

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			32.560.099,97	19,37%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	797.035,24	0,47%	74.297	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.427.275,33	3,23%	942	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.407.542,02	9,17%	783	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	207.578,44	0,12%	1.136	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	31.884.615,61	18,97%	773	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.894.604,98	1,72%	927	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	8.679.464,58	5,16%	1.186	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	933.200,21	0,56%	980	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	18.314.591,83	10,89%	164	0,75%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	968.722,00	0,58%	1.126	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	14.212.998,46	8,46%	139	1,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	7.755.382,75	4,61%	330	1,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	10.518.525,96	6,26%	354	1,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	133.136,95	0,08%	98	0,42%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.183.168,99	1,89%	2.724	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.322.251,99	1,98%	155	0,26%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.249.473,12	1,93%	491	0,16%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.273.126,66	1,95%	20	2,30%	Artigo 10º, Inciso I
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	903.160,43	0,54%	653	0,08%	Artigo 10º, Inciso I



CRÉDITO
& MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

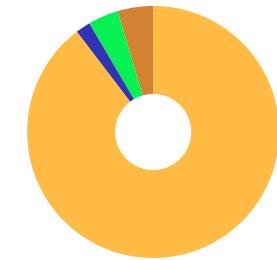
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento	
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	3.475.255,19	2,07%	3.117	1,84%	Artigo 10º, Inciso I	
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		45.350,58	0,03%		0,00%	DF - Artigo 6º	
Total para cálculo dos limites da Resolução			168.101.210,71					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			45.350,58					
			PL Total	168.146.561,29				



**CRÉDITO
& MERCADO**

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%	32.560.099,97	19,37%	14,45%	24,60%	64,38%	75.663.459,49
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	65.298.116,20	38,84%	21,55%	31,40%	64,38%	42.925.443,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	52.703.421,21	31,35%	10,00%	12,76%	60,00%	48.157.305,22
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	33.620.242,14
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	133.136,95	0,08%	0,00%	0,24%	0,24%	270.305,96
Total Renda Fixa	100,00%	150.694.774,33	89,65%	46,00%	74,00%	209,00%	



- █ RENDA FIXA 150.694.774,33
- █ RENDA VARIÁVEL 3.183.168,99
- █ EXTERIOR 6.571.725,11
- █ ESTRUTURADOS 7.651.542,28

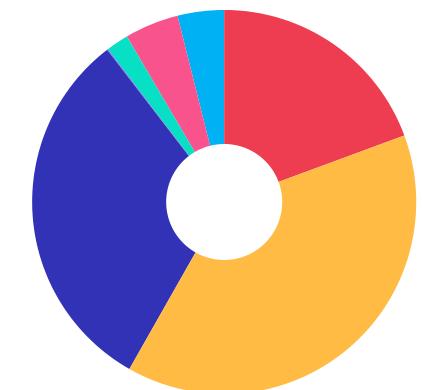


**CRÉDITO
& MERCADO**

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%	3.183.168,99	1,89%	5,00%	12,50%	20,00%	30.437.073,15
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	8.405.060,54
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	7.651.542,28	4,55%	2,00%	5,00%	10,00%	9.158.578,79
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,25%	5,00%	8.405.060,54
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,25%	5,00%	8.405.060,54
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.834.711,27	6,45%	7,00%	21,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.571.725,11	3,91%	2,00%	5,00%	10,00%	10.238.395,96
Total Exterior	10,00%	6.571.725,11	3,91%	2,00%	5,00%	10,00%	



■ 7º I a ■ 7º I b ■ 7º III a ■ 7º V a
■ 8º I ■ 10º I ■ 9º III



**CRÉDITO
& MERCADO**

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.561.366,05	28,89	-
CAIXA DTVM	46.708.158,29	27,79	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...)	32.560.099,97	19,37	-
SICREDI	21.749.163,90	12,94	0,02
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	17.486.125,12	10,40	0,00
ITAÚ UNIBANCO	903.160,43	0,54	0,00
PETRA CAPITAL	133.136,95	0,08	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)

