

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			74.173.345,48	8,42%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	28.642.300,97	3,25%	697	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	5,39	0,00%	97.685	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	78.594.057,48	8,93%	862	1,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.821.782,20	1,46%	792	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	45.656.219,39	5,19%	638	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	153.718.978,10	17,46%	1.141	1,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	9.978.931,96	1,13%	635	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.703.605,82	0,31%	777	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.116.345,40	0,47%	903	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.086.074,25	0,35%	1.155	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.610.818,53	0,98%	430	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ICATU VANGUARDA SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	3.330.262,43	0,38%	36	3,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	3.566.548,41	0,41%	206	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS - BTG PACTUAL	D+0		187.068,89	0,02%		0,00%	Artigo 7º, Inciso II
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	18.085.736,11	2,05%	44.456	0,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.307.376,47	0,94%	1.007	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	128.677.104,64	14,61%	1.148	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.706.537,99	0,31%	147	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENC...	D+0	Não há	15.735.684,60	1,79%	13.656	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	15.647.508,85	1,78%	113	2,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	128.577,00	0,01%	361	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	17.718.781,37	2,01%	1.011	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.564.885,47	2,68%	453	0,43%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	10.404.280,84	1,18%	208	0,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.243.655,04	0,60%	4.655	1,78%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	27.328.910,42	3,10%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	28.725,52	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA...	D+31	Não há	17.365.985,47	1,97%	5.978	0,57%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	11.337.200,62	1,29%	90	5,96%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	5.067.462,63	0,58%	1.188	0,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
XP BANCOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO ...	D+0	Não há	12.301.019,77	1,40%	1.103	0,32%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.332.144,74	0,26%	371	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	6.691.012,36	0,76%	1.852	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	6.342.406,98	0,72%	200	0,84%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	577.932,31	0,07%	81	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	2.394.763,36	0,27%	10.015	1,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	343.162,43	0,04%	1.554	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.681.491,21	0,19%	4.917	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.797.064,36	0,66%	1.804	1,03%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	18.420.888,88	2,09%	11.978	1,35%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.059.945,30	0,12%	50	0,76%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	464.589,94	0,05%	33	0,36%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕ...	D+6 du	Não há	12.666.592,79	1,44%	21	7,14%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	13.814.718,47	1,57%	110	0,88%	Artigo 9º, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.683.154,67	0,53%	59.337	0,26%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	16.764.884,81	1,90%	5.419	2,37%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	4.897.080,23	0,56%	102	0,97%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	29.062.038,56	3,30%	7.627	1,47%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	1.522.212,75	0,17%	565	0,32%	Artigo 10º, Inciso I
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	361.362,76	0,04%		0,00%	Artigo 11º
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.770.965,65	0,20%		1,24%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			880.484.190,07				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			101,16				Artigo 6º
PL Total			880.484.291,23				

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.

