

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

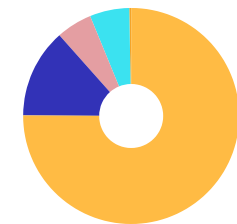
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			540.082.065,57	70,41%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.760.030,64	1,66%	927	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.208.396,89	0,16%	723	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	17.751.482,88	2,31%	1.004	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	782.879,13	0,10%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.599.586,19	0,34%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	D+1260	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	803.939,19	0,10%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	21.994.995,44	2,87%	21.398	1,61%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.103.523,70	0,40%	184	0,44%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	20.911.920,70	2,73%	17.026	1,14%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	11.143.094,73	1,45%	83	2,63%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	14.576.786,10	1,90%	1.256	1,13%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	17.650.926,77	2,30%	2.068	5,50%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	12.521.137,25	1,63%	3.306	13,14%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	8.507.122,63	1,11%	2.968	3,62%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	9.268.062,54	1,21%	8.888	1,42%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	12.666.981,12	1,65%	4.967	1,99%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	10.705.611,28	1,40%	491	0,53%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	18.246.132,45	2,38%	6.968	1,14%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	19.244.323,31	2,51%	653	1,70%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.121.302,33	0,28%	3.117	1,13%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	748.234,89	0,10%	17	2,71%	Artigo 10º, Inciso II
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	758.026,25	0,10%	22	0,56%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	4.292.795,26	0,56%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.192.379,22	0,29%		1,55%	Artigo 11º
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	435.006,84	0,06%		0,46%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			767.076.743,31				

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%	540.082.065,57	70,41%	30,00%	60,00%	80,00%	73.579.329,08
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	13.968.427,53	1,82%	0,00%	8,00%	60,00%	446.277.618,46
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.353.837,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	18.534.362,01	2,42%	0,00%	4,00%	30,00%	211.588.660,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	76.707.674,33
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	76.707.674,33
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	3.403.525,39	0,44%	0,00%	1,00%	5,00%	34.950.311,78
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.353.837,17
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.353.837,17
Total Renda Fixa	100,00%	575.988.380,50	75,09%	30,00%	73,00%	210,00%	

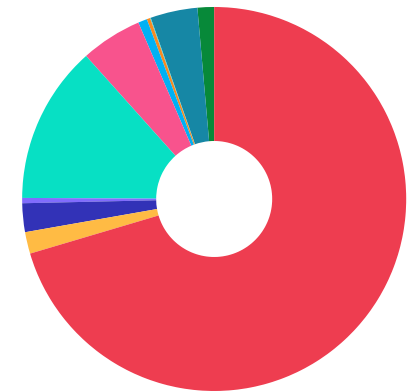


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

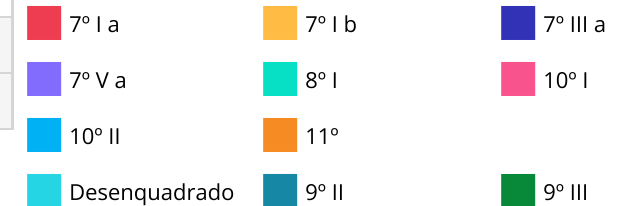


Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2023)

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%	101.902.384,69	13,28%	5,00%	15,00%	40,00%	204.928.312,63
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	76.707.674,33
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	39.611.758,09	5,16%	0,00%	5,00%	10,00%	37.095.916,24
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	5.799.056,40	0,76%	0,00%	1,00%	5,00%	32.554.780,77
Artigo 11º	10,00%	2.192.379,22	0,29%	0,00%	0,50%	5,00%	36.161.457,95
Desenquadrado - RV	0,00%	435.006,84	0,06%	0,00%	0,00%	0,00%	-435.006,84
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	149.940.585,24	19,55%	5,00%	21,50%	70,00%	