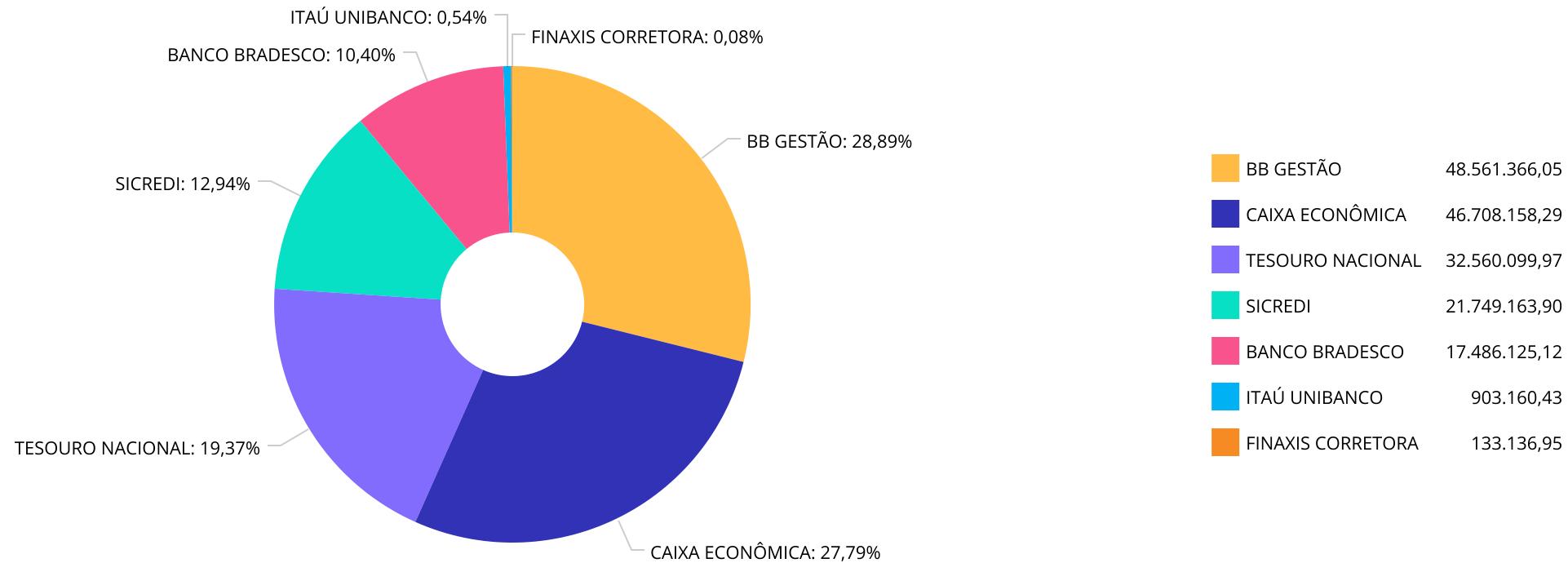
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	32.560.099,97	19,37	14,45	64,38
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	65.298.116,20	38,84	21,55	64,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	52.703.421,21	31,35	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	133.136,95	0,08	0,00	0,24
Artigo 8º, Inciso I	3.183.168,99	1,89	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	6.571.725,11	3,91	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	7.651.542,28	4,55	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00



