

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	1.100.993,84	2,16%	664	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	7.490.884,96	14,72%	942	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.437.445,36	2,82%	783	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.835.439,11	11,47%	572	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	Não há	4.913.380,19	9,66%	280	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	2.623.117,45	5,15%	86	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	6.718.770,21	13,20%	180	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.240.859,98	8,33%	901	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	309.092,53	0,61%	980	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.864.261,57	7,59%	148	0,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.546.418,94	5,00%	354	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.564.151,43	5,04%	367	0,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	308.574,03	0,61%	607	2,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	190.649,85	0,37%	603	5,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	276.133,56	0,54%	98	0,87%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.179.239,90	2,32%	3.732	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	582.991,52	1,15%	83	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	1.209.931,73	2,38%	156	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.097.724,78	2,16%	123	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.396.970,15	4,71%	443	1,67%	Artigo 8º, Inciso I

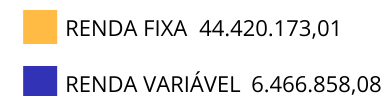
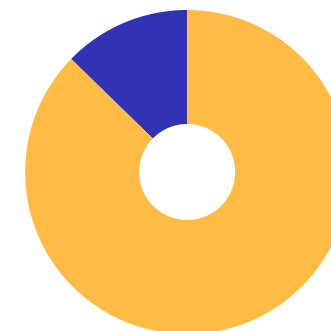


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			50.887.031,09				

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

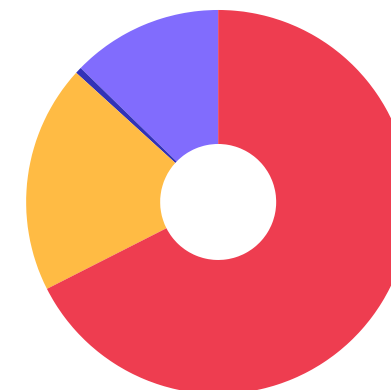
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,01%	81,95%	41.701.921,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	34.360.891,10	67,52%	20,98%	25,97%	81,95%	7.341.030,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	9.783.148,35	19,23%	21,38%	26,51%	60,00%	20.749.070,30
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.177.406,22
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	276.133,56	0,54%	0,00%	0,60%	5,00%	2.268.217,99
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,40%	5,00%	2.544.351,55
Total Renda Fixa	100,00%	44.420.173,01	87,29%	42,36%	77,49%	253,90%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	6.466.858,08	12,71%	1,89%	11,51%	20,00%	3.710.548,14
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	5.088.703,11
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	6.466.858,08	12,71%	1,89%	16,51%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	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%	5.088.703,11
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º III a
 ■ 7º V a
 ■ 8º I

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.087.235,99	41,44	-
CAIXA DTVM	7.131.508,01	14,01	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.718.770,21	13,20	0,03
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.487.379,02	12,75	0,00
SICREDI	5.110.570,37	10,04	0,01
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.396.970,15	4,71	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.179.239,90	2,32	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	499.223,88	0,98	-
PETRA CAPITAL	276.133,56	0,54	0,01

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 %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	34.360.891,10	67,52	20,98	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.783.148,35	19,23	21,38	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	276.133,56	0,54	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	6.466.858,08	12,71	1,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	0,03%
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%	-	-
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-11,49%	-94,73%	-95,03%	-94,73%	-94,13%	-93,05%	15,62%	0,96%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,22%	6,70%	3,27%	6,70%	13,87%	22,56%	0,12%	0,00%
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%	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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,37%	11,21%	7,03%	11,21%	13,18%	17,03%	2,17%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	2,11%	9,60%	5,45%	9,60%	16,62%	19,26%	0,92%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	-15,59%	-87,36%	-88,06%	-87,36%	-85,95%	-83,54%	24,63%	0,88%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,50%	-7,99%	-7,49%	-7,99%	0,83%	-59,45%	-	-

