

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2023

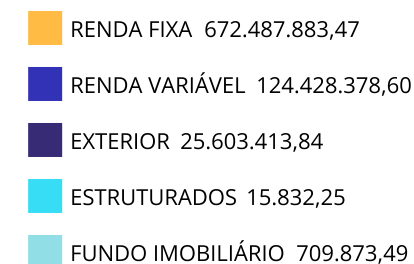
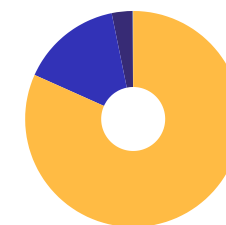


Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.174.716,13	0,75%	3.870	2,41%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.956.134,16	0,48%	11.732	2,57%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.832.032,48	0,83%	2.785	2,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	20.587.870,17	2,50%	30.087	2,61%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	12.978.444,64	1,58%	21.999	1,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	9.405.959,57	1,14%	83	1,56%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	13.152.771,37	1,60%	6.687	10,35%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.337.885,29	1,50%	6.071	1,99%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	25.669.659,57	3,12%	2.735	3,78%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	8.562.300,90	1,04%	34	3,24%	Artigo 8º, Inciso I
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	10.039.686,84	1,22%	9.129	1,52%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	8.849.774,05	1,07%	5.319	1,11%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	6.713.952,95	0,82%	216	2,27%	Artigo 9º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIELSTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	15.832,24	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	709.873,49	0,09%		1,88%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			823.245.381,65				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 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%	40,00%	329.298.152,66
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	444.814.562,29	54,03%	15,00%	50,00%	75,00%	172.619.473,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	141.589.750,64	17,20%	4,00%	7,00%	60,00%	352.357.478,35
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	40.615.770,79	4,93%	0,00%	1,00%	20,00%	124.033.305,54
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	71.252,90	0,01%	0,00%	0,10%	0,50%	4.044.974,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	45.396.546,85	5,51%	0,00%	1,50%	5,00%	-4.234.277,77
Total Renda Fixa	100,00%	672.487.883,47	81,69%	19,00%	74,60%	200,50%	