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%	30.442.166,29	3,97%	0,00%	4,00%	10,00%	46.265.508,04
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	10.705.611,28	1,40%	0,00%	1,50%	5,00%	27.648.225,89
Total Exterior	10,00%	41.147.777,57	5,36%	0,00%	5,50%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	540.082.065,57	70,41	-
CAIXA DTVM	63.775.177,84	8,31	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.994.995,44	2,87	-
ITAÚ DTVM	20.911.920,70	2,73	0,00
ITAÚ UNIBANCO	19.244.323,31	2,51	0,00
XP ASSET MANAGEMENT	17.775.185,17	2,32	-
SOMMA INVESTIMENTOS	17.650.926,77	2,30	-
NAVI CAPITAL	14.576.786,10	1,90	1,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	12.666.981,12	1,65	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	12.521.137,25	1,63	0,03
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	11.143.094,73	1,45	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	6.378.783,73	0,83	2,50
KPTL	4.292.795,26	0,56	1,20
SICREDI	2.121.302,33	0,28	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.506.261,14	0,20	-
CADENCE GESTORA	435.006,84	0,06	-
GENIAL GESTÃO LTDA	0,01	0,00	-

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'	540.082.065,57	70,41	30,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	13.968.427,53	1,82	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	18.534.362,01	2,42	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	3.403.525,39	0,44	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	101.902.384,69	13,28	5,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	30.442.166,29	3,97	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	10.705.611,28	1,40	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	39.611.758,09	5,16	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	5.799.056,40	0,76	0,00	5,00
Artigo 11º	2.192.379,22	0,29	0,00	5,00
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
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,48%	6,35%	2,42%	6,35%	10,35%	32,11%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,05%	-2,62%	0,27%	-2,62%	-11,08%	-19,17%	0,30%	0,03%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,38%	-1,05%	-0,99%	-1,05%	-0,38%	3,65%	-	-
120% do CDI (Benchmark)	1,29%	7,85%	3,79%	7,85%	16,46%	28,66%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	7,00%	2,57%	7,00%	10,18%	21,01%	0,88%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,31%	2,76%	1,37%	2,76%	5,69%	4,84%	0,28%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35%	11,24%	7,06%	11,24%	13,32%	17,31%	2,12%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12%	6,42%	3,25%	6,42%	13,55%	23,98%	0,01%	0,00%

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
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,77%	13,72%	19,95%	13,72%	20,91%	2,63%	8,04%	0,18%
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	5,27%	-1,57%	7,34%	-1,57%	13,35%	-15,61%	7,12%	0,19%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,24%	4,73%	16,62%	4,73%	14,29%	-4,39%	8,49%	0,20%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,75%	3,91%	15,52%	3,91%	5,48%	-28,99%	7,86%	0,24%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8,96%	5,17%	14,28%	5,17%	12,53%	-7,54%	7,42%	0,17%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,96%	1,86%	14,48%	1,86%	12,06%	-17,44%	7,92%	0,18%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8,63%	6,85%	15,61%	6,85%	17,92%	-21,87%	7,79%	0,18%
IFIX (Benchmark)	4,71%	10,05%	14,28%	10,05%	12,87%	14,54%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	-84,71%	-0,14%	-84,71%	-50,83%	-51,05%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,00%	-8,71%	-0,23%	-8,71%	-3,90%	-6,75%	0,00%	0,00%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,75%	8,05%	3,23%	8,05%	13,95%	40,88%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,15%	-0,87%	-0,43%	-0,87%	-8,46%	-10,13%	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,64%	7,33%	2,88%	7,33%	12,41%	37,09%	-	-

