

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	8.620.379,86	7,62%	664	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.192.423,85	1,05%	572	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.664.967,78	2,36%	1.136	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	3.028.434,35	2,68%	280	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.896.133,78	2,56%	75	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.911.253,01	5,23%	773	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	9.391.440,69	8,30%	901	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.867.567,20	2,54%	927	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	13.536.161,77	11,97%	1.186	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.431.430,24	3,92%	352	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.361.964,82	2,09%	1.525	1,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.354.701,95	1,20%	148	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.293.812,06	3,80%	139	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.363.179,26	3,86%	118	0,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	75.877,26	0,07%	352	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	6.045.808,05	5,35%	228	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.708.877,28	1,51%	208	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	2.984.312,35	2,64%	31	1,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	43.461,90	0,04%	603	1,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.054.217,35	6,24%	3.044	0,53%	Artigo 8º, Inciso I

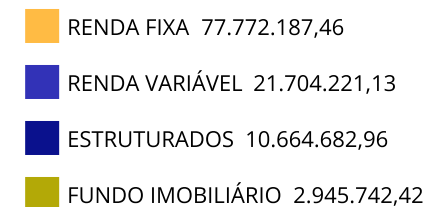
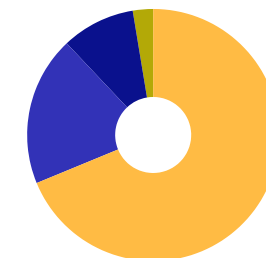


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.118.916,75	2,76%	2.815	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.301.958,96	2,92%	53	5,67%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	8.229.128,07	7,28%	2.068	2,57%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	2.899.073,17	2,56%	3.078	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	2.371.368,91	2,10%	27	2,66%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	5.394.240,88	4,77%	22	3,96%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	797.417,76	0,71%		1,08%	Artigo 11º
MACAM SHOPPING FII	Não se ...	Não se aplica	2.148.324,66	1,90%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			113.086.833,97				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			86.078,97				Artigo 6º
		PL Total	113.172.912,94				

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%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	81,95%	92.674.660,44
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	56.902.157,35	50,32%	20,49%	26,05%	81,95%	35.772.503,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	20.870.030,11	18,45%	20,89%	23,95%	60,00%	46.982.070,27
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	22.617.366,79
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	5.654.341,70
Total Renda Fixa	100,00%	77.772.187,46	68,77%	41,38%	68,00%	248,90%	



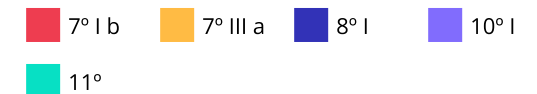
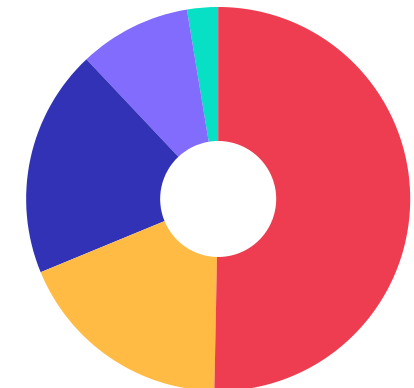
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	21.704.221,13	19,19%	1,89%	18,80%	20,00%	913.145,66
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.664.682,96	9,43%	3,75%	9,20%	10,00%	644.000,44
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.654.341,70
Artigo 11º	5,00%	2.945.742,42	2,60%	0,50%	1,00%	5,00%	2.708.599,28
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	35.314.646,51	31,23%	6,14%	30,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 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%	2,00%	10,00%	11.308.683,40
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	49.521.790,65	43,79	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.506.205,84	13,71	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	8.544.647,79	7,56	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	8.378.553,23	7,41	0,09
SOMMA INVESTIMENTOS	8.229.128,07	7,28	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	7.054.217,35	6,24	0,02
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	4.733.333,73	4,19	0,04
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.301.958,96	2,92	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.118.916,75	2,76	0,17
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	2.148.324,66	1,90	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.708.877,28	1,51	-
ZION INVEST	797.417,76	0,71	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	43.461,90	0,04	-