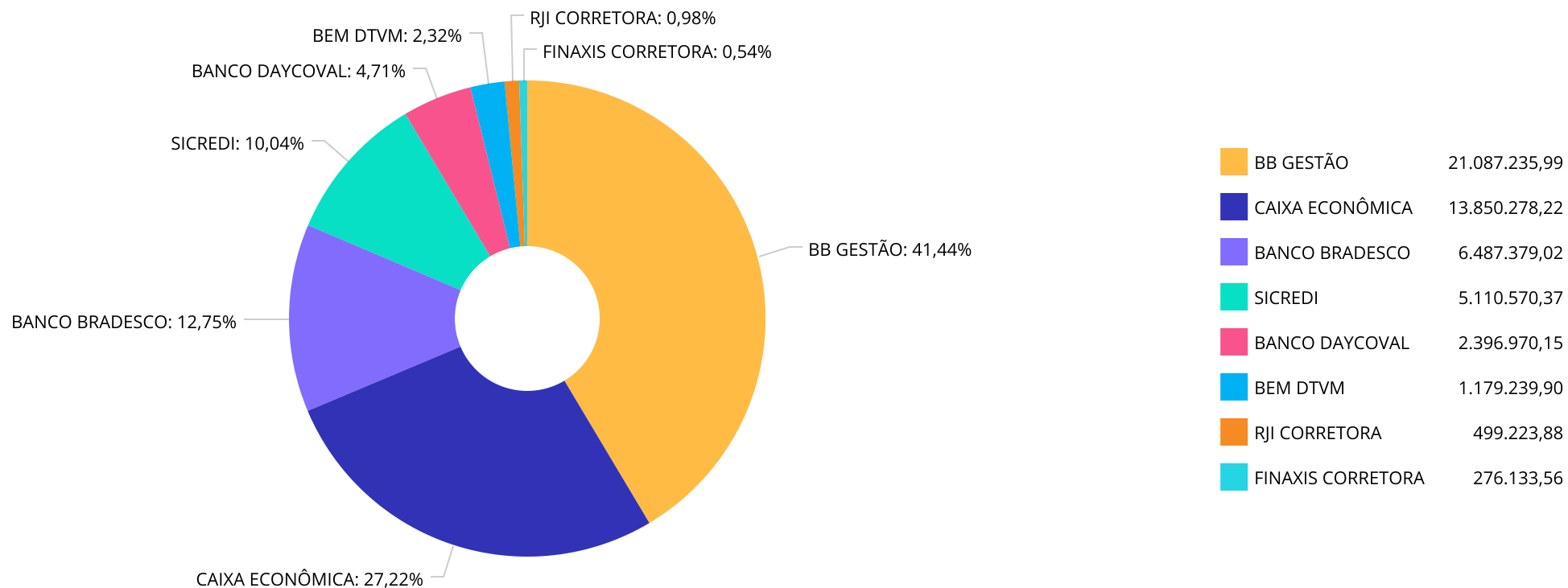
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,01%	9,45%	5,68%	9,45%	14,37%	19,80%	1,19%	0,03%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-

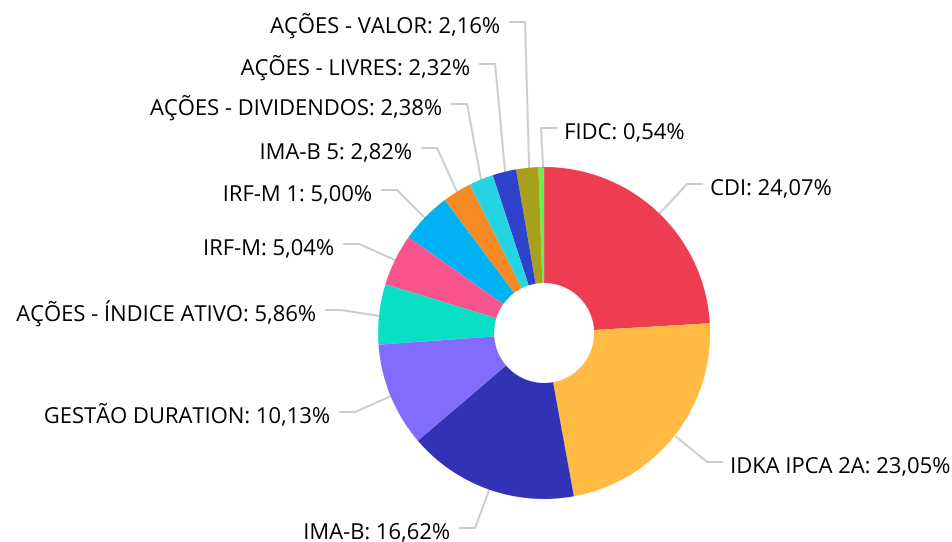
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8,65%	3,42%	12,04%	3,42%	16,88%	-15,20%	7,79%	0,18%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,93%	5,78%	14,56%	5,78%	13,83%	-18,28%	8,64%	0,19%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8,37%	7,39%	15,81%	7,39%	15,11%	-9,65%	7,57%	0,17%
IBX-50 (Benchmark)	8,77%	4,96%	13,79%	4,96%	17,68%	-9,03%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	8,14%	5,47%	12,67%	5,47%	15,97%	-12,72%	7,52%	0,18%
IDIV (Benchmark)	8,78%	9,30%	13,95%	9,30%	17,73%	12,91%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	8,09%	10,12%	15,22%	10,12%	17,90%	3,03%	7,13%	0,15%

