

**CMPREV - Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do
Município de Cândido Mota/SP**

Rua: Antônio Pipolo Sobrinho, nº 603 - Telefone: 3341-1059 - email:
prev@candidomotaprev.com.br

**ATA DA 6ª REUNIÃO ORDINÁRIA DE 2023 DO COMITÊ DE
INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES
PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE CÂNDIDO MOTA/SP.**

Local: Instituto de Previdência dos Servidores Públicos de Cândido Mota.

Data: Ao 12º (decimo segundo) dia do mês de julho de 2023 o Comitê de Investimentos, se reuniu para discutir e deliberar os assuntos que seguem

Participantes: Comitê de Investimentos, Presidente Horst Gunther Muller e os membros titulares, Eduardo Faria.

Convidados: *Mauricio* Mario Alcântara e Josiane Rossi (assessora de investimentos)

Ausentes:

Foi passada a palavra ao Presidente do Comitê de Investimentos Sr. Horst Gunther Muller que fez a abertura e logo após foi apresentado ao Comitê de Investimento os itens da Pauta, pela assessora de investimentos Josiane Rossi.

Itens da Pauta

1. Explicação e avaliação do comportamento da Carteira RPPS do Instituto, com fechamento junho 2023 e do 2º trimestre

Carteira Consolidada de Investimentos – mês base junho de 2023 com a importância líquida patrimonial de R\$103.633.402,55 (cento e três milhões seiscentos e trinta e três mil quatrocentos e dois reais e cinquenta e cinco centavos). Na renda fixa os investimentos se posicionaram em R\$90.068.885,71 (noventa milhões sessenta e oito mil oitocentos e oitenta e cinco reais e setenta e um centavos), e no segmento de renda variável a carteira apresenta, R\$13.564.516,84 (treze milhões quinhentos e sessenta e quatro mil quinhentos e dezesseis reais e oitenta e quatro centavos).

Anexo encontra-se o relatório com o fechamento do 2º trimestre para apreciação do Comitê de Investimentos, juntamente com a evolução da carteira.

2. Fundos Estruturados

**W7 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIAS -
CNPJ: 15.711.367/0001-90-**

Saldo atual: R\$ 2.775.190,24

Situação: Fundo em fase de liquidação, com acompanhamento mensal.

**CMPREV - Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do
Município de Cândido Mota/SP**

Rua: Antônio Pipolo Sobrinho, nº 603 - Telefone: 3341-1059 - email:
prev@candidomotaprev.com.br

GGR PRIME FIDC SÊNIOR CNPJ: 02.671.743/0001-19

Saldo atual: R\$ 3.845.076,14

Situação: Fundo em fase de liquidação com amortizações semestrais.

MZL IMA-B FI Renda Fixa CNPJ: 27.385.044/0001-33

Saldo atual: R\$ 71.132,94

Situação: Fundo em fase de liquidação,

REAG MULTIATIVOS IMOBILIARIOS FII –CNPJ 17.374.696/0001-19

Saldo atual: R\$ 3.118.735,86

Situação: Fundo requer um acompanhamento mensal, pois trata-se de um fundo de condomínio fechado com tempo indeterminado e com valor de cotas patrimoniais, onde vem ocorrendo mensalmente, pagamentos de rendimentos no valor de R\$ 7.800,00, no mês de junho tivemos uma melhora no valor patrimonial das cotas, onde podemos ter um resultado positivo.

3. Cenário atual

Mediante a atual situação do cenário Econômico que estamos passando e conforme posicionado na reunião anterior, o Comitê de Investimentos efetivou as seguintes realocações e aplicações nos fundos que segue:

Realocamos R\$4.000.000,00(quatro milhões de reais) do Caixa Brasil Títulos Públicos para o Caixa Brasil IDKA 2Pre Fic Renda Fixa LP.

Realocamos R\$4.000.000,00(quatro milhões de reais) do Caixa Brasil Referenciado DI para o Caixa Brasil Gestão Estratégica.

Realocamos R\$3.500.000,00 (Três milhões e quinhentos mil reais) do Caixa Matriz FI Renda Fixa para o Caixa Brasil IMA-B.