CRÉDITO
& MERCADO

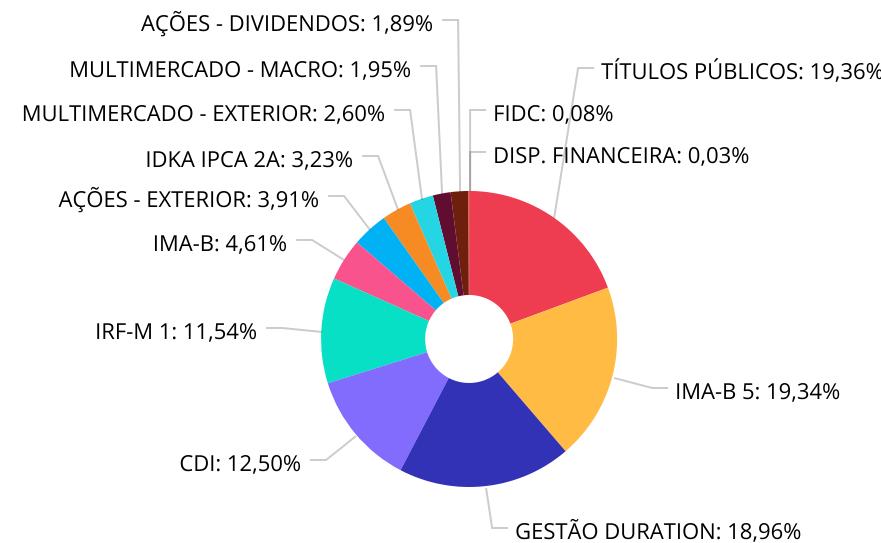
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Junho / 2023)





**CRÉDITO
& MERCADO**

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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	32.560.099,97	■ IMA-B 5	32.515.145,46	■ GESTÃO DURATION	31.884.615,61	■ CDI	21.013.549,28
■ IRF-M 1	19.405.568,98	■ IMA-B	7.755.382,75	■ AÇÕES - EXTERIOR	6.571.725,11	■ IDKA IPCA 2A	5.427.275,33
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	4.378.415,62	■ MULTIMERCADO - MACRO	3.273.126,66	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.183.168,99	■ FIDC	133.136,95
■ DISP. FINANCEIRA	45.350,58						



**CRÉDITO
& MERCADO**

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	15/05/2025	26/05/2022	1.249	4.002,49183	4.180,799149	4.999.112,30	5.221.818,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	07/10/2022	2.184	4.029,51689	4.256,465801	8.800.464,89	9.296.121,30	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	12/08/2022	417	4.079,09772	4.199,717875	1.700.983,75	1.751.282,35	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	08/09/2022	1.939	4.021,23598	4.260,95513	7.797.176,57	8.261.991,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	08/09/2022	1.908	4.087,02508	4.208,312795	7.798.043,85	8.029.460,81	Curva

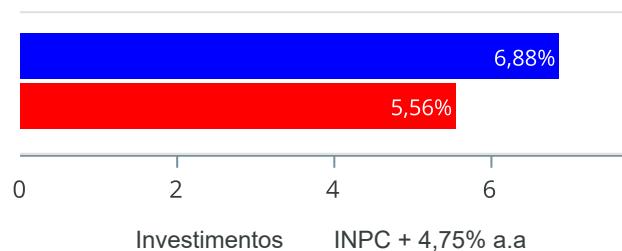


**CRÉDITO
& MERCADO**

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	155.377.860,43	3.530.757,61	4.496.551,92	156.802.677,30	2.390.611,18	2.390.611,18	1,54%	1,54%	0,87%	0,87%	176,85%	2,20%
Fevereiro	156.802.677,30	2.550.403,10	1.641.432,24	158.138.029,22	426.381,06	2.816.992,24	0,27%	1,81%	1,10%	1,98%	91,38%	1,93%
Março	158.138.029,22	5.040.860,98	4.193.340,80	160.741.650,68	1.756.101,28	4.573.093,52	1,10%	2,94%	1,07%	3,07%	95,61%	1,75%
Abril	160.741.650,68	8.168.425,11	7.280.895,40	163.234.183,95	1.605.003,56	6.178.097,08	0,99%	3,96%	0,86%	3,96%	99,92%	1,32%
Maio	163.234.183,95	10.546.675,07	10.074.199,93	165.794.931,19	2.088.272,10	8.266.369,18	1,28%	5,29%	0,77%	4,76%	111,03%	1,10%
Junho	165.794.931,19	1.436.004,13	1.642.117,98	168.101.210,71	2.512.393,37	10.778.762,55	1,52%	6,88%	0,77%	5,56%	123,66%	1,27%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

