

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	D+0	Não há	69.843.219,99	15,47%	160	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	20.260.763,67	4,49%	370	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	4.994.351,10	1,11%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA...	D+0	Não há	49.291.631,22	10,92%	37	6,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	36.778.070,52	8,15%	301	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.190.202,64	4,47%	45	8,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	55.182.913,07	12,22%	360	0,63%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	72.554.355,26	16,07%	1.004	0,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	76.564.342,76	16,96%	379	1,60%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	485.997,36	0,11%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.979.553,71	1,10%	3.044	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.244.365,85	0,50%	1.354	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.850.675,21	0,63%	29.477	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.719.598,56	0,82%	441	1,82%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.208.911,76	0,49%	490	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.276.756,69	0,50%	145	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.305.344,21	0,51%	2.523	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	4.512.364,56	1,00%	38	0,91%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	2.360.878,18	0,52%	3.306	2,48%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	2.473.817,90	0,55%	38	0,32%	Artigo 8º, Inciso I



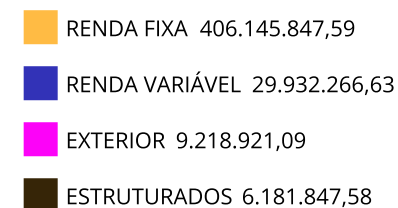
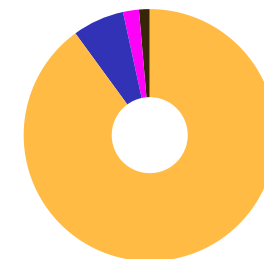
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	4.745.788,31	1,05%	102	0,41%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	1.839.703,22	0,41%	4.967	0,29%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.633.429,56	0,58%	405	0,36%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	4.242.317,87	0,94%	2.264	0,86%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.939.529,71	0,43%	23.779	0,24%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			451.478.882,89				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	1,00%	7,00%	15,00%	67.721.832,43
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	201.358.239,14	44,60%	20,00%	23,00%	70,00%	114.676.978,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	204.301.611,09	45,25%	10,00%	30,00%	50,00%	21.437.830,36
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,25%	10,00%	45.147.888,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	10,00%	485.997,36	0,11%	0,00%	0,25%	0,25%	642.699,85
Total Renda Fixa	100,00%	406.145.847,59	89,96%	31,00%	63,50%	145,25%	



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

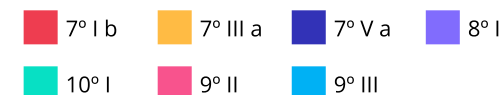
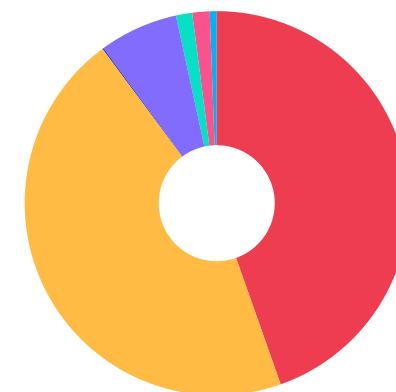




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	29.932.266,63	6,63%	10,00%	20,00%	28,00%	96.481.820,58
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	6.181.847,58	1,37%	6,00%	9,50%	10,00%	38.966.040,71
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	36.114.114,21	8,00%	16,00%	29,50%	38,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	6.585.491,53	1,46%	2,00%	3,00%	10,00%	38.562.396,76
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.633.429,56	0,58%	1,00%	4,00%	10,00%	42.514.458,73
Total Exterior	10,00%	9.218.921,09	2,04%	3,00%	7,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	129.522.628,42	28,69	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	99.944.813,03	22,14	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	76.564.342,76	16,96	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	59.668.581,52	13,22	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	55.839.293,30	12,37	0,04
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	4.994.351,10	1,11	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.979.553,71	1,10	0,02
ITAÚ DTVM	4.512.364,56	1,00	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.719.598,56	0,82	0,01
BANCO J. SAFRA S/A	2.633.429,56	0,58	0,00
VINCI PARTNERS	2.473.817,90	0,55	-
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.360.878,18	0,52	0,00
WESTERN ASSET	1.939.529,71	0,43	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.839.703,22	0,41	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	485.997,36	0,11	0,19

