

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

RELATÓRIO MENSAL

Junho/2023

1. INTRODUÇÃO

A Divisão de Investimentos e Financeiro do IPREMB apresenta o relatório mensal da carteira de investimentos dos recursos deste RPPS correspondente ao posicionamento das aplicações no mês de junho/2023.

Em consonância com as legislações vigentes que regem as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, o presente relatório demonstra o resultado detalhado e a adequação das aplicações financeiras do IPREMB às essas normas, quais sejam:

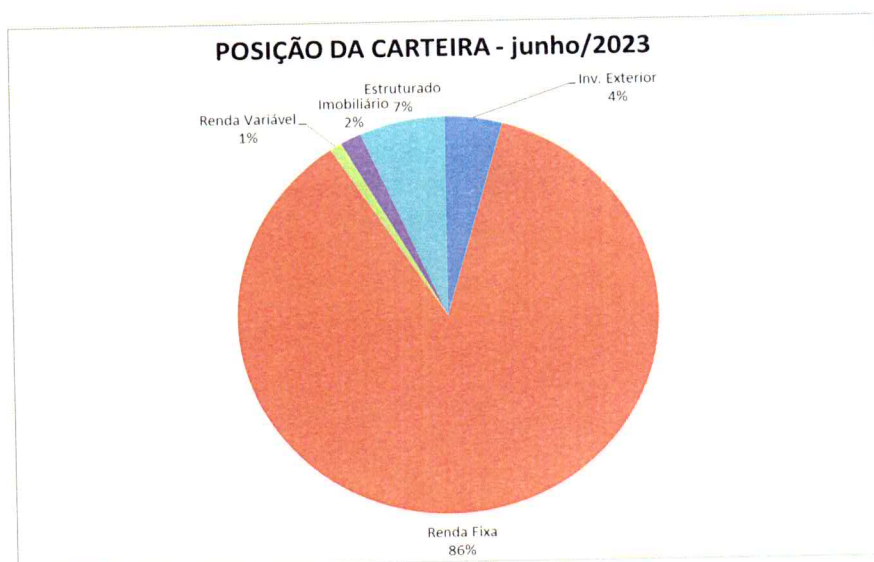
- Resolução do Conselho Monetário Nacional - CMN nº 4.963/2021.
- Portaria da Secretaria de Previdência Social nº 1.467/2022.
- Política de Investimento do IPREMB.

2. POSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

JUNHO 2023	
VALOR APLICADO	R\$ 1.514.116.646,80
VALOR EM CONTA	R\$ 968.563,66
TOTAL:	R\$ 1.515.085.210,46

2.1 POR TIPO DE INVESTIMENTO

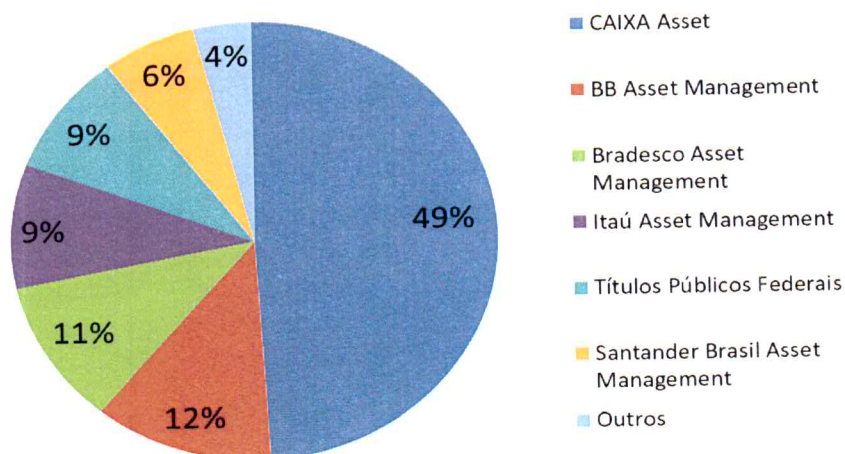
Investimento	Valor	%
Inv. Exterior	67.035.668,19	4,43%
Renda Fixa	1.309.092.971,28	86,46%
Renda Variável	13.788.608,26	0,91%
Imobiliário	25.178.693,84	1,66%
Estruturado	99.020.705,23	6,54%
Total Geral	1.514.116.646,80	100,00%