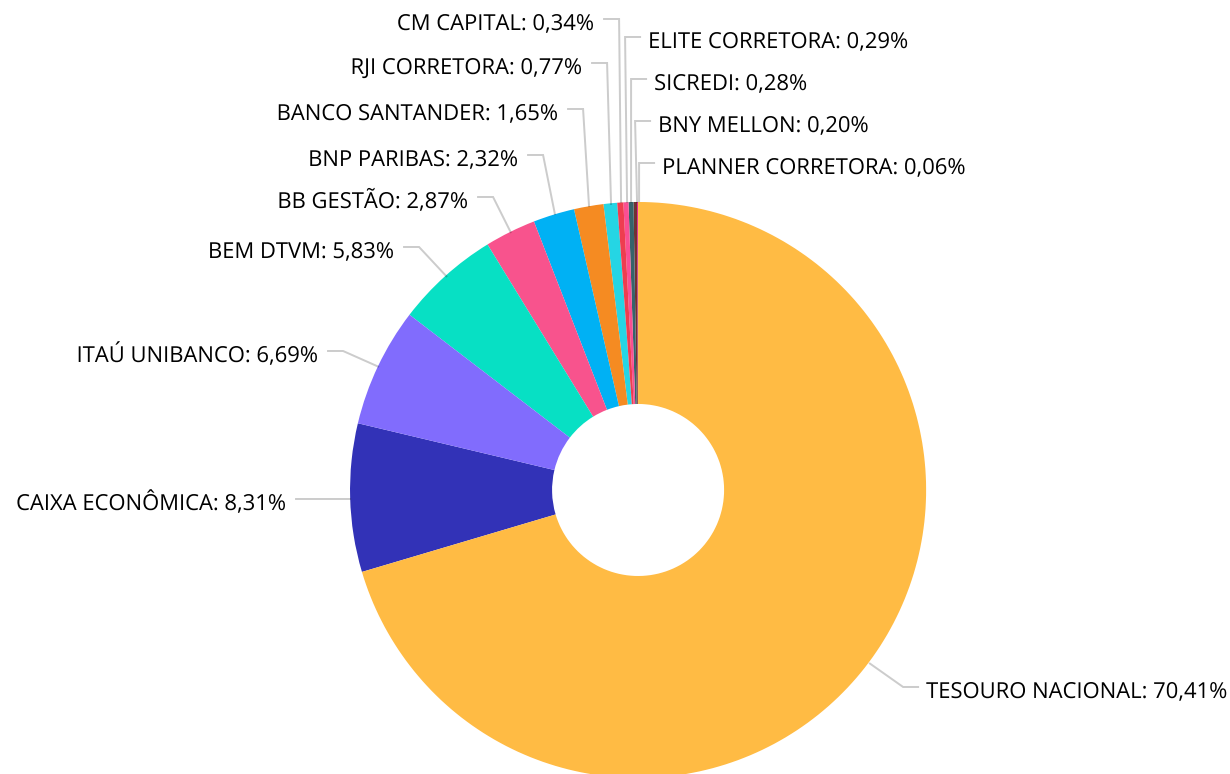
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,06%	-0,33%	-0,16%	-0,33%	-0,68%	-1,61%	-	0,00%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,03%	-0,19%	-0,09%	-0,19%	-0,38%	-1,08%	-	0,00%
MSCI ACWI (Benchmark)	-0,09%	4,18%	0,15%	4,18%	5,27%	-8,63%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,00%	20,17%	10,43%	20,17%	28,33%	20,97%	5,04%	0,20%
S&P 500 (Benchmark)	6,47%	15,91%	8,30%	15,91%	17,57%	3,56%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,06%	20,38%	10,51%	20,38%	28,85%	21,58%	5,05%	0,20%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	6,99%	20,07%	10,36%	20,07%	28,33%	20,88%	5,06%	0,20%

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

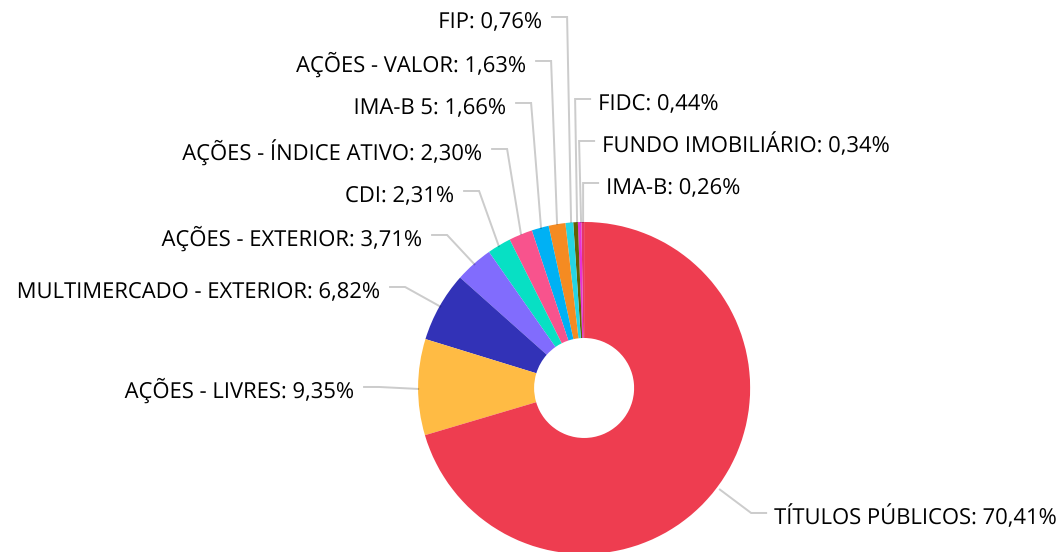
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	16,781%
MSCI WORLD (Benchmark)	0,18%	5,28%	0,82%	5,28%	7,20%	-5,27%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-0,78%	1,02%	0,12%	1,02%	7,24%	-13,40%	5,16%	13,100%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,56%	21,72%	5,61%	21,72%	25,89%	-30,09%	7,68%	21,264%
MSCI ACWI (Benchmark)	-0,09%	4,18%	0,15%	4,18%	5,27%	-8,63%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	6,51%	24,04%	8,57%	24,04%	18,53%	-18,54%	7,43%	24,144%

