
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE
NOBRES / PREVINOBRES

RELATÓRIO SEMESTRAL
DE
INVESTIMENTOS

1º SEMESTRE
2023

01 de agosto de 2023

SUMÁRIO EXECUTIVO

O Sumário Executivo apresenta as principais informações do Relatório Mensal de Investimentos de 2023 do PREVINOBRES.

Índice Inflacionário: INPC – Índice Nacional de Preços ao Consumidor

Taxa de Juros (anual): 5,20% a.a.

Taxa de Juros (mensal): 0,42%

Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice): 5,20% a.a. + INPC a.a.

Previsão da Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice): 10,54%

Data Focal: 30/06/2023

MENSAL												
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN						
RENTABILIDADE DA CARTEIRA	0,75%	0,12%	1,61%	1,46%	2,31%	2,51%						
TAXA DE JUROS	0,42%	0,42%	0,42%	0,42%	0,42%	0,42%						
VARIAÇÃO IPCA	0,46%	0,77%	0,64%	0,53%	0,36%	-0,10%						
META ATUARIAL	0,88%	1,19%	1,06%	0,95%	0,78%	0,32%						
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%						

ACUMULADO												
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN						
RENTABILIDADE DA CARTEIRA	0,75%	0,86%	2,48%	3,98%	6,38%	9,05%						
TAXA DE JUROS	0,42%	0,85%	1,28%	1,70%	2,13%	2,57%						
VARIAÇÃO IPCA	0,46%	1,23%	1,88%	2,42%	2,79%	2,69%						
META ATUARIAL	0,88%	2,09%	3,17%	4,16%	4,97%	5,31%						
CDI	1,12%	2,05%	3,24%	4,19%	5,36%	6,49%						

SUMÁRIO (ÍNDICE)

1 – INTRODUÇÃO	4
2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	5
3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO	7
3.1 - Resumo do Regulamento dos Títulos Públicos	13
4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA	14
5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	27
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos	29
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos	31
6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO	33
7 – CONCLUSÃO	34
7.1 - Rentabilidade da Carteira Semestral	34
7.2 - Meta Atuarial	35
7.3 - Perfil de Risco do Investidor	36
7.4 - Avaliação de Desempenho no 1º Semestre	37
7.5 - Orientação para a Carteira de Investimento no 2º Semestre	38

1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Semestral dos investimentos, referente ao 1º SEMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras da PREVINOBRES.

Este relatório vem atender o **Art. 129 da Portaria MTP 1.467/2022**, que deverá emitir Relatórios, no mínimo, **Semestralmente**, que contemplem:

Art. 129. *Deverão ser emitidos relatórios, no mínimo, semestralmente, que contemplem:*

I - as conclusões dos exames efetuados, inclusive sobre a aderência da gestão dos recursos do RPPS às normas em vigor e à política de investimentos;

II - as recomendações a respeito de eventuais deficiências, com estabelecimento de cronograma para seu saneamento, quando for o caso; e

III - análise de manifestação dos responsáveis pelas correspondentes áreas, a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores, bem como análise das medidas efetivamente adotadas para saná-las.

Parágrafo único. *As conclusões, recomendações, análises e manifestações deverão ser levadas em tempo hábil ao conhecimento dos órgãos ou instâncias com atribuições para determinar as providências necessárias.*

2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - PREVINOBRES

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL		RENTABILIDADE FUNDOS DE INVESTIMENTOS			RENTABILIDADE CONSOLIDADA DA CARTEIRA (TPF + FI)	SALDO FINAL
					VARIAÇÃO DO CAPITAL	PROJEÇÃO DE RENTABILIDADE **	Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)		
1	JANEIRO	32.075.833,76	442.051,16	(375.569,69)	-	-	301.428,41	(61.755,13)	239.673,28	239.673,28	32.381.988,51
2	FEVEREIRO	32.381.988,51	533.078,82	(536.246,42)	-	-	296.804,04	(259.465,73)	37.338,31	37.338,31	32.416.159,22
3	MARÇO	32.416.159,22	844.327,84	(750.018,76)	-	-	620.506,29	(99.507,30)	520.998,99	520.998,99	33.031.467,29
4	ABRIL	33.031.467,29	606.921,32	(500.046,14)	-	-	487.830,01	(6.435,54)	481.394,47	481.394,47	33.619.736,94
5	MAIO	33.619.736,94	437.629,18	(249.416,01)	-	-	776.824,88	(72,89)	776.751,99	776.751,99	34.584.702,10
6	JUNHO	34.584.702,10	777.363,59	(944.796,34)	(2.444,30)	3.648,98	859.697,59	-	859.697,59	863.346,57	35.274.522,64
7	JULHO	35.274.522,64	-	-	-	-	-	-	-	-	35.274.522,64
8	AGOSTO	35.274.522,64	-	-	-	-	-	-	-	-	35.274.522,64
9	SETEMBRO	35.274.522,64	-	-	-	-	-	-	-	-	35.274.522,64
10	OUTUBRO	35.274.522,64	-	-	-	-	-	-	-	-	35.274.522,64
11	NOVEMBRO	35.274.522,64	-	-	-	-	-	-	-	-	35.274.522,64
12	DEZEMBRO	35.274.522,64	-	-	-	-	-	-	-	-	35.274.522,64
13	ANO	32.075.833,76	3.641.371,91	(3.356.093,36)	(2.444,30)	3.648,98	3.343.091,22	(427.236,59)	2.915.854,63	2.919.503,61	35.274.522,64

* Os Valores Acima Não Consideram Disponibilidade Financeira (Conta Corrente).

** Os Títulos Públicos adquiridos pelo RPPS possuem CUPOM DE JUROS depositados em Conta Corrente nos dias 15/02 e 15/08. As informações acima tratam-se de uma projeção dos JUROS produzidos mensalmente e podem apresentar ligeira diferença com os valores que serão efetivamente depositados em Conta Corrente.

2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVINOBRES

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	30,0%	100,0%	2,1%	744.461,05	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	15,7%	100,0%	48,1%	17.160.988,17	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operação	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	31,9%	60,0%	33,2%	11.849.729,03	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (60%)	0,0%	0,0%	60,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de 'Crédito Privado'	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
11	TOTAL - RENDA FIXA					83,4%	29.755.178,25	
RENDA VARIÁVEL								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	2,4%	30,0%	9,4%	3.337.855,53	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
14	TOTAL - RENDA VARIÁVEL	Art. 8º (30%)				9,4%	3.337.855,53	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	10,0%	10,0%	3,1%	1.102.187,47	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
18	TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	Art. 10 (15%)				3,1%	1.102.187,47	
FUNDOS IMOBILIÁRIOS								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
20	TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Art. 11 (5%)				0,0%	-	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	10,0%	10,0%	3,0%	1.079.301,39	-
24	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Art. 9º (10%)				3,0%	1.079.301,39	
EMPRÉSTIMO CONSIGNADO								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO	Art. 12 (5%)				0,0%	-	
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				1,1%	384.856,41	
29	PATRIMÔNIO TOTAL					100,0%	35.659.379,05	

3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB RF CP AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI
CNPJ	04.288.966/0001-27	13.077.415/0001-05	03.543.447/0001-03	35.292.588/0001-89
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	CDI252	SELIC	IMA - B 5	IPCA
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
ADMINISTRADOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ ADM	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ GESTOR	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ CUSTODIANTE	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
CNPJ AUDITORIA	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20	57.755.217/0001-29
DATA DE INÍCIO	15/07/2002	28/04/2011	17/12/1999	16/03/2020
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,75% a.a.	1,00% a.a.	0,20% a.a.	0,30% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
APLICAÇÃO INICIAL	0,01	1.000,00	1.000,00	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	0,01	1.000,00
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	1.000,00
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	1.000,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	1 - Muito baixo	1 - Muito Baixo	3 - Médio	3 - Médio
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

7

Continuação.....