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 '	56.902.157,35	50,32	20,49	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	20.870.030,11	18,45	20,89	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	21.704.221,13	19,19	1,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	10.664.682,96	9,43	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,50	5,00
Artigo 11º	2.945.742,42	2,60	0,50	5,00

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 PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	2,24%	10,02%	5,43%	10,02%	16,97%	17,54%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2,22%	9,79%	5,38%	9,79%	16,41%	16,40%	1,06%	0,04%
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%
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%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	6,59%	3,15%	6,59%	13,58%	21,47%	0,11%	0,00%
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%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,03%	6,94%	2,52%	6,94%	9,94%	20,35%	0,90%	0,02%
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%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,51%	11,47%	7,48%	11,47%	13,21%	17,04%	2,29%	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,37%	11,29%	7,16%	11,29%	13,23%	17,19%	2,15%	0,05%

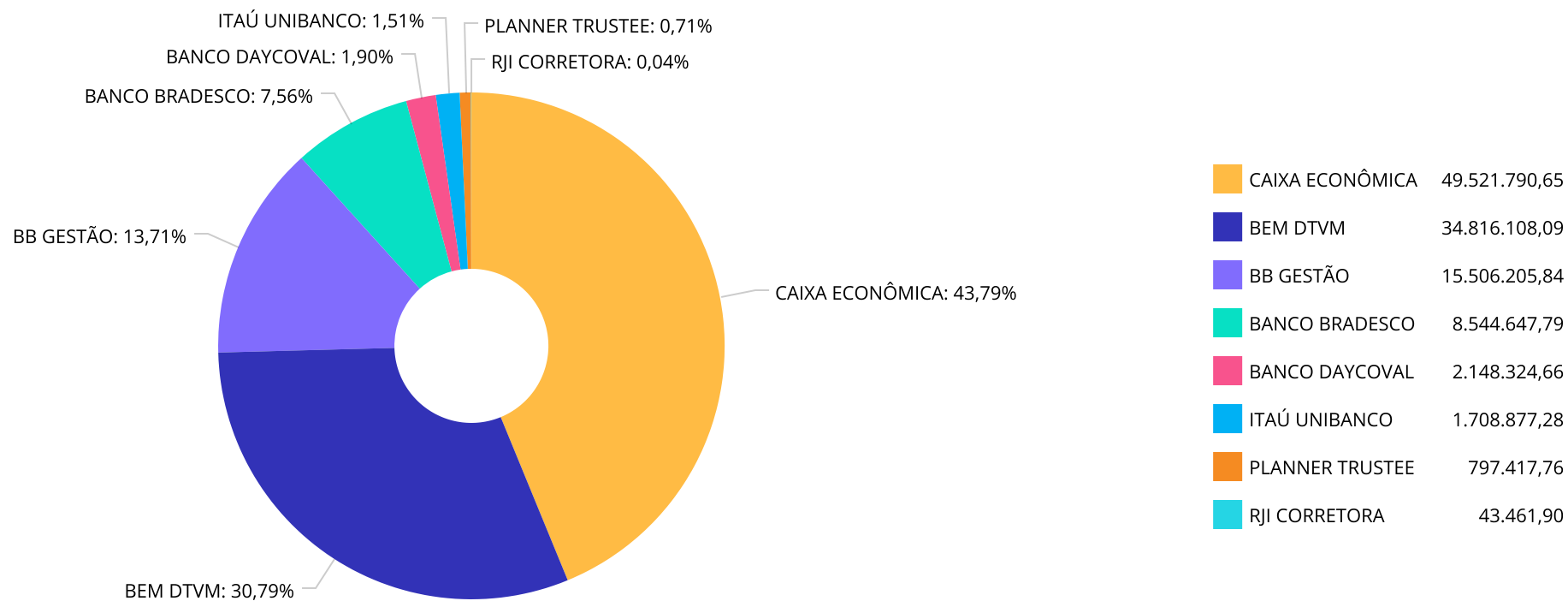
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IRF-M (Benchmark)	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,10%	9,56%	5,47%	9,56%	16,61%	18,51%	0,90%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	5,64%	2,77%	5,64%	11,68%	19,63%	0,00%	0,00%
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%	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	-0,57%	-	-	-	-	-	4,33%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,69%	7,76%	4,31%	7,76%	13,75%	19,35%	0,56%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,01%	9,45%	5,68%	9,45%	14,37%	19,80%	1,19%	0,03%

