

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	258.563,35	0,23%	675	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.045.017,14	0,93%	589	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.157.381,47	1,92%	1.132	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	12.515.555,08	11,11%	552	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	1.325.783,33	1,18%	191	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	1.341.248,83	1,19%	40	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	414.663,61	0,37%	120	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.625.376,71	4,99%	77	1,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	10.517.207,91	9,34%	187	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	4.187.943,86	3,72%	48	2,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	Não há	4.219.513,01	3,75%	21	5,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	1.035.944,92	0,92%	9	2,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	660.579,37	0,59%	777	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.239.214,61	4,65%	741	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.487.093,72	3,98%	381	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.030.007,92	2,69%	42	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.009.405,47	0,90%	24	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.935.227,74	1,72%	980	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	631.134,57	0,56%	1.126	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.137.617,41	3,67%	147	0,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '



Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	6.718,23	0,01%	355	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.168.388,48	1,04%	424	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.689.334,73	1,50%	208	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.164.241,57	4,59%	235	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	382.935,86	0,34%	14	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	5.582.079,90	4,96%	471	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info		4.405.753,23	3,91%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	D+1 du	Não há	1.393.912,23	1,24%	716	0,08%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.222.644,68	1,09%	3.656	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.339.864,13	2,08%	3.004	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	1.717.664,76	1,53%	39	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	1.738.245,06	1,54%	20.876	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.444.582,21	1,28%	1.332	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.560.696,38	1,39%	143	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	2.081.209,79	1,85%	83	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	506.087,90	0,45%	203	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	467.395,28	0,41%	33	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.483.331,23	1,32%	38	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	1.479.701,73	1,31%	30	1,15%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	3.388.910,65	3,01%	22.172	0,84%	Artigo 9º, Inciso III

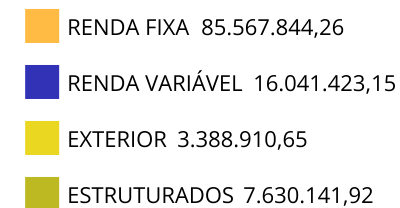
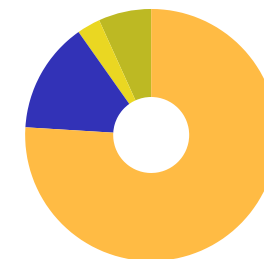


Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	3.089.857,33	2,74%	196.415	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.430.008,26	1,27%	115	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+32	Não há	3.110.276,33	2,76%	271	1,27%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			112.628.319,98				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			0,01				Artigo 6º
PL Total			112.628.319,99				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2023)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	75,00%	84.471.239,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	59.070.500,31	52,45%	21,00%	30,00%	90,00%	42.294.987,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	20.697.678,49	18,38%	15,00%	20,00%	65,00%	52.510.729,50
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	4.405.753,23	3,91%	3,00%	5,00%	20,00%	18.119.910,77
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	1.393.912,23	1,24%	1,00%	5,00%	5,00%	4.237.503,77
Total Renda Fixa	100,00%	85.567.844,26	75,97%	40,00%	75,00%	255,00%	



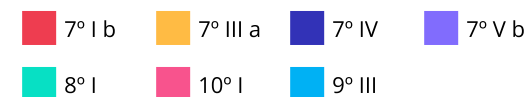
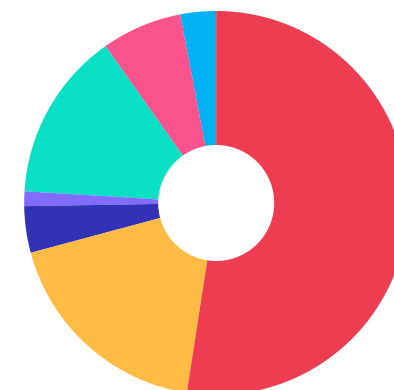
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	16.041.423,15	14,24%	10,00%	15,00%	25,00%	12.115.656,85
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	7.630.141,92	6,77%	3,75%	5,00%	10,00%	3.632.690,08
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	23.671.565,07	21,02%	13,75%	20,00%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.388.910,65	3,01%	2,00%	5,00%	10,00%	7.873.921,35
Total Exterior	10,00%	3.388.910,65	3,01%	2,00%	5,00%	10,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	35.033.822,16	31,11	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.286.170,37	27,78	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	11.323.690,50	10,05	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	10.857.067,40	9,64	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	5.582.079,90	4,96	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.280.173,57	4,69	0,02
ICATU VANGUARDA	3.110.276,33	2,76	0,01
ITAÚ DTVM	1.483.331,23	1,32	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.479.701,73	1,31	0,02
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.393.912,23	1,24	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	1.009.405,47	0,90	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	382.935,86	0,34	0,00