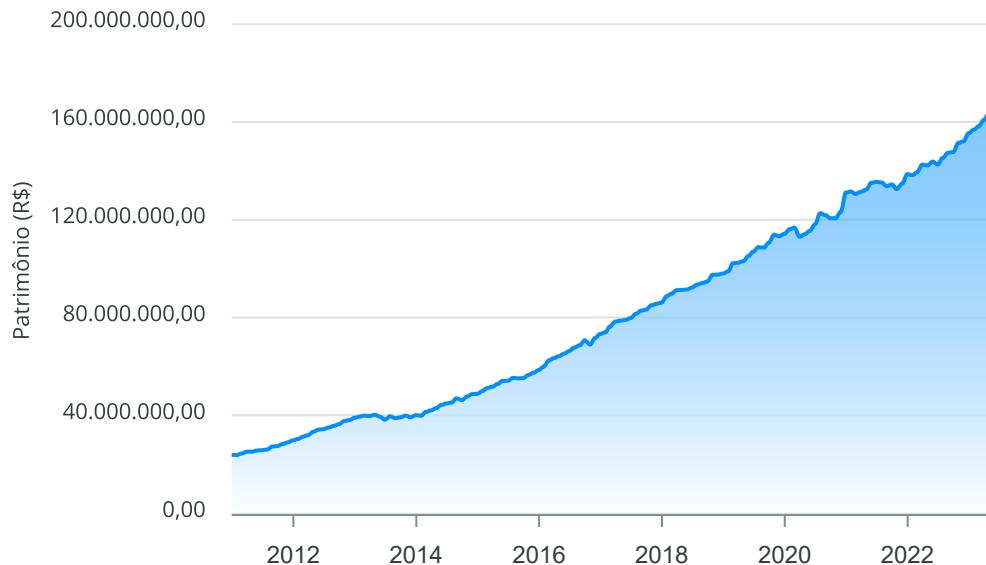




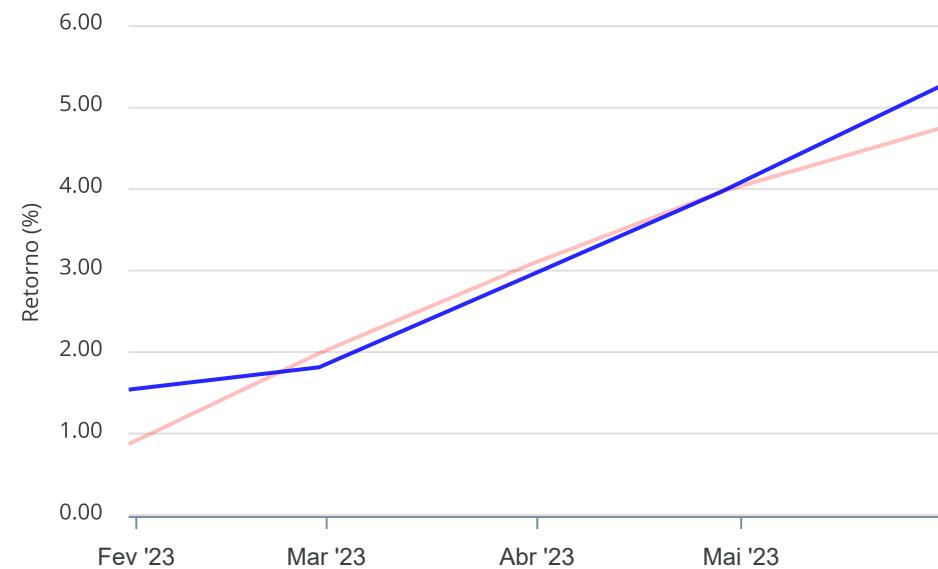
CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 SMILL IDIV