Podemos observar nestas movimentações, que são fundos que já possuímos em nosso portfólio e com a mudança de cenário estamos realocando fundos pós-fixados para títulos pré-fixados, esta mudança se faz necessária para melhor atingimento da meta atuarial.

Com a extinção do Fundo Fic Pratico, que possui o perfil de fundo com aplicação e resgate automático, imigramos o mesmo para o Fundo Caixa Disponibilidades CNPJ: 14.508.643/0001-55, com as mesmas características e com taxa ADM inferior ao Fic Pratico.

Solicitamos também ao Comitê, a abertura de um fundo na renda variável a ser analisada e apresentada posteriormente.

Não havendo mais assuntos a serem deliberados, os trabalhos são encerrados. Todos os itens, foram debatidos e aprovados por unanimidade. Do que, para constar foi lavrada a presente Ata que lida e achada conforme, vai assinada por todos os presentes.

**CMPREV - Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do
Município de Cândido Mota/SP**

Rua: Antônio Pipolo Sobrinho, nº 603 - Telefone: 3341-1059 - email:

prev@candidomotaprev.com.br

Comitê de Investimentos

Horst Gunther Muller

Eduardo Faria

Presidente do Instituto de Cândido Mota

Mauricio Mario Alcântara

Diretor Administrativo/Financeiro

Jovane Bordim de Moraes

Assessora de Investimentos

Josiane Rossi



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.



CRÉDITO
& MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	2.113.023,23	2,04%	301	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	3.745.958,13	3,61%	45	1,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.028.044,67	9,68%	773	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.392.377,61	4,24%	901	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.804.859,10	2,71%	45	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.544.499,67	3,42%	927	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.003.651,42	0,97%	723	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.676.426,86	7,41%	1.186	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.115.032,12	15,55%	714	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	4.821.958,09	4,65%	16.763	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.086.835,13	2,01%	1.126	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	15.456.585,65	14,91%	1.004	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.363.424,95	11,93%	416	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
MZL IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	30 dias	71.132,94	0,07%	7	7,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.845.076,14	3,71%	33	3,06%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	87.994,93	0,08%	6.604	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	135.704,82	0,13%	5.984	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	1.118.956,00	1,08%	583	0,63%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERC...	D+2 du	806 dias	531.057,24	0,51%	606	0,39%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	5.796.877,75	5,59%	3.078	0,35%	Artigo 10º, Inciso I



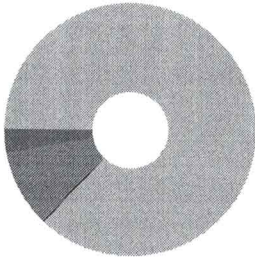
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.775.190,24	2,68%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	3.118.735,86	3,01%		0,00%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		0,01	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			103.633.402,55				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			0,01				Artigo 6º
		PL Total	103.633.402,56				



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%	15,00%	86,17%	89.300.902,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	56.245.830,90	54,27%	20,05%	26,73%	86,17%	33.055.072,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	29.977.978,67	28,93%	17,01%	22,68%	55,00%	27.020.392,73
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	20.726.680,51
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	3.845.076,14	3,71%	3,00%	4,50%	5,00%	1.336.593,99
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	5.181.670,13
Total Renda Fixa	100,00%	90.068.885,71	86,91%	40,06%	80,91%	257,34%	



RENDA FIXA 90.068.885,71

RENDA VARIÁVEL 223.699,75

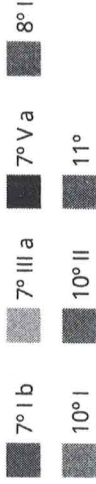
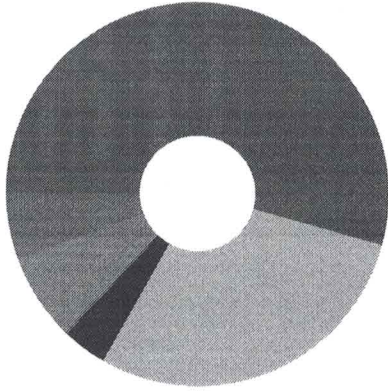
ESTRUTURADOS 10.222.081,23