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



TESOURO NACIONAL	540.082.065,57
CAIXA ECONÔMICA	63.775.177,84
ITAÚ UNIBANCO	51.299.338,74
BEM DTVM	44.748.850,12
BB GESTÃO	21.994.995,44
BNP PARIBAS	17.775.185,17
BANCO SANTANDER	12.666.981,12
RJI CORRETORA	5.879.613,59
CM CAPITAL	2.599.586,19
ELITE CORRETORA	2.192.379,22
SICREDI	2.121.302,33
BNY MELLON	1.506.261,14
PLANNER CORRETORA	435.006,84

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



TÍTULOS PÚBLICOS	540.082.065,57	AÇÕES - LIVRES	71.730.320,67	MULTIMERCADO - EXTERIOR	52.278.739,21	AÇÕES - EXTERIOR	28.480.796,45
CDI	17.751.482,88	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	17.650.926,77	IMA-B 5	12.760.030,64	AÇÕES - VALOR	12.521.137,25
FIP	5.799.056,40	FIDC	3.403.525,39	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.627.386,06	IMA-B	1.991.276,02

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	09/11/2022	1.600	4060,354006	4.262,59324	6.496.566,41	6.820.149,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	02/12/2022	1.724	4.059,444003	4.224,891953	6.998.481,46	7.283.713,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	29/12/2022	3.200	4.062,499278	4.198,43462	12.999.997,69	13.434.990,78	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	24/05/2022	10.309	4.151,368820	4.341,366937	42.796.461,17	44.755.151,75	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	01/06/2022	1.942	4119,013540	4.297,591852	7.999.124,29	8.345.923,37	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	18/08/2022	2.161	4.003,343810	4.284,173379	8.651.225,97	9.258.098,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	23/08/2022	3.607	4.003,343810	4.260,752945	14.440.061,12	15.368.535,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	13.717	4.009,617406	4.247,912143	54.999.921,96	58.268.610,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/10/2022	1.592	4080,866490	4.313,882175	6.496.739,45	6.867.700,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	28/10/2021	1.449	3977,478261	4.505,338858	5.763.366,00	6.528.236,01	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	30/11/2021	1.387	4169,633376	4.505,338858	5.783.281,49	6.248.905,00	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/11/2021	303	4.128,989331	4.505,338858	1.251.083,77	1.365.117,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/12/2021	1.452	4200,155373	4.505,338858	6.098.625,60	6.541.752,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	13.639	4.193,558503	4.388,422368	57.195.944,42	59.853.692,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/07/2022	2.940	4081,521882	4.213,276639	11.999.674,33	12.387.033,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/08/2022	803	4.010,486989	4.306,413713	3.220.421,05	3.458.050,21	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/03/2023	7.730	3.880,60527900	4.033,150561	29.997.078,81	31.176.253,83	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2023	5.532	3.886,16363200	4.033,472406	21.498.257,21	22.313.169,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	27/03/2023	13.187	4.011,33	4.124,925982	52.897.408,71	54.395.398,92	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2023	5.530	3.887,58634400	4.030,146671	21.498.352,48	22.286.711,09	Curva

