

# Relatório Analítico dos Investimentos

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





Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			5.949.218,98	9,96%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.064.906,92	1,78%	664	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	769.628,25	1,29%	783	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FIC RENDA FIXA P...	D+0	Não há	3.221.303,91	5,39%	280	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FIC RENDA FIXA P...	D+0	46980	1.395.666,14	2,34%	38	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FIC RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	8.818.313,40	14,77%	370	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC RE...	D+0	Não há	1.415.306,88	2,37%	901	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA F...	D+0	Não há	1.494.445,20	2,50%	1.186	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	D+0	Não há	4.402.325,85	7,37%	352	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.195.772,43	3,68%	218	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASILATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.904.888,18	6,54%	118	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.312.669,57	13,92%	1.004	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.017.240,47	5,05%	208	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	877.936,52	1,47%	1.505	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.115.823,70	1,87%	2.724	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.570.180,66	2,63%	145	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	5.150.643,21	8,62%	184	0,73%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	535.464,06	0,90%	5.984	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.088.836,08	5,17%	155	0,24%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	1.419.156,74	2,38%	892	1,96%	Artigo 10º, Inciso I



**CRÉDITO  
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

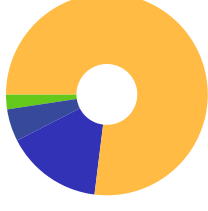
INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/06/2023

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>59.719.727,15</b>				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	5.949.218,98	9,96%	9,00%	14,00%	87,87%	46.526.505,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	22.581.896,55	37,81%	22,01%	32,00%	87,87%	29.893.827,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	17.430.570,65	29,19%	23,53%	25,00%	65,00%	21.387.252,00
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	11.943.945,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.985.986,36
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>45.961.686,18</b>	<b>76,96%</b>	<b>54,54%</b>	<b>72,00%</b>	<b>265,74%</b>	



RENDA FIXA 45.961.686,18

RENDA VARIÁVEL 9.250.048,15

EXTERIOR 3.088.836,08

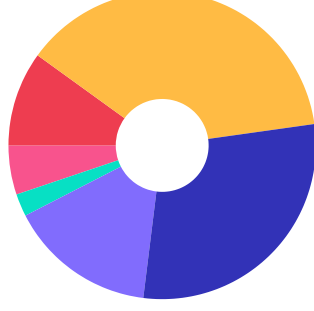
ESTRUTURADOS 1.419.156,74

**ⓘ ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

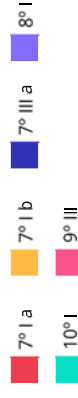


**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2023)**

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	9.250.048,15	15,49%	9,00%	17,00%	35,00%	11.651.856,35
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.985.986,36
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.419.156,74	2,38%	2,07%	5,00%	10,00%	4.552.815,98
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>35,00%</b>	<b>10.669.204,89</b>	<b>17,87%</b>	<b>11,07%</b>	<b>22,00%</b>	<b>50,00%</b>	



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%	3.088.836,08	5,17%	3,75%	5,00%	10,00%	2.883.136,64
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>3.088.836,08</b>	<b>5,17%</b>	<b>3,75%</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	