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



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

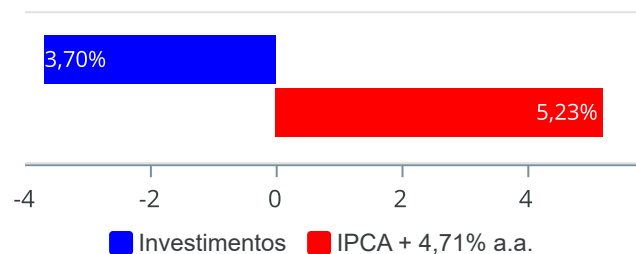


■ CDI	12.249.816,96	■ IDKA IPCA 2A	11.731.744,94	■ IMA-B	8.458.556,56	■ GESTÃO DURATION	5.155.905,26
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.979.961,67	■ IRF-M	2.564.151,43	■ IRF-M 1	2.546.418,94	■ IMA-B 5	1.437.445,36
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.209.931,73	■ AÇÕES - LIVRES	1.179.239,90	■ AÇÕES - VALOR	1.097.724,78	■ FIDC	276.133,56

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	53.016.139,38	1.872.917,36	1.238.814,34	54.413.637,45	763.395,05	763.395,05	1,42%	1,42%	0,93%	0,93%	152,22%	2,19%
Fevereiro	54.413.637,45	1.876.795,63	1.388.953,32	55.017.474,75	115.994,99	879.390,04	0,21%	1,64%	1,17%	2,12%	77,31%	1,92%
Março	55.017.474,75	1.139.579,79	1.376.104,43	55.449.414,48	668.464,37	1.547.854,41	1,22%	2,87%	1,13%	3,28%	87,68%	1,55%
Abril	55.449.414,48	1.528.363,06	1.764.963,14	55.904.879,51	692.065,11	2.239.919,52	1,25%	4,16%	0,94%	4,25%	97,84%	1,55%
Maio	55.904.879,51	13.728.354,17	13.757.359,74	50.597.804,18	-5.278.069,76	-3.038.150,24	-9,44%	-5,68%	0,63%	4,91%	-115,67%	4,06%
Junho	50.597.804,18	876.937,75	1.645.940,35	50.887.031,09	1.058.229,51	-1.979.920,73	2,09%	-3,70%	0,30%	5,23%	-70,88%	2,04%