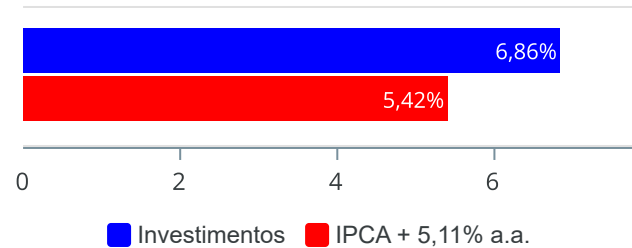
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/04/2023	5.626	4.088,420000	4.180,675362	23.001.450,92	23.520.479,58	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/05/2023	3.620	4.289,326116	4.323,170299	15.527.360,54	15.649.876,48	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	09/06/2023	1.650	4.423,334274	4.437,35523	7.298.501,55	7.321.636,12	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	31/07/2019	414	4.824,512198	4.500,457537	1.997.348,05	1.863.189,42	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	4.500,457537	34.966,87	31.503,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	03/08/2021	1.293	4563,054091	4.500,457537	5.900.028,94	5.819.091,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	13/09/2021	9.500	4428,231791	4.500,457537	42.068.202,01	42.754.346,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	14/09/2021	145	4428,231791	4.500,457537	642.093,61	652.566,34	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	28/11/2022	428	3886,763534	4.054,681185	1.663.534,79	1.735.403,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	01/02/2023	1.766	3.849,911563	3.926,830208	6.798.943,82	6.934.782,14	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	7.752	3.869,91365700	3.899,427971	29.999.570,67	30.228.365,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	11/05/2023	1.735	4.263,612425	4.188,275862	7.397.367,56	7.266.658,62	Curva

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	671.383.822,37	8.458.835,49	668.824,98	691.351.415,74	12.177.582,86	12.177.582,86	1,79%	1,79%	0,97%	0,97%	185,16%	6,78%
Fevereiro	691.351.415,74	26.072.745,92	17.430.082,46	692.616.110,99	-7.377.968,21	4.799.614,65	-1,05%	0,72%	1,20%	2,18%	33,04%	5,69%
Março	692.616.110,99	213.834.015,77	212.822.035,70	698.789.161,84	5.161.070,78	9.960.685,43	0,74%	1,47%	1,17%	3,37%	43,55%	7,15%
Abril	698.789.161,84	37.424.640,43	24.761.833,48	720.229.823,99	8.777.855,20	18.738.540,63	1,23%	2,72%	0,97%	4,38%	62,20%	6,62%
Mai	720.229.823,99	33.529.164,17	26.886.338,91	740.283.589,20	13.410.939,95	32.149.480,58	1,85%	4,62%	0,67%	5,07%	91,02%	6,40%
Junho	740.283.589,20	21.660.213,55	10.942.037,53	767.076.743,31	16.074.978,09	48.224.458,67	2,14%	6,86%	0,34%	5,42%	126,38%	5,78%