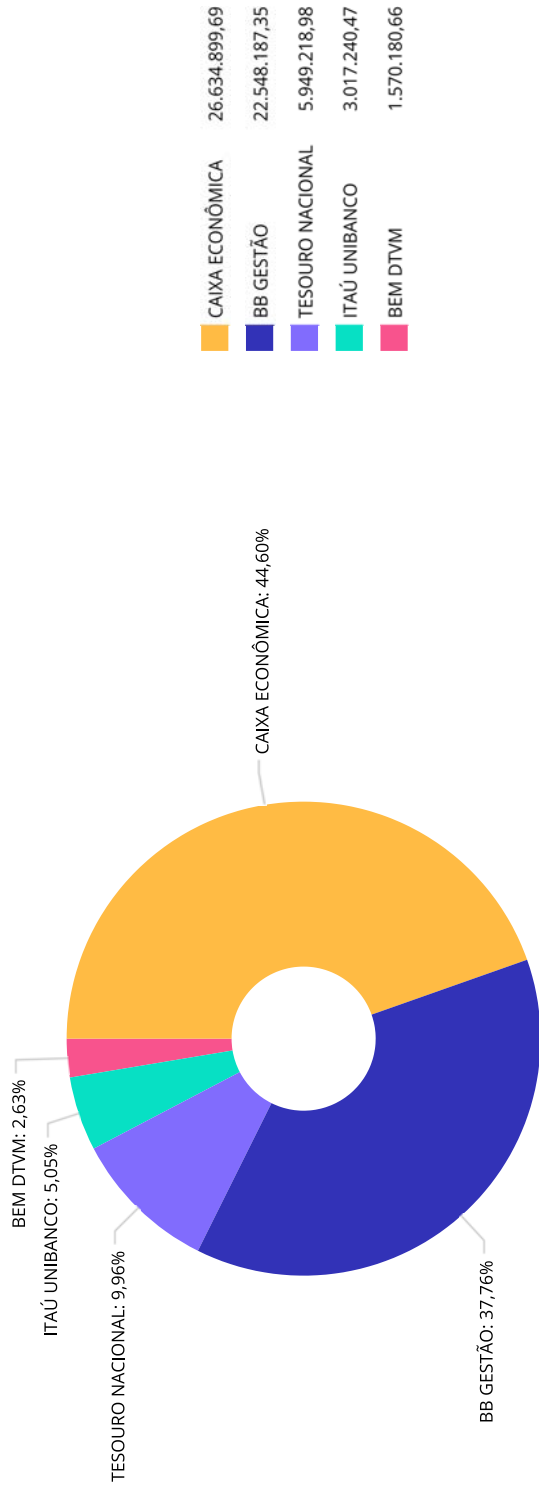
Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

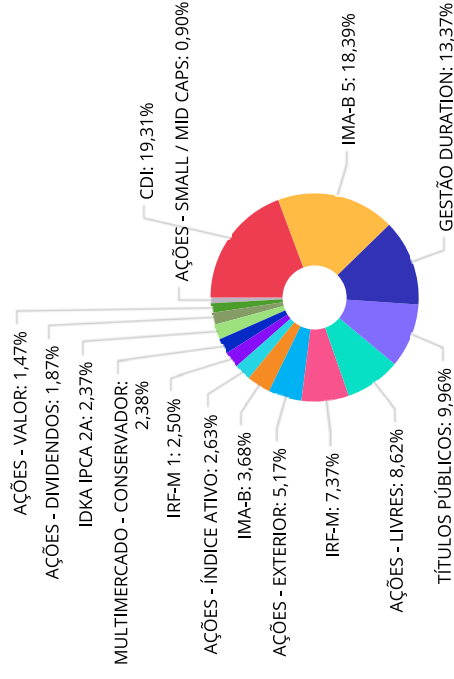
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Gestão	Valor	% SI Carteira	% SI/PL Gestão
CAIXA DTVM	26.634.899,69	44,60	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	22.548.187,35	37,76	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PUBL...	5.949.218,98	9,96	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	3.017.240,47	5,05	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.570.180,66	2,63	0,00

**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)

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	5.949.218,98	9,96	9,00	87,87
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	22.581.896,55	37,81	22,01	87,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	17.430.570,65	29,19	23,53	65,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	9.250.048,15	15,49	9,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	3.088.836,08	5,17	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.419.156,74	2,38	2,07	10,00





■ CDI	11.533.973,48	■ IMA-B 5	10.983.607,79	■ GESTÃO DURATION	7.987.035,57
■ TÍTULOS PÚBLICOS	5.949.218,98	■ AÇÕES - LIVRES	5.150.643,21	■ IRF-M	4.402.325,85
■ AÇÕES - EXTERIOR	3.088.836,08	■ IMA-B	2.195.772,43	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.570.180,66
■ IRF-M 1	1.494.445,20	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.419.156,74	■ IDKA IPCA 2A	1.415.306,88
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.115.823,70	■ AÇÕES - VALOR	877.936,52	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	535.464,06





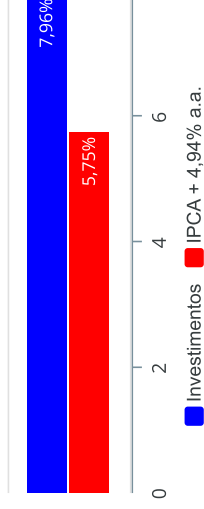
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	4.159,000320	743.672,41	2.079.500,16	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	4.159,000320	403.538,02	1.122.930,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	4.442,059123	695.984,05	2.798.497,25	Mercado