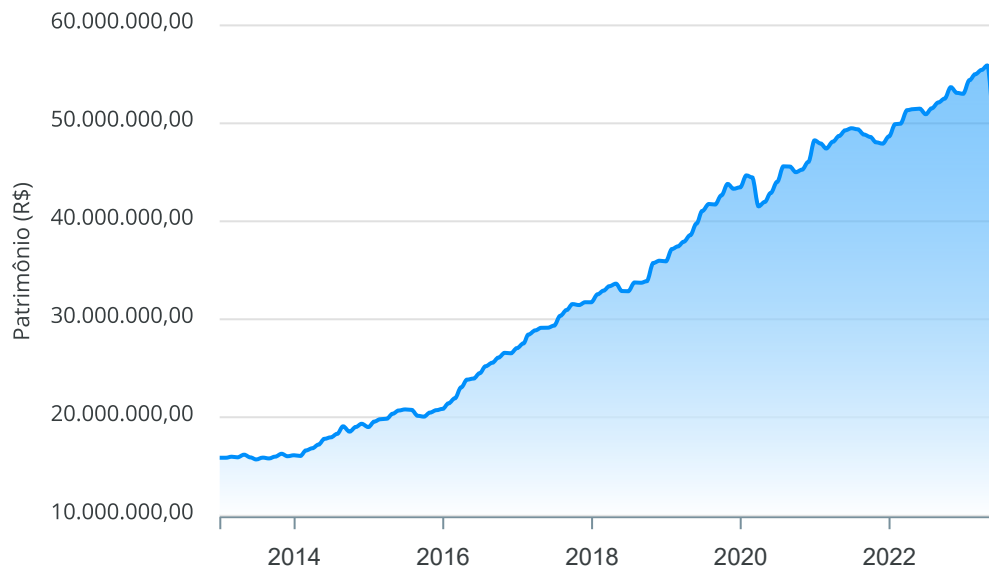
Investimentos x Meta de Rentabilidade



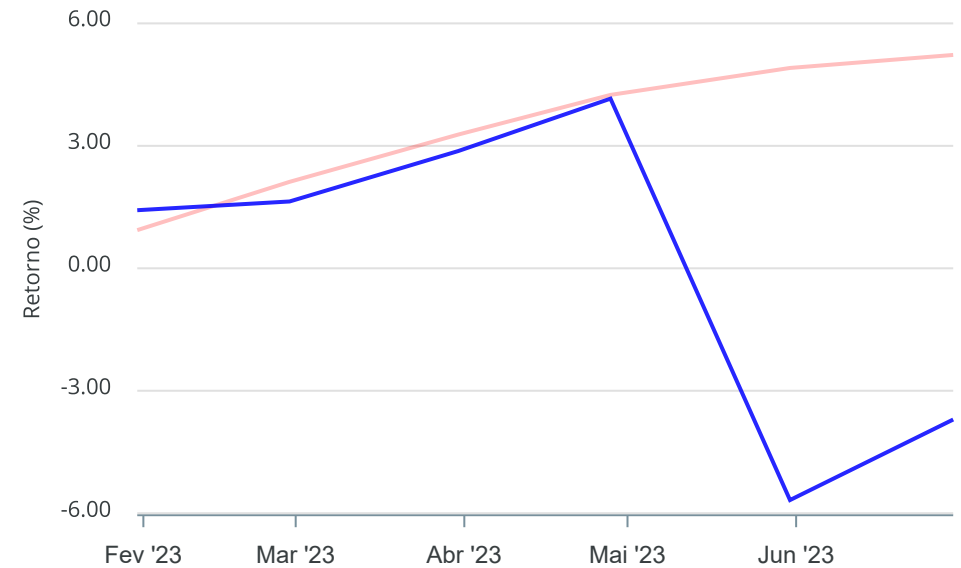
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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...	5.700.226,41	0,00	0,00	5.835.439,11	135.212,70	2,37%	2,37%	2,15%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.562.461,86	0,00	0,00	2.623.117,45	60.655,59	2,37%	2,37%	2,17%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	2.511.228,78	0,00	0,00	2.564.151,43	52.922,65	2,11%	2,11%	0,92%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.788.177,18	0,00	0,00	3.864.261,57	76.084,39	2,01%	2,01%	1,19%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.081.482,36	0,00	0,00	1.100.993,84	19.511,48	1,80%	1,80%	0,95%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.515.800,34	0,00	0,00	2.546.418,94	30.618,60	1,22%	1,22%	0,12%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.197.073,31	0,00	0,00	4.240.859,98	43.786,67	1,04%	1,04%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.422.777,75	0,00	0,00	1.437.445,36	14.667,61	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.415.285,96	0,00	0,00	7.490.884,96	75.599,00	1,02%	1,02%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	4.867.601,75	0,00	0,00	4.913.380,19	45.778,44	0,94%	0,94%	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.656.270,43	0,00	0,00	6.718.770,21	62.499,78	0,94%	0,94%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.070.594,95	876.937,75	1.645.940,35	309.092,53	7.500,18	0,39%	1,00%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	277.526,68	0,00	0,00	276.133,56	-1.393,12	-0,50%	-	-
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	215.408,00	0,00	0,00	190.649,85	-24.758,15	-11,49%	-11,49%	15,62%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	365.581,49	0,00	0,00	308.574,03	-57.007,46	-15,59%	-15,59%	24,63%
Total Renda Fixa	44.647.497,25	876.937,75	1.645.940,35	44.420.173,01	541.678,36	1,21%		1,21%

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	1.072.761,18	0,00	0,00	1.179.239,90	106.478,72	9,93%	9,93%	8,64%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2.206.124,49	0,00	0,00	2.396.970,15	190.845,66	8,65%	8,65%	7,79%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.012.906,11	0,00	0,00	1.097.724,78	84.818,67	8,37%	8,37%	7,57%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	539.100,80	0,00	0,00	582.991,52	43.890,72	8,14%	8,14%	7,52%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.119.414,35	0,00	0,00	1.209.931,73	90.517,38	8,09%	8,09%	7,13%
Total Renda Variável	5.950.306,93	0,00	0,00	6.466.858,08	516.551,15	8,68%		7,76%