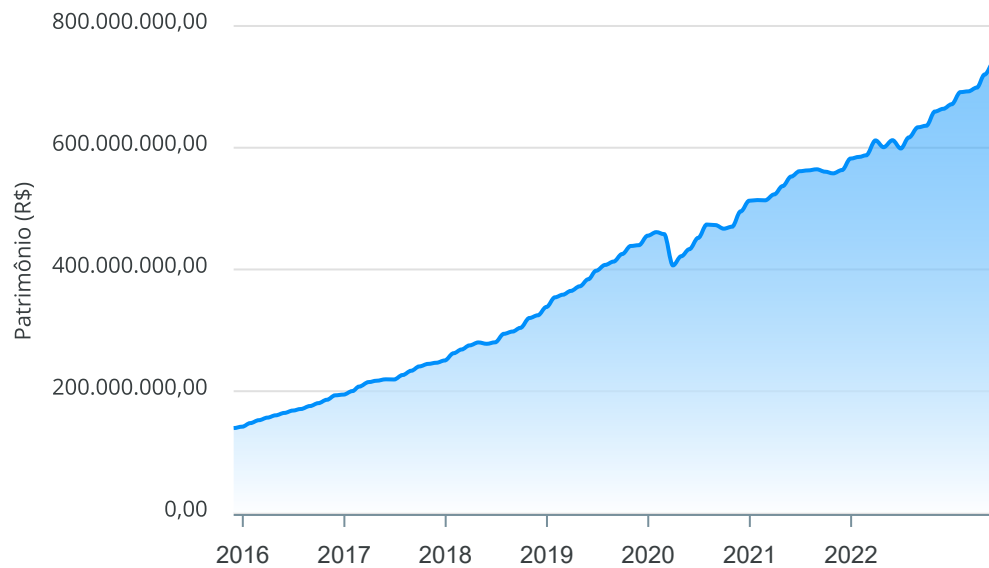
Investimentos x Meta de Rentabilidade



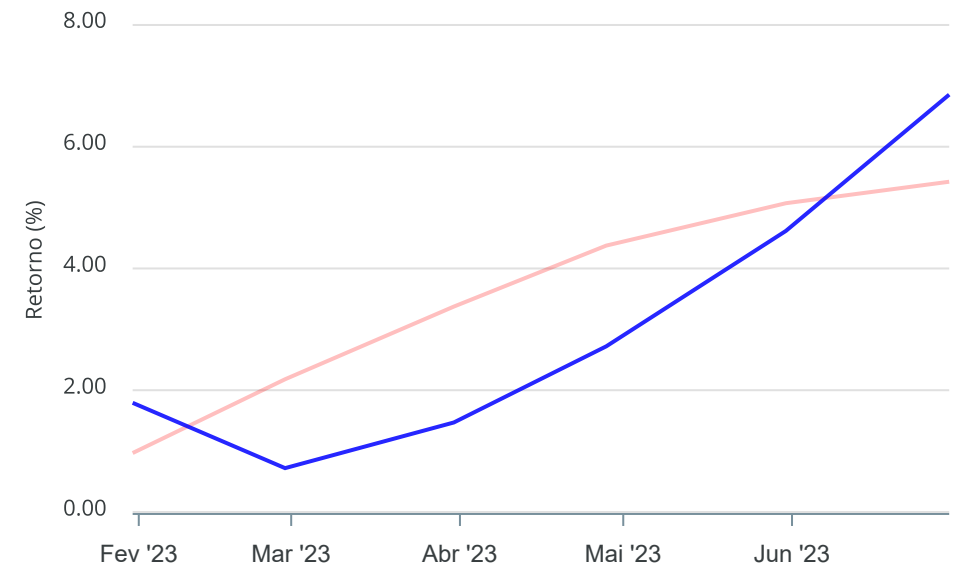
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.180.611,78	0,00	0,00	1.208.396,89	27.785,11	2,35%	2,35%	2,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.629.748,21	0,00	0,00	12.760.030,64	130.282,43	1,03%	1,03%	0,88%
TÍTULOS PÚBLICOS	527.700.937,74	7.298.501,55	0,00	540.082.065,57	5.082.626,28	0,95%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.181.703,98	14.361.712,00	10.942.037,53	17.751.482,88	150.104,43	0,53%	1,12%	0,01%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	780.454,28	0,00	0,00	782.879,13	2.424,85	0,31%	0,31%	0,28%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.600.819,99	0,00	0,00	2.599.586,19	-1.233,80	-0,05%	-0,05%	0,30%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	806.998,53	0,00	0,00	803.939,19	-3.059,34	-0,38%	-	-
Total Renda Fixa	559.881.274,52	21.660.213,55	10.942.037,53	575.988.380,50	5.388.929,96	0,94%		0,43%