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

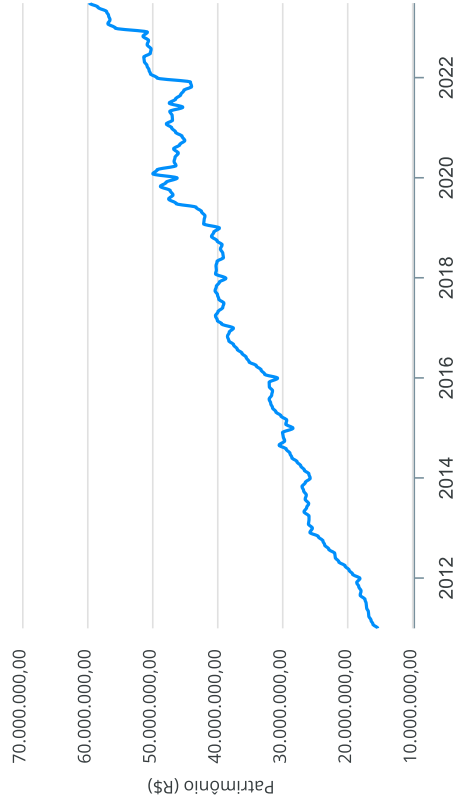
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	55.775.197,74	357.989,05	0,00	56.902.473,09	769.286,30	769.286,30	1,37%	1,37%	0,95%	0,95%	143,64%	3,07%
Fevereiro	56.902.473,09	3.866.620,81	4.048.910,15	56.580.527,32	-139.656,43	629.629,87	-0,25%	1,12%	1,19%	2,15%	52,09%	2,56%
Março	56.580.527,32	1.432.328,52	1.730.000,00	56.799.894,42	517.038,58	1.146.668,45	0,91%	2,05%	1,15%	3,33%	61,39%	2,41%
Abril	56.799.894,42	1.438.236,32	1.765.000,00	57.098.176,48	625.045,74	1.771.714,19	1,10%	3,17%	0,96%	4,32%	73,33%	2,41%
Mai	57.098.176,48	11.171.153,35	11.043.526,89	58.434.394,26	1.208.591,32	2.980.305,51	2,11%	5,35%	0,65%	5,00%	106,90%	2,29%
Junho	58.434.394,26	1.421.882,55	1.585.000,00	59.719.727,15	1.448.450,34	4.428.755,85	2,48%	7,96%	0,71%	5,75%	138,46%	2,26%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