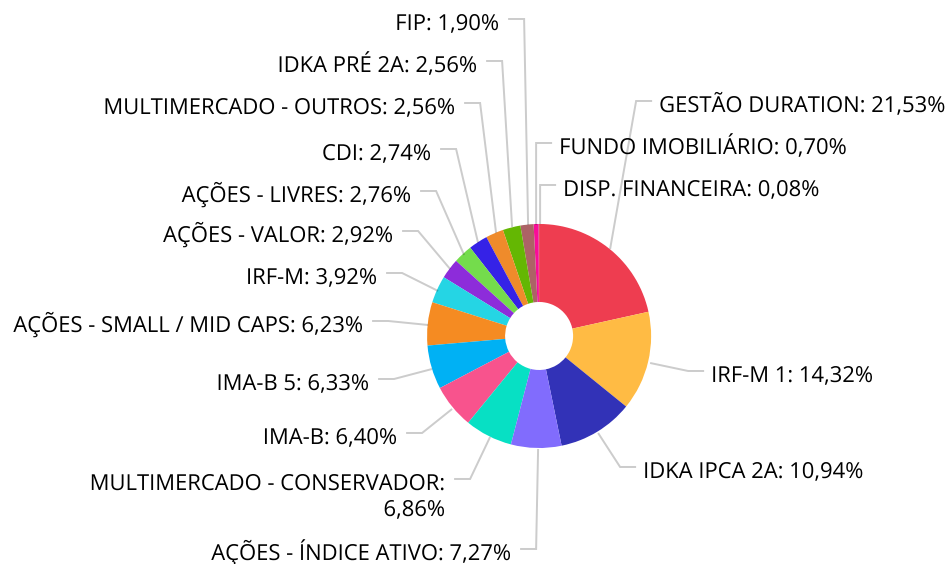
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	1,27%	6,00%	3,14%	6,00%	12,10%	21,02%	0,40%	0,01%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,22%	6,56%	3,37%	6,56%	13,54%	24,64%	0,21%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,96%	1,86%	14,48%	1,86%	12,06%	-17,44%	7,92%	0,18%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3,96%	5,52%	6,65%	5,52%	12,62%	-	3,44%	0,06%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	13,91%	27,44%	36,11%	27,44%	-4,93%	-31,68%	11,73%	0,36%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8,16%	11,84%	18,12%	11,84%	17,01%	-3,57%	7,14%	0,18%
IFIX (Benchmark)	4,71%	10,05%	14,28%	10,05%	12,87%	14,54%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	7,29%	-26,95%	-8,44%	-26,95%	-50,48%	154,32%	14,96%	0,31%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,56%	6,84%	2,66%	6,84%	11,38%	34,59%	-	-
MACAM SHOPPING FII	-	-	-	-	-	-	-	-
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)