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	75,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	59.070.500,31	52,45	21,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	20.697.678,49	18,38	15,00	65,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	1.393.912,23	1,24	1,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	16.041.423,15	14,24	10,00	25,00
Artigo 9º, Inciso III	3.388.910,65	3,01	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	7.630.141,92	6,77	3,75	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,99%	11,11%	5,62%	10,25%	16,82%	19,48%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,95%	10,83%	5,55%	9,99%	16,27%	18,26%	1,08%	0,04%
IMA Geral (Benchmark)	0,98%	9,70%	4,55%	8,94%	14,59%	21,41%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,79%	12,10%	5,76%	12,12%	15,18%	18,67%	1,58%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,73%	15,74%	8,42%	17,22%	19,37%	15,53%	-	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,72%	12,65%	5,84%	12,41%	16,27%	16,64%	1,59%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,07%	7,81%	3,44%	6,64%	13,84%	23,07%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,62%	3,38%	6,50%	13,50%	22,42%	0,16%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	12,14%	5,79%	12,17%	15,29%	18,72%	1,55%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	12,10%	5,78%	12,11%	15,14%	18,55%	1,54%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,89%	10,59%	5,29%	9,67%	16,44%	20,41%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	10,52%	5,26%	9,56%	16,33%	20,12%	1,08%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	10,30%	5,13%	9,40%	15,98%	19,65%	1,06%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,14%	7,58%	3,52%	6,46%	13,70%	25,14%	0,02%	0,00%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,10%	7,97%	3,42%	6,72%	14,16%	26,24%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,15%	7,73%	3,59%	6,55%	13,76%	24,97%	0,04%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	6,68%	2,97%	5,66%	11,77%	20,50%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	7,57%	3,35%	6,37%	13,57%	24,57%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,98%	7,02%	3,06%	5,93%	12,47%	21,74%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	9,61%	4,54%	8,91%	14,14%	21,06%	0,49%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,99%	8,16%	3,83%	7,05%	13,23%	26,01%	0,43%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,87%	10,40%	5,15%	9,78%	14,96%	21,08%	1,02%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	-	-	-	-	-	1,27%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	10,10%	3,35%	8,80%	12,42%	-	1,11%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	12,57%	5,83%	12,25%	15,21%	-	1,57%	0,06%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,90%	11,27%	5,57%	10,71%	13,06%	23,97%	1,15%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,89%	9,23%	4,88%	8,11%	14,71%	20,86%	1,04%	0,01%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
---------------------------------	---	---	---	---	---	---	---	---



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,82%	-	-	-	-	-	1,11%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,07%	-	-	-	-	-	0,42%	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	1,31%	-	4,89%	-	-	-	3,03%	-
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,72%	-	-	-	-	-	1,56%	-
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,81%	-	-	-	-	-	1,27%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	3,12%	16,80%	26,65%	13,48%	17,47%	-20,79%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,63%	13,32%	17,83%	10,39%	13,26%	-13,09%	7,93%	0,18%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,12%	14,11%	18,63%	11,16%	14,05%	-13,06%	8,72%	0,19%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,11%	19,52%	10,06%	12,57%	11,11%	4,41%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,28%	20,19%	10,09%	13,47%	15,98%	14,96%	3,57%	0,18%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1,99%	14,66%	8,71%	11,61%	27,86%	21,71%	2,39%	0,08%
IDIV (Benchmark)	2,84%	12,41%	12,81%	6,16%	18,72%	18,15%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,89%	13,01%	16,71%	8,22%	19,90%	14,12%	6,91%	0,19%
IBX-50 (Benchmark)	3,70%	8,84%	16,09%	5,28%	16,73%	-1,88%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3,47%	9,13%	15,56%	4,14%	14,82%	-6,18%	7,77%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,61%	1,01%	8,71%	-1,37%	9,71%	-10,68%	7,35%	0,19%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4,71%	10,76%	17,46%	6,76%	14,00%	-9,91%	9,32%	0,19%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2,64%	8,36%	17,40%	4,26%	15,00%	-4,88%	7,36%	0,21%