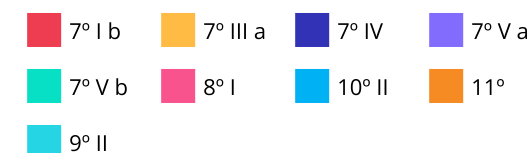
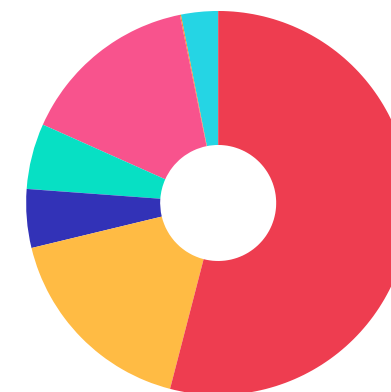
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 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%	124.428.378,60	15,11%	10,00%	18,00%	35,00%	163.707.504,98
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	10,00%	82.324.538,17
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	15.832,25	0,00%	0,00%	0,10%	3,00%	24.681.529,20
Artigo 11º	5,00%	709.873,49	0,09%	0,00%	0,10%	1,00%	7.522.580,33
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	125.154.084,34	15,20%	10,00%	22,20%	49,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	25.603.413,84	3,11%	0,50%	2,90%	10,00%	56.721.124,33
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,30%	10,00%	82.324.538,17
Total Exterior	10,00%	25.603.413,84	3,11%	0,50%	3,20%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	282.168.543,22	34,28	-
CAIXA DTVM	218.172.686,31	26,50	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	138.105.237,16	16,78	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	33.482.371,46	4,07	0,01
SICREDI	29.609.238,90	3,60	0,03
ICATU VANGUARDA	25.669.659,57	3,12	0,05
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	23.442.483,47	2,85	0,01
XP ASSET MANAGEMENT	10.039.686,84	1,22	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	6.713.952,95	0,82	0,09
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.174.716,13	0,75	0,02
ARX INVESTIMENTOS	4.770.604,32	0,58	0,01
ITAÚ UNIBANCO	3.483.471,89	0,42	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	709.873,49	0,09	-
VILA RICA CAPITAL	71.252,89	0,01	0,04
PÁTRIA INVESTIMENTOS	15.832,24	0,00	0,00
PLURAL	0,02	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 '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	444.680.313,92	54,02	15,00	75,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	141.589.750,64	17,20	4,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	71.252,90	0,01	0,00	0,50
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	45.396.546,85	5,51	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	124.428.378,60	15,11	10,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	25.603.413,84	3,11	0,50	10,00
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 10º, Inciso II	15.832,25	0,00	0,00	3,00
Artigo 11º	709.873,49	0,09	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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 Maio/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,43%	6,86%	4,14%	8,39%	17,43%	31,14%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,36%	1,27%	0,77%	-13,84%	-59,04%	-60,95%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	5,76%	2,60%	7,07%	8,74%	18,79%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,49%	2,47%	6,77%	8,61%	18,88%	0,68%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,14%	5,42%	3,26%	6,67%	13,53%	20,82%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	5,37%	3,20%	6,58%	13,30%	20,31%	0,09%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	5,27%	3,18%	6,49%	13,21%	20,16%	0,09%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,57%	5,93%	3,02%	6,92%	9,45%	19,90%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,56%	5,83%	2,96%	6,81%	9,23%	19,39%	0,67%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,61%	5,90%	3,02%	6,87%	9,27%	19,31%	0,68%	0,02%
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	5,34%	3,26%	6,57%	13,81%	23,57%	0,03%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,04%	4,93%	2,98%	6,02%	12,37%	19,93%	0,01%	0,00%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	900,00%	-	900,00%	0,00%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	5,23%	3,20%	6,42%	13,65%	23,76%	0,03%	0,00%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,13%	5,22%	3,25%	6,46%	14,00%	24,25%	0,08%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,97%	4,60%	2,80%	5,61%	11,56%	18,74%	0,01%	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1,16%	5,34%	3,22%	6,50%	13,42%	22,46%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	4,58%	1,78%	5,96%	7,63%	-	0,51%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	4,57%	1,78%	5,94%	8,30%	19,47%	0,51%	0,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,55%	5,63%	2,79%	6,71%	9,00%	19,39%	0,54%	0,02%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	1,56%	1,78%	2,89%	1,43%	4,52%	0,51%	0,05%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	3,74%	-1,28%	3,24%	-3,69%	-2,71%	-14,17%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3,08%	-3,48%	0,99%	-5,96%	-9,91%	-15,82%	8,14%	0,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,99%	-4,33%	-2,44%	-7,07%	-12,86%	-34,01%	9,07%	0,23%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	16,49%	25,86%	23,28%	20,73%	17,29%	-19,53%	10,37%	0,34%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2,05%	-3,77%	0,03%	-7,44%	-9,03%	-25,30%	5,47%	0,20%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,47%	-5,48%	2,02%	-7,83%	-10,85%	-19,99%	8,15%	0,21%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4,46%	-1,15%	3,13%	-3,74%	-3,49%	-15,44%	8,76%	0,20%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	11,99%	-1,81%	6,06%	-6,99%	-16,97%	-48,29%	9,27%	0,31%
IBX-50 (Benchmark)	2,92%	-3,51%	0,95%	-5,97%	-4,44%	-15,81%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3,28%	-2,47%	0,56%	-4,90%	-6,48%	-18,83%	7,93%	0,21%
IDIV (Benchmark)	0,84%	0,48%	2,64%	-1,14%	-0,85%	1,55%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,15%	-3,55%	0,25%	-5,92%	-3,27%	-20,09%	8,05%	0,17%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,52%	8,64%	9,15%	7,44%	3,29%	-6,81%	5,73%	0,20%
IFIX (Benchmark)	5,43%	5,10%	7,30%	5,10%	6,84%	6,99%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-