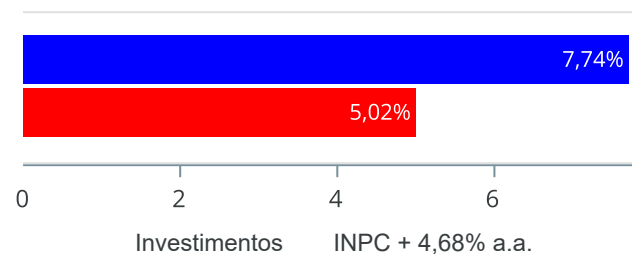


■ GESTÃO DURATION	24.363.818,08	■ IRF-M 1	16.201.129,55	■ IDKA IPCA 2A	12.375.753,04
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	8.229.128,07	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	7.765.609,79	■ IMA-B	7.238.231,90
■ IMA-B 5	7.161.379,26	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.054.217,35	■ IRF-M	4.431.430,24
■ AÇÕES - VALOR	3.301.958,96	■ AÇÕES - LIVRES	3.118.916,75	■ CDI	3.104.311,61
■ MULTIMERCADO - OUTROS	2.899.073,17	■ IDKA PRÉ 2A	2.896.133,78	■ FIP	2.148.324,66
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	797.417,76	■ DISP. FINANCEIRA	86.078,97		

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	105.458.142,39	465.011,24	1.499.830,53	106.753.952,51	2.330.629,41	2.330.629,41	2,21%	2,21%	0,86%	0,86%	256,40%	2,61%
Fevereiro	106.753.952,51	1.513.545,40	1.445.545,04	106.256.532,65	-565.420,22	1.765.209,19	-0,53%	1,67%	1,10%	1,97%	84,67%	2,38%
Março	106.256.532,65	1.731.987,30	1.553.553,58	107.124.647,15	689.680,78	2.454.889,97	0,65%	2,33%	1,06%	3,05%	76,24%	2,08%
Abril	107.124.647,15	946.584,79	1.314.870,47	107.919.225,38	1.162.863,91	3.617.753,88	1,09%	3,44%	0,86%	3,94%	87,31%	1,95%
Mai	107.919.225,38	10.528.474,73	9.862.935,05	109.909.767,08	1.325.002,02	4.942.755,90	1,22%	4,70%	0,76%	4,73%	99,39%	2,08%
Junho	109.909.767,08	4.517.835,63	4.532.751,81	113.086.833,97	3.191.983,07	8.134.738,97	2,90%	7,74%	0,28%	5,02%	154,07%	2,72%