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

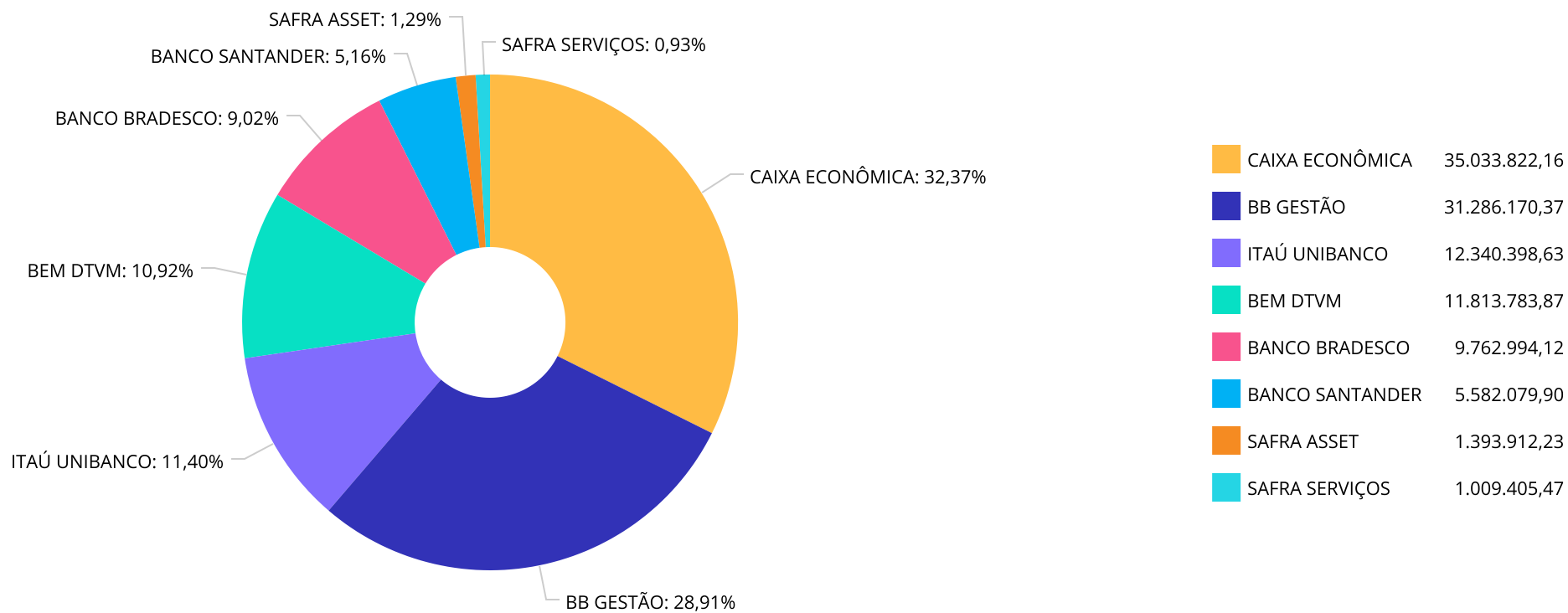
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	3,45%	10,18%	17,22%	6,33%	15,96%	-4,59%	7,97%	0,21%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	3,31%	11,17%	16,14%	6,86%	17,72%	5,83%	7,86%	0,21%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3,40%	10,90%	17,00%	7,30%	17,12%	-4,39%	7,48%	0,20%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,49%	6,92%	5,17%	5,73%	15,45%	21,00%	1,69%	0,04%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,01%	7,45%	3,38%	6,47%	12,87%	23,00%	0,23%	0,00%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

