CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

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

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

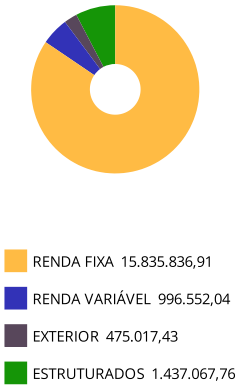
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.562.535,54	8,34%	664	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.007.583,41	5,38%	942	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.486.544,65	7,93%	773	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.159.049,44	11,52%	901	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.559.223,89	13,65%	927	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	870.331,19	4,64%	71	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.087.869,65	11,14%	208	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	393.968,72	2,10%	379	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.708.730,42	19,79%	233	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	238.585,41	1,27%	21.398	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	757.966,63	4,04%	83	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	475.017,43	2,53%	3.835	0,27%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	719.995,29	3,84%	182	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	349.194,60	1,86%	6.968	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	367.877,87	1,96%	3.078	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			**18.744.474,14**				

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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%	0,00	0,00%	0,00%	32,00%	71,95%	13.486.649,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	8.774.936,93	46,81%	20,49%	39,00%	81,95%	6.586.159,63
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.874.447,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	7.060.899,98	37,67%	20,89%	16,00%	60,00%	4.185.784,50
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	3.748.894,83
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	937.223,71
Total Renda Fixa	100,00%	15.835.836,91	84,48%	41,38%	87,00%	248,90%	

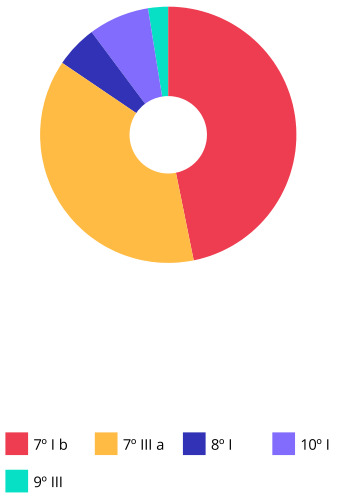


Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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%	996.552,04	5,32%	1,00%	5,00%	20,00%	2.752.342,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.437.067,76	7,67%	3,00%	5,00%	10,00%	437.379,65
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	2.433.619,80	12,98%	4,00%	10,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	475.017,43	2,53%	0,00%	3,00%	10,00%	1.399.429,98
Total Exterior	10,00%	475.017,43	2,53%	0,00%	3,00%	10,00%	



Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	8.293.884,04	44,25	-
CAIXA DTVM	6.921.890,45	36,93	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.528.699,65	18,83	-

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 '	0,00	0,00	0,00	71,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	8.774.936,93	46,81	20,49	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.973.030,33	26,53	20,89	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	996.552,04	5,32	1,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	475.017,43	2,53	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.437.067,76	7,67	3,00	10,00

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	6,60%	2,14%	6,60%	9,23%	19,78%	0,83%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	0,03%
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%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,57%	11,73%	7,47%	11,73%	12,55%	16,53%	2,29%	0,05%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	6,46%	3,25%	6,46%	13,73%	24,70%	0,03%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,30%	7,10%	3,67%	7,10%	13,07%	25,65%	0,28%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,22%	6,56%	3,37%	6,56%	13,54%	24,64%	0,21%	0,01%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	6,57%	3,17%	6,57%	13,52%	21,80%	0,47%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
ITAÚ 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%
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%