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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 PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	2,24%	10,02%	5,43%	10,02%	16,97%	17,54%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	2,19%	9,71%	5,36%	9,71%	-	-	1,04%	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	1,61%	1,21%	1,61%	-48,18%	-45,93%	0,48%	0,51%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	2,50%	1,44%	2,50%	2,15%	5,84%	0,47%	0,05%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	6,46%	3,25%	6,46%	13,73%	24,70%	0,03%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,08%	6,49%	3,14%	6,49%	13,53%	23,46%	0,01%	0,00%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	6,53%	3,22%	6,53%	13,88%	24,53%	0,02%	0,00%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA SIMPLES	1,09%	6,50%	3,15%	6,50%	13,52%	23,45%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,56%	1,44%	5,56%	8,39%	-	0,47%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	8,07%	7,26%	15,64%	7,26%	19,04%	-11,73%	7,03%	0,17%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	8,01%	5,57%	14,39%	5,57%	19,10%	-11,84%	6,95%	0,19%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8,63%	6,85%	15,61%	6,85%	17,92%	-21,87%	7,79%	0,18%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10,33%	11,33%	19,32%	11,33%	16,60%	-11,98%	7,84%	0,21%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7,60%	6,86%	13,93%	6,86%	13,62%	-12,04%	7,44%	0,18%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7,40%	2,75%	10,27%	2,75%	6,15%	-28,95%	7,62%	0,21%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8,88%	6,51%	15,45%	6,51%	17,05%	-11,63%	7,60%	0,17%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,39%	6,66%	15,10%	6,66%	17,15%	-33,62%	7,85%	0,22%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	6,47%	15,91%	8,30%	15,91%	17,57%	3,56%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7,07%	20,38%	10,59%	20,38%	34,24%	27,00%	5,06%	0,19%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6,98%	20,06%	10,37%	20,06%	28,23%	20,74%	5,04%	0,20%
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%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6,48%	4,22%	15,83%	4,22%	9,72%	-24,07%	9,10%	0,24%