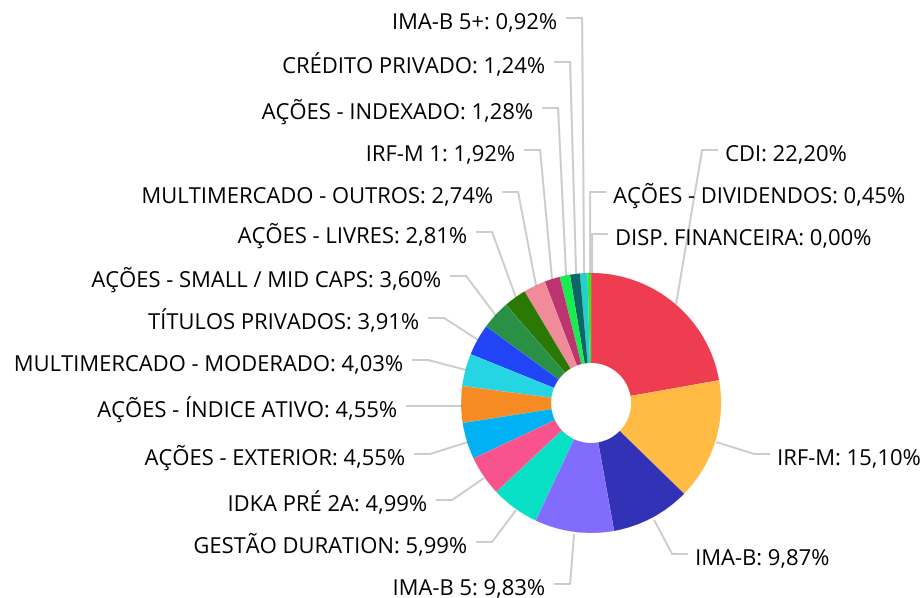
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,95%	16,01%	6,98%	8,63%	12,74%	6,90%	6,78%	16,744%

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





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

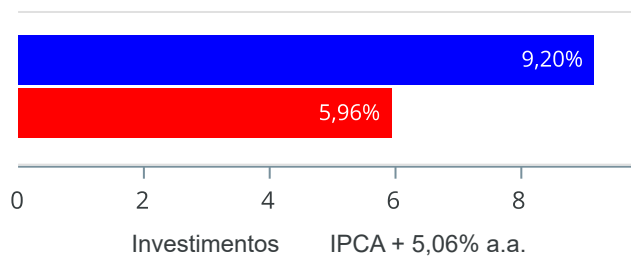


■ CDI	25.004.998,40	■ IRF-M	17.002.648,80	■ IMA-B	11.121.244,61	■ IMA-B 5	11.074.489,03
■ GESTÃO DURATION	6.746.094,86	■ IDKA PRÉ 2A	5.625.376,71	■ AÇÕES - EXTERIOR	5.127.155,71	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.125.237,40
■ MULTIMERCADO - MODERADO	4.540.284,59	■ TÍTULOS PRIVADOS	4.405.753,23	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.057.528,89	■ AÇÕES - LIVRES	3.169.741,69
■ MULTIMERCADO - OUTROS	3.089.857,33	■ IRF-M 1	2.157.381,47	■ AÇÕES - INDEXADO	1.444.582,21	■ CRÉDITO PRIVADO	1.393.912,23
■ IMA-B 5+	1.035.944,92	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	506.087,90	■ 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	98.481.900,53	2.620.709,67	2.273.953,46	100.292.916,55	1.464.259,81	1.464.259,81	1,48%	1,48%	0,96%	0,96%	154,33%	2,30%
Fevereiro	100.292.916,55	1.716.821,30	1.268.293,71	100.363.330,20	-378.113,94	1.086.145,87	-0,38%	1,10%	1,20%	2,17%	50,78%	1,85%
Março	100.363.330,20	1.595.933,70	1.082.666,19	101.913.723,14	1.037.125,43	2.123.271,30	1,03%	2,14%	1,16%	3,36%	63,74%	1,83%
Abril	101.913.723,14	1.025.559,38	501.008,09	103.547.972,64	1.109.698,21	3.232.969,51	1,08%	3,25%	0,97%	4,36%	74,54%	1,72%
Mai	103.547.972,64	41.997.105,57	41.519.614,72	105.878.046,86	1.852.583,37	5.085.552,88	1,78%	5,09%	0,66%	5,05%	100,76%	1,85%
Junho	105.878.046,86	8.343.564,46	7.768.632,21	109.092.844,66	2.639.865,55	7.725.418,43	2,48%	7,69%	0,33%	5,40%	142,54%	2,00%
Julho	109.092.844,66	13.518.392,29	11.541.818,10	112.628.319,98	1.558.901,13	9.284.319,56	1,40%	9,20%	0,53%	5,96%	154,48%	2,08%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