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS X FI	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FI
CNPJ	07.111.384/0001-69	20.734.931/0001-20	29.258.294/0001-38	10.418.335/0001-88
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Ações	Fundo de Ações
ÍNDICE	IRF-M	IMA-B	IBOVESPA	IGC
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
ADMINISTRADOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ ADM	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ GESTOR	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ CUSTODIANTE	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
CNPJ AUDITORIA	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20	57.755.217/0001-29	61.562.112/0001-20
DATA DE INÍCIO	08/12/2004	29/09/2015	29/01/2018	10/06/2009
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,20% a.a.	2,00% a.a.	1,00% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	20% IBOVESPA	Não Possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00	300.000,00	0,01	0,01
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	0,01	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01	90.000.000.000,00	0,01	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	0,01
CARÊNCIA	Não possui	1192 dias	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+32 (Trinta e dois dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	3 - Médio	3 - Médio	4 - Alto	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

8

Continuação.....

3

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FI LP	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF
CNPJ	10.418.362/0001-50	22.632.237/0001-28	03.737.206/0001-97	10.740.670/0001-06
SEGMENTO	Investimentos Estruturados	Investimento no Exterior	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo Multimercado	Fundo de Ações	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	105% CDI	IBOVESPA	CDI	IRF-M 1
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
ADMINISTRADOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ ADM	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
GESTOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A
CNPJ GESTOR	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ CUSTODIANTE	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
AUDITORIA	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
CNPJ AUDITORIA	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001-29
DATA DE INÍCIO	02/03/2009	29/12/2015	05/07/2006	28/05/2010
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,60% a.a.	1,00% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00	0,01	1.000,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00	0,01	0,00	0,00
RESGATE MÍNIMO	0,00	0,01	0,00	0,00
SALDO MÍNIMO	0,00	0,01	0,00	0,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO*	4 - Alto	5 - Muito Alto	1 - Muito Baixo	2 - Baixo
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

9

Continuação.....

4

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	BRANCO FIC FI RF ALOCÇÃO DINÂMICA	BRANCO FI AÇÕES SELECTION
CNPJ	14.386.926/0001-71	10.577.503/0001-88	28.515.874/0001-09	03.660.879/0001-96
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Ações
ÍNDICE	IDKA 2	IMA-B 5+	IPCA + 6,00% a.a.	IBOVESPA
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
ADMINISTRADOR	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	BANCO BRADESCO S.A.	BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA
CNPJ ADM	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	60.746.948/0001-12	00.066.670/0001-00
GESTOR	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A.	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A.
CNPJ GESTOR	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	62.375.134/0001-44	62.375.134/0001-44
CUSTODIANTE	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	BANCO BRADESCO S.A.	BANCO BRADESCO S.A.
CNPJ CUSTODIANTE	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	60.746.948/0001-12	60.746.948/0001-12
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Banco Bradesco SA	Banco Bradesco S.A
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	60.746.948/0001-12	60.746.948/0001-12
AUDITORIA	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
CNPJ AUDITORIA	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001-29	61.562.112/0001-20	57.755.217/0001-29
DATA DE INÍCIO	16/08/2012	18/04/2012	28/12/2017	09/03/2000
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,40% a.a.	1,50% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	0,01	50.000,00	20.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00	0,01	1.000,00	1.000,00
RESGATE MÍNIMO	0,00	0,01	1.000,00	1.000,00
SALDO MÍNIMO	0,00	0,01	1.000,00	20.000,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	3 - Médio	3 - Médio	2 - Baixo	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

10

Continuação.....

5

INFORMAÇÕES	SICREDI - FIC FI RF LP TAXA SELIC	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FI AÇÕES	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI
CNPJ	07.277.931/0001-80	11.087.118/0001-15	06.051.151/0001-55	24.571.992/0001-75
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Ações	Fundo de Ações
ÍNDICE	CDI	IMA – B	IBOVESPA	IBOVESPA
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
ADMINISTRADOR	BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	ITAUNIBANCO S.A.
CNPJ ADM	01.181.521/0001-55	01.181.521/0001-55	01.181.521/0001-55	60.701.190/0001-04
GESTOR	CONFEDERAÇÃO INTERESTADUAL DAS COOPERATIVAS LIGADAS AO	CONFEDERAÇÃO INTERESTADUAL DAS COOPERATIVAS LIGADAS AO	SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	ITAUNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA.
CNPJ GESTOR	03.795.072/0001-60	03.795.072/0001-60	92.886.662/0001-29	40.430.971/0001-96
CUSTODIANTE	BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	ITAUNIBANCO S.A.
CNPJ CUSTODIANTE	01.181.521/0001-55	01.181.521/0001-55	01.181.521/0001-55	60.701.190/0001-04
DISTRIBUIDOR	Banco Cooperativo Sicredi SA	Banco Cooperativo Sicredi S.A.	Banco Cooperativo Sicredi S.A.	Itaú Unibanco S.A.
CNPJ DISTRIBUIDOR	01.181.521/0001-55	01.181.521/0001-55	01.181.521/0001-55	60.701.190/0001-04
AUDITORIA	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
CNPJ AUDITORIA	49.928.567/0001-11	49.928.567/0001-11	49.928.567/0001-11	49.928.567/0001-11
DATA DE INÍCIO	06/12/2005	18/12/2009	30/09/2011	12/09/2016
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,24% a.a.	0,18% a.a.	1,50% a.a.	2,00% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	20% IBOVESPA
APLICAÇÃO INICIAL	100,00	50.000,00	500,00	1,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00	5.000,00	100,00	1,00
RESGATE MÍNIMO	100,00	5.000,00	100,00	1,00
SALDO MÍNIMO	100,00	50.000,00	300,00	1,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+23 (Vinte e três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	1 - Muito Baixo	2 - Baixo	4 - Alto	5 - Muito Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

11

Continuação.....

6

INFORMAÇÕES	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI	PORTO SEGURO CLÁSSICO RF FIC FI LP		
CNPJ	42.318.981/0001-60	02.603.461/0001-84		
SEGMENTO	Renda Variável	Renda Fixa		
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Ações	Fundo de Renda Fixa		
ÍNDICE	IBOVESPA	CDI		
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral		
ADMINISTRADOR	ITAU UNIBANCO S.A.	INTRAG DTVM LTDA.		
CNPJ ADM	60.701.190/0001-04	62.418.140/0001-31		
GESTOR	ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA.	PORTO SEGURO INVESTIMENTOS LTDA		
CNPJ GESTOR	40.430.971/0001-96	16.492.391/0001-49		
CUSTODIANTE	ITAU UNIBANCO S.A.	ITAU UNIBANCO S.A.		
CNPJ CUSTODIANTE	60.701.190/0001-04	60.701.190/0001-04		
DISTRIBUIDOR	Itaú Unibanco S.A	PORTOPAR DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA		
CNPJ DISTRIBUIDOR	60.701.190/0001-04	40.303.299/0001-78		
AUDITORIA	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.		
CNPJ AUDITORIA	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20		
DATA DE INÍCIO	04/08/2021	03/07/1998		
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	2,50% a.a.	0,50% a.a.		
TAXA DE PERFORMANCE	20% IBOVESPA	20% CDI		
APLICAÇÃO INICIAL	1,00	20.000,00		
APLICAÇÕES ADICIONAIS	1,00	100,00		
RESGATE MÍNIMO	1,00	100,00		
SALDO MÍNIMO	1,00	1.000,00		
CARÊNCIA	Não possui	Não possui		
CRÉDITO DO RESGATE	D+23 (Vinte e Três dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)		
RISCO DE MERCADO*	5 - Muito Alto	2 - Baixo		
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)		