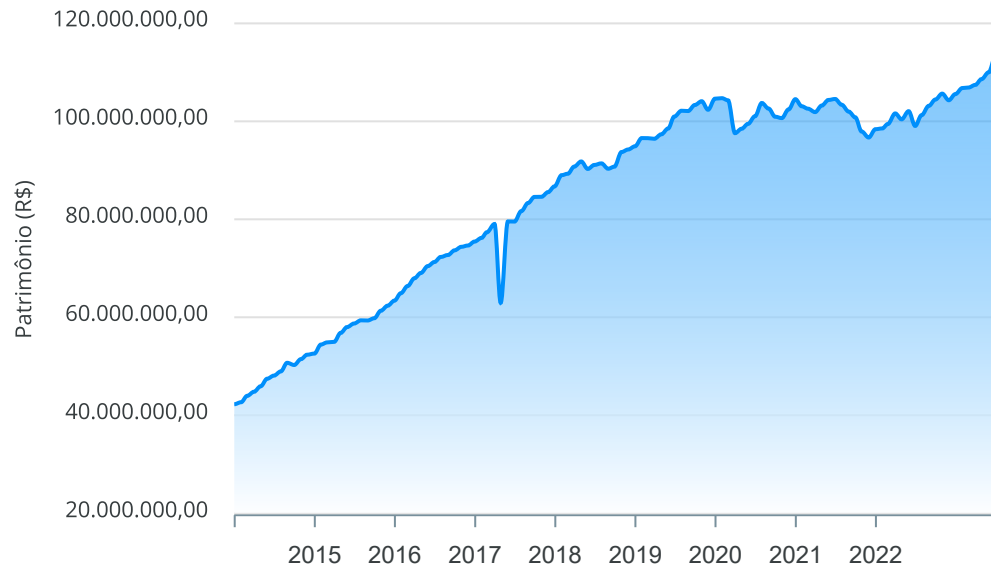
Investimentos x Meta de Rentabilidade



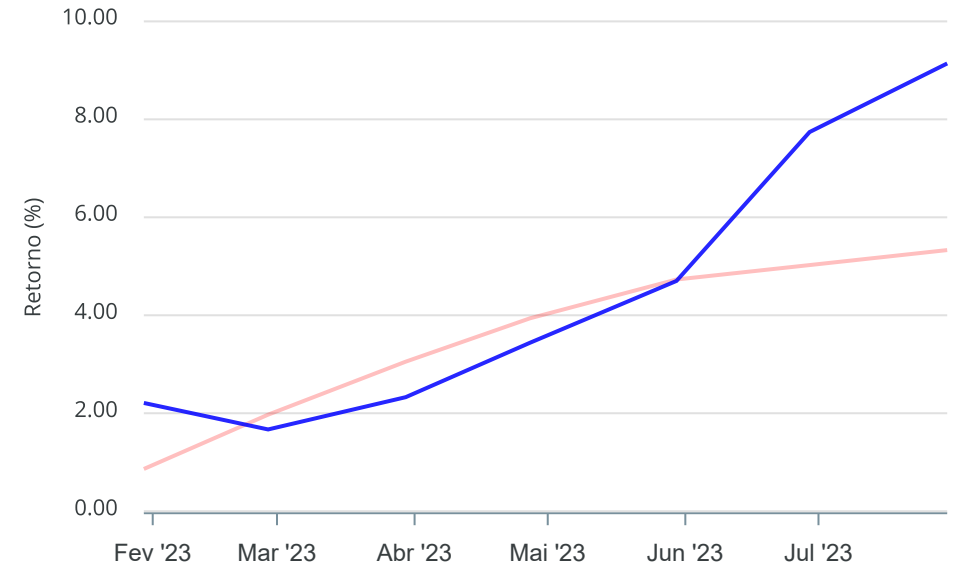
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.304.168,59	0,00	0,00	2.361.964,82	57.796,23	2,51%	2,51%	2,29%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	5.905.628,03	0,00	0,00	6.045.808,05	140.180,02	2,37%	2,37%	2,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.160.745,47	7.835,63	3.788,40	1.192.423,85	27.631,15	2,36%	2,37%	2,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.671.697,22	0,00	0,00	1.708.877,28	37.180,06	2,22%	2,22%	1,33%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.833.261,77	0,00	0,00	2.896.133,78	62.872,01	2,22%	2,22%	1,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.789.398,83	0,00	0,00	5.911.253,01	121.854,18	2,10%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.340.287,25	0,00	0,00	4.431.430,24	91.142,99	2,10%	2,10%	0,90%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.328.028,89	0,00	0,00	1.354.701,95	26.673,06	2,01%	2,01%	1,19%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.467.612,15	0,00	0,00	8.620.379,86	152.767,71	1,80%	1,80%	0,95%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.290.849,27	0,00	0,00	4.363.179,26	72.329,99	1,69%	1,69%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.381.212,25	0,00	0,00	13.536.161,77	154.949,52	1,16%	1,16%	0,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.294.474,54	0,00	0,00	9.391.440,69	96.966,15	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.838.288,77	0,00	0,00	2.867.567,20	29.278,43	1,03%	1,03%	0,88%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	4.249.995,61	0,00	0,00	4.293.812,06	43.816,45	1,03%	1,03%	0,90%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	75.134,83	0,00	0,00	75.877,26	742,43	0,99%	0,99%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	3.000.218,13	0,00	0,00	3.028.434,35	28.216,22	0,94%	0,94%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.646.074,33	1.510.000,00	4.528.963,41	2.664.967,78	37.856,86	0,53%	1,16%	0,10%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	3.001.408,33	0,00	0,00	2.984.312,35	-17.095,98	-0,57%	-0,57%	4,33%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	49.105,95	0,00	0,00	43.461,90	-5.644,05	-11,49%	-11,49%	15,62%
Total Renda Fixa	79.627.590,21	1.517.835,63	4.532.751,81	77.772.187,46	1.159.513,43	1,46%		1,01%