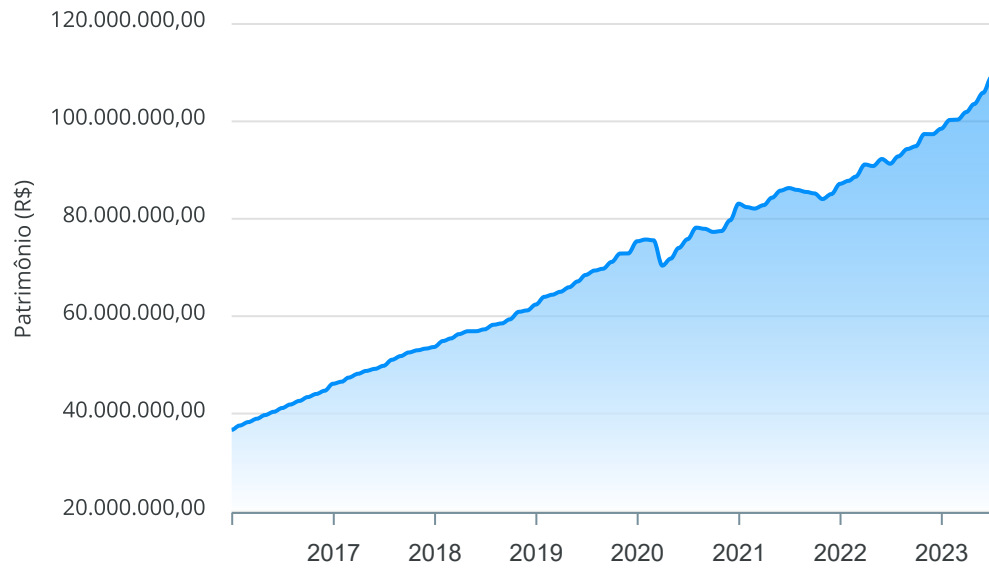




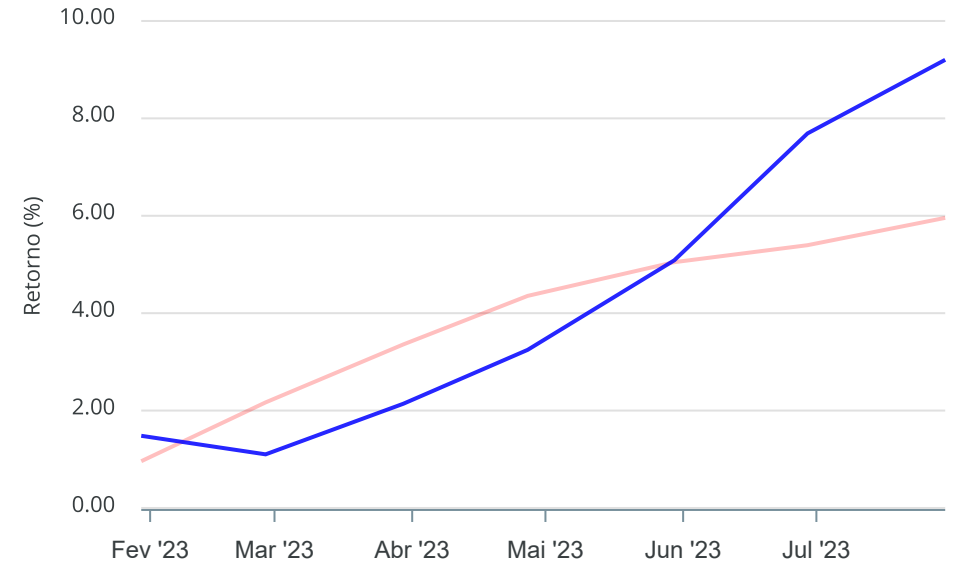
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- 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 Julho/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	378.004,48	0,00	0,00	382.935,86	4.931,38	1,30%	1,30%	3,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.519.442,11	0,00	0,00	5.582.079,90	62.637,79	1,13%	1,13%	0,02%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.378.748,88	0,00	0,00	1.393.912,23	15.163,35	1,10%	1,10%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.134.784,15	0,00	0,00	2.157.381,47	22.597,32	1,06%	1,06%	0,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	0,00	3.030.007,92	30.007,92	1,00%	0,79%	1,58%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	5.572.718,35	0,00	0,00	5.625.376,71	52.658,36	0,94%	0,94%	1,08%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.419.186,79	2.000.000,00	0,00	10.517.207,91	98.021,12	0,94%	1,07%	0,42%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.009.405,47	9.405,47	0,94%	0,72%	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.674.298,06	0,00	0,00	1.689.334,73	15.036,67	0,90%	0,90%	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	654.732,33	0,00	0,00	660.579,37	5.847,04	0,89%	0,89%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.187.107,89	2.006.000,00	0,00	5.239.214,61	46.106,72	0,89%	0,80%	1,55%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.102.077,64	0,00	0,00	4.137.617,41	35.539,77	0,87%	0,87%	1,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.352.046,91	96.641,32	0,00	4.487.093,72	38.405,49	0,86%	0,88%	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	8.096.692,07	0,00	3.000.000,00	5.164.241,57	67.549,50	0,83%	0,99%	0,43%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.153.753,36	0,00	0,00	4.187.943,86	34.190,50	0,82%	0,82%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.315.014,46	0,00	0,00	1.325.783,33	10.768,87	0,82%	0,82%	1,11%
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.185.546,15	0,00	0,00	4.219.513,01	33.966,86	0,81%	0,81%	1,27%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.618.020,29	0,00	1.000.000,00	631.134,57	13.114,28	0,81%	1,06%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.330.473,65	0,00	0,00	1.341.248,83	10.775,18	0,81%	0,81%	1,27%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.127.549,83	0,00	4.000.000,00	1.168.388,48	40.838,65	0,80%	1,15%	0,04%



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	256.545,44	0,00	0,00	258.563,35	2.017,91	0,79%	0,79%	0,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.421.376,70	1.000.000,00	0,00	12.515.555,08	94.178,38	0,76%	0,78%	1,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.037.409,65	0,00	0,00	1.045.017,14	7.607,49	0,73%	0,73%	1,54%
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.028.536,86	0,00	0,00	1.035.944,92	7.408,06	0,72%	0,72%	1,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	411.724,49	0,00	0,00	414.663,61	2.939,12	0,71%	0,71%	1,57%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.038.358,75	2.410.131,80	1.535.818,10	1.935.227,74	22.555,29	0,65%	0,98%	0,01%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	4.385.377,64	0,00	0,00	4.405.753,23	20.375,59	0,46%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	6.074,13	2.005.619,17	2.006.000,00	6.718,23	1.024,93	0,05%	0,99%	0,00%
Total Renda Fixa	82.785.601,06	13.518.392,29	11.541.818,10	85.567.844,26	805.669,01	0,95%		0,87%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.167.678,93	0,00	0,00	1.222.644,68	54.965,75	4,71%	4,71%	9,32%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.247.275,02	0,00	0,00	2.339.864,13	92.589,11	4,12%	4,12%	8,72%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.657.443,82	0,00	0,00	1.717.664,76	60.220,94	3,63%	3,63%	7,93%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	2.011.446,66	0,00	0,00	2.081.209,79	69.763,13	3,47%	3,47%	7,77%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.396.461,72	0,00	0,00	1.444.582,21	48.120,49	3,45%	3,45%	7,97%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.434.596,87	0,00	0,00	1.483.331,23	48.734,36	3,40%	3,40%	7,48%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	1.432.286,33	0,00	0,00	1.479.701,73	47.415,40	3,31%	3,31%	7,86%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.682.974,21	0,00	0,00	1.738.245,06	55.270,85	3,28%	3,28%	3,57%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	491.851,27	0,00	0,00	506.087,90	14.236,63	2,89%	2,89%	6,91%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.520.579,38	0,00	0,00	1.560.696,38	40.117,00	2,64%	2,64%	7,36%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	455.499,45	0,00	0,00	467.395,28	11.895,83	2,61%	2,61%	7,35%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	3.049.588,59	0,00	0,00	3.110.276,33	60.687,74	1,99%	1,99%	2,39%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.409.011,05	0,00	0,00	1.430.008,26	20.997,21	1,49%	1,49%	1,69%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.058.857,82	0,00	0,00	3.089.857,33	30.999,51	1,01%	1,01%	0,23%
Total Renda Variável	23.015.551,12	0,00	0,00	23.671.565,07	656.013,95	2,85%		5,53%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	3.291.692,48	0,00	0,00	3.388.910,65	97.218,17	2,95%	2,95%	6,78%
Total Exterior	3.291.692,48	0,00	0,00	3.388.910,65	97.218,17	2,95%		6,78%

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.