2.2 POSIÇÃO POR INSTITUIÇÕES

Gestor	Valor	%
CAIXA Asset	744.259.297,80	49,15%
BB Asset Management	181.568.696,82	11,99%
Bradesco Asset Management	160.923.554,09	10,63%
Itaú Asset Management	139.396.329,66	9,21%
Títulos Públicos Federais	135.539.614,80	8,95%
Santander Brasil Asset Management	94.404.486,57	6,23%
Outros	58.024.667,08	3,83%
Total Geral	1.514.116.646,80	100,00%

Distribuição da carteira por gestor



3. RENTABILIDADE TOTAL POR GESTOR

Gestor	Total Gestor	Rentabilidade	Rentabilidade%
CAIXA Asset	744.259.297,80	10.431.136,03	1,40%
Inv. Exterior	44.368.020,95	206.714,98	0,47%
Renda Fixa	614.323.149,38	6.936.935,93	1,13%
Renda Variável	9.527.763,50	1.059.909,48	11,12%
Imobiliário	6.294.400,00	844.000,00	13,41%
Estruturado	69.745.963,97	1.383.575,64	1,98%
BB Asset Management	181.568.696,82	2.967.998,44	1,63%
Inv. Exterior	22.667.647,24	645.062,42	2,85%
Renda Fixa	158.901.049,58	2.322.936,03	1,46%
Bradesco Asset Management	160.923.554,09	1.932.908,69	1,20%
Renda Fixa	157.454.175,67	1.688.078,83	1,07%
Renda Variável	2.080.999,25	154.368,81	7,42%
Estruturado	1.388.379,18	90.461,06	6,52%
Itaú Asset Management	139.396.329,66	2.252.471,17	1,62%
Renda Fixa	137.899.239,82	2.177.577,91	1,58%
Renda Variável	1.497.089,84	74.893,26	5,00%
Títulos Públicos Federais	135.539.614,80	606.344,34	0,45%
Renda Fixa	135.539.614,80	606.344,34	0,45%
Santander Brasil Asset Management	94.404.486,57	1.333.873,56	1,41%
Renda Fixa	93.721.730,89	1.276.745,30	1,36%
Renda Variável	682.755,68	57.128,26	8,37%
Queluz Asset Management	38.741.583,20	-472.352,69	-1,22%
Imobiliário	8.763.039,60	-13.906,12	-0,16%
Estruturado	29.978.543,59	-458.446,57	-1,53%
Graphen Investimentos	11.250.362,68	-9.586,78	-0,09%
Renda Fixa	11.250.362,68	-9.586,78	-0,09%
Macam Asset	6.792.098,96	-3.102,73	-0,05%
Imobiliário	6.792.098,96	-3.102,73	-0,05%
Veritas Capital Management	2.645.166,33	-3.905,98	-0,15%
Imobiliário	2.645.166,33	-3.905,98	-0,15%
RB Capital Asset Management	683.988,96	28.050,56	4,10%
Imobiliário	683.988,96	28.050,56	4,10%
BTG Pactual Gestora de Recursos	163.451,21	-18.664,88	-11,42%
Estruturado	163.451,21	-18.664,88	-11,42%
Genial Banco	3.648,47	2.030,97	55,67%
Renda Fixa	3.648,47	2.030,97	55,67%
Arena Capital	-2.255.632,73	-2.281,51	0,10%
Estruturado	-2.255.632,73	-2.281,51	0,10%
Total Geral	1.514.116.646,80	19.044.919,20	1,26%