FUNDO IMOBILIÁRIO 3.118.735,86



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%	223.699,75	0,22%	0,20%	3,00%	20,00%	20.502.980,76
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.181.670,13
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	7.446.890,99	7,19%	1,00%	3,62%	10,00%	2.916.449,27
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	2.775.190,24	2,68%	2,34%	3,12%	5,00%	2.406.479,89
Artigo 11º	5,00%	3.118.735,86	3,01%	2,51%	3,35%	5,00%	2.062.934,27
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	13.564.516,84	13,09%	6,05%	13,09%	45,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	10.363.340,26
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]



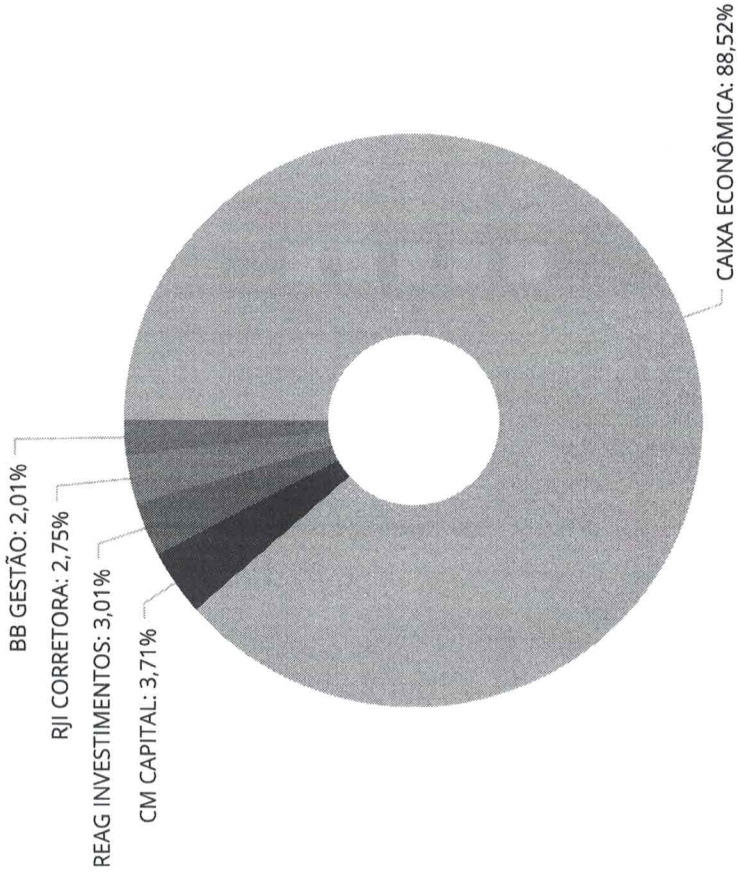
Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	91.736.432,24	88,52	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.845.076,14	3,71	1,51
REAG GESTORA DE RECURSOS	3.118.735,86	3,01	0,01
KPTL	2.775.190,24	2,68	696,68
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.086.835,13	2,01	-
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	71.132,94	0,07	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'	0,00	0,00	0,00	86,17
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	56.245.830,90	54,27	20,05	86,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	29.977.978,67	28,93	17,01	55,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	3.845.076,14	3,71	3,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	223.699,75	0,22	0,20	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	7.446.890,99	7,19	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	2.775.190,24	2,68	2,34	5,00
Artigo 11º	3.118.735,86	3,01	2,51	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