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
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.898.637,92	0,00	0,00	3.301.958,96	403.321,04	13,91%	13,91%	11,73%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.474.005,44	0,00	0,00	7.054.217,35	580.211,91	8,96%	8,96%	9,11%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7.622.717,49	0,00	0,00	8.229.128,07	606.410,58	7,96%	7,96%	7,92%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	743.224,32	0,00	0,00	797.417,76	54.193,44	7,29%	7,29%	14,96%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.118.916,75	118.916,75	3,96%	8,16%	7,14%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5.188.589,07	0,00	0,00	5.394.240,88	205.651,81	3,96%	3,96%	3,44%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.341.631,27	0,00	0,00	2.371.368,91	29.737,64	1,27%	1,27%	0,40%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.864.065,32	0,00	0,00	2.899.073,17	35.007,85	1,22%	1,22%	0,21%
MACAM SHOPPING FII	2.149.306,04	0,00	0,00	2.148.324,66	-981,38	-0,05%	-	-
Total Renda Variável	30.282.176,87	3.000.000,00	0,00	35.314.646,51	2.032.469,64	6,11%		6,71%



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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.206.751,04	0,00	0,00	8.620.379,86	413.628,82	5,04%	5,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.122.652,46	0,00	0,00	13.536.161,77	413.509,31	3,15%	3,15%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	5.641.715,43	0,00	0,00	6.045.808,05	404.092,62	7,16%	7,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.637.533,53	0,00	0,00	5.911.253,01	273.719,48	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.201.701,85	0,00	0,00	4.431.430,24	229.728,39	5,47%	5,47%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	10.657.102,39	0,00	6.563.000,00	4.293.812,06	199.709,67	1,87%	2,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.195.060,89	0,00	0,00	9.391.440,69	196.379,80	2,14%	2,14%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.183.070,11	0,00	0,00	4.363.179,26	180.109,15	4,31%	4,31%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.197.586,64	0,00	0,00	2.361.964,82	164.378,18	7,48%	7,48%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.748.232,87	0,00	0,00	2.896.133,78	147.900,91	5,38%	5,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.613.502,60	0,00	0,00	1.708.877,28	95.374,68	5,91%	5,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.291.095,51	6.977.933,38	6.690.045,48	2.664.967,78	85.984,37	0,93%	3,14%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.111.519,12	14.817,57	13.158,20	1.192.423,85	79.245,36	7,04%	7,11%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.281.887,48	0,00	0,00	1.354.701,95	72.814,47	5,68%	5,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.795.755,06	0,00	0,00	2.867.567,20	71.812,14	2,57%	2,57%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.400.141,96	0,00	2.444.353,65	0,00	44.211,69	1,84%	3,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.000.000,00	0,00	3.028.434,35	28.434,35	0,95%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	73.687,73	144,20	0,00	75.877,26	2.045,33	2,77%	2,77%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	0,00	2.984.312,35	-15.687,65	-0,52%	-
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	874.686,39	0,00	0,00	43.461,90	-831.224,49	-95,03%	-95,03%



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
Total Renda Fixa	78.233.683,06	12.992.895,15	15.710.557,33	77.772.187,46	2.256.166,58	2,47%	