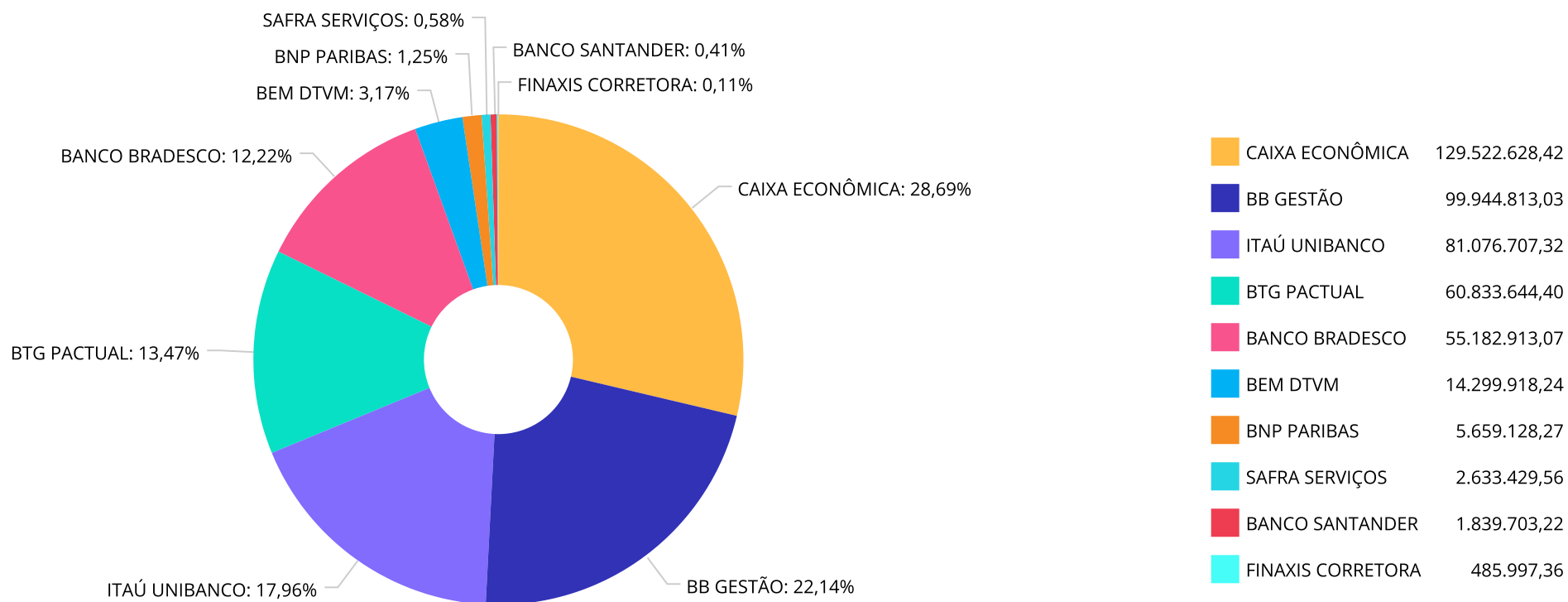


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

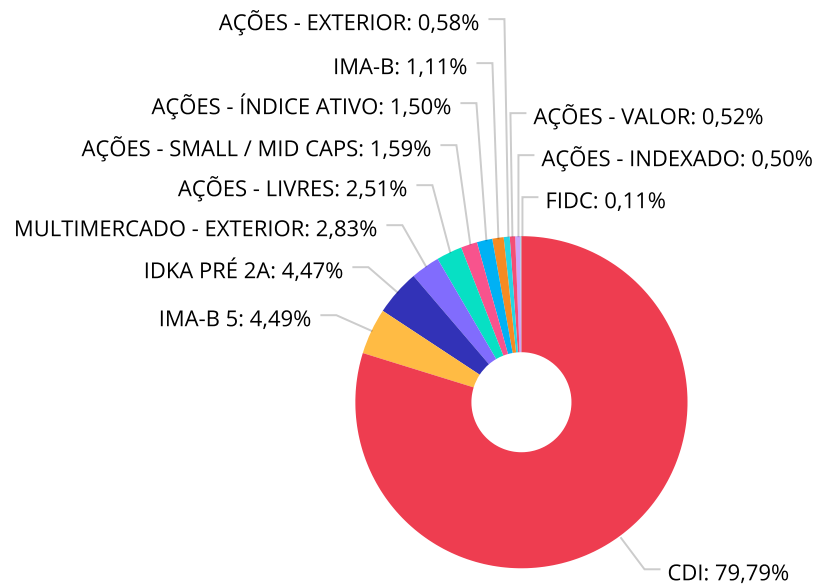
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,06%	7,46%	2,43%	7,46%	6,61%	-9,35%	5,79%	14,722%

MSCI WORLD (Benchmark)	0,18%	5,28%	0,82%	5,28%	7,20%	-5,27%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,39%	4,29%	-0,52%	4,29%	13,08%	2,11%	5,66%	13,208%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-0,78%	1,02%	0,12%	1,02%	7,24%	-13,40%	5,16%	13,100%

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



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



■ CDI	360.214.532,82	■ IMA-B 5	20.260.763,67	■ IDKA PRÉ 2A	20.190.202,64	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	12.767.339,11
■ AÇÕES - LIVRES	11.349.435,88	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.188.465,47	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.789.121,25	■ IMA-B	4.994.351,10
■ AÇÕES - EXTERIOR	2.633.429,56	■ AÇÕES - VALOR	2.360.878,18	■ AÇÕES - INDEXADO	2.244.365,85	■ FIDC	485.997,36