4. ENQUADRAMENTO DAS APLICAÇÕES: POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023

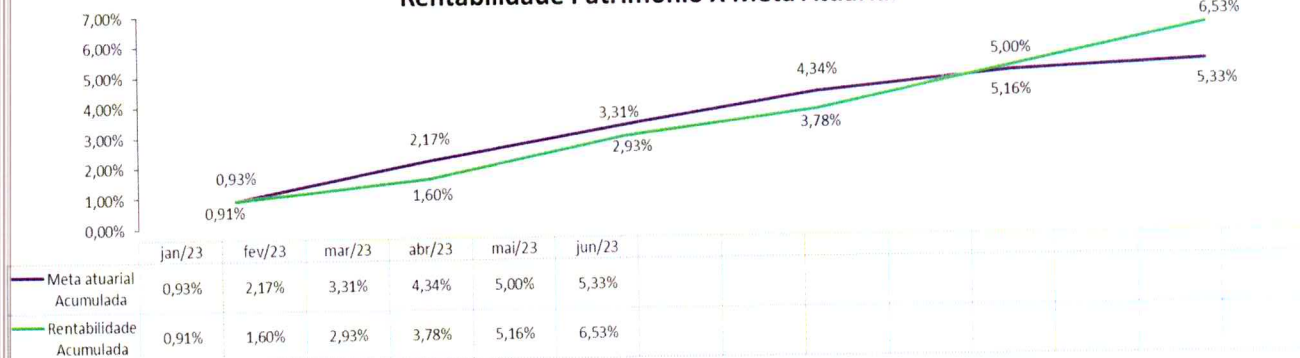
Lig.	Descrição	Limite Resolução CMN	Limite Política de Investimento	Posição carteira do IPREMB em junho/2023
Renda fixa		100%	100%	86,46%
7º I A	Títulos Públicos - Art. 7º, I, a	100%	100%	8,95%
7º I B	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b	100%	100%	24,41%
7º I C	Fundos de índices carteira 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c	100%	100%	-
7º II	Operações compromissadas - Art. 7º, II	5%	5%	-
7º III A	Fundos referenciados em indicadores RF* - Art. 7º, III, a	60%	60%	50,55%
7º III B	Fundos de índices (ETF) em indicadores títulos - Art. 7º, III, b	60%	60%	-
7º III A	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	60%	60%	50,55%
7º III B	FI Renda Fixa (ETF) - quaisquer indicadores - Art. 7º, IV, b	60%	60%	-
7º IV	Letra Imobiliária Garantida - LIG - Art. 7º, V, b	20%	20%	-
7º IV	CDB nos limites garantidos pelo FGC - Art. 7º, VI, a	15%	15%	-
26	Poupança nos limites garantidos pelo FGC - Art. 7º, VI, b	15%	15%	-
7º V A	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a	5%	5%	0,74%
7º V B	FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, b	5%	5%	1,80%
7º V C	FI Renda Fixa de debêntures de infraestrutura- Art. 7º, VII, c	5%	5%	-
Renda variável		30%	30%	0,91%
8º I	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, a	30%	30%	0,91%
8º II	ETF de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, b	30%	30%	-
8º I	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	30%	30%	0,91%
8º II	ETF de Ações - Geral - Art. 8º, II, b	30%	30%	-
Estruturado		10%	10%	6,54%
10 I	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	10%	10%	6,17%
10 II	FI em Participações - Art. 8º, IV, a	5%	5%	0,37%
10 III	FI Ações - Mercado de Acesso	5%	5%	-
Imobiliário		30%	30%	1,66%
11	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, b	5%	5%	1,18%
Inv. exterior		10%	10%	4,43%
9º I	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	10%	10%	-
9º II	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	10%	10%	-
9º III	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	10%	10%	4,43%
Empréstimos Consignados		5%	10%	0,00%
12 I	Empréstimos Consignados - Art. 12, I	5%	5%	-
12 II	Empréstimos Consignados - Art. 12, II	10%	-	-