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
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7.188.558,07	0,00	0,00	8.229.128,07	1.040.570,00	14,48%	14,48%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.084.942,57	0,00	0,00	7.054.217,35	969.274,78	15,93%	15,93%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.426.040,87	0,00	0,00	3.301.958,96	875.918,09	36,10%	36,10%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5.057.979,10	0,00	0,00	5.394.240,88	336.261,78	6,65%	6,65%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.118.916,75	118.916,75	3,96%	18,12%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.804.547,72	0,00	0,00	2.899.073,17	94.525,45	3,37%	3,37%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.299.285,94	0,00	0,00	2.371.368,91	72.082,97	3,14%	3,14%
MACAM SHOPPING FII	2.158.643,82	0,00	0,00	2.148.324,66	-10.319,16	-0,48%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	870.966,00	0,00	0,00	797.417,76	-73.548,24	-8,44%	-8,44%
Total Renda Variável	28.890.964,09	3.000.000,00	0,00	35.314.646,51	3.423.682,42	10,74%	

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.699.745,22	0,00	0,00	13.536.161,77	836.416,55	6,59%	6,59%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	7.926.338,06	0,00	0,00	8.620.379,86	694.041,80	8,76%	8,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	10.217.061,13	0,00	6.563.000,00	4.293.812,06	639.750,93	6,26%	6,94%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	5.432.475,52	0,00	0,00	6.045.808,05	613.332,53	11,29%	11,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.810.168,87	0,00	0,00	9.391.440,69	581.271,82	6,60%	6,60%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.460.208,98	0,00	0,00	5.911.253,01	451.044,03	8,26%	8,26%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.044.922,41	0,00	0,00	4.431.430,24	386.507,83	9,56%	9,56%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.048.854,06	0,00	0,00	4.363.179,26	314.325,20	7,76%	7,76%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.637.906,07	0,00	0,00	2.896.133,78	258.227,71	9,79%	9,79%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.118.931,01	0,00	0,00	2.361.964,82	243.033,81	11,47%	11,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.864.329,24	9.787.342,90	11.181.397,83	2.664.967,78	194.693,47	1,43%	6,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.679.876,91	0,00	0,00	2.867.567,20	187.690,29	7,00%	7,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.549.600,90	0,00	0,00	1.708.877,28	159.276,38	10,28%	10,28%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.323.624,63	0,00	2.444.353,65	0,00	120.729,02	5,20%	6,57%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.237.699,82	0,00	0,00	1.354.701,95	117.002,13	9,45%	9,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	188.657,93	915.951,99	20.735,00	1.192.423,85	108.548,93	9,83%	11,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.000.000,00	0,00	3.028.434,35	28.434,35	0,95%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	71.689,62	144,20	0,00	75.877,26	4.043,44	5,63%	5,64%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	0,00	2.984.312,35	-15.687,65	-0,52%	-
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	824.258,48	0,00	0,00	43.461,90	-780.796,58	-94,73%	-94,73%



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
Total Renda Fixa	76.136.348,86	16.703.439,09	20.209.486,48	77.772.187,46	5.141.885,99	5,54%	

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
MACAM SHOPPING FII	1.054.381,01	0,00	0,00	2.148.324,66	1.093.943,65	103,75%	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.590.910,55	0,00	0,00	3.301.958,96	711.048,41	27,44%	27,44%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.436.740,55	0,00	0,00	7.054.217,35	617.476,80	9,59%	9,59%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5.111.976,36	0,00	0,00	5.394.240,88	282.264,52	5,52%	5,52%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.720.535,64	0,00	0,00	2.899.073,17	178.537,53	6,56%	6,56%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	8.078.534,38	0,00	0,00	8.229.128,07	150.593,69	1,86%	1,86%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.237.104,32	0,00	0,00	2.371.368,91	134.264,59	6,00%	6,00%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.118.916,75	118.916,75	3,96%	11,84%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.091.610,72	0,00	0,00	797.417,76	-294.192,96	-26,95%	-26,95%
Total Renda Variável	29.321.793,53	3.000.000,00	0,00	35.314.646,51	2.992.852,98	9,26%	

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.