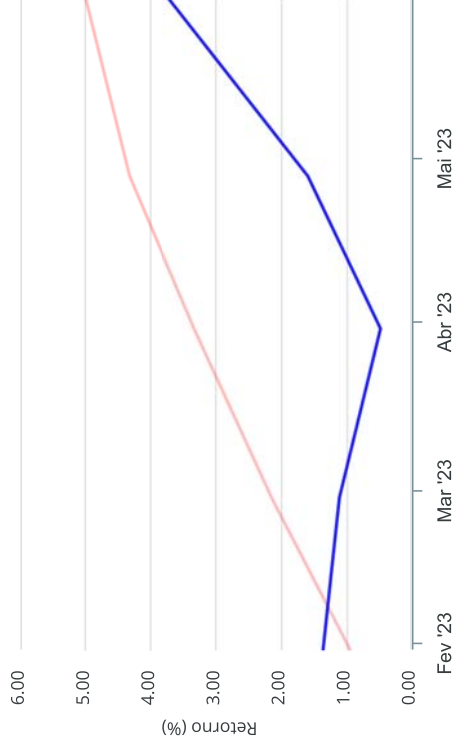




Evolução do Patrimônio



Comparativo



ANO 36M

- Investimentos
- IMA-B 5
- IMA-B 5 +
- IMA-B 1 +
- Meta de Rentabilidade
- IMA Geral
- IMA-B
- CDI
- IRF-M
- 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 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.144.597,20	0,00	0,00	2.195.772,43	51.175,23	2,39%	2,39%	2,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.951.594,34	0,00	0,00	3.017.240,47	65.646,13	2,22%	2,22%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.311.781,45	0,00	0,00	4.402.325,85	90.544,40	2,10%	2,10%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.046.034,97	0,00	0,00	1.064.906,92	18.871,95	1,80%	1,80%	0,95%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.840.155,44	0,00	0,00	3.904.888,18	64.732,74	1,69%	1,69%	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.373.333,83	0,00	0,00	1.395.666,14	22.332,31	1,63%	1,63%	1,64%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.869.254,96	0,00	0,00	5.949.218,98	79.964,02	1,36%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA ZA TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.400.693,90	0,00	0,00	1.415.306,88	14.612,98	1,04%	1,04%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	761.775,01	0,00	0,00	769.628,25	7.853,24	1,03%	1,03%	0,90%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.805.116,93	0,00	1.585.000,00	8.312.669,57	92.552,64	0,94%	1,12%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	3.191.290,71	0,00	0,00	3.221.303,91	30.013,20	0,94%	0,94%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.736.959,96	0,00	0,00	8.818.313,40	81.353,44	0,93%	0,93%	0,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	64.052,05	1.421.882,55	0,00	1.494.445,20	8.510,60	0,57%	1,16%	0,11%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>45.496.640,75</b>	<b>1.421.882,55</b>	<b>1.585.000,00</b>	<b>45.961.686,18</b>	<b>628.162,88</b>	<b>1,38%</b>		<b>0,65%</b>



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 (%)	(%) Insttt	Var - Mês
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.010.099,41	0,00	0,00	1.115.823,70	105.724,29	10,47%	10,47%	7,64%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.692.033,69	0,00	0,00	5.150.643,21	458.609,52	9,77%	9,77%	8,04%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	811.570,29	0,00	0,00	877.936,52	66.366,23	8,18%	8,18%	7,42%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	495.654,22	0,00	0,00	535.464,06	39.809,84	8,03%	8,03%	10,00%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.453.704,44	0,00	0,00	1.570.180,66	116.476,22	8,01%	8,01%	6,95%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	1.430.577,16	0,00	0,00	1.419.156,74	-11.420,42	-0,80%	-0,80%	1,59%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.893.639,21</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>10.669.204,89</b>	<b>775.565,68</b>	<b>7,84%</b>		<b>7,03%</b>



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
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.044.114,30	0,00	0,00	3.088.836,08	44.721,78	1,47%	1,47%	6,71%
<b>Total Exterior</b>	<b>3.044.114,30</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.088.836,08</b>	<b>44.721,78</b>	<b>1,47%</b>		<b>6,71%</b>



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
TÍTULOS PÚBLICOS	5.713.759,19	0,00	76.707,85	5.949.218,98	312.167,64	5,46%	-
CAIXA-BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.174.106,25	0,00	0,00	4.402.325,85	228.219,60	5,47%	5,47%
CAIXA-BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.853.138,45	7.059.578,99	4.800.000,00	8.312.669,57	199.952,13	1,55%	3,25%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.848.844,33	0,00	0,00	3.017.240,47	168.396,14	5,91%	5,91%
CAIXA-BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.743.696,97	0,00	0,00	3.904.888,18	161.191,21	4,31%	4,31%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.048.262,21	0,00	0,00	2.195.772,43	147.510,22	7,20%	7,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.693.166,01	0,00	0,00	8.818.313,40	125.147,39	1,44%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.482.441,59	0,00	4.556.173,52	0,00	73.731,93	1,64%	3,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.013.809,84	0,00	0,00	1.064.906,92	51.097,08	5,04%	5,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.189.000,00	0,00	3.221.303,91	32.303,91	1,01%	-
CAIXA-BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.385.712,09	0,00	0,00	1.415.306,88	29.594,79	2,14%	2,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.367.173,53	0,00	1.395.666,14	28.492,61	2,08%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	750.440,43	0,00	0,00	769.628,25	19.187,82	2,56%	2,56%
CAIXA-BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	62.814,40	1.421.882,55	0,00	1.494.445,20	9.748,25	0,66%	3,15%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>40.770.191,76</b>	<b>13.037.635,07</b>	<b>9.432.881,37</b>	<b>45.961.686,18</b>	<b>1.586.740,72</b>	<b>3,58%</b>	