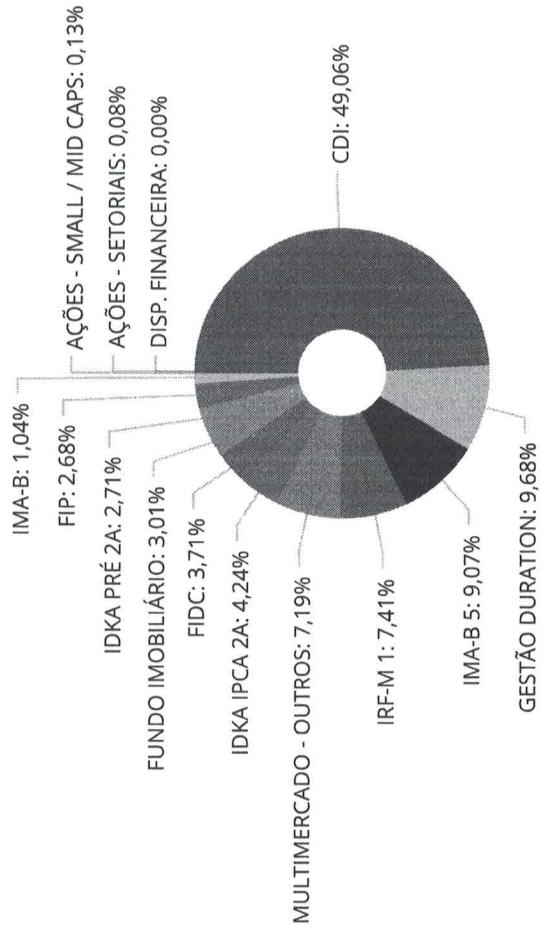


CAIXA ECONÔMICA	91.736.432,24
CM CAPITAL	3.845.076,14
REAG INVESTIMENTOS	3.118.735,86
RJI CORRETORA	2.846.323,18
BB GESTÃO	2.086.835,13

[Handwritten signatures]



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



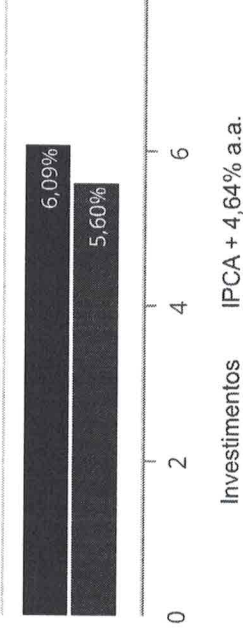
■ CDI	50.843.835,94	■ GESTÃO DURATION	10.028.044,67	■ IMA-B 5	9.403.481,03	■ IRF-M 1	7.676.426,86
■ MULTIMERCADO - OUTROS	7.446.890,99	■ IDKA IPCA 2A	4.392.377,61	■ FIDC	3.845.076,14	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	3.118.735,86
■ IDKA PRÉ 2A	2.804.859,10	■ FIP	2.775.190,24	■ IMA-B	1.074.784,36	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	135.704,82
■ AÇÕES - SETORIAIS	87.994,93	■ DISP. FINANCEIRA	0,01				



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	100.099.996,01	2.799.480,79	3.046.573,13	100.852.925,04	1.000.021,37	1.000.021,37	1,00%	1.00%	0,93%	0,93%	107,55%	0,39%
Fevereiro	100.852.925,04	2.786.171,18	3.014.885,89	101.216.685,20	592.474,87	1.592.496,24	0,59%	1.59%	1,17%	2,11%	75,58%	0,67%
Março	101.216.685,20	8.723.425,39	9.349.188,40	101.722.526,99	1.131.604,80	2.724.101,04	1,12%	2.73%	1,13%	3,26%	83,73%	0,37%
Abril	101.722.526,99	2.676.345,86	3.009.319,07	102.189.698,86	800.145,08	3.524.246,12	0,79%	3.54%	0,94%	4,23%	83,69%	0,28%
Mai	102.189.698,86	10.543.986,13	11.171.087,33	102.699.141,70	1.136.544,04	4.660.790,16	1,11%	4,69%	0,63%	4,88%	96,07%	0,30%
Junho	102.699.141,70	2.633.708,57	3.079.300,12	103.633.402,55	1.379.852,40	6.040.642,56	1,34%	6,09%	0,69%	5,60%	108,84%	0,40%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