100,00%

5. QUADRO COMPARATIVO: META ATUARIAL

	IPCA (%)	Meta atuarial (%)	Rentabilidade média da carteira (%)	% atingido da meta	Meta atuarial Acumulada	Rentabilidade Acumulada	Patrimônio Líquido (R\$)	Evolução Patrimonial (%)
jan/23	0,53%	0,93%	0,91%	-1,99%	0,93%	0,91%	R\$ 1.441.934.022,85	0,00%
fev/23	0,84%	1,24%	0,69%	-44,49%	2,17%	1,60%	R\$ 1.450.878.647,30	0,62%
mar/23	0,71%	1,11%	1,31%	18,60%	3,31%	2,93%	R\$ 1.467.462.249,24	1,77%
abr/23	0,61%	1,01%	0,82%	-18,51%	4,34%	3,78%	R\$ 1.478.967.579,30	2,57%
mai/23	0,23%	0,62%	1,33%	113,29%	5,00%	5,16%	R\$ 1.499.463.861,99	3,99%
jun/23	-0,08%	0,31%	1,30%	315,35%	5,33%	6,53%	R\$ 1.515.085.210,46	5,07%

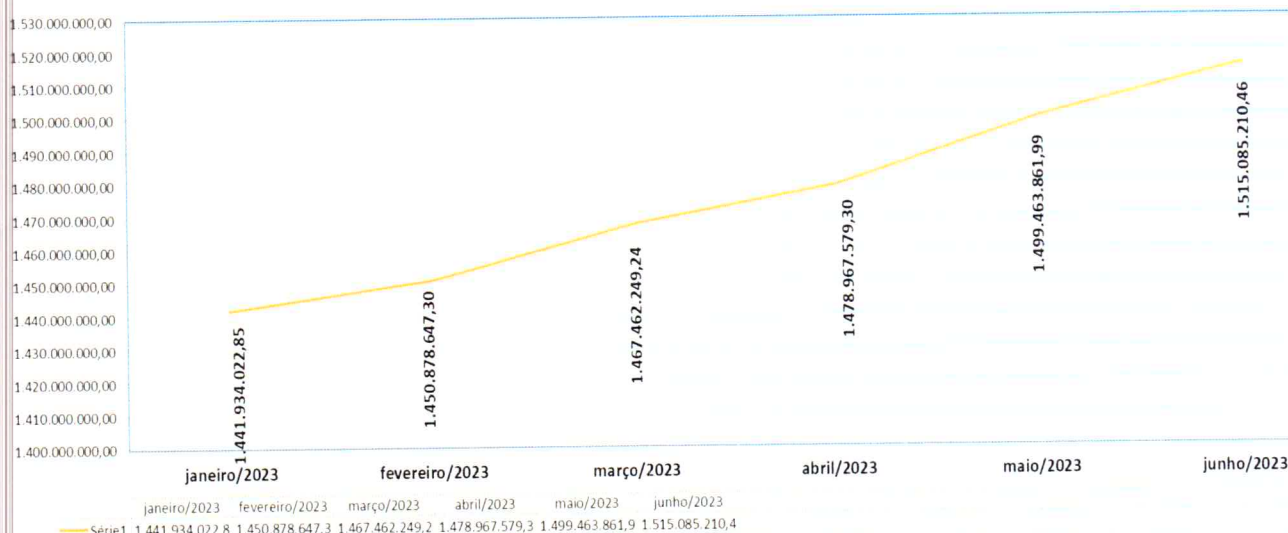
Rentabilidade Patrimônio X Meta Atuarial



6. PATRIMÔNIO LÍQUIDO

Patrimônio líquido - 2023		Evolução Patrimonial
janeiro/2023	1.441.934.022,85	0,0000%
fevereiro/2023	1.450.878.647,30	0,6203%
março/2023	1.467.462.249,24	1,7704%
abril/2023	1.478.967.579,30	2,5683%
maio/2023	1.499.463.861,99	3,9898%
junho/2023	1.515.085.210,46	5,0731%