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
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.223.179,47	0,00	0,00	14.576.786,10	1.353.606,63	10,24%	10,24%	8,49%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.827.188,22	0,00	0,00	3.103.523,70	276.335,48	9,77%	9,77%	8,04%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	20.185.970,06	0,00	0,00	21.994.995,44	1.809.025,38	8,96%	8,96%	7,42%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.526.375,59	0,00	0,00	12.521.137,25	994.761,66	8,63%	8,63%	7,79%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	16.350.216,83	0,00	0,00	17.650.926,77	1.300.709,94	7,96%	7,96%	7,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.341.977,47	0,00	0,00	11.143.094,73	801.117,26	7,75%	7,75%	7,86%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.981.443,34	0,00	0,00	2.121.302,33	139.858,99	7,06%	7,06%	5,05%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17.051.763,97	0,00	0,00	18.246.132,45	1.194.368,48	7,00%	7,00%	5,04%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	17.987.196,03	0,00	0,00	19.244.323,31	1.257.127,28	6,99%	6,99%	5,06%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	19.865.783,17	0,00	0,00	20.911.920,70	1.046.137,53	5,27%	5,27%	7,12%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	758.264,64	0,00	0,00	758.026,25	-238,39	-0,03%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	435.235,56	0,00	0,00	435.006,84	-228,72	-0,05%	0,00%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	748.653,53	0,00	0,00	748.234,89	-418,64	-0,06%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.194.570,31	0,00	0,00	2.192.379,22	-2.191,09	-0,10%	0,00%	0,00%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.299.084,11	0,00	0,00	4.292.795,26	-6.288,85	-0,15%	-	-
Total Renda Variável	139.776.902,30	0,00	0,00	149.940.585,24	10.163.682,94	7,27%		6,86%

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
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	7.987.532,44	0,00	0,00	8.507.122,63	519.590,19	6,51%	6,51%	7,43%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	9.216.184,96	0,00	0,00	9.268.062,54	51.877,58	0,56%	0,56%	7,68%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	10.655.732,78	0,00	0,00	10.705.611,28	49.878,50	0,47%	0,47%	6,60%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	12.765.962,20	0,00	0,00	12.666.981,12	-98.981,08	-0,78%	-0,78%	5,16%
Total Exterior	40.625.412,38	0,00	0,00	41.147.777,57	522.365,19	1,29%		6,57%

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	482.611.416,03	53.224.652,50	15.517.046,58	540.082.065,57	19.763.043,62	3,69%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.496.002,31	39.389.365,65	30.507.235,22	17.751.482,88	373.350,14	0,78%	3,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.440.482,74	0,00	0,00	12.760.030,64	319.547,90	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.128.686,49	0,00	0,00	1.208.396,89	79.710,40	7,06%	7,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.486.817,51	0,00	16.565.928,12	0,00	79.110,61	0,48%	10,61%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	772.288,83	0,00	0,00	782.879,13	10.590,30	1,37%	1,37%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.592.697,21	0,00	0,00	2.599.586,19	6.888,98	0,27%	0,27%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-100,00%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	811.976,37	0,00	0,00	803.939,19	-8.037,18	-0,99%	-0,99%
Total Renda Fixa	525.340.367,50	92.614.018,15	62.590.209,92	575.988.380,50	20.624.204,77	3,71%	

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
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	19.247.416,46	0,00	0,00	21.994.995,44	2.747.578,98	14,28%	14,28%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	15.418.974,03	0,00	0,00	17.650.926,77	2.231.952,74	14,48%	14,48%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.498.929,58	0,00	0,00	14.576.786,10	2.077.856,52	16,62%	16,62%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	17.438.206,06	0,00	0,00	19.244.323,31	1.806.117,25	10,36%	10,36%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16.523.011,92	0,00	0,00	18.246.132,45	1.723.120,53	10,43%	10,43%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	10.830.795,86	0,00	0,00	12.521.137,25	1.690.341,39	15,61%	15,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	9.646.017,35	0,00	0,00	11.143.094,73	1.497.077,38	15,52%	15,52%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	19.482.128,63	0,00	0,00	20.911.920,70	1.429.792,07	7,34%	7,34%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.587.338,87	0,00	0,00	3.103.523,70	516.184,83	19,95%	19,95%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.919.583,38	0,00	0,00	2.121.302,33	201.718,95	10,51%	10,51%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	758.730,88	0,00	0,00	758.026,25	-704,63	-0,09%	-0,09%
OSASCO PROPERTIES FII	435.839,47	0,00	0,00	435.006,84	-832,63	-0,19%	-0,14%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	749.467,63	0,00	0,00	748.234,89	-1.232,74	-0,16%	-0,16%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.199.548,55	0,00	0,00	2.192.379,22	-7.169,33	-0,33%	-0,23%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.311.189,28	0,00	0,00	4.292.795,26	-18.394,02	-0,43%	-0,43%
Total Renda Variável	134.047.177,95	0,00	0,00	149.940.585,24	15.893.407,29	11,86%	

