



CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.600/2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 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	23.456.591,71	9,84%	657	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	10.707.536,30	4,49%	784	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.258.546,47	0,53%	1.127	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	213.755,86	0,09%	36	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	11.883.459,84	4,98%	233	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	6.003.195,73	2,52%	370	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	7.997.695,18	3,35%	165	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	553.355,40	0,23%	775	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.209.790,70	6,80%	934	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	34.954.283,11	14,66%	1.461	23,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.243.229,38	3,88%	120	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	22.516.103,07	9,44%	207	3,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	28.934.813,74	12,14%	144	2,93%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.094.286,17	1,72%	357	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.371.563,55	2,25%	2.329	1,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	2.868.098,60	1,20%	467	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	138.285,32	0,06%	61	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	D+0	Não há	7.121.339,28	2,99%	132.998	0,08%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	612.338,75	0,26%	487	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIAÇÕES	D+7 du	Não há	721.674,93	0,30%	7.250	0,28%	Artigo 8º, Inciso I

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

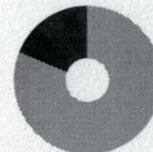
Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	938.586,68	0,39%	508	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.091.084,55	0,88%	123	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.222.280,78	2,61%	38	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
MAG FI AÇÕES	D+3	Não há	1.229.174,79	0,52%	23	10,57%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	356.329,23	0,15%	142	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.065.009,73	1,29%	50	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	D+7	Não há	939.143,67	0,39%	40	0,80%	Artigo 8º, Inciso I
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	D+4 du	Não há	3.417.278,23	1,43%	77	4,43%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	3.872.841,10	1,62%	9.129	0,59%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	6.128.441,19	2,57%	5.319	0,77%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	508.793,15	0,21%	412	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.060.348,96	4,64%	23.129	1,42%	Artigo 10º, Inciso I
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	15.832,23	0,01%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	3.733.064,60	1,57%		6,45%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			238.438.151,98				

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	8,00%	30,00%	71.531.445,59
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	122.481.439,68	51,37%	15,00%	22,00%	70,00%	44.425.266,71
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	23.843.815,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	63.784.865,13	26,75%	20,00%	30,00%	60,00%	79.278.026,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	35.765.722,80
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	47.687.630,40
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.921.907,60
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	7.121.339,28	2,99%	3,00%	5,00%	5,00%	4.800.568,32
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.921.907,60
Total Renda Fixa	100,00%	193.387.644,09	81,11%	38,00%	66,00%	220,00%	



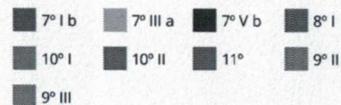
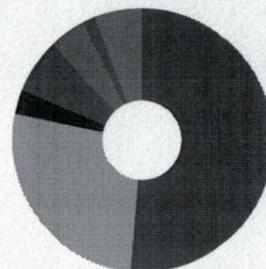
- RENDA FIXA 193.387.644,09
- RENDA VARIÁVEL 16.175.623,11
- EXTERIOR 13.927.353,67
- ESTRUTURADOS 11.076.181,19
- FUNDO IMOBILIÁRIO 3.733.064,60

Rodolfo
Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.600/2021

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	16.175.623,11	6,78%	0,00%	14,00%	30,00%	55.355.822,48
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	23.843.815,20
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	11.060.348,96	4,64%	5,00%	7,00%	10,00%	12.783.466,24
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	15.832,23	0,01%	0,01%	3,00%	5,00%	11.906.075,37
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.768.763,04
Artigo 11º	5,00%	3.733.064,60	1,57%	0,01%	1,00%	5,00%	8.188.843,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	30.984.868,90	12,99%	5,02%	25,00%	62,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	2.384.381,52
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	13.418.560,52	5,63%	4,49%	5,99%	10,00%	10.425.254,68
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	508.793,15	0,21%	0,10%	2,01%	10,00%	23.335.022,05
Total Exterior	10,00%	13.927.353,67	5,84%	4,59%	8,00%	21,00%	



Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.590/2021

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

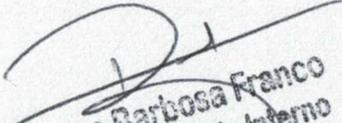
Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	122.481.439,68	51,37	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	63.784.865,13	26,75	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	7.121.339,28	2,99	3,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	16.175.623,11	6,78	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso II	13.418.560,52	5,63	4,49	10,00
Artigo 9º, Inciso III	508.793,15	0,21	0,10	10,00
Artigo 10º, Inciso I	11.060.348,96	4,64	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	15.832,23	0,01	0,01	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 11º	3.733.064,60	1,57	0,01	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00


Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.590/2021

Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	76.039.188,98	31,89	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	44.972.299,68	18,86	0,43
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	33.967.686,59	14,25	0,00
CAIXA ASSET	26.851.925,83	11,26	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	18.378.054,49	7,71	0,00
WESTERN ASSET	11.060.348,96	4,64	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	7.843.014,21	3,29	0,01
GUEPARDO INVESTIMENTOS	6.222.280,78	2,61	0,15
XP ASSET MANAGEMENT	3.872.841,10	1,62	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.733.064,60	1,57	-
TARPON INVESTIMENTOS	3.065.009,73	1,29	0,06
VINCI PARTNERS	939.143,67	0,39	-
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	612.338,75	0,26	0,02
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	508.793,15	0,21	-
META ASSET MANAGEMENT	356.329,23	0,15	0,17
PÁTRIA INVESTIMENTOS	15.832,23	0,01	0,00

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)


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
IRF-M 1 (Benchmark)	1,14%	5,42%	3,26%	6,67%	13,53%	20,82%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	5,27%	3,18%	6,49%	13,21%	20,16%	0,09%	0,42%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,57%	5,93%	3,02%	6,92%	9,45%	19,90%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,61%	5,90%	3,02%	6,87%	9,27%	19,31%	0,68%	2,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,29%	3,20%	6,46%	12,36%	25,72%	0,00%	0,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	5,91%	3,04%	6,89%	9,41%	19,60%	0,63%	2,38%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,56%	5,83%	2,96%	6,81%	9,23%	19,39%	0,67%	2,42%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,60%	5,85%	2,99%	6,83%	9,12%	18,95%	0,68%	2,41%

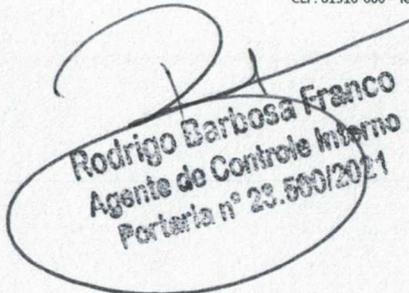
IMA-B (Benchmark)	2,53%	8,76%	7,39%	8,55%	10,47%	15,54%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,64%	8,72%	7,43%	8,46%	10,14%	15,01%	1,54%	4,39%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,85%	8,74%	7,44%	8,52%	9,94%	14,64%	1,70%	4,50%

CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88%	6,83%	5,12%	7,65%	12,47%	17,91%	0,69%	1,97%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,19%	5,17%	3,24%	6,36%	13,50%	23,20%	0,02%	0,40%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	5,34%	3,26%	6,57%	13,81%	23,57%	0,03%	0,36%
MAG FI RENDA FIXA	1,17%	5,04%	3,08%	6,24%	13,18%	23,02%	0,08%	0,41%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,15%	5,41%	3,27%	6,63%	13,86%	24,60%	0,02%	0,34%

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2023

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
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%	2,77%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,81%	6,03%	3,94%	7,24%	12,48%	16,41%	0,56%	1,65%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,58%	5,86%	3,87%	6,79%	11,68%	18,81%	0,43%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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%	-	-
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	3,94%	-1,23%	3,75%	-3,20%	-9,87%	-19,20%	8,63%	21,86%
MAG FI AÇÕES	5,01%	0,29%	5,25%	-3,09%	-2,75%	-16,89%	8,22%	19,32%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,17%	11,07%	16,40%	7,42%	9,91%	13,90%	9,19%	26,96%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	13,28%	13,36%	13,63%	7,95%	20,91%	24,32%	6,83%	28,64%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,80%	3,42%	6,11%	1,95%	2,94%	-1,12%	5,57%	16,90%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,70%	-0,90%	3,15%	-4,34%	-5,27%	-17,03%	8,41%	19,42%

IBX (Benchmark)	3,59%	-2,09%	2,36%	-4,66%	-4,47%	-16,34%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	4,78%	-7,50%	-2,98%	-11,16%	-12,93%	-31,51%	10,96%	25,50%