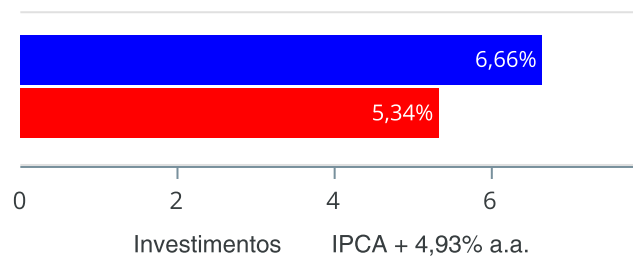
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

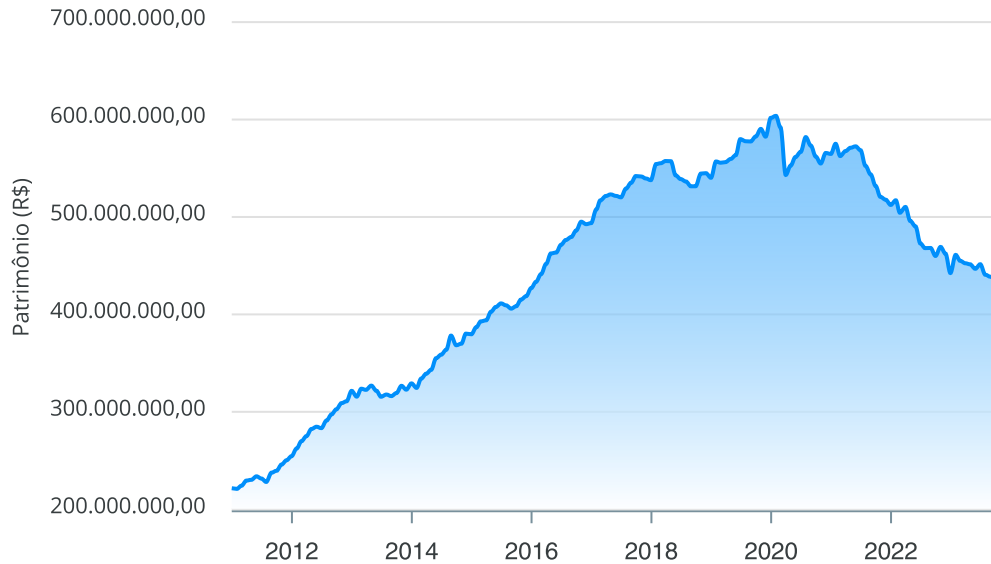
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	442.489.269,76	80.207.800,23	71.481.073,23	461.039.580,19	9.823.583,43	9.823.583,43	2,18%	2,18%	0,95%	0,95%	228,39%	3,56%
Fevereiro	461.039.580,19	126.377.910,00	131.271.700,37	454.959.267,08	-1.186.522,74	8.637.060,69	-0,26%	1,91%	1,19%	2,15%	88,96%	2,30%
Março	454.959.267,08	23.290.659,62	28.735.277,12	452.472.867,08	2.958.217,50	11.595.278,19	0,65%	2,58%	1,15%	3,33%	77,38%	1,90%
Abril	452.472.867,08	23.491.509,52	28.468.206,39	451.454.306,49	3.958.136,28	15.553.414,47	0,87%	3,47%	0,96%	4,32%	80,45%	1,83%
Mai	451.454.306,49	107.420.294,47	118.068.793,83	446.828.593,72	6.022.786,59	21.576.201,06	1,33%	4,85%	0,65%	5,00%	97,12%	1,00%
Junho	446.828.593,72	79.517.474,01	82.544.489,71	451.478.882,89	7.677.304,87	29.253.505,93	1,72%	6,66%	0,32%	5,34%	124,74%	0,83%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