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...	5.447.992,24	0,00	0,00	5.835.439,11	387.446,87	7,11%	7,11%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.656.559,68	0,00	0,00	3.864.261,57	207.701,89	5,68%	5,68%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.450.825,45	0,00	0,00	2.623.117,45	172.292,00	7,03%	7,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.336.870,95	0,00	0,00	7.490.884,96	154.014,01	2,10%	2,10%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	2.431.687,14	0,00	0,00	2.564.151,43	132.464,29	5,45%	5,45%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.554.064,63	0,00	6.658.143,75	0,00	104.079,12	1,59%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.152.181,44	0,00	0,00	4.240.859,98	88.678,54	2,14%	2,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.940.950,25	0,00	5.022.224,23	0,00	81.273,98	1,64%	3,22%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.465.828,98	0,00	0,00	2.546.418,94	80.589,96	3,27%	3,27%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	6.658.188,67	0,00	6.718.770,21	60.581,54	0,91%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.048.165,22	0,00	0,00	1.100.993,84	52.828,62	5,04%	5,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	4.869.121,70	0,00	4.913.380,19	44.258,49	0,91%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.401.607,99	0,00	0,00	1.437.445,36	35.837,37	2,56%	2,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.158.537,69	4.606.344,61	5.487.895,25	309.092,53	32.105,48	0,56%	2,90%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	298.473,05	0,00	0,00	276.133,56	-22.339,49	-7,48%	-7,48%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	2.584.614,44	0,00	0,00	308.574,03	-2.276.040,41	-88,06%	-88,06%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	3.836.896,45	0,00	0,00	190.649,85	-3.646.246,60	-95,03%	-95,03%
Total Renda Fixa	49.765.255,60	16.133.654,98	17.168.263,23	44.420.173,01	-4.310.474,34	-6,54%	

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
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	2.139.414,65	0,00	0,00	2.396.970,15	257.555,50	12,04%	12,04%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.050.123,17	0,00	0,00	1.209.931,73	159.808,56	15,22%	15,22%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	947.840,61	0,00	0,00	1.097.724,78	149.884,17	15,81%	15,81%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.029.361,15	0,00	0,00	1.179.239,90	149.878,75	14,56%	14,56%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	517.419,30	0,00	0,00	582.991,52	65.572,22	12,67%	12,67%
Total Renda Variável	5.684.158,88	0,00	0,00	6.466.858,08	782.699,20	13,77%	

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...	5.243.932,36	0,00	0,00	5.835.439,11	591.506,75	11,28%	11,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.029.593,79	0,00	0,00	7.490.884,96	461.291,17	6,56%	6,56%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.530.515,23	0,00	0,00	3.864.261,57	333.746,34	9,45%	9,45%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.324.421,21	0,00	6.658.143,75	0,00	333.722,54	5,28%	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.358.816,13	0,00	0,00	2.623.117,45	264.301,32	11,20%	11,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.978.377,02	0,00	0,00	4.240.859,98	262.482,96	6,60%	6,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.767.307,31	0,00	5.022.224,23	0,00	254.916,92	5,35%	6,98%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	2.339.461,26	0,00	0,00	2.564.151,43	224.690,17	9,60%	9,60%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.386.601,62	0,00	0,00	2.546.418,94	159.817,32	6,70%	6,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.343.538,05	0,00	0,00	1.437.445,36	93.907,31	6,99%	6,99%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.012.350,99	0,00	0,00	1.100.993,84	88.642,85	8,76%	8,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	237.762,25	9.495.637,39	9.491.767,34	309.092,53	67.460,23	0,69%	5,98%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	6.658.188,67	0,00	6.718.770,21	60.581,54	0,91%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	4.869.121,70	0,00	4.913.380,19	44.258,49	0,91%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	300.111,43	0,00	0,00	276.133,56	-23.977,87	-7,99%	-7,99%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	2.441.436,09	0,00	0,00	308.574,03	-2.132.862,06	-87,36%	-87,36%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	3.615.689,53	0,00	0,00	190.649,85	-3.425.039,68	-94,73%	-94,73%
Total Renda Fixa	46.909.914,27	21.022.947,76	21.172.135,32	44.420.173,01	-2.340.553,70	-3,45%	

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 EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.098.785,90	0,00	0,00	1.209.931,73	111.145,83	10,12%	10,12%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2.317.735,65	0,00	0,00	2.396.970,15	79.234,50	3,42%	3,42%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.022.147,32	0,00	0,00	1.097.724,78	75.577,46	7,39%	7,39%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.114.797,01	0,00	0,00	1.179.239,90	64.442,89	5,78%	5,78%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	552.759,23	0,00	0,00	582.991,52	30.232,29	5,47%	5,47%
Total Renda Variável	6.106.225,11	0,00	0,00	6.466.858,08	360.632,97	5,91%	

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. 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.