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

3.1-RESUMO DO REGULAMENTO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

7

INFORMAÇÕES	NTN - B 7,0400% a.a.
DESCRIÇÃO	Trata-se de um Título de responsabilidade do Tesouro Nacional, emitido para a cobertura de déficit orçamentário, exclusivamente sob a forma escriturada, SELIC. É um título de rentabilidade pós-fixada (a exceção da NTN – F) com rentabilidade vinculada à variação do IPCA, acrescida de juros definidos no momento da compra. Ideal para formar poupança de médio e longo prazo, garantindo seu poder de compra. Forma de Pagamento: semestralmente (juros) e no vencimento (principal). A rentabilidade deste Título é de forma semestral e no vencimento do principal.
RENDIMENTO	PRÉFIXADO, acrescido da variação do IPCA
PAGAMENTO DOS JUROS	De forma Semestral e no vencimento
VALOR DO RESGATE	O Valor Nominal, na data de Vencimento (15/08/2024)
ENQUADRAMENTO LEGAL	Esse tipo de investimento permite aplicação de até 100% do patrimônio líquido do RPPS em Títulos Públicos Federal, conforme alínea a, inciso I do Art. 7 da Resolução CMN 4.693/2021

4.1 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.109.754,92	-	-	15.634,99	1.125.389,91	1,409%
FEVEREIRO	1.125.389,91	-	-	16.924,16	1.142.314,07	1,504%
MARÇO	1.142.314,07	-	-	15.923,01	1.158.237,08	1,394%
ABRIL	1.158.237,08	-	-	8.317,87	1.166.554,95	0,718%
MAIO	1.166.554,95	-	-	4.204,57	1.170.759,52	0,360%
JUNHO	1.170.759,52	-	-	12.214,13	1.182.973,65	1,043%

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	4.416.037,57	-	-	56.400,40	4.359.637,17	-1,277%
FEVEREIRO	4.359.637,17	-	-	49.481,85	4.409.119,02	1,135%
MARÇO	4.409.119,02	-	-	161.260,12	4.570.379,14	3,657%
ABRIL	4.570.379,14	-	-	135.939,09	4.706.318,23	2,974%
MAIO	4.706.318,23	-	-	187.538,12	4.893.856,35	3,985%
JUNHO	4.893.856,35	-	-	161.319,11	5.055.175,46	3,296%

FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	126.102,12	-	-	1.413,89	127.516,01	1,121%
FEVEREIRO	127.516,01	-	-	1.232,29	128.748,30	0,966%
MARÇO	128.748,30	-	-	1.553,08	130.301,38	1,206%
ABRIL	130.301,38	-	-	1.091,25	131.392,63	0,837%
MAIO	131.392,63	-	-	1.476,12	132.868,75	1,123%
JUNHO	132.868,75	-	-	1.538,57	134.407,32	1,158%

Continuação...

FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO						
4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	48.587,52	-	-	531,65	49.119,17	1,094%
FEVEREIRO	49.119,17	-	-	392,66	49.511,83	0,799%
MARÇO	49.511,83	-	-	569,80	50.081,63	1,151%
ABRIL	50.081,63	-	-	459,81	50.541,44	0,918%
MAIO	50.541,44	-	-	596,40	51.137,84	1,180%
JUNHO	51.137,84	-	-	570,39	51.708,23	1,115%

4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI						
5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.020.532,85	442.051,16	- 352.079,63	10.696,52	1.121.200,90	1,048%
FEVEREIRO	1.121.200,90	504.376,94	- 485.810,89	9.056,34	1.148.823,29	0,808%
MARÇO	1.148.823,29	215.296,62	- 734.719,31	11.200,59	640.601,19	1,780%
ABRIL	640.601,19	606.921,32	- 439.048,07	5.273,78	813.748,22	0,823%
MAIO	813.748,22	437.629,18	- 94.773,43	9.130,37	1.165.734,34	1,122%
JUNHO	1.165.734,34	17.115,05	- 887.161,98	7.565,77	303.253,18	2,559%

BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI						
6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	47.753,16	-	-	656,47	48.409,63	1,375%
FEVEREIRO	48.409,63	-	-	677,20	49.086,83	1,399%
MARÇO	49.086,83	-	-	730,30	49.817,13	1,488%
ABRIL	49.817,13	-	-	445,36	50.262,49	0,894%
MAIO	50.262,49	-	-	307,07	50.569,56	0,611%
JUNHO	50.569,56	-	-	521,33	51.090,89	1,031%

BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI						
7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	24.663,49	-	- 23.490,06	207,61	1.381,04	0,842%
FEVEREIRO	1.381,04	28.701,88	- 27.828,03	38,62	2.293,51	0,135%
MARÇO	2.293,51	629.031,22	- 15.299,45	1.474,77	617.500,05	0,240%
ABRIL	617.500,05	-	- 60.998,07	4.918,72	561.420,70	0,884%
MAIO	561.420,70	-	- 154.642,58	5.595,70	412.373,82	1,376%
JUNHO	412.373,82	4.478,00	- 57.634,36	3.881,87	363.099,33	1,081%

Continuação...

BB RF CP AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI						
8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	42.063,33	-	-	400,28	42.463,61	0,952%
FEVEREIRO	42.463,61	-	-	331,38	42.794,99	0,780%
MARÇO	42.794,99	-	-	427,13	43.222,12	0,998%
ABRIL	43.222,12	-	-	337,98	43.560,10	0,782%
MAIO	43.560,10	-	-	415,76	43.975,86	0,954%
JUNHO	43.975,86	-	-	399,97	44.375,83	0,910%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	4.200.749,28	-	-	34.311,98	4.235.061,26	0,817%
FEVEREIRO	4.235.061,26	-	-	34.806,96	4.269.868,22	0,822%
MARÇO	4.269.868,22	-	-	90.634,26	4.360.502,48	2,123%
ABRIL	4.360.502,48	-	-	46.890,46	4.407.392,94	1,075%
MAIO	4.407.392,94	-	-	95.834,22	4.503.227,16	2,174%
JUNHO	4.503.227,16	-	-	94.240,14	4.597.467,30	2,093%

BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS X FI						
10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	771.976,95	-	-	10.678,26	782.655,21	1,383%
FEVEREIRO	782.655,21	-	22.607,50	10.422,67	770.470,38	1,371%
MARÇO	770.470,38	-	-	9.783,00	780.253,38	1,270%
ABRIL	780.253,38	-	-	3.983,00	784.236,38	0,510%
MAIO	784.236,38	-	-	72,89	784.163,49	-0,009%
JUNHO	784.163,49	-	-	7.275,86	791.439,35	0,928%

Continuação...

BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI						
11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	4.917.822,83	-	-	31.850,54	4.949.673,37	0,648%
FEVEREIRO	4.949.673,37	-	-	48.345,42	4.998.018,79	0,977%
MARÇO	4.998.018,79	-	-	93.783,28	5.091.802,07	1,876%
ABRIL	5.091.802,07	-	-	64.690,92	5.156.492,99	1,270%
MAIO	5.156.492,99	-	-	97.157,91	5.253.650,90	1,884%
JUNHO	5.253.650,90	-	-	94.783,30	5.348.434,20	1,804%

4.3 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - SICREDI

SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP						
12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	5.341.789,46	-	-	5.295,64	5.336.493,82	-0,099%
FEVEREIRO	5.336.493,82	-	-	66.484,27	5.402.978,09	1,246%
MARÇO	5.402.978,09	-	-	142.891,24	5.545.869,33	2,645%
ABRIL	5.545.869,33	-	-	112.440,24	5.658.309,57	2,027%
MAIO	5.658.309,57	-	-	146.788,14	5.805.097,71	2,594%
JUNHO	5.805.097,71	-	-	139.886,14	5.944.983,85	2,410%

SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP						
13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	59.604,23	-	-	59,09	59.545,14	-0,099%
FEVEREIRO	59.545,14	-	-	741,83	60.286,97	1,246%
MARÇO	60.286,97	-	-	1.594,40	61.881,37	2,645%
ABRIL	61.881,37	-	-	1.254,62	63.135,99	2,027%
MAIO	63.135,99	-	-	1.637,88	64.773,87	2,594%
JUNHO	64.773,87	-	-	1.560,86	66.334,73	2,410%

SICREDI - FIC FI RF LP TAXA SELIC						
14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	3.201.490,23	-	-	35.562,66	3.237.052,89	1,111%
FEVEREIRO	3.237.052,89	-	-	30.010,22	3.267.063,11	0,927%
MARÇO	3.267.063,11	-	-	37.175,60	3.304.238,71	1,138%
ABRIL	3.304.238,71	-	-	28.760,02	3.332.998,73	0,870%
MAIO	3.332.998,73	-	-	38.556,36	3.371.555,09	1,157%
JUNHO	3.371.555,09	-	-	36.707,54	3.408.262,63	1,089%

Continuação...

SICREDI - FIC FI RF LP TAXA SELIC						
15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	6.840,13	-	-	75,98	6.916,11	1,111%
FEVEREIRO	6.916,11	-	-	64,11	6.980,22	0,927%
MARÇO	6.980,22	-	-	79,43	7.059,65	1,138%
ABRIL	7.059,65	-	-	61,45	7.121,10	0,870%
MAIO	7.121,10	-	-	82,38	7.203,48	1,157%
JUNHO	7.203,48	8.865,19	-	152,01	16.220,68	2,110%

4.4 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BRADESCO

BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA						
16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	496.981,84	-	-	2.823,56	499.805,40	0,568%
FEVEREIRO	499.805,40	-	-	4.528,84	504.334,24	0,906%
MARÇO	504.334,24	-	-	10.390,57	514.724,81	2,060%
ABRIL	514.724,81	-	-	7.094,02	521.818,83	1,378%
MAIO	521.818,83	-	-	11.433,45	533.252,28	2,191%
JUNHO	533.252,28	-	-	10.710,21	543.962,49	2,008%

4.5 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - OUTROS BANCOS

PORTO SEGURO CLÁSSICO RF FIC FI LP						
17	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.034.134,09	-	-	13.758,45	1.047.892,54	1,330%
FEVEREIRO	1.047.892,54	-	-	12.758,48	1.060.651,02	1,218%
MARÇO	1.060.651,02	-	-	16.093,53	1.076.744,55	1,517%
ABRIL	1.076.744,55	-	-	2.919,37	1.079.663,92	0,271%
MAIO	1.079.663,92	-	-	11.730,87	1.091.394,79	1,087%
JUNHO	1.091.394,79	-	-	16.133,29	1.107.528,08	1,478%

4.6 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - TÍTULOS PÚBLICOS

NTN - B 7,0400% a.a.					
28	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)
JANEIRO	-	-	-	-	-
FEVEREIRO	-	-	-	-	-
MARÇO	-	-	-	-	-
ABRIL	-	-	-	-	-
MAIO	-	-	-	-	-
JUNHO	-	746.905,35	-	3.648,98	744.461,05

4.7 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - RENDA VARIÁVEL

BRDESCO FI AÇÕES SELECTION						
18	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	480.710,81	-	-	18.873,84	499.584,65	3,926%
FEVEREIRO	499.584,65	-	-	37.384,48	462.200,17	-7,483%
MARÇO	462.200,17	-	-	18.559,50	443.640,67	-4,015%
ABRIL	443.640,67	-	-	40,08	443.680,75	0,009%
MAIO	443.680,75	-	-	26.167,22	469.847,97	5,898%
JUNHO	469.847,97	-	-	37.645,97	507.493,94	8,012%

BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FI						
19	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	957.501,09	-	-	34.665,91	992.167,00	3,620%
FEVEREIRO	992.167,00	-	-	76.764,74	915.402,26	-7,737%
MARÇO	915.402,26	-	-	32.009,38	883.392,88	-3,497%
ABRIL	883.392,88	-	-	16.610,83	900.003,71	1,880%
MAIO	900.003,71	-	-	36.692,69	936.696,40	4,077%
JUNHO	936.696,40	-	-	83.154,42	1.019.850,82	8,877%

BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FI LP						
20	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.034.260,11	-	-	12.036,65	1.046.296,76	1,164%
FEVEREIRO	1.046.296,76	-	-	7.364,18	1.053.660,94	0,704%
MARÇO	1.053.660,94	-	-	14.685,96	1.068.346,90	1,394%
ABRIL	1.068.346,90	-	-	9.728,25	1.078.075,15	0,911%
MAIO	1.078.075,15	-	-	14.263,45	1.092.338,60	1,323%
JUNHO	1.092.338,60	-	-	9.848,87	1.102.187,47	0,902%

Continuação...

BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I						
21	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.007.262,23	-	-	18.956,18	1.026.218,41	1,882%
FEVEREIRO	1.026.218,41	-	-	3.142,56	1.029.360,97	0,306%
MARÇO	1.029.360,97	-	-	10.256,22	1.039.617,19	0,996%
ABRIL	1.039.617,19	-	-	6.435,54	1.033.181,65	-0,619%
MAIO	1.033.181,65	-	-	31.387,75	1.064.569,40	3,038%
JUNHO	1.064.569,40	-	-	14.731,99	1.079.301,39	1,384%

BB AÇÕES VALOR FIC FIA						
22	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	60.103,41	-	-	2.005,62	62.109,03	3,337%
FEVEREIRO	62.109,03	-	-	4.556,69	57.552,34	-7,337%
MARÇO	57.552,34	-	-	1.958,67	55.593,67	-3,403%
ABRIL	55.593,67	-	-	697,63	56.291,30	1,255%
MAIO	56.291,30	-	-	1.524,48	57.815,78	2,708%
JUNHO	57.815,78	-	-	4.727,90	62.543,68	8,178%

ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI						
23	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	351.560,62	-	-	14.371,59	365.932,21	4,088%
FEVEREIRO	365.932,21	-	-	33.734,07	332.198,14	-9,219%
MARÇO	332.198,14	-	-	17.549,69	314.648,45	-5,283%
ABRIL	314.648,45	-	-	5.860,06	320.508,51	1,862%
MAIO	320.508,51	-	-	16.012,07	336.520,58	4,996%
JUNHO	336.520,58	-	-	26.343,46	362.864,04	7,828%

Continuação...

ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI						
24	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	403.116,39	-	-	9.745,43	412.861,82	2,418%
FEVEREIRO	412.861,82	-	-	28.076,18	384.785,64	-6,800%
MARÇO	384.785,64	-	-	15.117,90	369.667,74	-3,929%
ABRIL	369.667,74	-	-	4.901,03	374.568,77	1,326%
MAIO	374.568,77	-	-	2.378,71	376.947,48	0,635%
JUNHO	376.947,48	-	-	19.850,15	396.797,63	5,266%

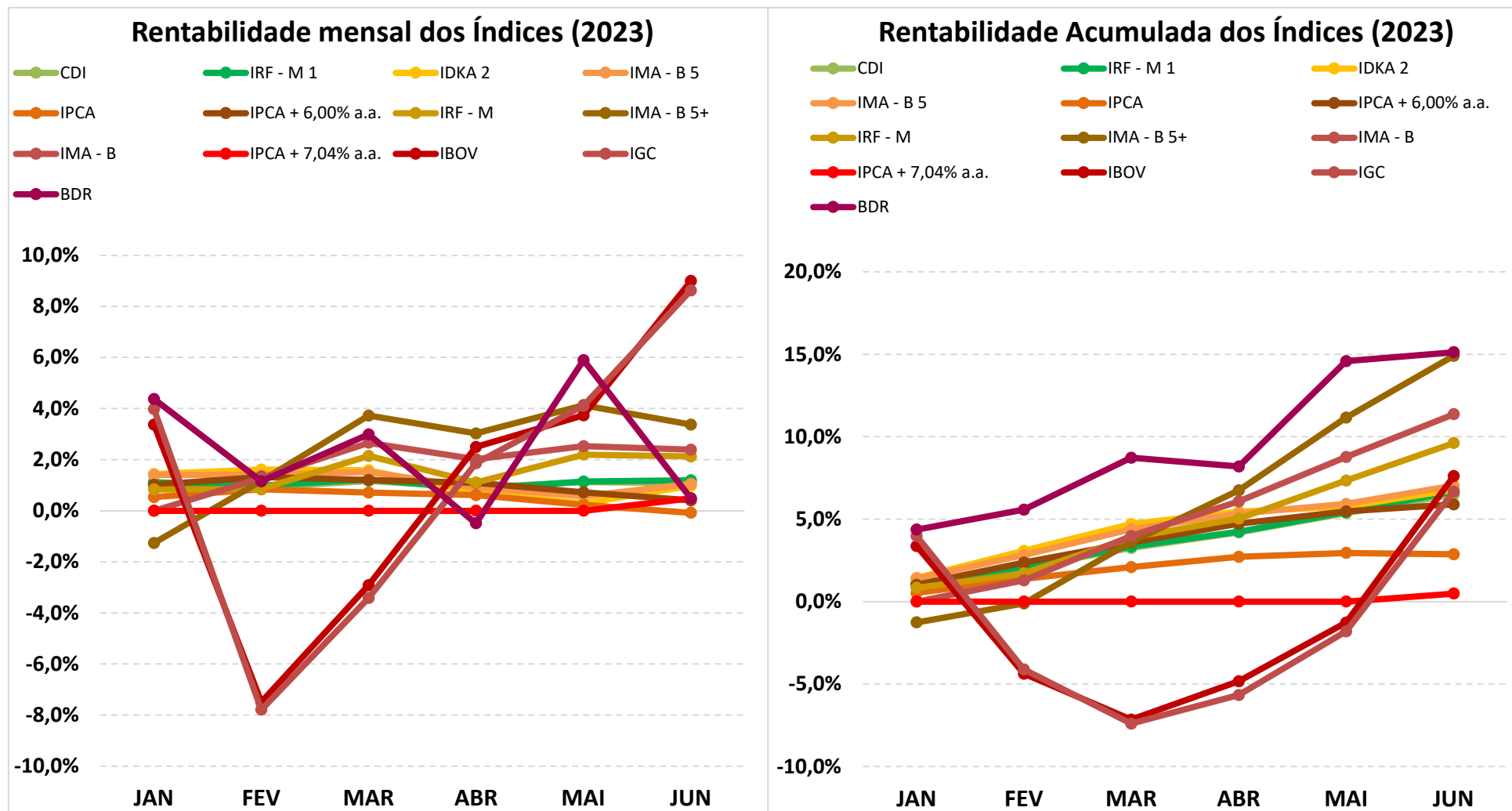
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FI AÇÕES						
25	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	914.435,10	-	-	32.170,35	946.605,45	3,518%
FEVEREIRO	946.605,45	-	-	78.949,57	867.655,88	-8,340%
MARÇO	867.655,88	-	-	14.312,16	853.343,72	-1,650%
ABRIL	853.343,72	-	-	25.114,17	878.457,89	2,943%
MAIO	878.457,89	-	-	35.913,19	914.371,08	4,088%
JUNHO	914.371,08	-	-	73.934,34	988.305,42	8,086%

5-TABELA DE RENTABILIDADE

Nº	INVESTIMENTOS	RENTABILIDADE MENSAL						ACUMULADO
		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	
1	BB RF CP AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI	0,95%	0,78%	1,00%	0,78%	0,95%	0,91%	5,49%
2	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	1,03%	0,85%	1,08%	0,83%	1,04%	1,00%	5,97%
3	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	1,37%	1,40%	1,49%	0,89%	0,61%	1,03%	6,99%
4	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65%	0,98%	1,88%	1,27%	1,88%	1,80%	8,76%
5	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	0,82%	0,82%	2,12%	1,08%	2,17%	2,09%	9,44%
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS X FI	1,38%	1,34%	1,27%	0,51%	-0,01%	0,93%	5,53%
7	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3,34%	-7,34%	-3,40%	1,25%	2,71%	8,18%	4,07%
8	BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FI	3,62%	-7,74%	-3,50%	1,88%	4,08%	8,88%	6,51%
9	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FI LP	1,16%	0,70%	1,39%	0,91%	1,32%	0,90%	6,57%
10	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	1,88%	0,31%	1,00%	-0,62%	3,04%	1,38%	7,15%
11	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	1,09%	0,80%	1,15%	0,92%	1,18%	1,12%	6,42%
12	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	1,12%	0,97%	1,21%	0,84%	1,12%	1,16%	6,58%
13	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2 A TP RF LP	1,41%	1,50%	1,39%	0,72%	0,36%	1,04%	6,60%
14	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	-1,28%	1,14%	3,66%	2,97%	3,98%	3,30%	14,47%
15	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,57%	0,91%	2,06%	1,38%	2,19%	2,01%	9,46%
16	BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	3,93%	-7,48%	-4,02%	0,01%	5,90%	8,01%	5,57%
17	SICREDI - FIC FI RF LP TAXA SELIC	1,11%	0,93%	1,14%	0,87%	1,16%	1,09%	6,47%
18	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	-0,10%	1,25%	2,64%	2,03%	2,59%	2,41%	11,29%
19	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FI AÇÕES	3,52%	-8,34%	-1,65%	2,94%	4,09%	8,09%	8,08%
20	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	2,42%	-6,80%	-3,93%	1,33%	0,64%	5,27%	-1,55%
21	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI	4,09%	-9,22%	-5,28%	1,86%	5,00%	7,83%	3,22%
22	PORTO SEGURO CLÁSSICO RF FIC FI LP	1,33%	1,22%	1,52%	0,27%	1,08%	1,48%	7,09%
23	NTN - B 7,0400% a.a.	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,49%	0,49%
	CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	6,49%
	IRF - M 1	1,10%	0,98%	1,23%	0,86%	1,14%	1,19%	6,68%
	IDKA 2	1,44%	1,62%	1,58%	0,71%	0,29%	0,97%	6,79%
	IMA - B 5	1,40%	1,41%	1,52%	0,90%	0,57%	1,05%	7,04%
	IPKA	0,53%	0,84%	0,71%	0,61%	0,23%	-0,08%	2,87%
	IPKA + 6,00% a.a.	1,02%	1,33%	1,20%	1,10%	0,72%	0,41%	5,90%
	IRF - M	0,84%	0,86%	2,15%	1,10%	2,20%	2,12%	9,62%
	IMA - B 5+	-1,26%	1,17%	3,73%	3,03%	4,13%	3,37%	14,91%
	IMA - B	0,00%	1,28%	2,66%	2,02%	2,53%	2,39%	11,37%
	IPKA + 7,04% a.a.	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,49%	0,49%
	IBOV	3,37%	-7,49%	-2,91%	2,50%	3,74%	9,00%	7,61%
	IGC	3,98%	-7,79%	-3,42%	1,86%	4,11%	8,63%	6,67%
	BDR	4,37%	1,15%	2,99%	-0,49%	5,90%	0,48%	15,13%