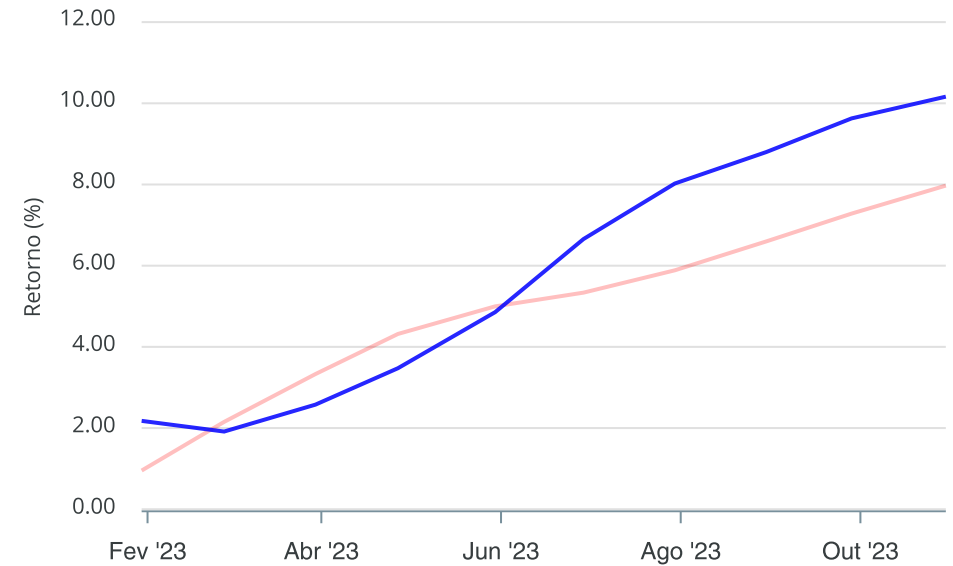
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	90.565.875,43	0,00	15.000.000,00	76.564.342,76	998.467,33	1,10%	1,17%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	80.936.785,23	1.018.021,58	12.950.000,00	69.843.219,99	838.413,18	1,02%	1,08%	0,01%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	37.999.135,54	10.800.000,00	0,00	49.291.631,22	492.495,68	1,01%	1,08%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	0,00	20.190.202,64	190.202,64	0,95%	2,19%	1,04%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	36.438.658,71	0,00	0,00	36.778.070,52	339.411,81	0,93%	0,93%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	20.073.847,79	0,00	0,00	20.260.763,67	186.915,88	0,93%	0,93%	0,47%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.952.160,90	0,00	0,00	4.994.351,10	42.190,20	0,85%	0,85%	0,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	88.075.287,11	19.748.527,93	36.165.886,65	72.554.355,26	896.426,87	0,83%	1,12%	0,01%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	34.372.756,11	27.950.924,50	7.628.603,06	55.182.913,07	487.835,52	0,78%	1,13%	0,02%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	488.449,26	0,00	0,00	485.997,36	-2.451,90	-0,50%	-	-
Total Renda Fixa	393.902.956,08	79.517.474,01	71.744.489,71	406.145.847,59	4.469.907,21	1,11%		0,14%



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
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.446.785,74	0,00	1.300.000,00	2.473.817,90	327.032,16	9,49%	10,33%	7,84%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.061.369,53	0,00	0,00	2.244.365,85	182.996,32	8,88%	8,88%	7,60%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.173.314,46	0,00	0,00	2.360.878,18	187.563,72	8,63%	8,63%	7,79%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.794.066,57	0,00	1.800.000,00	2.305.344,21	311.277,64	8,20%	9,39%	7,85%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.175.609,43	0,00	0,00	4.512.364,56	336.755,13	8,06%	8,06%	7,03%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.107.866,57	0,00	0,00	2.276.756,69	168.890,12	8,01%	8,01%	6,95%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.654.345,21	0,00	0,00	2.850.675,21	196.330,00	7,40%	7,40%	7,62%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3.962.048,28	0,00	0,00	4.242.317,87	280.269,59	7,07%	7,07%	5,06%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8.578.433,01	0,00	4.200.000,00	4.979.553,71	601.120,70	7,01%	8,96%	9,11%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.813.024,11	0,00	0,00	1.939.529,71	126.505,60	6,98%	6,98%	5,04%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.074.487,38	0,00	0,00	2.208.911,76	134.424,38	6,48%	6,48%	9,10%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.782.360,34	0,00	3.500.000,00	3.719.598,56	437.238,22	6,45%	7,60%	7,44%
Total Renda Variável	43.623.710,63	0,00	10.800.000,00	36.114.114,21	3.290.403,58	7,54%		7,38%