Patrimônio Líquido - IPREMB - JUNHO/2023



7. RANKING DOS FUNDOS

RANKING DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - junho/2023

META ATUARIAL NO MÊS: 0,31%

META ATUARIAL NO ANO: 5,33%

Gestão	Fundo	% Mês	% Meta	Fundo
Genial Banco	MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	125,56%	40046,54%	2.030,97
CAIXA Asset	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	15,49%	4938,79%	844.000,00
CAIXA Asset	CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	12,52%	3992,11%	1.059.909,48
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9,13%	2912,34%	57.128,26
Bradesco Asset Management	BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	8,01%	2555,45%	154.368,81
CAIXA Asset	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,00%	2233,96%	31.774,17
Bradesco Asset Management	BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	6,97%	2222,91%	90.461,06
Itaú Asset Management	ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,27%	1679,54%	74.893,26
BB Asset Management	BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,88%	1556,54%	474.988,40
CAIXA Asset	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP	4,65%	1483,41%	707.739,07
RB Capital Asset Management	RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4,28%	1363,91%	28.050,56
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,37%	757,26%	190.849,87
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35%	750,61%	21.954,00
Itaú Asset Management	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	709,35%	999.249,45
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,10%	671,30%	4.563,70
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,10%	668,54%	173.982,56
BB Asset Management	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	575,41%	1.706.502,51
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,78%	568,56%	199.461,51
BB Asset Management	BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,38%	441,36%	170.074,02
Itaú Asset Management	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,30%	413,92%	1.178.328,46
CAIXA Asset	CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,22%	389,84%	129.089,57
CAIXA Asset	CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,22%	389,84%	129.089,57
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	1,18%	376,90%	68.455,36
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	369,32%	155.818,65
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	369,32%	155.818,65
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	369,32%	155.818,65
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	369,32%	155.818,65
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,16%	369,02%	4.199.113,76
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,16%	369,02%	4.199.113,76
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,16%	369,02%	4.199.113,76
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,15%	366,31%	240.055,38
Bradesco Asset Management	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	361,18%	916.932,71
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12%	355,74%	101.485,09
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12%	355,74%	101.485,09
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,11%	355,34%	50.370,20
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08%	343,56%	167.183,37
BB Asset Management	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	335,09%	171.813,34
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	332,74%	329.014,04
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	332,74%	329.014,04
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,03%	329,76%	85.866,92
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	329,00%	237.786,24
Bradesco Asset Management	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,03%	328,82%	771.146,11
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03%	328,11%	48.046,59
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1,02%	326,26%	138.340,46
BB Asset Management	BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	318,07%	173.073,38
BB Asset Management	BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,99%	316,28%	140.905,46
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	315,15%	0,00
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	296,13%	299.571,60
BB Asset Management	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	296,06%	130.641,34
CAIXA Asset	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	149,29%	206.714,98
Veritas Capital Management	CAM THRONE FII	0,26%	82,63%	1.282,52
Arena Capital	CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,10%	32,29%	(2.281,51)
Queluz Asset Management	BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,03%	-10,03%	(2.408,06)
Macam Asset	MACAM SHOPPING FII	-0,05%	-14,56%	(3.102,73)
Graphen Investimentos	GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,05%	-15,13%	(4.898,54)
Queluz Asset Management	ÁQUILA FII - AQLL11	-0,16%	-50,53%	(13.906,12)
Veritas Capital Management	SÃO DOMINGOS FII - FSD11	-0,24%	-76,82%	(5.188,49)
Graphen Investimentos	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,50%	-160,10%	(4.688,24)
Queluz Asset Management	SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-2,00%	-638,56%	(456.038,51)
BTG Pactual Gestora de Recursos	BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-10,25%	-3268,76%	(18.664,88)