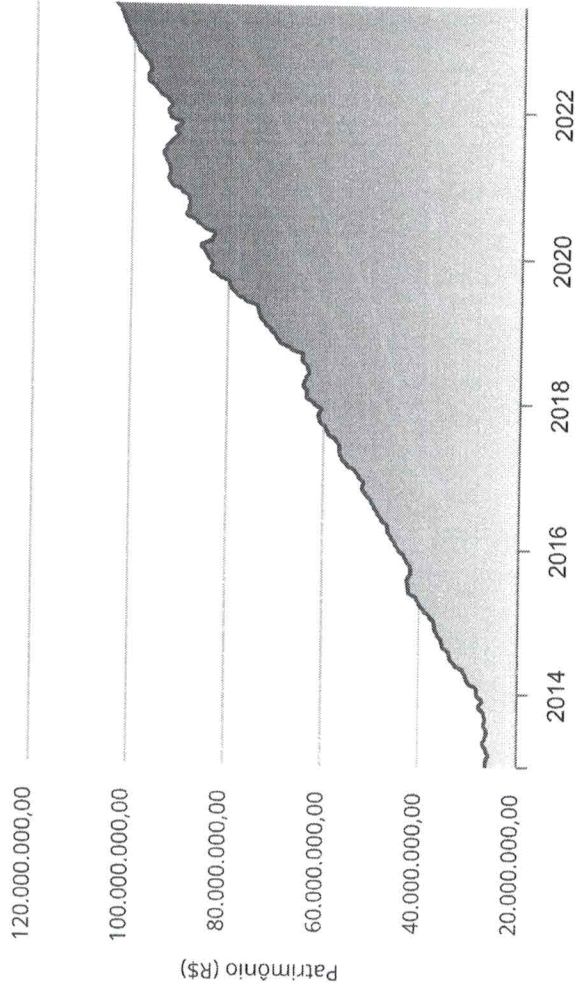


Handwritten signature and initials in blue ink.