IFIX (Benchmark)	5,43%	5,10%	7,30%	5,10%	6,84%	6,99%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-1,91%	-3,80%	-4,66%	-4,70%	-11,43%	22,96%	-	-

IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	0,70%	3,65%	2,39%	3,88%	4,14%	112,89%	-	-

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	0,25%	8,86%	5,28%	2,44%	1,15%	-0,58%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,18%	12,23%	7,31%	6,80%	10,56%	15,90%	6,05%	21,82%

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
SMLL (Benchmark)	13,54%	4,71%	13,69%	1,56%	-7,34%	-32,24%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	9,56%	4,08%	7,50%	0,91%	-9,69%	-29,84%	9,59%	28,04%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	9,66%	-2,13%	3,77%	-4,69%	-12,67%	-28,06%	9,92%	27,65%

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.600/2021

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

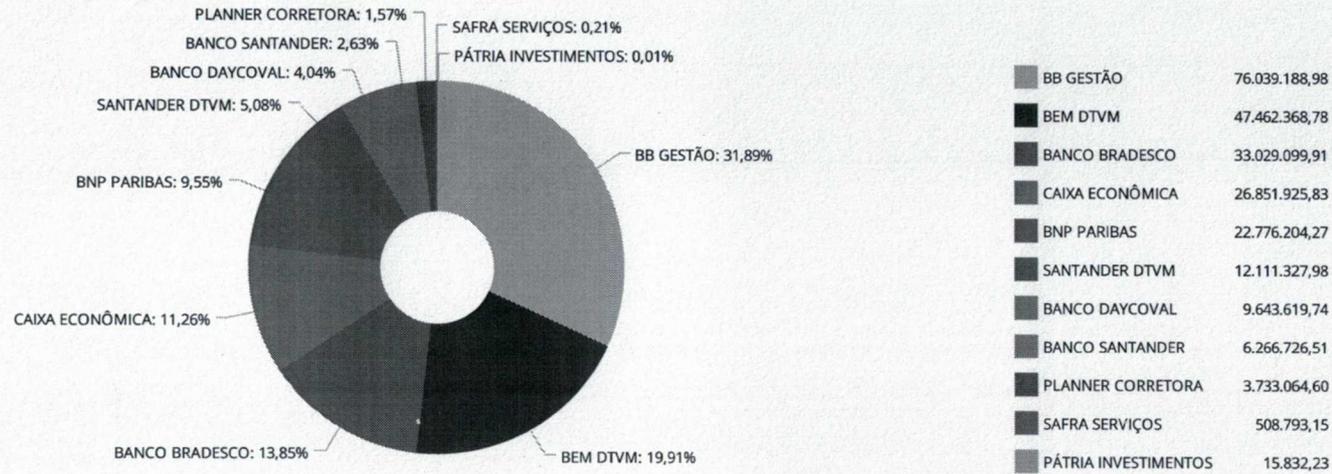
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,90%	14,58%	8,54%	9,75%	14,79%	-0,17%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,71%	7,52%	4,60%	2,50%	8,12%	-9,49%	7,22%	14,719%

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%	-	-
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	4,72%	3,12%	-0,51%	1,90%	-7,46%	-33,06%	9,20%	20,758%

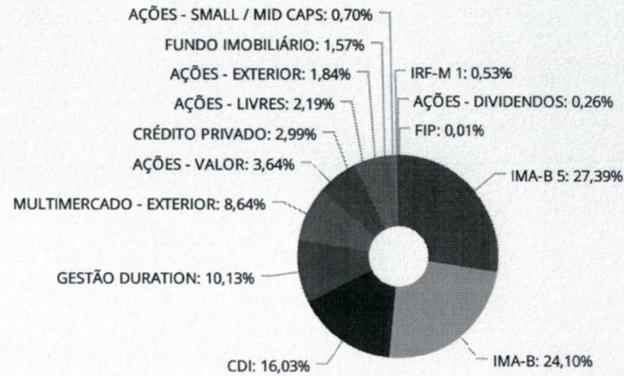

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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



Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.600/2021

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



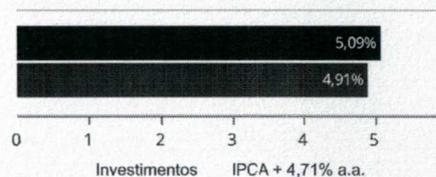
■ IMA-B 5	65.309.125,98	■ IMA-B	57.470.386,18	■ CDI	38.218.299,07	■ GESTÃO DURATION	24.148.232,43
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.606.068,38	■ AÇÕES - VALOR	8.669.694,56	■ CRÉDITO PRIVADO	7.121.339,28	■ AÇÕES - LIVRES	5.233.328,19
■ AÇÕES - EXTERIOR	4.381.634,25	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	3.733.064,60	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.660.261,61	■ IRF-M 1	1.258.546,47
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	612.338,75	■ FIP	15.832,23				

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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	223.796.588,87	12.539.062,06	12.362.323,08	227.589.514,36	3.616.186,51	3.616.186,51	1,61%	1,61%	0,93%	0,93%	172,73%	2,69%
Fevereiro	227.589.514,36	25.946.684,84	25.647.672,62	227.579.922,73	-308.603,85	3.307.582,66	-0,14%	1,48%	1,17%	2,12%	69,74%	2,27%
Março	227.579.922,73	34.347.476,63	32.777.536,62	230.825.157,11	1.675.294,37	4.982.877,03	0,73%	2,22%	1,13%	3,28%	67,74%	2,09%
Abril	230.825.157,11	61.881.489,12	61.419.086,00	233.661.284,29	2.373.724,06	7.356.601,09	1,03%	3,27%	0,94%	4,25%	76,93%	1,83%
Maio	233.661.284,29	81.094.754,70	80.456.211,96	238.438.151,98	4.138.324,95	11.494.926,04	1,77%	5,09%	0,63%	4,91%	103,74%	2,26%

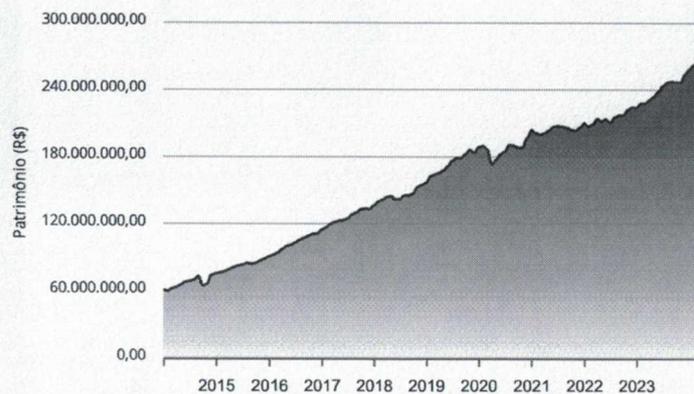
Investimentos x Meta de Rentabilidade



Rodrigo Barbosa Franco
Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 28.560/2021