8. ENQUADRAMENTO DAS APLICAÇÕES AOS LIMITES DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO - PL DOS FUNDOS

FUNDO	CNPJ	RUBRICA	SALDO Junho/2023	PL - FUNDO Junho/2023	LIMITE DO PL - RESOLUÇÃO 4963	% PL - FUNDO	SITUAÇÃO
NTN-B 760199 20240815		7º I A	8.784.883,37	-	-	-	ENQUADRADO
NTN-B 760199 20240815		7º I A	12.719.345,35	-	-	-	ENQUADRADO
NTN-B 760199 20240815		7º I A	14.176.553,49	-	-	-	ENQUADRADO
NTN-B 760199 20240815		7º I A	31.946.800,26	-	-	-	ENQUADRADO
NTN-B 760199 20240815		7º I A	3.144.165,40	-	-	-	ENQUADRADO
NTN-B 760199 20240815		7º I A	30.900.254,23	-	-	-	ENQUADRADO
NTN-B 760199 20250515		7º I A	2.089.947,22	-	-	-	ENQUADRADO
NTN-B 760199 20250515		7º I A	31.777.665,48	-	-	-	ENQUADRADO
NTN-B 760199 20280815		7º I B	16.525.166,37	70.727.169,40	100%	23,36%	ENQUADRADO
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.523.305/0001-06	7º I B	14.204.460,42	188.086.257,13	100%	7,55%	ENQUADRADO
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.303.795/0001-35	7º I B	13.612.087,16	7.499.601.550,53	100%	0,18%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	7º I B	13.539.465,50	7.499.601.550,53	100%	0,18%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	7º I B	8.553.827,25	7.499.601.550,53	100%	0,11%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.670/0001-06	7º I B	954.796,90	4.139.130.466,41	100%	0,02%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	7º I B	23.289.092,91	8.232.973.124,19	100%	0,28%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	7º I B	5.321.353.779,04	5.321.353.779,04	100%	0,00%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	23.215.097/0001-55	7º I B	32.564.472,20	187.978.487,33	100%	17,32%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.768.682/0001-05	7º I B	4.718.380,96	1.118.219.664,59	100%	0,42%	ENQUADRADO
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	13.455.117/0001-01	7º I B	13.661.811,98	682.546.993,54	100%	2,00%	ENQUADRADO
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	18.599.673/0001-75	7º I B	8.229.005,72	360.996.844,37	100%	2,28%	ENQUADRADO
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	14.504.578/0001-90	7º I B	8.474.069,94	558.060.978,49	100%	1,52%	ENQUADRADO
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.455.197/0001-03	7º I B	31.865.922,29	5.952.109.445,19	100%	0,54%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	7º I B	4.050.022,95	5.952.109.445,19	100%	0,07%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	7º I B	5.861.198,03	100.502.712,81	100%	5,83%	ENQUADRADO
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	10.979.025/0001-32	7º I B	45.927.699,18	2.082.365.411,58	100%	2,21%	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.838.150/0001-49	7º I B	5.809.520.567,24	5.809.520.567,24	100%	1,66%	ENQUADRADO
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.292.588/0001-89	7º I B	15.687.410,79	7.108.458.943,17	100%	0,22%	ENQUADRADO
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	09.577.447/0001-00	7º I B	11.388.398,13	288.748.866,27	100%	3,94%	ENQUADRADO
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	26.507.132/0001-06	7º I B	0,01	850.915.526,47	100%	0,00%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	14.508.643/0001-55	7º I B	17.530.251,48	4.945.135.674,50	15%	0,35%	ENQUADRADO
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	13.077.415/0001-05	7º I A	9.134.686,75	15.441.343.704,61	15%	0,06%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	7º I A	69.056.079,69	15.441.343.704,61	15%	0,45%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	7º I A	75.568.795,57	967.184.662,68	15%	7,81%	ENQUADRADO
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	20.216.216/0001-04	7º I A	91.971.540,64	2.978.606.440,04	15%	3,09%	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	32.972.942/0001-28	7º I A	21.130.109,73	3.135.781.237,60	15%	0,67%	ENQUADRADO