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
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	7.835.837,59	0,00	0,00	8.507.122,63	671.285,04	8,57%	8,57%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.137.599,05	0,00	0,00	10.705.611,28	568.012,23	5,60%	5,60%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	8.776.031,24	0,00	0,00	9.268.062,54	492.031,30	5,61%	5,61%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	12.652.148,51	0,00	0,00	12.666.981,12	14.832,61	0,12%	0,12%
Total Exterior	39.401.616,39	0,00	0,00	41.147.777,57	1.746.161,18	4,43%	

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	314.662.778,81	215.914.317,09	22.884.487,87	540.082.065,57	32.389.457,54	6,10%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	50.828.218,53	0,00	40.000.000,00	12.760.030,64	1.931.812,11	3,80%	7,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.541.443,57	125.065.298,24	111.555.638,43	17.751.482,88	700.379,50	0,54%	6,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.930.058,19	0,00	16.565.928,12	0,00	635.869,93	3,99%	14,47%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	29.816.321,45	0,00	29.000.000,00	1.208.396,89	392.075,44	1,31%	11,24%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	20.190.517,06	0,00	20.361.189,22	0,00	170.672,16	0,85%	11,73%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	761.862,13	0,00	0,00	782.879,13	21.017,00	2,76%	2,76%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.669.589,10	0,00	82.833,97	2.599.586,19	12.831,06	0,48%	-2,62%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-100,00%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	812.495,89	0,00	0,00	803.939,19	-8.556,70	-1,05%	-1,05%
Total Renda Fixa	439.213.284,74	340.979.615,33	240.450.077,61	575.988.380,50	36.245.558,04	6,72%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	16.027.787,10	0,00	0,00	19.244.323,31	3.216.536,21	20,07%	20,07%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15.183.386,49	0,00	0,00	18.246.132,45	3.062.745,96	20,17%	20,17%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	20.914.270,00	0,00	0,00	21.994.995,44	1.080.725,44	5,17%	5,17%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.718.447,80	0,00	0,00	12.521.137,25	802.689,45	6,85%	6,85%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.918.528,89	0,00	0,00	14.576.786,10	658.257,21	4,73%	4,73%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15.062.027,44	0,00	15.564.818,97	0,00	502.791,53	3,34%	20,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.724.075,70	0,00	0,00	11.143.094,73	419.019,03	3,91%	3,91%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.729.117,12	0,00	0,00	3.103.523,70	374.406,58	13,72%	13,72%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.762.115,52	0,00	0,00	2.121.302,33	359.186,81	20,38%	20,38%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	17.327.913,40	0,00	0,00	17.650.926,77	323.013,37	1,86%	1,86%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.279.893,34	0,00	155.135,78	2.192.379,22	67.621,66	2,97%	-8,71%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	759.443,04	0,00	0,00	758.026,25	-1.416,79	-0,19%	-0,19%
OSASCO PROPERTIES FII	436.810,17	0,00	0,00	435.006,84	-1.803,33	-0,41%	-84,71%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	750.675,21	0,00	0,00	748.234,89	-2.440,32	-0,33%	-0,33%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.330.286,42	0,00	0,00	4.292.795,26	-37.491,16	-0,87%	-0,87%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	21.244.929,88	0,00	0,00	20.911.920,70	-333.009,18	-1,57%	-1,57%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	18.640.085,60	0,00	17.162.663,70	0,00	-1.477.421,90	-7,93%	7,26%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	21.984.878,05	0,00	20.178.457,00	0,00	-1.806.421,05	-8,22%	6,51%
Total Renda Variável	195.794.671,17	0,00	53.061.075,45	149.940.585,24	7.206.989,52	3,68%	

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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	7.614.040,66	0,00	0,00	9.268.062,54	1.654.021,88	21,72%	21,72%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	6.858.235,36	0,00	0,00	8.507.122,63	1.648.887,27	24,04%	24,04%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	9.347.431,55	0,00	0,00	10.705.611,28	1.358.179,73	14,53%	14,53%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	12.556.158,89	0,00	0,00	12.666.981,12	110.822,23	0,88%	1,02%
Total Exterior	36.375.866,46	0,00	0,00	41.147.777,57	4.771.911,11	13,12%	

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.

