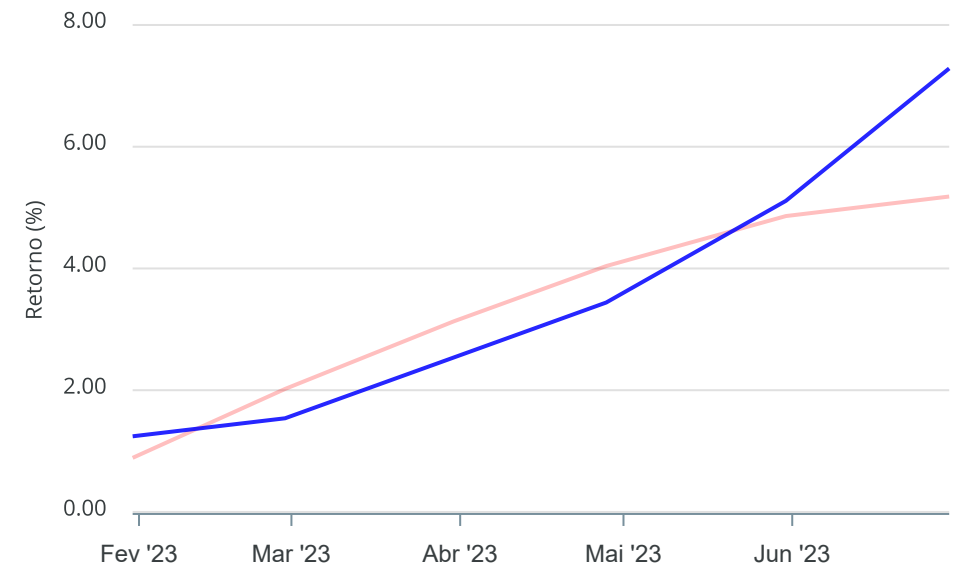
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.741.075,08	0,00	0,00	12.019.580,24	278.505,16	2,37%	2,37%	2,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.994.852,23	0,00	0,00	6.135.938,17	141.085,94	2,35%	2,35%	2,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	13.114.687,90	0,00	0,00	13.390.723,38	276.035,48	2,10%	2,10%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.195.049,71	0,00	0,00	1.216.610,10	21.560,39	1,80%	1,80%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.942.950,11	0,00	0,00	7.023.389,72	80.439,61	1,16%	1,16%	0,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.546.056,48	0,00	0,00	16.718.675,96	172.619,48	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.866.522,84	0,00	0,00	14.009.563,23	143.040,39	1,03%	1,03%	0,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	17.413.837,96	0,00	1.518.421,49	16.069.871,92	174.455,45	1,00%	1,09%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.585.003,80	0,00	0,00	2.609.544,56	24.540,76	0,95%	0,95%	1,44%
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	4.376.790,09	2.238.717,97	0,00	6.672.354,22	56.846,16	0,86%	1,06%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	354.751,69	126.455,10	116.731,77	368.360,69	3.885,67	0,81%	1,12%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	208.912,79	0,00	0,00	207.864,11	-1.048,68	-0,50%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	3.000.000,00	0,00	0,00	2.982.912,04	-17.087,96	-0,57%	-0,57%	4,33%
Total Renda Fixa	97.340.490,68	2.365.173,07	1.635.153,26	99.425.388,34	1.354.877,85	1,38%		0,97%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.144.846,96	0,00	0,00	2.357.737,37	212.890,41	9,93%	9,93%	8,64%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.008.957,70	0,00	0,00	3.278.625,85	269.668,15	8,96%	8,96%	9,11%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	2.687.280,86	0,00	0,00	2.919.750,00	232.469,14	8,65%	8,65%	7,79%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	194.287,40	0,00	0,00	210.081,30	15.793,90	8,13%	8,13%	6,62%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	379.477,68	0,00	0,00	409.183,91	29.706,23	7,83%	7,83%	7,95%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.398.204,54	0,00	0,00	3.577.154,91	178.950,37	5,27%	5,27%	7,12%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.960.996,73	0,00	0,00	1.979.423,71	18.426,98	0,94%	0,94%	0,61%
Total Renda Variável	13.774.051,87	0,00	0,00	14.731.957,05	957.905,18	6,95%		7,08%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.221.534,25	0,00	0,00	12.019.580,24	798.045,99	7,11%	7,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.693.119,14	0,00	3.000.000,00	13.390.723,38	697.604,24	4,45%	4,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	18.467.101,38	0,00	2.932.954,33	16.069.871,92	535.724,87	2,90%	3,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.731.188,72	0,00	0,00	6.135.938,17	404.749,45	7,06%	7,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.658.723,46	0,00	0,00	14.009.563,23	350.839,77	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.369.079,94	0,00	0,00	16.718.675,96	349.596,02	2,14%	2,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.809.529,41	0,00	0,00	7.023.389,72	213.860,31	3,14%	3,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.582.473,41	0,00	72.334,08	2.609.544,56	99.405,23	3,85%	3,88%
BB TESOUREIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,00	6.574.749,57	0,00	6.672.354,22	97.604,65	1,48%	3,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.158.233,90	0,00	0,00	1.216.610,10	58.376,20	5,04%	5,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	204.557,07	411.824,74	277.149,75	368.360,69	29.128,63	4,73%	3,25%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	224.680,53	0,00	0,00	207.864,11	-16.816,42	-7,48%	-7,48%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	0,00	2.982.912,04	-17.087,96	-0,57%	-
Total Renda Fixa	92.120.221,21	9.986.574,31	6.282.438,16	99.425.388,34	3.601.030,98	3,76%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.828.130,89	0,00	0,00	3.278.625,85	450.494,96	15,93%	15,93%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2.606.021,58	0,00	0,00	2.919.750,00	313.728,42	12,04%	12,04%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.058.074,23	0,00	0,00	2.357.737,37	299.663,14	14,56%	14,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.332.577,30	0,00	0,00	3.577.154,91	244.577,61	7,34%	7,34%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	354.813,56	0,00	0,00	409.183,91	54.370,35	15,32%	15,32%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.925.284,67	0,00	0,00	1.979.423,71	54.139,04	2,81%	2,81%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	187.599,17	0,00	0,00	210.081,30	22.482,13	11,98%	11,98%
Total Renda Variável	13.292.501,40	0,00	0,00	14.731.957,05	1.439.455,65	10,83%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	10.801.220,70	0,00	0,00	12.019.580,24	1.218.359,54	11,28%	11,28%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.199.503,39	0,00	3.000.000,00	13.390.723,38	1.191.219,99	7,84%	8,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	20.069.318,41	6.005.743,64	11.173.105,72	16.069.871,92	1.167.915,59	4,48%	6,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.683.893,50	0,00	0,00	16.718.675,96	1.034.782,46	6,60%	6,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.092.598,18	0,00	0,00	14.009.563,23	916.965,05	7,00%	7,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.515.750,90	0,00	0,00	6.135.938,17	620.187,27	11,24%	11,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.662.374,61	4.012.557,80	0,00	7.023.389,72	348.457,31	5,22%	6,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.456.504,97	0,00	72.334,08	2.609.544,56	225.373,67	9,17%	9,20%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	791.880,51	573.132,15	368.360,69	149.612,33	18,89%	6,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.118.658,78	0,00	0,00	1.216.610,10	97.951,32	8,76%	8,76%
BB TESOUREIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,00	6.574.749,57	0,00	6.672.354,22	97.604,65	1,48%	6,37%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	0,00	2.982.912,04	-17.087,96	-0,57%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	225.913,85	0,00	0,00	207.864,11	-18.049,74	-7,99%	-7,99%
Total Renda Fixa	86.825.737,29	20.384.931,52	14.818.571,95	99.425.388,34	7.033.291,48	7,61%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.991.637,92	0,00	0,00	3.278.625,85	286.987,93	9,59%	9,59%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.228.892,16	0,00	0,00	2.357.737,37	128.845,21	5,78%	5,78%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.857.539,71	0,00	0,00	1.979.423,71	121.884,00	6,56%	6,56%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	2.823.234,42	0,00	0,00	2.919.750,00	96.515,58	3,42%	3,42%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	396.437,60	0,00	0,00	409.183,91	12.746,31	3,22%	3,22%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	201.444,82	0,00	0,00	210.081,30	8.636,48	4,29%	4,29%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.634.118,85	0,00	0,00	3.577.154,91	-56.963,94	-1,57%	-1,57%
Total Renda Variável	14.133.305,48	0,00	0,00	14.731.957,05	598.651,57	4,24%	

Disclaimer

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

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

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

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

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

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

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

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