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	02.224.354/0001-45	7º I A	81.885.380,09	8.830.042.526,49	15%	0,93%	ENQUADRADO
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	7º I A	365.891.195,10	6.183.909.341,95	15%	5,92%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.215.008/0001-70	7º I A	32.048.061,85	6.183.909.341,95	15%	0,52%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.215.008/0001-70	7º I A	10.321.080,35	125.524.529,52	5%	8,22%	DESENQUADRADO
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	17.013.985/0001-92	7º V A	3.648,47	182.137,28	5%	2,00%	ENQUADRADO
MASTER III FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	12.138.813/0001-21	7º V A	929.282,33	31.724.225,27	5%	2,93%	ENQUADRADO
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	06.018.364/0001-85	7º V A	14.346.608,63	313.178.761,30	5%	4,58%	ENQUADRADO
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	14.091.645/0001-91	7º V B	8.390.839,09	228.304.074,54	5%	3,68%	ENQUADRADO
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	21.918.896/0001-62	7º V B	4.571.345,61	1.266.517.614,50	5%	0,36%	ENQUADRADO
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	17.138.474/0001-05	7º V B	682.755,68	278.477.240,82	15%	0,25%	ENQUADRADO
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	8º I	2.080.999,25	460.747.306,79	15%	0,45%	ENQUADRADO
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	03.660.879/0001-96	8º I	1.497.089,84	1.490.817.423,11	15%	0,10%	ENQUADRADO
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	24.571.992/0001-75	8º I	9.527.763,50	318.112.334,78	15%	3,00%	ENQUADRADO
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	45.443.475/0001-90	8º I	10.207.609,05	392.768.281,51	15%	2,60%	ENQUADRADO
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	39.255.695/0001-98	9º III	17.502.937/0001-68	2.031.715.093,72	15%	2,18%	ENQUADRADO
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	9º III	12.460.038,19	643.045.653,26	15%	1,94%	ENQUADRADO
BB AÇÕES ESG GLOBAIS JS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	22.632.237/0001-28	9º III	22.321.399,88	142.543.778,66	15%	15,66%	DESENQUADRADO
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	14.655.180/0001-54	10 I	485.407,72	1.568.779.702,38	15%	0,03%	ENQUADRADO
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	10 I	1.388.379,18	639.071.313,21	15%	0,22%	ENQUADRADO
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	18.959.094/0001-96	10 I	15.924.398,78	134.542.249,65	15%	11,84%	ENQUADRADO
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP	42.229.068/0001-97	10 I	10.690.177,78	1.663.921.326,47	15%	0,64%	ENQUADRADO
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	14.120.520/0001-42	10 I	42.645.979,68	1.663.921.326,47	15%	2,56%	ENQUADRADO
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	12.312.767/0001-35	10 II	7.657.143,71	135.623.272,22	15%	5,64%	ENQUADRADO
BRASIL FLORESTA MULTISTRATÉGIA FIP	14.584.094/0001-06	10 II	163.451,21	25.075.410,72	15%	0,65%	ENQUADRADO
BTG PACTUAL II FIC FIP INFRAESTRUTURA	16.685.929/0001-31	11	6.792.098,96	316.482.156,45	15%	2,15%	ENQUADRADO
MACAM SHOPPING FII	10.625.626/0001-47	10 II	(2.255.632,73)	(50.478.707,60)	15%	4,47%	ENQUADRADO
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	21.862.783/0001-92	11	496.337,39	2.666.990,51	15%	18,61%	DESENQUADRADO
CAM THRONE FII	16.543.270/0001-89	11	2.148.828,94	79.858.015,12	15%	2,69%	ENQUADRADO
SÃO DOMINGOS FII - FISO11	09.006.914/0001-34	11	683.988,96	122.769.482,89	15%	0,56%	ENQUADRADO
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	13.555.918/0001-49	11	8.763.039,60	144.348.099,78	15%	6,07%	ENQUADRADO
AQUILA FII - AQL11	17.098.794/0001-70	11	6.294.400,00	126.744.425,48	15%	4,97%	ENQUADRADO