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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.293.976,99	0,00	0,00	5.150.643,21	856.666,22	19,95%	19,95%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	910.338,78	0,00	0,00	1.115.823,70	205.484,92	22,57%	22,57%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.372.619,36	0,00	0,00	1.570.180,66	197.561,30	14,39%	14,39%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	429.861,25	0,00	0,00	535.464,06	105.602,81	24,57%	24,57%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.958.509,69	0,00	4.060.069,73	0,00	101.560,04	2,57%	4,29%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	780.378,01	0,00	0,00	877.936,52	97.558,51	12,50%	12,50%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	887.517,91	0,00	900.575,79	0,00	13.057,88	1,47%	4,42%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	428.490,85	993.637,15	0,00	1.419.156,74	-2.971,26	-0,21%	0,36%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>13.061.692,84</b>	<b>993.637,15</b>	<b>4.960.645,52</b>	<b>10.669.204,89</b>	<b>1.574.520,42</b>	<b>11,20%</b>	





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 (%)	(%) Insttit
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.968.009,82	0,00	0,00	3.088.836,08	120.826,26	4,07%	4,07%
<b>Total Exterior</b>	<b>2.968.009,82</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.088.836,08</b>	<b>120.826,26</b>	<b>4,07%</b>	



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
TÍTULOS PÚBLICOS	5.605.681,73	0,00	168.465,71	5.949.218,98	512.002,96	9,13%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.472.916,63	121.570,52	243.152,29	8.818.313,40	466.978,54	5,43%	5,56%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.990.026,07	0,00	2.000.000,00	4.402.325,85	412.299,78	6,88%	9,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.638.354,96	12.594.946,85	8.244.000,00	8.312.669,57	323.367,76	1,99%	6,42%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.623.578,45	0,00	0,00	3.904.888,18	281.309,73	7,76%	7,76%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.736.017,75	0,00	0,00	3.017.240,47	281.222,72	10,28%	10,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.324.912,31	0,00	4.556.173,52	0,00	231.261,21	5,35%	6,98%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.972.584,81	0,00	0,00	2.195.772,43	223.187,62	11,31%	11,31%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.327.708,16	0,00	0,00	1.415.306,88	87.598,72	6,60%	6,60%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	979.169,48	0,00	0,00	1.064.906,92	85.737,44	8,76%	8,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	719.348,97	0,00	0,00	769.628,25	50.279,28	6,99%	6,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.189.000,00	0,00	3.221.303,91	32.303,91	1,01%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.367.173,53	0,00	1.395.666,14	28.492,61	2,08%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	60.790,06	1.421.882,55	0,00	1.494.445,20	11.772,59	0,79%	6,59%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>39.451.089,38</b>	<b>18.694.573,45</b>	<b>15.211.791,52</b>	<b>45.961.686,18</b>	<b>3.027.814,87</b>	<b>7,05%</b>	



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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.529.273,79	0,00	0,00	5.150.643,21	621.369,42	13,72%	13,72%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	929.792,70	0,00	0,00	1.115.823,70	186.031,00	20,01%	20,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.916.552,98	0,00	4.060.069,73	0,00	143.516,75	3,66%	5,35%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.487.313,94	0,00	0,00	1.570.180,66	82.866,72	5,57%	5,57%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	473.680,19	0,00	0,00	535.464,06	61.783,87	13,04%	13,04%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	843.682,11	0,00	0,00	877.936,52	34.254,41	4,06%	4,06%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	867.164,50	0,00	900.575,79	0,00	33.411,29	3,85%	6,66%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	408.243,92	993.637,15	0,00	1.419.156,74	17.275,67	1,23%	5,34%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>13.455.704,13</b>	<b>993.637,15</b>	<b>4.960.645,52</b>	<b>10.669.204,89</b>	<b>1.180.509,13</b>	<b>8,17%</b>	



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 (%)	(%) Insttit
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.868.404,23	0,00	0,00	3.088.836,08	220.431,85	7,68%	7,68%
<b>Total Exterior</b>	<b>2.868.404,23</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.088.836,08</b>	<b>220.431,85</b>	<b>7,68%</b>	



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. 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.