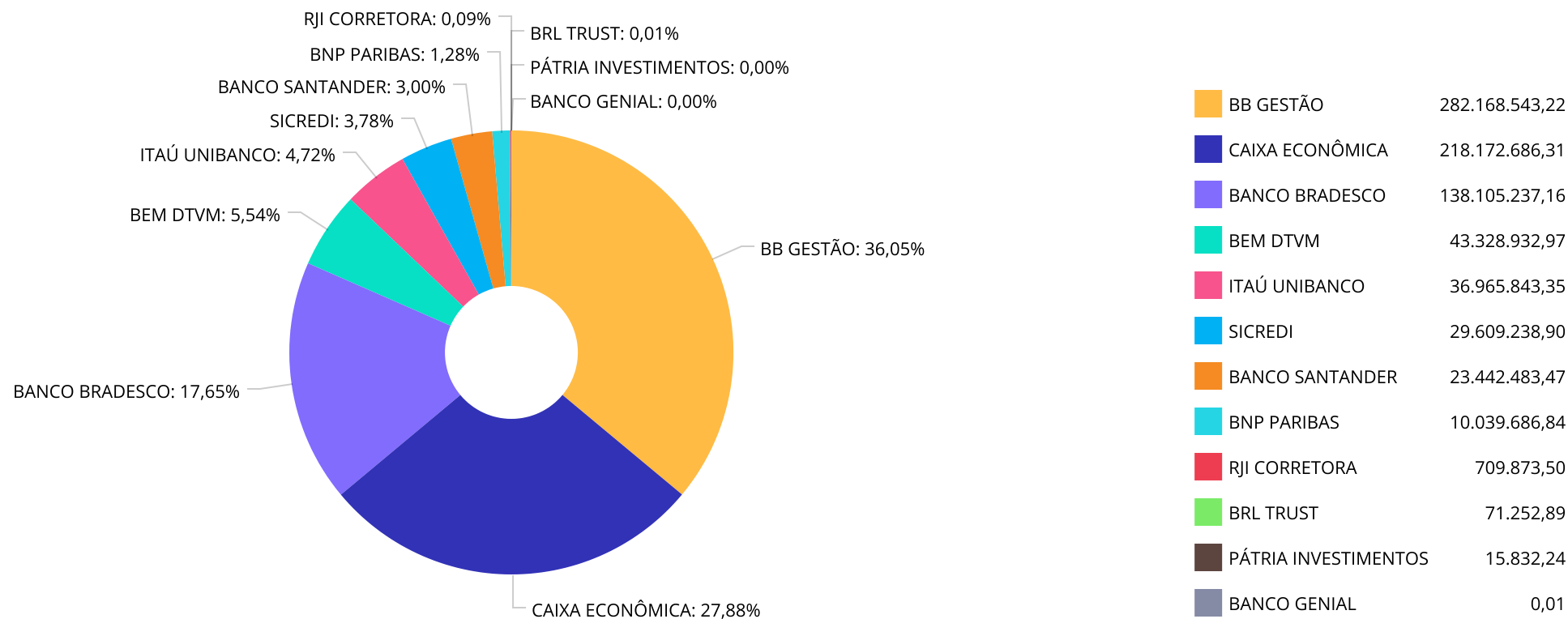
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	0,70%	3,65%	2,39%	3,88%	4,14%	112,89%	-	-
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,11%	7,24%	4,12%	8,85%	14,80%	41,74%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	13,54%	4,71%	13,69%	1,56%	-7,34%	-32,24%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	13,18%	4,64%	13,20%	1,51%	-7,90%	-33,41%	10,55%	0,31%

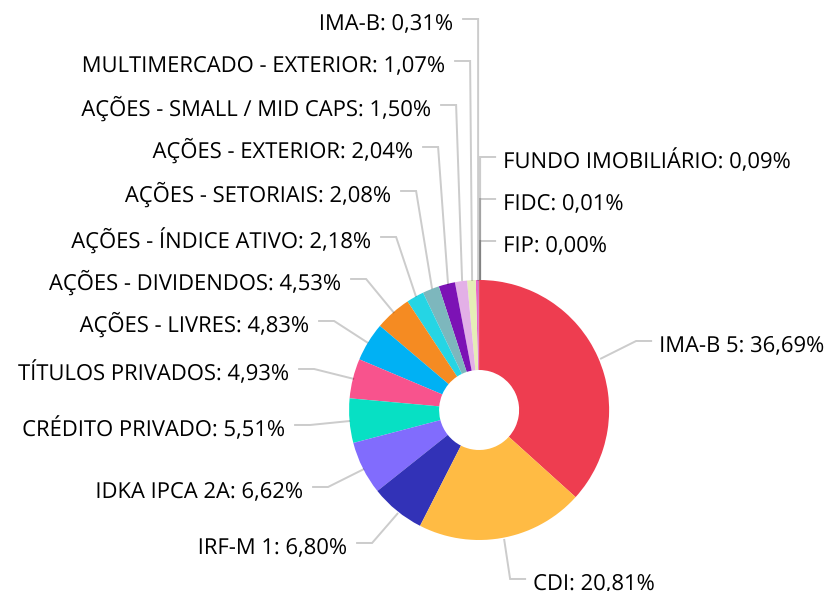
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	0,63%	5,09%	0,95%	-0,93%	8,13%	-8,34%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1,04%	1,81%	-0,55%	-0,37%	7,51%	-15,19%	7,38%	13,073%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	6,84%	21,04%	7,55%	17,16%	21,65%	-31,28%	11,22%	21,796%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,56%	4,28%	0,55%	-1,39%	6,70%	-11,51%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	2,61%	5,57%	3,40%	5,78%	13,30%	-7,12%	9,11%	14,021%