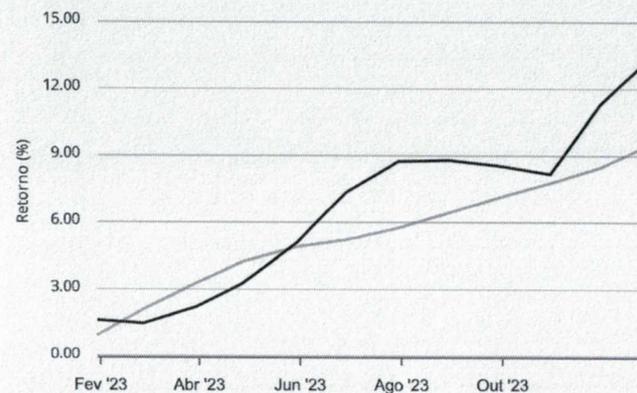
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	21.238.806,53	13.000.000,00	0,00	34.954.283,11	715.476,58	2,09%	2,85%	1,70%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	543.544,14	0,00	0,00	553.355,40	9.811,26	1,81%	1,81%	0,56%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	136.139,39	0,00	0,00	138.285,32	2.145,93	1,58%	1,58%	0,43%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	2.834.335,67	0,00	0,00	2.868.098,60	33.762,93	1,19%	1,19%	0,02%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.047.300,52	0,00	0,00	4.094.286,17	46.985,65	1,16%	1,16%	0,03%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CR...	7.040.144,15	0,00	0,00	7.121.339,28	81.195,13	1,15%	1,15%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	211.415,78	0,00	0,00	213.755,86	2.340,08	1,11%	1,11%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.366.560,84	0,00	122.721,16	1.258.546,47	14.706,79	1,08%	1,12%	0,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.601.338,52	20.664.707,73	0,00	23.456.591,71	190.545,46	0,82%	1,88%	0,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	39.579.090,83	3.818,09	39.874.928,69	0,00	292.019,77	0,74%	1,19%	0,13%
MAG FI RENDA FIXA	18.242.496,18	0,00	13.000.000,00	5.371.563,55	129.067,37	0,71%	1,17%	0,08%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.484.251,99	0,00	13.569.813,52	0,00	85.561,53	0,63%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	23.102.380,83	0,00	12.533.503,35	10.707.536,30	138.658,82	0,60%	0,61%	0,68%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	28.763.404,35	0,00	0,00	28.934.813,74	171.409,39	0,60%	0,60%	0,68%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	403.070,11	21.981.486,68	0,00	22.516.103,07	131.546,28	0,59%	2,64%	1,54%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	9.191.859,04	0,00	0,00	9.243.229,38	51.370,34	0,56%	0,56%	0,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.560.696,35	5.569.813,51	0,00	16.209.790,70	79.280,84	0,49%	0,63%	0,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	11.874.928,69	0,00	11.883.459,84	8.531,15	0,07%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.003.735,48	0,00	0,00	6.003.195,73	-539,75	-0,01%	-0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	8.000.000,00	0,00	7.997.695,18	-2.304,82	-0,03%	-	-

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.580/2021

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

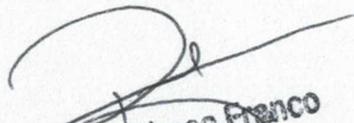
Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	189.350.570,70	81.094.754,70	79.100.966,72	193.525.929,41	2.181.570,73	1,14%		0,91%


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.705.718,98	0,00	0,00	3.065.009,73	359.290,75	13,28%	13,28%	6,83%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.597.262,38	0,00	0,00	6.222.280,78	625.018,40	11,17%	11,17%	9,19%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	855.947,55	0,00	0,00	938.586,68	82.639,13	9,65%	9,65%	9,92%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	658.676,56	0,00	0,00	721.674,93	62.998,37	9,56%	9,56%	9,59%
MAG FI AÇÕES	2.436.014,98	0,00	1.355.245,24	1.229.174,79	148.405,05	6,09%	5,01%	8,22%
META VALOR FI AÇÕES	340.085,37	0,00	0,00	356.329,23	16.243,86	4,78%	4,78%	10,96%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	903.540,54	0,00	0,00	939.143,67	35.603,13	3,94%	3,94%	8,63%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	589.906,34	0,00	0,00	612.338,75	22.432,41	3,80%	3,80%	5,57%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.016.466,61	0,00	0,00	2.091.084,55	74.617,94	3,70%	3,70%	8,41%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.931.912,34	0,00	0,00	11.060.348,96	128.436,62	1,17%	1,17%	6,05%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	15.721,86	0,00	0,00	15.832,23	110,37	0,70%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	3.805.559,67	0,00	0,00	3.733.064,60	-72.495,07	-1,90%	-1,91%	-
Total Renda Variável	30.856.813,18	0,00	1.355.245,24	30.984.868,90	1.483.300,96	4,81%		7,50%



Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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 INVESTMENT...	3.624.998,85	0,00	0,00	3.872.841,10	247.842,25	6,84%	6,84%	11,22%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	3.263.130,77	0,00	0,00	3.417.278,23	154.147,46	4,72%	4,72%	9,20%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	500.236,99	0,00	0,00	508.793,15	8.556,16	1,71%	1,71%	7,22%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	6.065.533,80	0,00	0,00	6.128.441,19	62.907,39	1,04%	1,04%	7,38%
Total Exterior	13.453.900,41	0,00	0,00	13.927.353,67	473.453,26	3,52%		8,89%

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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 E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS. 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>.

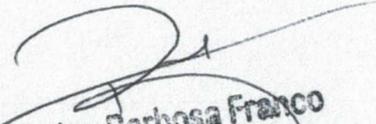
Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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.



Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021