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE CHAPADÃO DO SUL

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

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
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.573.964,65	0,00	0,00	7.755.382,75	181.418,10	2,40%	2,41%	2,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	31.227.348,25	0,00	0,00	31.884.615,61	657.267,36	2,10%	2,10%	0,90%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	10.387.545,43	0,00	0,00	10.518.525,96	130.980,53	1,26%	1,22%	0,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	205.201,02	0,00	0,00	207.578,44	2.377,42	1,16%	1,16%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.580.110,08	0,00	0,00	8.679.464,58	99.354,50	1,16%	1,16%	0,11%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	18.111.838,45	0,00	0,00	18.314.591,83	202.753,38	1,12%	1,12%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	958.252,78	0,00	0,00	968.722,00	10.469,22	1,09%	1,09%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.865.050,49	0,00	0,00	2.894.604,98	29.554,49	1,03%	1,03%	0,88%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	14.067.961,11	0,00	0,00	14.212.998,46	145.037,35	1,03%	1,03%	0,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.250.324,31	0,00	0,00	15.407.542,02	157.217,71	1,03%	1,03%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.372.502,56	0,00	0,00	5.427.275,33	54.772,77	1,02%	1,02%	0,78%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.408.923,05	905.792,76	1.530.825,46	797.035,24	13.144,89	0,57%	0,85%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	508.898,52	530.211,37	111.292,52	933.200,21	5.382,84	0,52%	1,00%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	32.412.054,77	0,00	0,00	32.560.099,97	148.045,20	0,46%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	133.808,64	0,00	0,00	133.136,95	-671,69	-0,50%	-	-
Total Renda Fixa	149.063.784,11	1.436.004,13	1.642.117,98	150.694.774,33	1.837.104,07	1,23%		0,69%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.881.563,76	0,00	0,00	3.183.168,99	301.605,23	10,47%	10,47%	7,64%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	844.161,86	0,00	0,00	903.160,43	58.998,57	6,99%	6,99%	5,06%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.261.313,45	0,00	0,00	3.475.255,19	213.941,74	6,56%	7,06%	5,05%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	3.235.623,81	0,00	0,00	3.273.126,66	37.502,85	1,16%	1,16%	0,29%
Total Renda Variável	10.222.662,88	0,00	0,00	10.834.711,27	612.048,39	5,99%		4,38%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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	3.274.150,68	0,00	0,00	3.322.251,99	48.101,31	1,47%	1,47%	6,71%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.234.333,52	0,00	0,00	3.249.473,12	15.139,60	0,47%	0,47%	6,60%
Total Exterior	6.508.484,20	0,00	0,00	6.571.725,11	63.240,91	0,97%		6,65%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	30.408.204,36	0,00	0,00	31.884.615,61	1.476.411,25	4,86%	4,86%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	17.747.696,24	0,00	0,00	18.314.591,83	566.895,59	3,19%	3,19%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.234.727,70	0,00	0,00	7.755.382,75	520.655,05	7,20%	7,20%
TÍTULOS PÚBLICOS	32.202.502,58	0,00	0,00	32.560.099,97	357.597,39	1,11%	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	13.863.252,40	0,00	0,00	14.212.998,46	349.746,06	2,52%	2,52%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	10.185.631,98	0,00	0,00	10.518.525,96	332.893,98	3,27%	3,27%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.425.117,33	8.700.000,00	0,00	15.407.542,02	282.424,69	1,87%	2,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.414.320,04	0,00	0,00	8.679.464,58	265.144,54	3,15%	3,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.315.689,53	0,00	0,00	5.427.275,33	111.585,80	2,10%	2,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.822.115,74	0,00	0,00	2.894.604,98	72.489,24	2,57%	2,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	939.020,21	0,00	0,00	968.722,00	29.701,79	3,16%	3,16%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	305.762,27	10.695.202,58	10.229.164,50	797.035,24	25.234,89	0,23%	2,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	379.496,24	755.901,73	216.290,01	933.200,21	14.092,25	1,24%	2,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	201.257,73	0,00	0,00	207.578,44	6.320,71	3,14%	3,14%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	143.907,87	0,00	0,00	133.136,95	-10.770,92	-7,48%	-7,48%
Total Renda Fixa	136.588.702,22	20.151.104,31	10.445.454,51	150.694.774,33	4.400.422,31	3,01%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