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



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

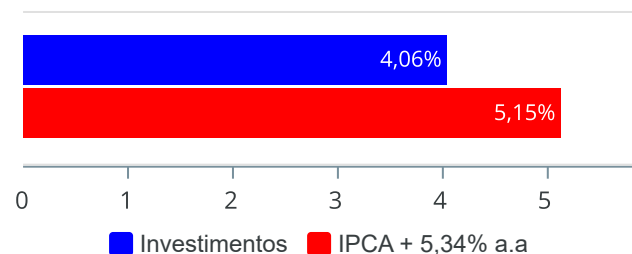


IMA-B 5	302.029.053,24	CDI	171.333.237,91	IRF-M 1	55.958.834,86	IDKA IPCA 2A	54.497.484,41
CRÉDITO PRIVADO	45.396.546,85	TÍTULOS PRIVADOS	40.615.770,79	AÇÕES - LIVRES	39.741.030,94	AÇÕES - DIVIDENDOS	37.272.296,37
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	17.968.260,47	AÇÕES - SETORIAIS	17.108.905,53	AÇÕES - EXTERIOR	16.753.639,79	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	12.337.885,29
MULTIMERCADO - EXTERIOR	8.849.774,05	IMA-B	2.585.702,51	FUNDO IMOBILIÁRIO	709.873,49	FIDC	71.252,90
FIP	15.832,25						

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	768.654.569,51	161.791.775,86	149.214.177,15	797.848.378,51	16.616.210,29	16.616.210,29	2,13%	2,13%	0,99%	0,99%	214,84%	3,05%
Fevereiro	797.848.378,51	37.116.816,98	32.138.780,94	795.008.960,59	-7.817.453,96	8.798.756,33	-0,97%	1,13%	1,21%	2,21%	51,20%	3,33%
Março	795.008.960,59	51.245.660,01	49.214.196,74	801.979.266,84	4.938.842,98	13.737.599,31	0,62%	1,76%	1,18%	3,42%	51,47%	2,42%
Abril	801.979.266,84	98.657.989,10	97.706.659,15	809.484.781,92	6.554.185,13	20.291.784,44	0,82%	2,59%	0,98%	4,43%	58,44%	2,03%
Mai	809.484.781,92	191.375.909,92	189.222.083,07	823.245.381,65	11.606.772,88	31.898.557,32	1,43%	4,06%	0,69%	5,15%	78,80%	1,94%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