- ❖ Conforme Resolução 4.963/2021, em seu artigo 27 § 2º: "As aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento, previstos em seu regulamento, superiores ao previsto no caput, poderão ser mantidas em carteira, durante o respectivo prazo, desde que o regime próprio de previdência social demonstre a adoção de medidas de melhoria da governança e do controle de riscos na gestão das aplicações, conforme regulamentação estabelecida pela Secretaria de Previdência." (NR)

9. COMENTÁRIO:

Em junho, a atividade econômica apresentou um quadro misto. Embora os indicadores de abril tenham apontado tendências negativas nos setores de serviços, varejo ampliado e indústria, a confiança teve uma recuperação em junho, com a incerteza econômica diminuindo. O setor agropecuário continuou em um momento de força, assim como a balança comercial, apesar da resiliência persistente no mercado de trabalho.

No varejo, houve um crescimento modesto de 0,1% em abril, liderado pelos hipermercados que se beneficiaram de um orçamento familiar melhor e uma distribuição de renda mais ampla.

Entretanto, a indústria teve uma retração de 0,6% no mesmo mês, com destaque para as quedas nas máquinas e equipamentos, veículos e alimentos. As paralisações de produção, principalmente nas fábricas de automóveis, contribuíram para esta queda.

Em contrapartida, o Índice de Atividade Econômica do Banco Central (IBC-Br) apresentou um crescimento de 0,6% em abril, com o setor agropecuário como principal contribuinte para essa taxa positiva. Em relação ao mercado de trabalho, houve um saldo positivo de 155.270 empregos formais em maio, principalmente nos serviços, e a taxa de desemprego diminuiu de 8,5% para 8,3%.

O IPCA diminuiu -0,08% em junho, uma desaceleração em comparação com o aumento de +0,23% visto no mês anterior, marcando a menor variação mensal em 9 meses. O dado oficial excedeu a nossa projeção de -0,19%.

Como resultado, o índice aumentou +3,16% em 12 meses (contra +3,94% em maio), mostrando uma desaceleração nessa base de comparação. Os grupos "Transportes" e "Habitação" foram importantes na variação, com alterações de -0,41% e +0,69%, respectivamente. O maior impacto para a variação do índice veio do grupo Habitação, impulsionado pelo aumento dos itens de Encargos e manutenção, incluindo Aluguel e taxas.

Os preços administrados aumentaram +0,06% em junho, principalmente devido ao aumento dos preços do item Ônibus interestadual. Em contrapartida, os preços livres desaceleraram.

Nas subdivisões dos preços livres, os serviços aumentaram, enquanto os produtos industriais e alimentos diminuíram.

No mês de junho, o Copom manteve a taxa Selic em 13,75% ao ano, citando a necessidade de cautela e parcimônia diante da inflação. O cenário externo continua adverso e prevê-se uma desaceleração da economia nos próximos trimestres. A Ata do Copom indicou uma possível flexibilização em agosto, dependendo da conjuntura econômica. O Banco Central revisou as projeções para a taxa de juros neutra, elevou a estimativa de crescimento do PIB em 2023 e estendeu o horizonte de projeção da inflação até 2025. A probabilidade de ultrapassar o limite superior da meta de inflação em 2023 diminuiu para 61%. As estimativas apontam para uma tendência de alta da taxa neutra de juros, com uma mediana de 4,8% em dois anos, reduzindo para 4,5% em cinco anos.

Fonte: Boletim RPPS CAIXA Asset #Público – Junho 2023

Gerência Nacional de Relacionamento e Distribuição

Em complemento à apresentação dos pontos mais importantes do cenário econômico mundial feito neste comentário, reproduzimos abaixo o Relatório FOCUS com base em pesquisa datada de 07 de Julho de 2023, com as previsões do mercado para o final de 2023, final de 2024, final de 2025 e 2026, respectivamente:

Focus | MEDIANAS DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

7 de julho de 2023

	2023				2024				2025				2026			
	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje	Hoje
IPCA (%)	5,42	4,98	4,95	▼ (8)	4,04	3,92	3,92	= (1)	3,60	= (1)	3,50	= (1)				
PIB (var. %)	1,84	2,19	2,19	= (1)	1,27	1,28	1,28	= (1)	1,80	▼ (2)	1,88	▼ (3)				
CÂMBIO (R\$/US\$)	5,10	5,00	5,00	= (3)	5,17	5,08	5,06	▼ (2)	5,15	▼ (1)	5,20	= (1)				
SELIC (% a.a.)	12,50	12,00	12,00	= (1)	10,00	9,50	9,50	= (3)	9,00	= (22)	8,75	▲ (1)				

* comportamento dos indicadores desde o último Focus; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento.

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade
em relação ao Focus anterior

Matheus Henrique de Andrade
Divisão de Investimentos e Financeiro

Poliane da Silva Duarte
Poliane da Silva Duarte
Analista Previdenciária/64.482.34-4
IPREMB

Bruno Ferreira Cypriano
Bruno Ferreira Cypriano
Presidente