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 DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.596.971,35	0,00	0,00	3.183.168,99	586.197,64	22,57%	22,57%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.144.786,12	0,00	0,00	3.475.255,19	330.469,07	10,51%	10,51%
ITAU MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	3.840.390,07	0,00	4.157.462,32	0,00	317.072,25	8,26%	15,32%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	3.164.889,13	0,00	0,00	3.273.126,66	108.237,53	3,42%	3,42%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	818.397,06	0,00	0,00	903.160,43	84.763,37	10,36%	10,36%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.318.155,11	0,00	4.394.296,48	0,00	76.141,37	1,76%	12,50%
Total Renda Variável	17.883.588,84	0,00	8.551.758,80	10.834.711,27	1.502.881,23	8,40%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.077.064,44	0,00	0,00	3.249.473,12	172.408,68	5,60%	5,60%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.192.295,18	0,00	0,00	3.322.251,99	129.956,81	4,07%	4,07%
Total Exterior	6.269.359,62	0,00	0,00	6.571.725,11	302.365,49	4,82%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	29.451.736,25	0,00	0,00	31.884.615,61	2.432.879,36	8,26%	8,26%
TÍTULOS PÚBLICOS	31.552.326,14	0,00	491.321,63	32.560.099,97	1.499.095,46	4,75%	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	16.788.545,90	500.000,00	0,00	18.314.591,83	1.026.045,93	5,93%	5,95%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	13.290.826,34	0,00	0,00	14.212.998,46	922.172,12	6,94%	6,94%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	6.968.500,32	0,00	0,00	7.755.382,75	786.882,43	11,29%	11,29%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.885.061,30	3.004.178,89	0,00	10.518.525,96	629.285,77	6,36%	6,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.143.149,51	0,00	0,00	8.679.464,58	536.315,07	6,59%	6,59%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.284.845,36	11.700.000,00	0,00	15.407.542,02	422.696,66	2,82%	6,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.093.061,93	0,00	0,00	5.427.275,33	334.213,40	6,56%	6,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.705.144,99	0,00	0,00	2.894.604,98	189.459,99	7,00%	7,00%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.506.255,46	15.092.439,34	16.879.530,18	797.035,24	77.870,62	0,44%	5,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	910.141,49	0,00	0,00	968.722,00	58.580,51	6,44%	6,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	335.425,81	976.507,77	401.735,77	933.200,21	23.002,40	1,75%	5,98%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	194.921,91	0,00	0,00	207.578,44	12.656,53	6,49%	6,49%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	144.697,81	0,00	0,00	133.136,95	-11.560,86	-7,99%	-7,99%
Total Renda Fixa	128.254.640,52	31.273.126,00	17.772.587,58	150.694.774,33	8.939.595,39	6,31%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.886.812,04	0,00	0,00	3.475.255,19	588.443,15	20,38%	20,38%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.652.468,57	0,00	0,00	3.183.168,99	530.700,42	20,01%	20,01%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	3.068.494,12	0,00	0,00	3.273.126,66	204.632,54	6,67%	6,67%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	752.204,32	0,00	0,00	903.160,43	150.956,11	20,07%	20,07%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	2.881.494,76	0,00	3.004.191,89	0,00	122.697,13	4,26%	8,08%
ITAU MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	4.290.915,59	0,00	4.157.462,32	0,00	-133.453,27	-3,11%	3,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.668.442,91	0,00	4.394.296,48	0,00	-274.146,43	-5,87%	4,06%
Total Renda Variável	21.200.832,31	0,00	11.555.950,69	10.834.711,27	1.189.829,65	5,61%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.837.224,98	0,00	0,00	3.249.473,12	412.248,14	14,53%	14,53%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.085.162,62	0,00	0,00	3.322.251,99	237.089,37	7,68%	7,68%
Total Exterior	5.922.387,60	0,00	0,00	6.571.725,11	649.337,51	10,96%	

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.