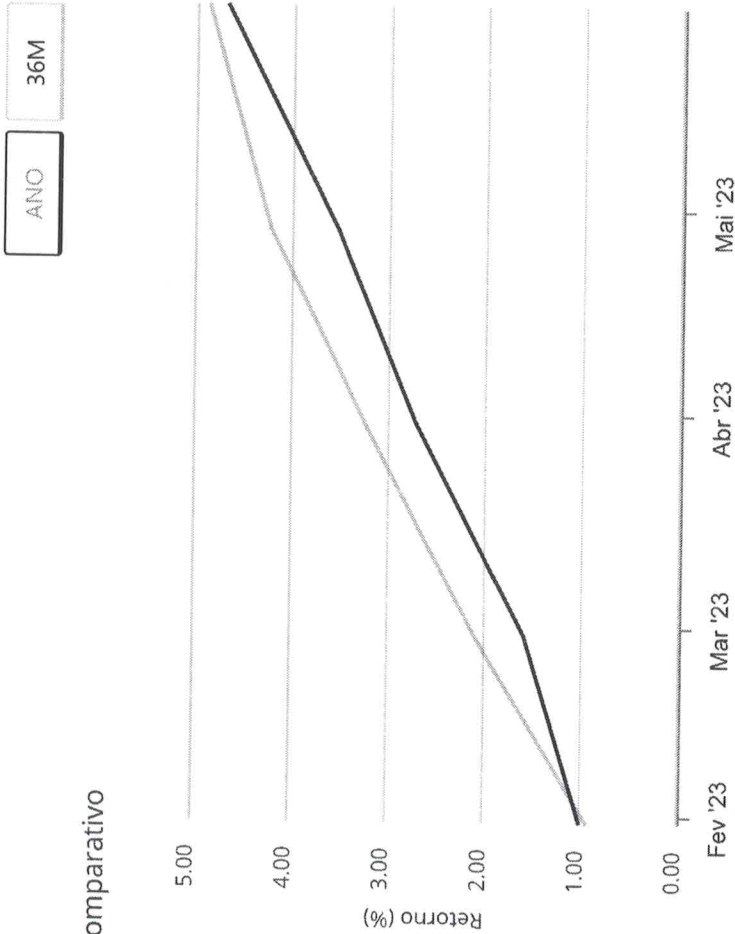


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 ☐ SMLL ☐ IDIV



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	980.574,07	0,00	0,00	1.003.651,42	23.077,35	2,35%	2,35%	2,12%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	2.744.697,94	0,00	0,00	2.804.859,10	60.161,16	2,19%	2,19%	1,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.821.327,23	0,00	0,00	10.028.044,67	206.717,44	2,10%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.588.554,17	0,00	0,00	7.676.426,86	87.872,69	1,16%	1,16%	0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	12.222.012,61	0,00	0,00	12.363.424,95	141.412,34	1,16%	1,16%	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.935.261,38	0,00	0,00	16.115.032,12	179.770,74	1,13%	1,13%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.276.599,83	0,00	1.000.000,00	15.456.585,65	179.985,82	1,11%	1,12%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.026.571,32	38.122,87	0,00	2.086.835,13	22.140,94	1,07%	1,09%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.347.026,55	0,00	0,00	4.392.377,61	45.351,06	1,04%	1,04%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.508.309,61	0,00	0,00	3.544.499,67	36.190,06	1,03%	1,03%	0,88%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.710.319,50	0,00	0,00	3.745.958,13	35.638,63	0,96%	0,96%	1,44%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.093.522,88	0,00	0,00	2.113.023,23	19.500,35	0,93%	0,93%	0,47%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.262.747,43	2.595.585,70	2.071.500,12	4.821.958,09	35.125,08	0,51%	0,85%	0,00%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.846.901,07	0,00	0,00	3.845.076,14	-1.824,93	-0,05%	-0,05%	0,30%
MZL IMA-B FI RENDA FIXA	73.828,53	0,00	0,00	71.132,94	-2.695,59	-3,65%	-3,65%	0,03%
Total Renda Fixa	89.438.254,12	2.633.708,57	3.071.500,12	90.068.885,71	1.068.423,14	1,19%		0,34%



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
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	80.465,05	0,00	0,00	87.994,93	7.529,88	9,36%	9,36%	10,36%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	125.615,65	0,00	0,00	135.704,82	10.089,17	8,03%	8,03%	10,00%
REAG MULTIATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	2.973.074,58	0,00	7.800,00	3.118.735,86	153.461,28	5,16%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	1.068.144,00	0,00	0,00	1.118.956,00	50.812,00	4,76%	4,76%	2,45%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCAD ...	507.455,10	0,00	0,00	531.057,24	23.602,14	4,65%	4,65%	3,84%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	5.726.877,37	0,00	0,00	5.796.877,75	70.000,38	1,22%	1,22%	0,21%
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	2.779.255,83	0,00	0,00	2.775.190,24	-4.065,59	-0,15%	-	-
Total Renda Variável	13.260.887,58	0,00	7.800,00	13.564.516,84	311.429,26	2,35%		1,08%



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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.907.145,91	0,00	2.327.949,11	16.115.032,12	535.835,32	2,99%	3,23%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.940.418,40	0,00	1.000.000,00	15.456.585,65	516.167,25	3,24%	3,25%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.563.697,91	0,00	0,00	10.028.044,67	464.346,76	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	11.966.453,30	0,00	0,00	12.363.424,95	396.971,65	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.441.923,59	0,00	0,00	7.676.426,86	234.503,27	3,15%	3,15%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	2.662.237,39	0,00	0,00	2.804.859,10	142.621,71	5,36%	5,36%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.910.446,17	12.004.389,61	10.188.775,65	4.821.958,09	95.897,96	0,64%	2,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.300.530,77	0,00	0,00	4.392.377,61	91.846,84	2,14%	2,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.455.735,20	0,00	0,00	3.544.499,67	88.764,47	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	937.446,80	0,00	0,00	1.003.651,42	66.204,62	7,06%	7,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.875.478,33	149.650,95	0,00	2.086.835,13	61.705,85	3,05%	3,16%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.661.437,80	0,00	3.719.581,76	0,00	58.143,96	1,59%	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.700.000,00	0,00	3.745.958,13	45.958,13	1,24%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.083.042,72	0,00	0,00	2.113.023,23	29.980,51	1,44%	1,44%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.834.886,59	0,00	0,00	3.845.076,14	10.189,55	0,27%	0,27%
MZL IMA-B FI RENDA FIXA	79.244,05	0,00	0,00	71.132,94	-8.111,11	-10,24%	-10,24%
Total Renda Fixa	88.620.124,93	15.854.040,56	17.236.306,52	90.068.885,71	2.831.026,74	2,71%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	5.607.868,22	0,00	0,00	5.796.877,75	189.009,53	3,37%	3,37%
REAG MULTIATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	3.004.675,89	0,00	23.400,00	3.118.735,86	137.459,97	4,57%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	1.031.520,00	0,00	0,00	1.118.956,00	87.436,00	8,48%	8,48%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCAD ...	491.025,81	0,00	0,00	531.057,24	40.031,43	8,15%	8,15%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	108.941,47	0,00	0,00	135.704,82	26.763,35	24,57%	24,57%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	71.289,13	0,00	0,00	87.994,93	16.705,80	23,43%	23,43%
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	2.787.081,54	0,00	0,00	2.775.190,24	-11.891,30	-0,43%	-0,43%
Total Renda Variável	13.102.402,06	0,00	23.400,00	13.564.516,84	485.514,78	3,71%	