**O RPPS aplicou no Título Público pela primeira vez em junho/2023, por conta disso, não há rentabilidade nos respectivos meses anteriores.*

GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES

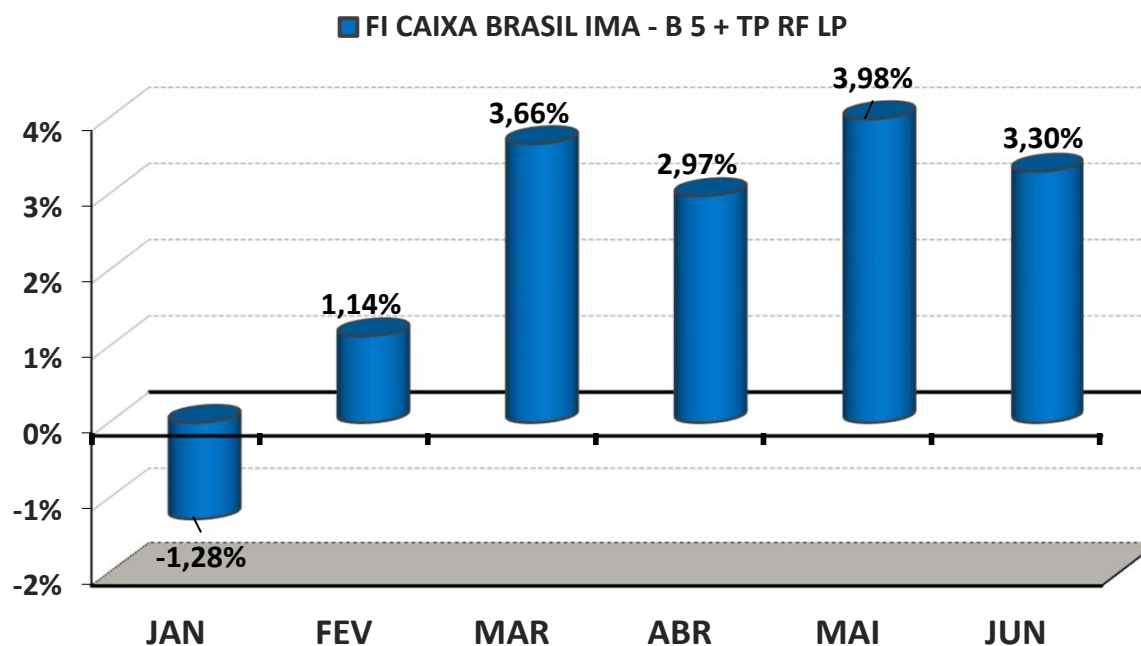


5.1-MELHOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	-1,28%	1,14%	3,66%	2,97%	3,98%	3,30%

Comportamento MENSAL no Semestre

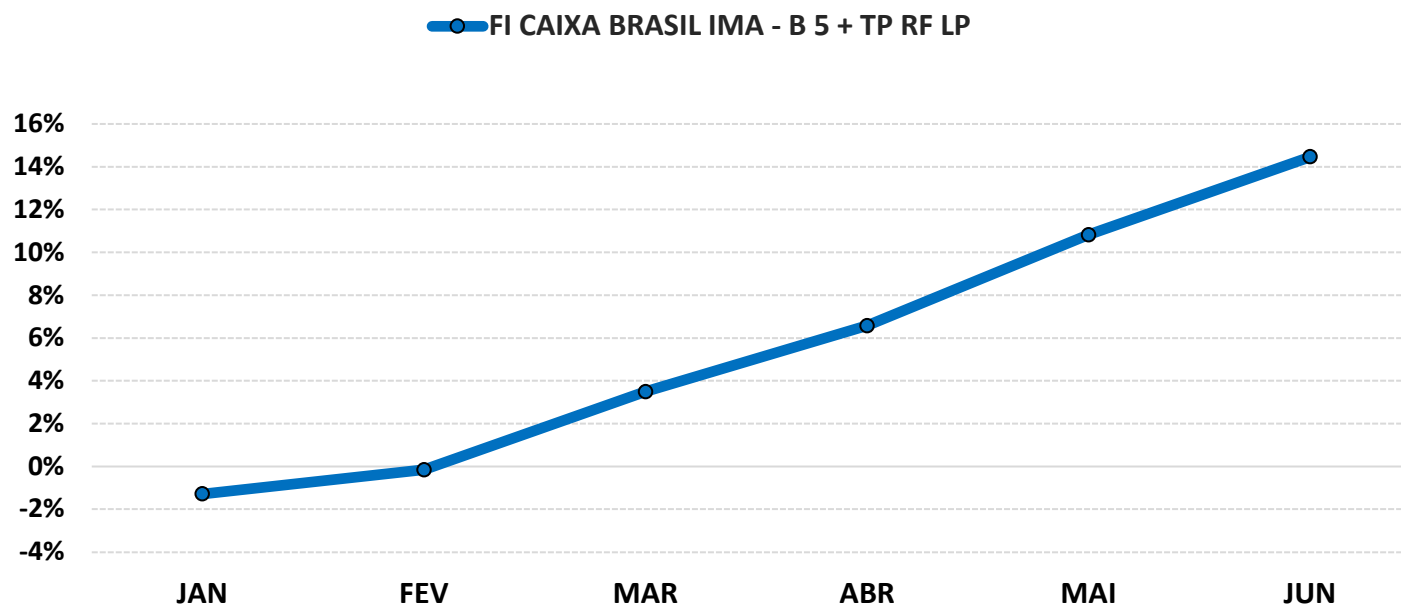


5.1-MELHOR DESEMPENHO ACUMULADO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	-1,28%	-0,16%	3,49%	6,57%	10,82%	14,47%