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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.634.961,81	0,00	0,00	2.633.429,56	-1.532,25	-0,06%	-0,06%	5,79%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	1.854.078,84	0,00	0,00	1.839.703,22	-14.375,62	-0,78%	-0,78%	5,16%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4.812.886,36	0,00	0,00	4.745.788,31	-67.098,05	-1,39%	-1,39%	5,66%
Total Exterior	9.301.927,01	0,00	0,00	9.218.921,09	-83.005,92	-0,89%		5,59%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	88.739.913,60	0,00	15.000.000,00	76.564.342,76	2.824.429,16	3,18%	3,25%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	94.082.667,21	53.299.620,20	77.545.123,95	72.554.355,26	2.717.191,80	1,84%	3,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	26.656.404,11	54.448.263,59	12.950.000,00	69.843.219,99	1.688.552,29	2,08%	3,14%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	42.502.857,48	34.107.109,51	22.828.777,08	55.182.913,07	1.401.723,16	1,83%	3,22%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	0,00	48.574.284,70	0,00	49.291.631,22	717.346,52	1,48%	3,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	37.224.804,97	0,00	37.818.199,20	0,00	593.394,23	1,59%	3,22%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	36.256.246,95	0,00	0,00	36.778.070,52	521.823,57	1,44%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	19.973.227,77	0,00	0,00	20.260.763,67	287.535,90	1,44%	1,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.691.862,76	0,00	6.965.105,00	0,00	273.242,24	4,08%	7,11%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	0,00	20.190.202,64	190.202,64	0,95%	5,36%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.934.824,20	0,00	0,00	4.994.351,10	59.526,90	1,21%	1,21%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	525.315,05	0,00	0,00	485.997,36	-39.317,69	-7,48%	-7,48%
Total Renda Fixa	357.588.124,10	210.429.278,00	173.107.205,23	406.145.847,59	11.235.650,72	2,85%	

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	8.062.902,11	0,00	4.200.000,00	4.979.553,71	1.116.651,60	13,85%	15,93%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.405.190,05	0,00	3.500.000,00	3.719.598,56	814.408,51	12,71%	13,93%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	5.305.043,51	0,00	1.500.000,00	4.512.364,56	707.321,05	13,33%	15,63%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.187.092,35	0,00	1.300.000,00	2.473.817,90	586.725,55	18,41%	19,32%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.605.795,79	0,00	1.800.000,00	2.305.344,21	499.548,42	13,85%	15,10%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	4.779.314,76	0,00	2.900.000,00	2.360.878,18	481.563,42	10,08%	15,61%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	6.697.700,63	0,00	4.300.000,00	2.850.675,21	452.974,58	6,76%	10,27%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	6.433.148,53	0,00	4.600.000,00	2.276.756,69	443.608,16	6,90%	14,39%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	4.131.696,54	0,00	300.000,00	4.242.317,87	410.621,33	9,94%	10,58%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	3.825.139,23	0,00	2.000.000,00	2.208.911,76	383.772,53	10,03%	15,83%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.696.593,81	0,00	800.000,00	2.244.365,85	347.772,04	12,90%	15,45%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.206.978,51	0,00	3.500.000,00	1.939.529,71	232.551,20	4,47%	10,37%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5.144.660,02	0,00	5.211.968,37	0,00	67.308,35	1,31%	10,24%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.231.485,87	0,00	1.262.316,33	0,00	30.830,46	2,50%	5,71%
Total Renda Variável	66.712.741,71	0,00	37.174.284,70	36.114.114,21	6.575.657,20	9,86%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.733.930,65	0,00	900.000,00	1.839.703,22	5.772,57	0,21%	0,12%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	18.303.838,57	0,00	15.600.000,00	2.633.429,56	-70.409,01	-0,38%	2,43%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	7.134.232,05	0,00	2.300.000,00	4.745.788,31	-88.443,74	-1,24%	-0,52%
Total Exterior	28.172.001,27	0,00	18.800.000,00	9.218.921,09	-153.080,18	-0,54%	

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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	64.923.654,78	21.500.000,00	15.000.000,00	76.564.342,76	5.140.687,98	5,95%	6,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.850.240,91	120.265.969,84	82.946.527,43	72.554.355,26	4.384.671,94	2,90%	6,42%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.121.088,20	120.026.548,06	74.658.135,14	55.182.913,07	2.693.411,95	2,12%	6,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	0,00	80.719.220,27	12.950.000,00	69.843.219,99	2.073.999,72	2,57%	6,49%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	34.664.077,56	1.212.432,50	1.028.538,57	36.778.070,52	1.930.099,03	5,38%	2,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	35.916.589,98	0,00	37.818.199,20	0,00	1.901.609,22	5,29%	6,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	59.176.707,28	25.797.206,37	86.135.435,60	0,00	1.161.521,95	1,37%	6,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	19.195.086,77	550.852,73	550.852,73	20.260.763,67	1.065.676,90	5,40%	5,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	26.117.171,31	0,00	26.965.105,00	0,00	847.933,69	3,25%	11,28%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	0,00	48.574.284,70	0,00	49.291.631,22	717.346,52	1,48%	6,50%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.915.015,20	0,00	183.893,93	4.994.351,10	263.229,83	5,36%	1,61%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	0,00	20.190.202,64	190.202,64	0,95%	9,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.037.193,85	1.659.133,38	5.858.568,35	0,00	162.241,12	2,85%	6,56%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	528.198,61	0,00	0,00	485.997,36	-42.201,25	-7,99%	-7,99%
Total Renda Fixa	287.445.024,45	440.305.647,85	344.095.255,95	406.145.847,59	22.490.431,24	5,86%	

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
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	14.861.431,70	0,00	16.211.968,37	0,00	1.350.536,67	9,09%	19,83%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9.388.058,04	0,00	6.300.000,00	4.242.317,87	1.154.259,83	12,29%	20,38%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.475.774,39	0,00	7.500.000,00	1.939.529,71	963.755,32	11,37%	20,06%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12.153.968,78	0,00	7.700.000,00	4.979.553,71	525.584,93	4,32%	9,59%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.866.671,44	0,00	4.500.000,00	3.719.598,56	352.927,12	4,49%	6,86%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	11.186.654,27	0,00	7.000.000,00	4.512.364,56	325.710,29	2,91%	7,26%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.531.693,01	0,00	3.300.000,00	2.473.817,90	242.124,89	4,38%	11,33%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.891.179,16	0,00	1.800.000,00	2.305.344,21	214.165,05	5,50%	6,66%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.926.570,58	0,00	5.800.000,00	2.244.365,85	117.795,27	1,49%	6,51%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	8.168.647,92	0,00	8.262.316,33	0,00	93.668,41	1,15%	6,01%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.182.572,94	0,00	4.900.000,00	2.360.878,18	78.305,24	1,09%	6,85%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	8.160.205,97	0,00	5.300.000,00	2.850.675,21	-9.530,76	-0,12%	2,75%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	12.922.482,88	0,00	10.600.000,00	2.276.756,69	-45.726,19	-0,35%	5,57%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.271.499,79	0,00	3.000.000,00	2.208.911,76	-62.588,03	-1,19%	4,22%
Total Renda Variável	122.987.410,87	0,00	92.174.284,70	36.114.114,21	5.300.988,04	4,31%	



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.446.903,18	0,00	15.600.000,00	2.633.429,56	786.526,38	4,51%	7,46%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	11.900.468,98	0,00	7.800.000,00	4.745.788,31	645.319,33	5,42%	4,29%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.709.462,28	0,00	900.000,00	1.839.703,22	30.240,94	1,12%	1,02%
Total Exterior	32.056.834,44	0,00	24.300.000,00	9.218.921,09	1.462.086,65	4,56%	

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 E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. 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.