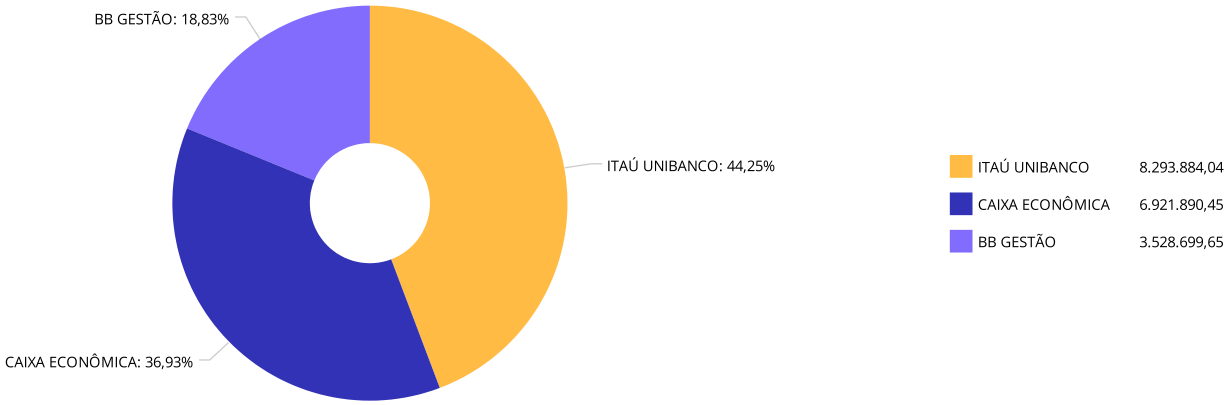
Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	-1,02%	-0,16%	2,20%	-0,16%	2,31%	2,05%	5,44%	13,145%

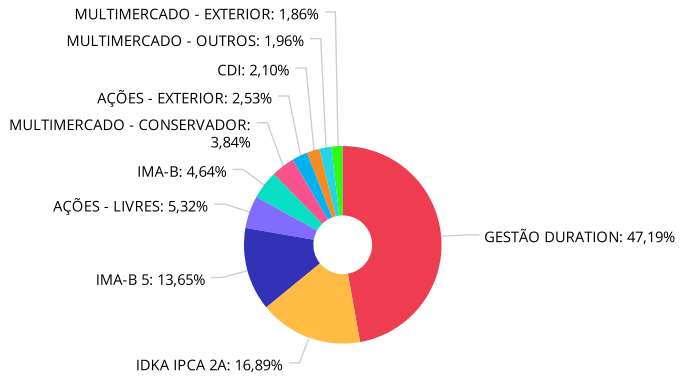
Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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



Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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

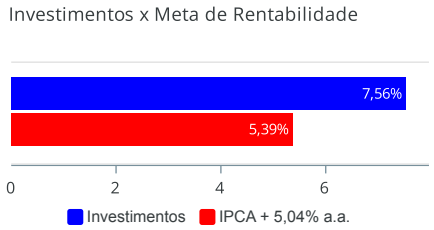


GESTÃO DURATION	8.845.680,26	IDKA IPCA 2A	3.166.632,85	IMA-B 5	2.559.223,89
AÇÕES - LIVRES	996.552,04	IMA-B	870.331,19	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	719.995,29
AÇÕES - EXTERIOR	475.017,43	CDI	393.968,72	MULTIMERCADO - OUTROS	367.877,87
MULTIMERCADO - EXTERIOR	349.194,60				

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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	18.128.566,53	0,00	0,00	18.355.392,69	226.826,16	226.826,16	1,25%	1,25%	0,96%	0,96%	130,00%	1,80%
Fevereiro	18.355.392,69	0,00	0,00	18.442.802,10	87.409,41	314.235,57	0,48%	1,73%	1,19%	2,17%	79,92%	1,62%
Março	18.442.802,10	0,00	0,00	18.672.072,12	229.270,02	543.505,59	1,24%	3,00%	1,16%	3,36%	89,31%	1,47%
Abril	18.672.072,12	0,00	0,00	18.865.435,34	193.363,22	736.868,81	1,04%	4,06%	0,96%	4,35%	93,37%	1,34%
Maio	18.865.435,34	0,00	500.000,00	18.649.559,79	284.124,45	1.020.993,26	1,51%	5,63%	0,66%	5,04%	111,67%	1,24%
Junho	18.649.559,79	0,00	640.000,00	18.350.505,42	340.945,63	1.361.938,89	1,83%	7,56%	0,33%	5,39%	140,31%	1,39%



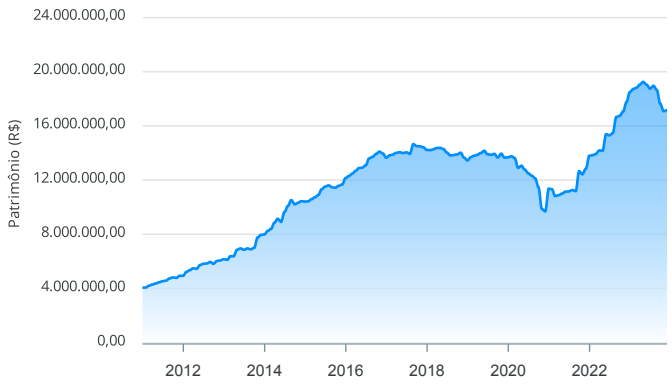
Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

CRÉDITO & MERCADO

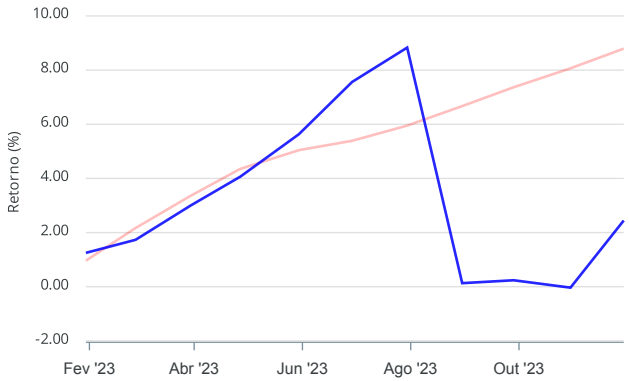
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	848.502,82	0,00	0,00	870.331,19	21.828,37	2,57%	2,57%	2,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.042.443,83	0,00	0,00	2.087.869,65	45.425,82	2,22%	2,22%	1,33%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.534.844,77	0,00	0,00	1.562.535,54	27.690,77	1,80%	1,80%	0,95%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.089.611,50	0,00	640.000,00	1.486.544,65	36.933,15	1,77%	2,10%	0,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.661.214,63	0,00	0,00	3.708.730,42	47.515,79	1,30%	1,30%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	389.422,45	0,00	0,00	393.968,72	4.546,27	1,17%	1,17%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.136.757,36	0,00	0,00	2.159.049,44	22.292,08	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.533.093,70	0,00	0,00	2.559.223,89	26.130,19	1,03%	1,03%	0,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	997.414,75	0,00	0,00	1.007.583,41	10.168,66	1,02%	1,02%	0,78%
Total Renda Fixa	**16.233.305,81**	**0,00**	**640.000,00**	**15.835.836,91**	**242.531,10**	**1,49%**		**0,85%**

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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 SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	218.962,44	0,00	0,00	238.585,41	19.622,97	8,96%	8,96%	7,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	703.473,68	0,00	0,00	757.966,63	54.492,95	7,75%	7,75%	7,86%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	326.336,77	0,00	0,00	349.194,60	22.857,83	7,00%	7,00%	5,04%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	363.435,55	0,00	0,00	367.877,87	4.442,32	1,22%	1,22%	0,21%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	713.561,59	0,00	0,00	719.995,29	6.433,70	0,90%	0,90%	0,47%
Total Renda Variável	**2.325.770,03**	**0,00**	**0,00**	**2.433.619,80**	**107.849,77**	**4,64%**		**4,07%**

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	479.906,40	0,00	0,00	475.017,43	-4.888,97	-1,02%	-1,02%	5,44%
Total Exterior	**479.906,40**	**0,00**	**0,00**	**475.017,43**	**-4.888,97**	**-1,02%**		**5,44%**

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.577.593,53	0,00	0,00	3.708.730,42	131.136,89	3,67%	3,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.971.342,90	0,00	0,00	2.087.869,65	116.526,75	5,91%	5,91%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.530.155,35	0,00	1.140.000,00	1.486.544,65	96.389,30	3,81%	4,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.487.560,92	0,00	0,00	1.562.535,54	74.974,62	5,04%	5,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.495.133,55	0,00	0,00	2.559.223,89	64.090,34	2,57%	2,57%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	809.830,06	0,00	0,00	870.331,19	60.501,13	7,47%	7,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.113.902,61	0,00	0,00	2.159.049,44	45.146,83	2,14%	2,14%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	986.867,31	0,00	0,00	1.007.583,41	20.716,10	2,10%	2,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	381.571,03	0,00	0,00	393.968,72	12.397,69	3,25%	3,25%
Total Renda Fixa	**16.353.957,26**	**0,00**	**1.140.000,00**	**15.835.836,91**	**621.879,65**	**3,80%**	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	656.133,64	0,00	0,00	757.966,63	101.832,99	15,52%	15,52%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	316.217,51	0,00	0,00	349.194,60	32.977,09	10,43%	10,43%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	208.781,71	0,00	0,00	238.585,41	29.803,70	14,28%	14,28%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	697.889,20	0,00	0,00	719.995,29	22.106,09	3,17%	3,17%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	355.883,06	0,00	0,00	367.877,87	11.994,81	3,37%	3,37%
Total Renda Variável	**2.234.905,12**	**0,00**	**0,00**	**2.433.619,80**	**198.714,68**	**8,89%**	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	464.780,77	0,00	0,00	475.017,43	10.236,66	2,20%	2,20%
Total Exterior	**464.780,77**	**0,00**	**0,00**	**475.017,43**	**10.236,66**	**2,20%**	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.462.834,74	0,00	0,00	3.708.730,42	245.895,68	7,10%	7,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.893.269,19	0,00	0,00	2.087.869,65	194.600,46	10,28%	10,28%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.450.571,13	0,00	1.140.000,00	1.486.544,65	175.973,52	7,18%	8,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.391.715,53	0,00	0,00	2.559.223,89	167.508,36	7,00%	7,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.025.417,66	0,00	0,00	2.159.049,44	133.631,78	6,60%	6,60%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.436.733,20	0,00	0,00	1.562.535,54	125.802,34	8,76%	8,76%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	778.946,34	0,00	0,00	870.331,19	91.384,85	11,73%	11,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	945.536,09	0,00	0,00	1.007.583,41	62.047,32	6,56%	6,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	370.070,22	0,00	0,00	393.968,72	23.898,50	6,46%	6,46%
Total Renda Fixa	**15.755.094,10**	**0,00**	**1.140.000,00**	**15.835.836,91**	**1.220.742,81**	**7,75%**	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	290.579,75	0,00	0,00	349.194,60	58.614,85	20,17%	20,17%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	675.622,27	0,00	0,00	719.995,29	44.373,02	6,57%	6,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	729.464,46	0,00	0,00	757.966,63	28.502,17	3,91%	3,91%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	345.222,35	0,00	0,00	367.877,87	22.655,52	6,56%	6,56%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	226.862,50	0,00	0,00	238.585,41	11.722,91	5,17%	5,17%
Total Renda Variável	**2.267.751,33**	**0,00**	**0,00**	**2.433.619,80**	**165.868,47**	**7,31%**	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	475.791,32	0,00	0,00	475.017,43	-773,89	-0,16%	-0,16%
Total Exterior	**475.791,32**	**0,00**	**0,00**	**475.017,43**	**-773,89**	**-0,16%**	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053

CRÉDITO & MERCADO

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 ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Av. Paulista, 302 - Cj. 10, Bairro Bela Vista, São Paulo/SP
CEP: 01310-000 - Telefone: (11) 3168-0053