Comportamento ACUMULADO no Semestre

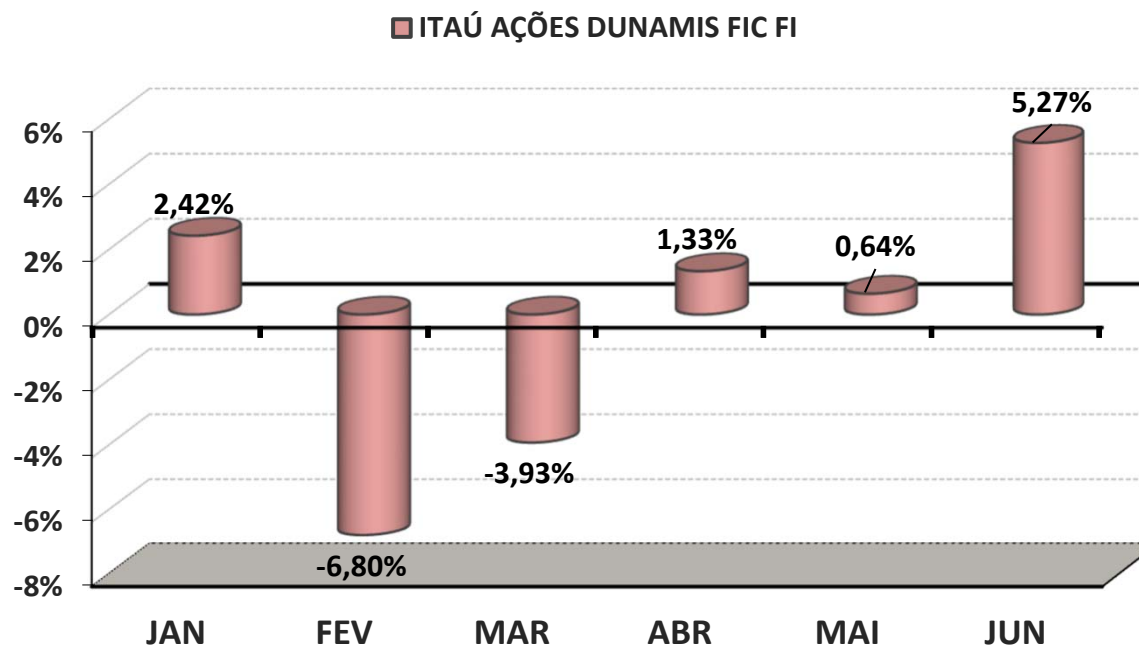


5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	2,42%	-6,80%	-3,93%	1,33%	0,64%	5,27%

Comportamento MENSAL no Semestre

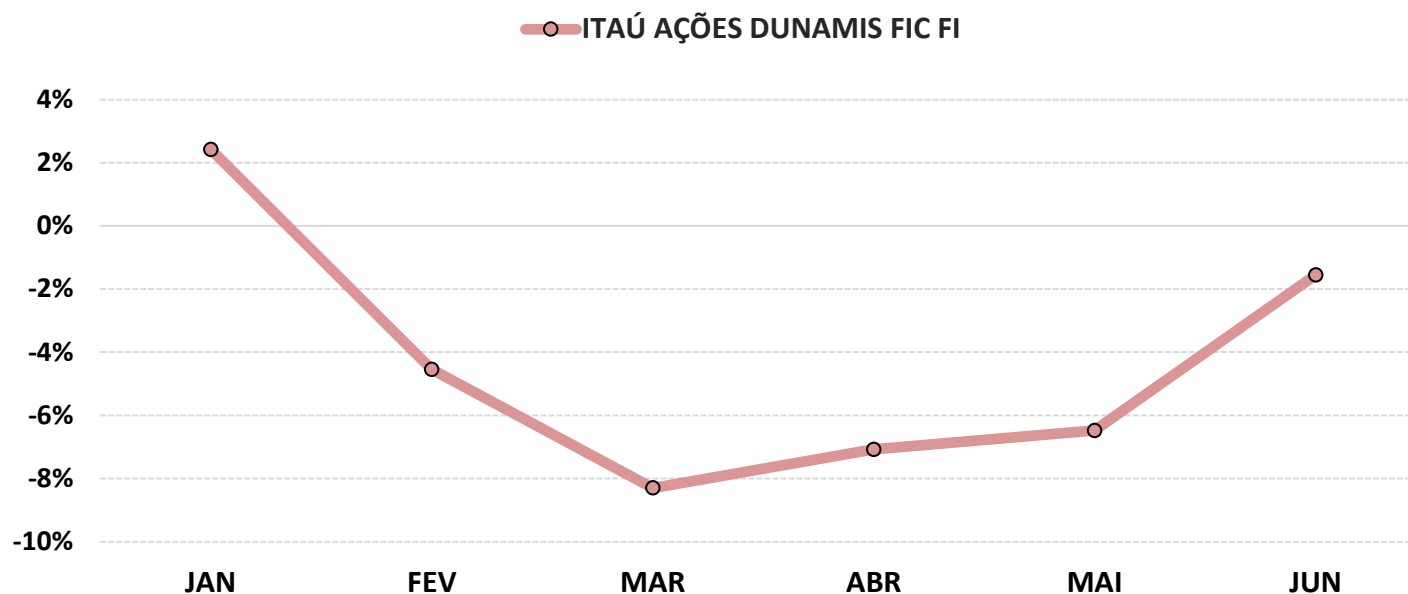


5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	2,42%	-4,54%	-8,30%	-7,08%	-6,48%	-1,55%

Comportamento ACUMULADO no Semestre



6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 1º SEMESTRE - 2023

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
MENSAL	0,75%	0,12%	1,61%	1,46%	2,31%	2,51%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%
IBOVESPA	3,37%	-7,49%	-2,91%	2,50%	3,74%	9,00%
META ATUARIAL	0,88%	1,19%	1,06%	0,95%	0,78%	0,32%

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
ACUMULADO DO SEMESTRE	0,75%	0,86%	2,48%	3,98%	6,38%	9,05%
CDI	1,12%	2,05%	3,24%	4,19%	5,36%	6,49%
IBOVESPA	3,37%	-4,37%	-7,16%	-4,83%	-1,27%	7,61%
META ATUARIAL	0,88%	2,09%	3,17%	4,16%	4,97%	5,31%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEMESTRE DA PREVINOBRRES: R\$ **2.917.059,31**

META ATUARIAL ACUMULADA DO SEMESTRE: R\$ **1.704.537,50**

GANHO SOBRE A META ATUARIAL: R\$ **1.212.521,82**

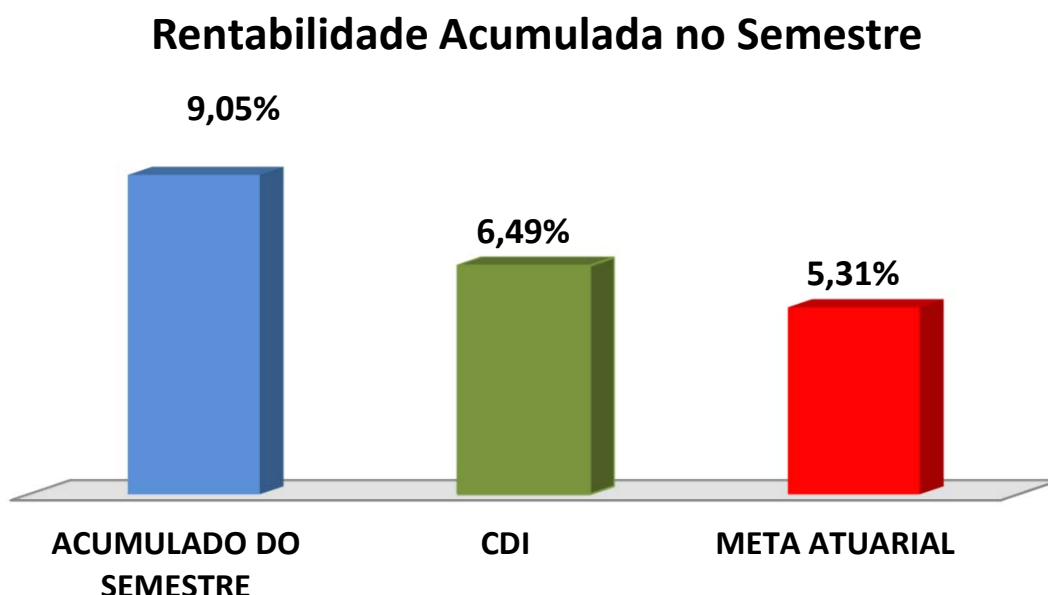
7-CONCLUSÃO

Atendendo o Art. 129, I, da Portaria MTP 1.467/2022, detalhado na página 4 deste relatório, segue uma análise do desempenho da Carteira de Investimento da PREVINOBRÉS, no 1º Semestre/2023, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2023.