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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.517.875,73	883.855,34	4.000.000,00	15.456.585,65	1.054.854,58	5,73%	6,42%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.906.540,09	4.550.000,00	2.327.949,11	16.115.032,12	986.441,14	5,65%	6,55%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	14.536.259,48	0,00	3.000.000,00	12.363.424,95	827.165,47	5,69%	6,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.262.878,70	0,00	0,00	10.028.044,67	765.165,97	8,26%	8,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.453.217,02	0,00	253.597,61	7.676.426,86	476.807,45	6,40%	6,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.158.444,17	0,00	2.927.713,16	3.544.499,67	313.768,66	5,09%	7,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.120.516,66	0,00	0,00	4.392.377,61	271.860,95	6,60%	6,60%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	2.556.556,84	0,00	0,00	2.804.859,10	248.302,26	9,71%	9,71%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.533.147,17	0,00	3.719.581,76	0,00	186.434,59	5,28%	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.225.220,78	17.800.054,45	15.360.691,22	4.821.958,09	157.374,08	0,79%	5,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.031.978,95	229.208,13	298.672,06	2.086.835,13	124.320,11	5,50%	6,44%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.061.464,39	0,00	61.166,94	2.113.023,23	112.725,78	5,47%	2,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.439.352,54	0,00	537.413,97	1.003.651,42	101.712,85	7,07%	11,24%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.700.000,00	0,00	3.745.958,13	45.958,13	1,24%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.948.618,20	0,00	122.520,62	3.845.076,14	18.978,56	0,48%	-2,62%
MZL IMA-B FI RENDA FIXA	102.005,66	0,00	14.247,49	71.132,94	-16.625,23	-16,30%	-30,27%
Total Renda Fixa	89.854.076,38	27.163.117,92	32.623.553,94	90.068.885,71	5.675.245,35	4,85%	



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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.512.095,76	3.000.000,00	0,00	5.796.877,75	284.781,99	5,17%	6,56%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	1.007.977,00	0,00	0,00	1.118.956,00	110.979,00	11,01%	11,01%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCAD...	488.727,94	0,00	0,00	531.057,24	42.329,30	8,66%	8,66%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	120.046,68	0,00	0,00	135.704,82	15.658,14	13,04%	13,04%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	81.947,47	0,00	0,00	87.994,93	6.047,46	7,38%	7,38%
W7 FIP MULTIESTRÉGIA	2.799.427,38	0,00	0,00	2.775.190,24	-24.237,14	-0,87%	-0,87%
REAG MULTIATIVOS IMOBILIÁRIOS FIL - RMAI11	3.235.697,40	0,00	46.800,00	3.118.735,86	-70.161,54	-2,17%	-
Total Renda Variável	10.245.919,63	3.000.000,00	46.800,00	13.564.516,84	365.397,21	2,77%	

[Handwritten signature]



**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. 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 aliquotas 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.