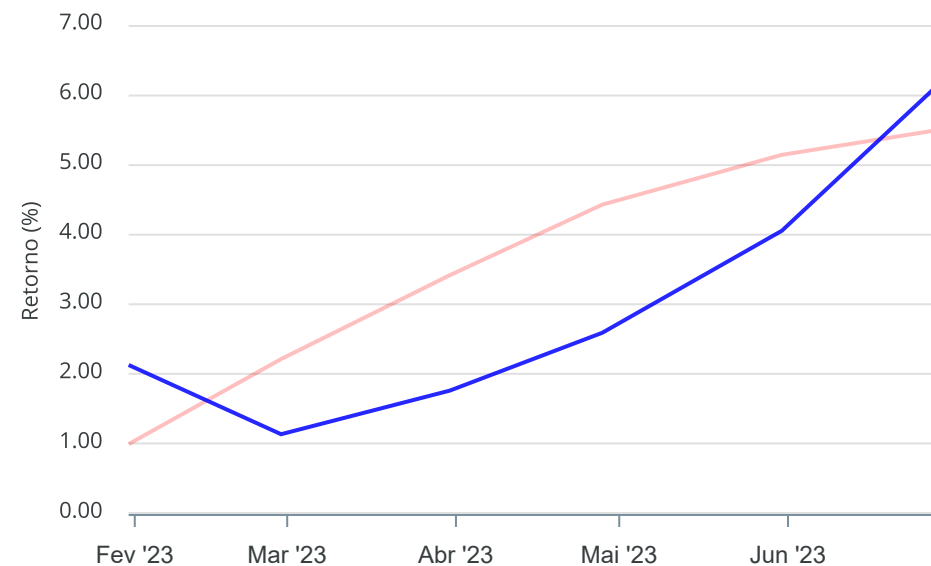
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	14.852.909,45	0,00	0,00	15.019.725,23	166.815,78	1,12%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	13.699.674,90	0,00	196.201,63	13.656.071,24	152.597,97	1,11%	1,12%	0,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	41.105.662,98	794.371,75	62.621,48	42.302.763,62	465.350,37	1,11%	1,12%	0,09%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	135.861.075,99	12.405.600,21	11.805.369,49	138.105.237,16	1.643.930,45	1,11%	1,16%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.536.429,40	910.813,19	0,00	3.483.471,89	36.229,30	1,05%	1,16%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	79.924.344,08	0,00	80.473.911,23	0,00	549.567,15	0,69%	1,19%	0,13%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	84.320.680,53	0,00	0,00	84.835.825,69	515.145,16	0,61%	0,61%	0,68%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.779.136,90	25.500.000,00	0,00	33.482.371,46	203.234,56	0,61%	1,13%	0,08%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.848.792,77	0,00	0,00	11.914.175,39	65.382,62	0,55%	0,55%	0,54%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.115.737,91	883.833,17	0,00	6.030.408,52	30.837,44	0,51%	0,56%	0,67%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,00	29.473.911,23	0,00	29.609.238,90	135.327,67	0,46%	1,16%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	54.286.415,52	0,00	0,00	54.497.484,41	211.068,89	0,39%	0,39%	0,68%
LETRA FINANCEIRA BRANCO	0,00	25.500.000,00	0,00	25.596.045,56	96.045,56	0,38%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	70.994,23	0,00	0,00	71.252,89	258,66	0,36%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	419.411,62	4.256.207,40	4.679.132,39	1.041,59	4.554,96	0,10%	1,04%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	428.209,86	91.651.172,97	92.004.846,85	134.248,37	59.712,39	0,06%	0,97%	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	70.330.083,74	0,00	0,00	70.323.760,94	-6.322,80	-0,01%	-0,01%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.585.942,86	0,00	0,00	2.585.702,51	-240,35	-0,01%	-0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	140.852.170,18	0,00	0,00	140.839.058,09	-13.112,09	-0,01%	-0,01%	0,51%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	666.017.672,93	191.375.909,92	189.222.083,07	672.487.883,47	4.316.383,69	0,65%		0,36%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	3.396.253,22	0,00	0,00	3.956.134,16	559.880,94	16,49%	16,49%	10,37%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.900.785,39	0,00	0,00	12.337.885,29	1.437.099,90	13,18%	13,18%	10,55%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	11.744.590,83	0,00	0,00	13.152.771,37	1.408.180,54	11,99%	11,99%	9,27%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6.414.100,31	0,00	0,00	6.832.032,48	417.932,17	6,52%	6,52%	5,73%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.566.489,84	0,00	0,00	4.770.604,32	204.114,48	4,47%	4,47%	8,15%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	8.196.653,21	0,00	0,00	8.562.300,90	365.647,69	4,46%	4,46%	8,76%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9.107.099,51	0,00	0,00	9.405.959,57	298.860,06	3,28%	3,28%	7,93%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	24.886.153,71	0,00	0,00	25.669.659,57	783.505,86	3,15%	3,15%	8,05%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.590.876,08	0,00	0,00	12.978.444,64	387.568,56	3,08%	3,08%	8,14%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.050.659,17	0,00	0,00	6.174.716,13	124.056,96	2,05%	2,05%	5,47%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	20.187.130,82	0,00	0,00	20.587.870,17	400.739,35	1,99%	1,99%	9,07%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	15.721,89	0,00	0,00	15.832,24	110,35	0,70%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	711.283,36	0,00	0,00	709.873,49	-1.409,87	-0,20%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	118.767.797,35	0,00	0,00	125.154.084,34	6.386.286,99	5,38%		8,42%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Maio / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	9.397.197,62	0,00	0,00	10.039.686,84	642.489,22	6,84%	6,84%	11,22%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	6.543.181,38	0,00	0,00	6.713.952,95	170.771,57	2,61%	2,61%	9,11%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	8.758.932,64	0,00	0,00	8.849.774,05	90.841,41	1,04%	1,04%	7,38%
Total Exterior	24.699.311,64	0,00	0,00	25.603.413,84	904.102,20	3,66%		9,34%

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.