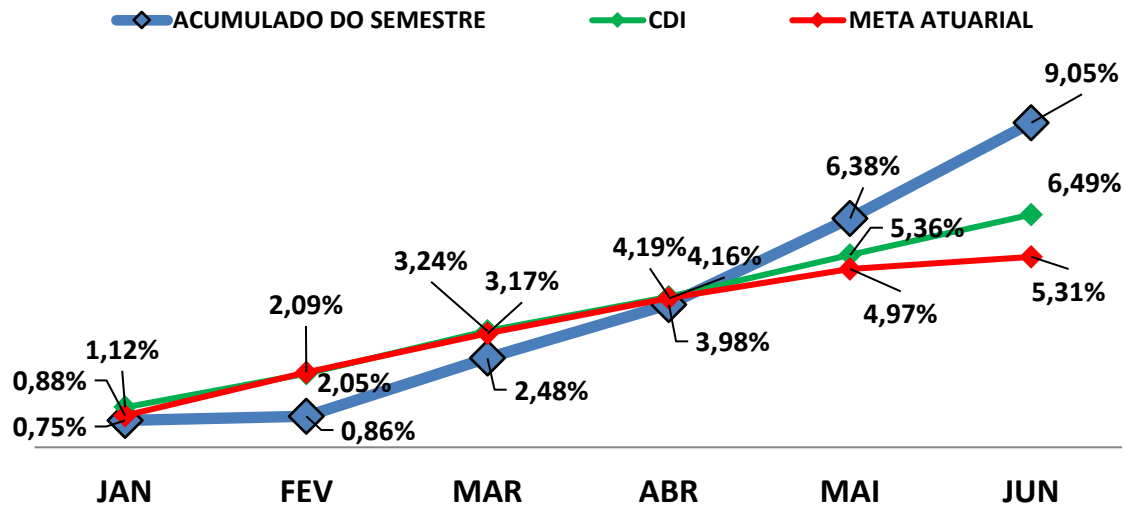
7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA SEMESTRAL

A Carteira de Investimentos da PREVINOBRÉS, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no semestre de 9,05% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no semestre de 6,49% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 139,46% sobre o índice de referência do mercado.

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL



Rentabilidade Acumulada no Semestre



7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no semestre da PREVINOBRES é de 9,05% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 5,31%, representando 170,36% sobre a Meta Atuarial.

7.3-PERFIL DE RISCO DO INVESTIDOR



PERFIL 7
ARROJADO COM
TENDÊNCIA
CONSERVADORA

Descrição do Perfil de Investidor

Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação, mas protegendo uma pequena parte da carteira, das oscilações de mercado. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados e arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é um perfil indicado.

Comportamento da carteira

A carteira com perfil ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para proteção de parte dos recursos, investe também em ativos conservadores. Apesar de possuir ativos que podem rentabilizar negativo em um mês, esses mesmos ativos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil busca o cumprimento da Meta Atuarial, mas protegendo parte dos recursos das oscilações de mercado.

Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

CONSERVADOR	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
MODERADO	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
ARROJADO	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO

7.4-AVALIAÇÃO DE DESEMPENHO NO 1º SEMESTRE

No 1º trimestre o RPPS optou por uma carteira com perfil 6 - Moderado com Tendência Arrojada. No 2º trimestre, elevou o perfil de risco para o 7 - Arrojado com Tendência Conservadora. Após os investidores sofrerem os efeitos ocorridos pela pandemia de COVID-19 e a guerra entre Ucrânia e Rússia, que desencadearam atritos geopolíticos entre as principais economias globais, o 1º semestre/2023 apresentou recuperação dos índices de Renda Fixa e de Renda Variável, com maior destaque para os investimentos de Longo Prazo. No Brasil, o PIB veio acima do esperado pelo mercado, com perspectiva de fechar 2023 da mesma forma. Devido a Diversificação da carteira de Investimentos do RPPS, que possui uma boa concentração em índices de Longo Prazo, o RPPS fechou o 1º semestre/2023 com uma excelente rentabilidade, que supera 160% da Meta Atuarial, quase alcançando a Meta Atuarial esperada para o ano.

7.5-ORIENTAÇÃO PARA A CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO 2º SEMESTRE

Com relação a Renda Fixa, a iminência do ciclo de redução da Taxa Selic deverá ocorrer em agosto ou setembro. Atualmente, a Taxa Selic se encontra em 13,75% a.a. e o mercado financeiro projeta encerrando 2023 em 12,00% a.a., com perspectiva de revisão para baixo. Com isso, os Ativos de Renda Fixa com Juros Pré-Fixados de Longo Prazo (como os sub-índices IMA-B, IMA - B 5+, IRF-M e IRF-M 1+) tendem a apresentar melhor desempenho do que o verificado no 1º semestre/2023. Em contrapartida, os índices conservadores como DI e IRF - M 1 passarão a apresentar menor desempenho com o passar dos meses. Assim, orientamos o RPPS a aumentar de forma gradativa a aplicação em índices de Renda Fixa de Longo Prazo como IMA - B e IRF - M. Devido a alta concentração da carteira em IMA - B 5+ e/ou IRF-M1+, apenas manter o atual percentual aplicado. Com relação aos índices conservadores (DI e IRF - M 1), recomendamos o RPPS continuar aplicando, mas que não ultrapasse 20% dos repasses previdenciários.

Com relação a Renda Variável, a perspectiva é de desempenho positivo no 2º semestre/2023. Além do ciclo de redução da Taxa Selic favorecer a Bolsa de Valores, outras variáveis corroboram para essa perspectiva positiva. No 1º Trimestre/2023 o PIB surpreendeu positivamente. O mercado de trabalho mostrou aumento de empregados e estabilidade na taxa de desemprego. O IPCA vem demonstrando redução a cada mês, além da aprovação do novo arcabouço fiscal e a reforma tributária, favorecendo o consumo. Assim, orientamos o RPPS a aproveitar os meses de desvalorização, para aportar no máximo 30% dos repasses previdenciários em Renda Variável.

Com relação a Investimento no Exterior, o ambiente externo ainda é incerto e merece precaução. A pressão inflacionária sobre as principais economias globais estão levando os Bancos Centrais dos EUA e da Europa a elevarem as Taxas de Juros para promover a convergência da inflação dentro das metas. Aliado a isso, temos redução do crédito nos EUA devido a estabilidade no setor bancário, gerando impacto negativo e incerto sobre o crescimento das principais economias do mundo. Na China, a atividade econômica apresenta crescimento de forma moderada, apesar da diminuição no ritmo do consumo. Assim, orientamos o RPPS a não aplicar mais em Investimento no Exterior em 2023, mantendo na carteira apenas o atual percentual aplicado.

As orientações e análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Relatório.



Igor França Garcia
Atuário MIBA/RJ 1.659
Certificação de Especialista em Investimento - CEA
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM