

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

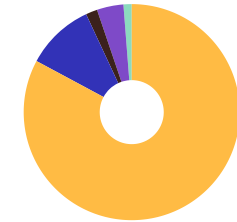
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	15.101.568,02	13,52%	931	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	789.641,01	0,71%	1.132	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	4.112.719,13	3,68%	40	2,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	4.138.609,02	3,71%	120	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	7.354.528,73	6,59%	303	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	5.457.206,98	4,89%	83	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.492.899,71	4,92%	777	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	15.682.519,89	14,04%	892	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.590.398,96	6,80%	1.184	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.600.581,35	5,91%	720	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	127.216,08	0,11%	980	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.255.770,97	1,12%	1.126	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	2.424.671,82	2,17%	355	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.105.447,68	2,78%	424	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDIT...	D+0	Não há	2.034.138,12	1,82%	1.148	0,96%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	191.013,57	0,17%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	154.946,65	0,14%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	8.104.461,30	7,26%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	Não pos...	Não há	1.111.900,67	1,00%	8	5,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	935.806,42	0,84%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	740.484,01	0,66%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	373.073,76	0,33%	585	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.824.951,26	1,63%	188	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.609.851,55	5,02%	22	0,96%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.610.204,21	3,23%	30	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	952.746,06	0,85%	11.374	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	977.499,61	0,88%	488	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.310.147,29	1,17%	5.643	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	16.245,90	0,01%	12	1,16%	Artigo 10º, Inciso I
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	883.872,47	0,79%	14	0,62%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.232.450,46	2,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	205.417,75	0,18%		0,07%	Artigo 11º
HAZ FII - ACR11	Não se ...	Não se aplica	1.170.300,92	1,05%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			111.673.291,33				

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

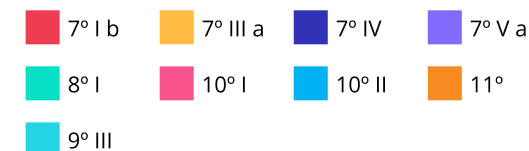
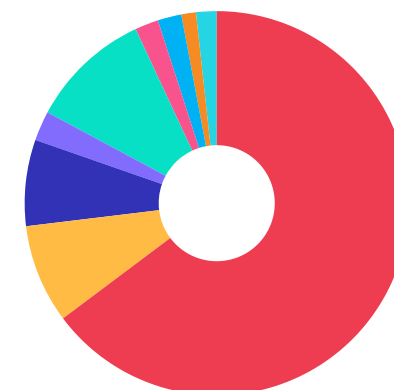
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	22.334.658,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	72.320.672,80	64,76%	15,00%	69,00%	90,00%	28.185.289,40
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	11.167.329,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	60,00%	9.293.204,89	8,32%	4,00%	7,00%	60,00%	57.710.769,91
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	8.104.461,30	7,26%	0,00%	1,00%	20,00%	14.230.196,97
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	5,00%	2.788.191,10	2,50%	0,00%	3,00%	5,00%	2.795.473,47
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	5.583.664,57
Total Renda Fixa	100,00%	92.506.530,09	82,84%	19,00%	82,50%	210,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	11.418.080,78	10,22%	0,00%	9,00%	30,00%	22.083.906,62
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.210.265,66	1,98%	0,00%	3,00%	10,00%	8.957.063,47
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	2.232.450,46	2,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.351.214,11
Artigo 11º	5,00%	1.375.718,67	1,23%	0,00%	1,50%	5,00%	4.207.945,90
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	17.236.515,57	15,43%	0,00%	16,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.930.245,67	1,73%	0,00%	1,50%	10,00%	9.237.083,46
Total Exterior	10,00%	1.930.245,67	1,73%	0,00%	1,50%	10,00%	



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	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	72.320.672,80	64,76	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.293.204,89	8,32	4,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	2.788.191,10	2,50	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	11.418.080,78	10,22	5,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	1.930.245,67	1,73	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.210.265,66	1,98	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	2.232.450,46	2,00	0,00	5,00
Artigo 11º	1.375.718,67	1,23	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	57.820.853,28	51,78	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.851.344,05	24,04	-
TRÍGONO CAPITAL	9.220.055,76	8,26	0,19
BANCO DAYCOVAL	8.104.461,30	7,26	0,07
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.974.737,92	3,56	5,22
KPTL	2.232.450,46	2,00	6,87
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	2.034.138,12	1,82	0,02
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	883.872,47	0,79	-
ZION INVEST	205.417,75	0,18	-
RJI CORRETORA DE VALORES	191.013,57	0,17	0,34
PLURAL	154.946,65	0,14	-

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)

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
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,76%	7,66%	2,22%	6,47%	12,31%	33,51%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	-0,82%	-2,95%	-1,74%	-2,62%	-4,45%	11,29%	-	-

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,98%	7,84%	2,26%	6,31%	10,55%	21,73%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	7,57%	2,34%	6,08%	10,55%	20,96%	0,71%	2,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	7,57%	2,37%	6,04%	10,71%	21,24%	0,66%	2,49%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,69%	7,08%	1,98%	5,98%	11,27%	31,05%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,01%	-2,61%	0,24%	-2,42%	-8,81%	-18,11%	0,39%	1,88%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,31%	-1,36%	-0,98%	-1,80%	-0,90%	3,04%	0,06%	0,59%

IRF-M 1 (Benchmark)	1,07%	7,81%	3,44%	6,64%	13,84%	23,07%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,07%	7,73%	3,39%	6,53%	13,63%	22,57%	0,16%	0,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,62%	3,38%	6,50%	13,50%	22,42%	0,16%	0,36%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,23%	-5,79%	-0,67%	-1,24%	-20,63%	-28,10%	0,30%	14,67%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,44%	3,11%	1,38%	2,52%	4,70%	7,04%	0,02%	0,54%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	3,59%	1,99%	2,17%	3,56%	7,16%	0,42%	4,76%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,82%	6,89%	0,35%	5,64%	6,24%	-	1,11%	5,96%

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%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	7,66%	3,44%	6,47%	13,55%	24,37%	0,03%	0,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,15%	7,73%	3,59%	6,55%	13,76%	24,97%	0,04%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	7,57%	3,35%	6,37%	13,57%	24,57%	0,01%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,98%	7,02%	3,06%	5,93%	12,47%	21,74%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	6,68%	2,97%	5,66%	11,77%	20,50%	0,00%	0,02%
MAG PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,03%	7,53%	3,29%	6,34%	13,50%	-	0,02%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,89%	9,23%	4,88%	8,11%	14,71%	20,86%	1,04%	1,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	12,57%	5,83%	12,25%	15,21%	-	1,57%	5,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,96%	9,08%	2,80%	7,70%	14,91%	39,76%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,15%	-1,01%	-0,45%	-0,86%	-8,54%	-10,15%	-	-
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,71%	8,12%	4,44%	4,01%	0,56%	-7,12%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	9,42%	6,67%	7,40%	3,63%	-5,70%	5,15%	21,52%
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,16%	-17,86%	-2,25%	-4,26%	-18,98%	-22,28%	0,09%	14,23%
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-
HAZ FII - ATCR11	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-3,40%	-29,43%	5,29%	-21,65%	-56,65%	158,44%	8,52%	34,06%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,65%	10,45%	16,02%	6,90%	14,66%	-2,73%	7,43%	20,14%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,51%	8,41%	21,72%	4,88%	17,68%	2,54%	6,90%	20,10%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,08%	11,94%	19,85%	6,38%	24,18%	21,15%	5,97%	21,70%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,90%	15,88%	18,79%	12,17%	18,29%	9,69%	6,37%	19,46%
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-

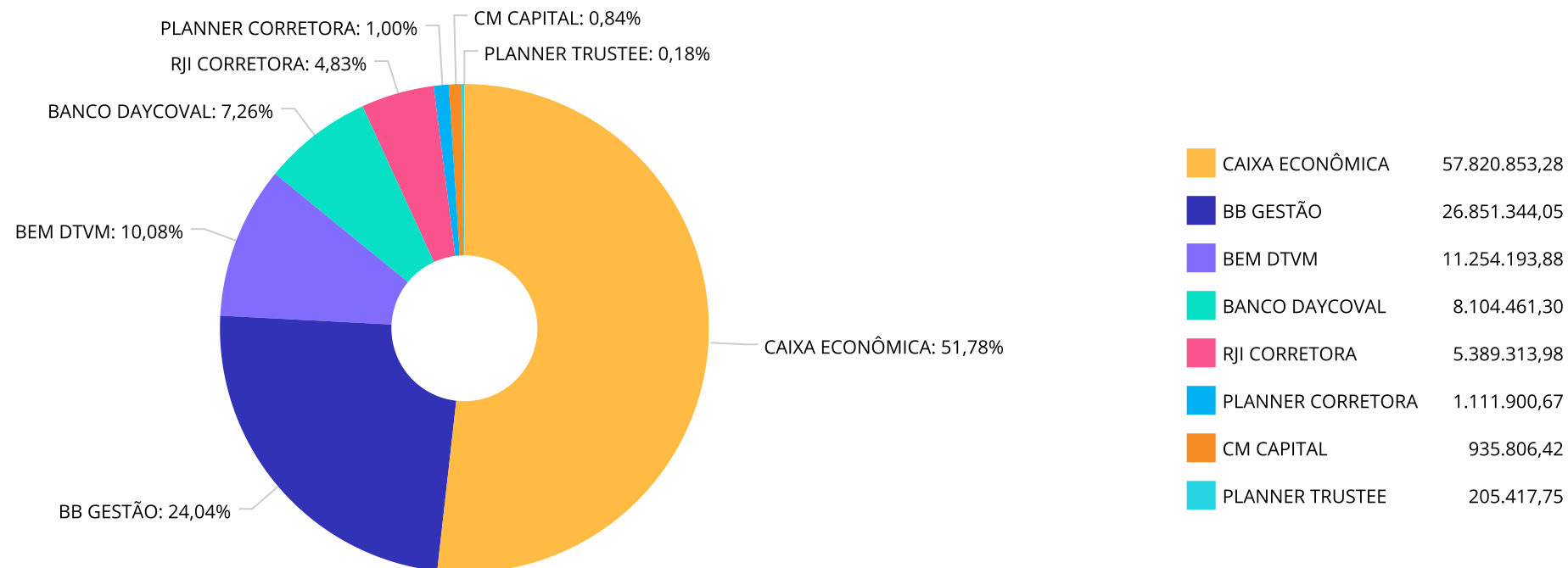
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	23,13%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,36%	-2,51%	-1,13%	-2,16%	-6,33%	-11,49%	0,00%	2,24%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,48%	8,24%	5,19%	6,95%	14,09%	18,57%	1,54%	4,24%

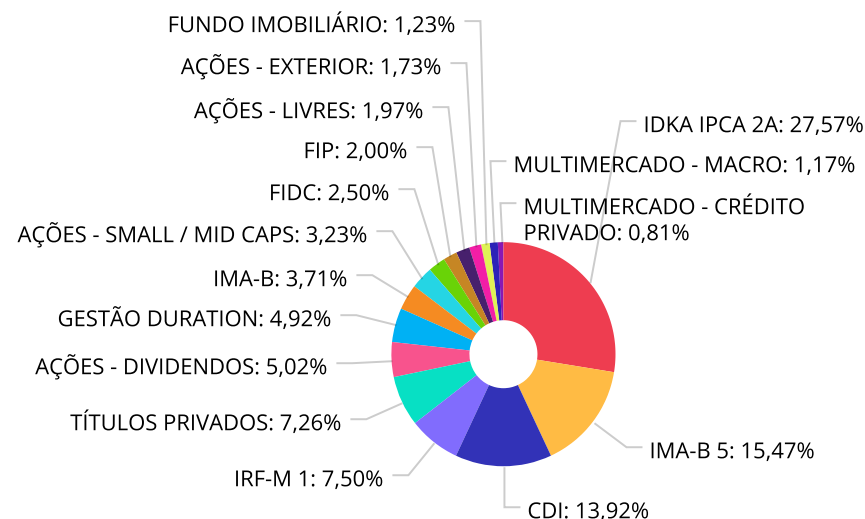
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,71%	8,12%	4,44%	4,01%	0,56%	-7,12%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	9,42%	6,67%	7,40%	3,63%	-5,70%	5,15%	21,524%
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	23,133%

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



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

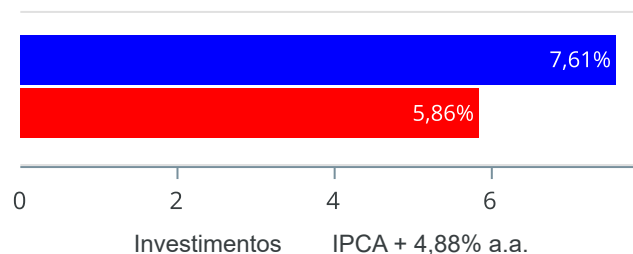


IDKA IPCA 2A	30.784.087,91	IMA-B 5	17.270.415,06	CDI	15.547.826,02
IRF-M 1	8.380.039,97	TÍTULOS PRIVADOS	8.104.461,30	AÇÕES - DIVIDENDOS	5.609.851,55
GESTÃO DURATION	5.492.899,71	IMA-B	4.138.609,02	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	3.610.204,21
FIDC	2.788.191,10	FIP	2.232.450,46	AÇÕES - LIVRES	2.198.025,02
AÇÕES - EXTERIOR	1.930.245,67	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.375.718,67	MULTIMERCADO - MACRO	1.310.147,29
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	900.118,37				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

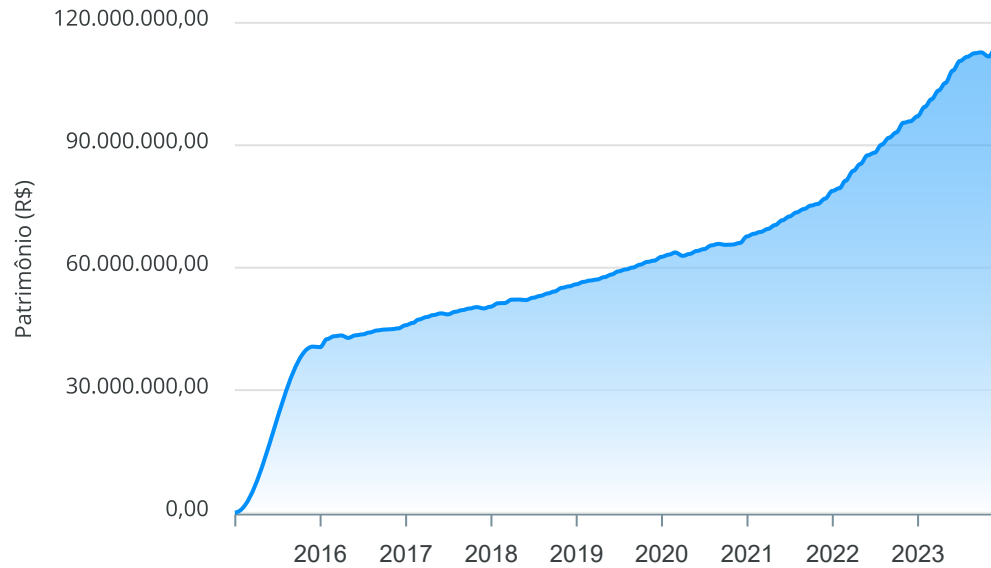
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	97.086.530,51	2.605.686,61	1.434.352,47	99.418.761,12	1.160.896,47	1.160.896,47	1,18%	1,18%	0,95%	0,95%	124,49%	1,83%
Fevereiro	99.418.761,12	1.868.013,19	677.044,41	101.258.624,52	648.894,62	1.809.791,09	0,64%	1,83%	1,18%	2,14%	85,54%	1,88%
Março	101.258.624,52	1.746.003,57	472.085,39	103.421.420,80	888.878,10	2.698.669,19	0,87%	2,72%	1,15%	3,32%	81,89%	1,51%
Abril	103.421.420,80	4.118.113,96	2.858.616,80	105.226.833,23	545.915,27	3.244.584,46	0,52%	3,25%	0,95%	4,30%	75,60%	1,25%
Maio	105.226.833,23	44.619.542,35	45.192.036,87	106.307.852,41	1.653.513,70	4.898.098,16	1,57%	4,88%	0,65%	4,98%	97,93%	2,29%
Junho	106.307.852,41	3.026.252,70	489.897,37	110.641.947,78	1.797.740,04	6.695.838,20	1,65%	6,61%	0,32%	5,31%	124,40%	1,58%
Julho	110.641.947,78	505.483,39	511.453,93	111.673.291,33	1.037.314,09	7.733.152,29	0,94%	7,61%	0,52%	5,86%	129,87%	1,38%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



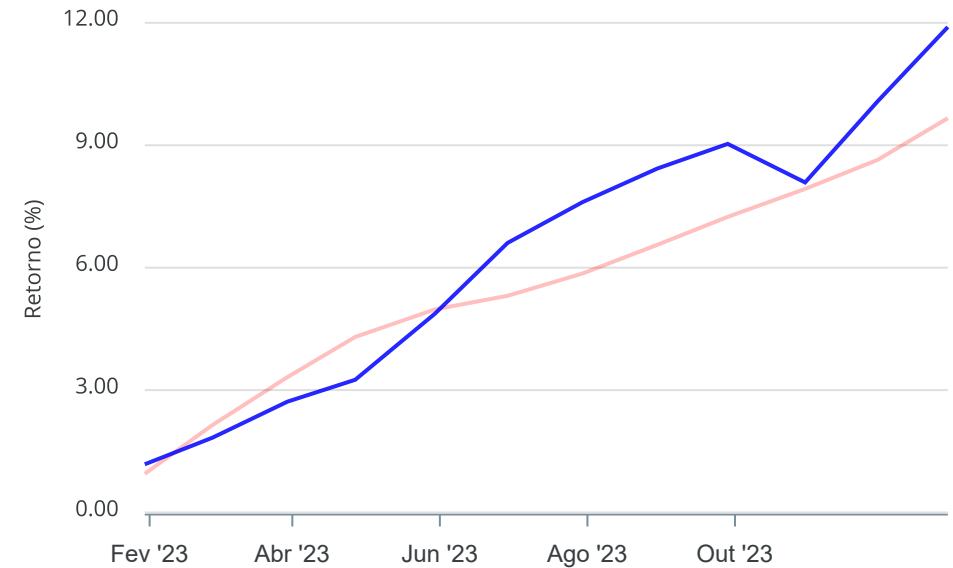
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.070.236,15	0,00	0,00	3.105.447,68	35.211,53	1,15%	1,15%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.509.942,15	0,00	0,00	7.590.398,96	80.456,81	1,07%	1,07%	0,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.242.543,69	0,00	0,00	1.255.770,97	13.227,28	1,06%	1,06%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	781.369,98	0,00	0,00	789.641,01	8.271,03	1,06%	1,06%	0,16%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.277.581,35	0,00	0,00	7.354.528,73	76.947,38	1,06%	1,06%	0,42%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.532.280,37	0,00	0,00	6.600.581,35	68.300,98	1,05%	1,05%	0,03%
MAG PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO ...	2.013.460,22	0,00	0,00	2.034.138,12	20.677,90	1,03%	1,03%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	125.977,31	0,00	0,00	127.216,08	1.238,77	0,98%	0,98%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.960.445,71	0,00	0,00	15.101.568,02	141.122,31	0,94%	0,94%	0,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.540.144,11	0,00	0,00	15.682.519,89	142.375,78	0,92%	0,92%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.444.279,88	0,00	0,00	5.492.899,71	48.619,83	0,89%	0,89%	1,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.402.340,69	505.483,39	507.287,40	2.424.671,82	24.135,14	0,83%	0,99%	0,00%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.412.902,04	0,00	0,00	5.457.206,98	44.304,94	0,82%	0,82%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	4.079.678,81	0,00	0,00	4.112.719,13	33.040,32	0,81%	0,81%	1,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	4.109.274,77	0,00	0,00	4.138.609,02	29.334,25	0,71%	0,71%	1,57%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	8.067.867,70	0,00	0,00	8.104.461,30	36.593,60	0,45%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	190.179,83	0,00	0,00	191.013,57	833,74	0,44%	0,44%	0,02%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	935.676,93	0,00	0,00	935.806,42	129,49	0,01%	0,01%	0,39%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	155.307,27	0,00	0,00	154.946,65	-360,62	-0,23%	-0,23%	0,30%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	742.816,54	0,00	0,00	740.484,01	-2.332,53	-0,31%	-0,31%	0,06%

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
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	1.121.131,29	0,00	0,00	1.111.900,67	-9.230,62	-0,82%	-	-
Total Renda Fixa	91.715.436,79	505.483,39	507.287,40	92.506.530,09	792.897,31	0,86%		0,60%

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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	359.943,13	0,00	0,00	373.073,76	13.130,63	3,65%	3,65%	7,43%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	3.521.770,83	0,00	0,00	3.610.204,21	88.433,38	2,51%	2,51%	6,90%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.790.949,27	0,00	0,00	1.824.951,26	34.001,99	1,90%	1,90%	6,37%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.291.079,11	0,00	0,00	1.310.147,29	19.068,18	1,48%	1,48%	1,54%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.549.823,76	0,00	0,00	5.609.851,55	60.027,79	1,08%	1,08%	5,97%
HAZ FII - ATCR11	1.172.780,65	0,00	4.166,53	1.170.300,92	1.686,80	0,14%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.235.720,99	0,00	0,00	2.232.450,46	-3.270,53	-0,15%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	885.246,03	0,00	0,00	883.872,47	-1.373,56	-0,16%	-0,16%	0,09%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	16.304,59	0,00	0,00	16.245,90	-58,69	-0,36%	-0,36%	0,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	212.643,50	0,00	0,00	205.417,75	-7.225,75	-3,40%	-3,40%	8,52%
Total Renda Variável	17.036.261,86	0,00	4.166,53	17.236.515,57	204.420,24	1,20%		5,54%

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 GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	933.002,72	0,00	0,00	952.746,06	19.743,34	2,12%	2,12%	5,15%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	957.246,41	0,00	0,00	977.499,61	20.253,20	2,12%	2,12%	5,49%
Total Exterior	1.890.249,13	0,00	0,00	1.930.245,67	39.996,54	2,12%		5,33%

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 E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. 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.

