

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

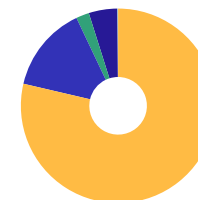
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	582.747,09	0,13%	675	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	7.605.774,89	1,70%	931	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	21.890.415,94	4,89%	786	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.578.798,50	1,25%	552	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.755.531,68	1,96%	105	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	22.421.328,95	5,01%	303	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.643.821,83	2,16%	777	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.368.573,40	3,66%	892	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.162.598,12	4,73%	925	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.129.552,33	2,26%	741	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.595.613,89	1,25%	381	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	25.329.232,76	5,66%	980	0,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	38.997.341,84	8,72%	162	1,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.860.811,26	1,53%	378	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	71.480.685,00	15,98%	424	1,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	7.914.327,58	1,77%	208	0,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não possui	16.226.853,81	3,63%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0		42.628.971,47	9,53%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	5.644.654,53	1,26%	732	1,91%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	419.208,33	0,09%	3.656	0,14%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.220.457,86	1,39%	1.475	0,69%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	30.438,77	0,01%	2.432	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	7.005.478,93	1,57%	5.925	1,00%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	10.760.848,88	2,41%	2.744	0,78%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.456.287,43	1,44%	2.007	1,94%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	13.314.547,49	2,98%	22	2,27%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	14.112.745,87	3,16%	30	1,54%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	2.980.407,54	0,67%	103	0,25%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	3.392.800,61	0,76%	54	0,66%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	D+6 du	Não há	305.309,36	0,07%	9	1,66%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD ...	D+6 du	Não há	324.407,78	0,07%	14	1,97%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.735.525,81	0,61%	395	0,38%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	6.139.855,69	1,37%	2.345	1,16%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.547.393,74	1,02%	5.643	0,29%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.561.351,67	1,24%	10	11,13%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	4.869.092,59	1,09%	79	0,82%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	682.285,43	0,15%		0,23%	Artigo 11º
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.589.984,95	2,81%	306	0,26%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			447.266.063,60				

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%	3,00%	30,00%	134.179.819,08
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	129.734.756,62	29,01%	30,00%	39,15%	90,00%	272.804.700,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	150.582.398,44	33,67%	15,00%	29,00%	60,00%	117.777.239,72
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	58.855.825,28	13,16%	0,00%	5,00%	20,00%	30.597.387,44
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	22.363.303,18
Desenquadrado - RF	0,00%	12.589.984,95	2,81%	0,00%	0,00%	0,00%	-12.589.984,95
Total Renda Fixa	100,00%	351.762.965,29	78,65%	45,00%	76,15%	205,00%	

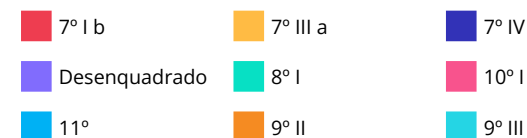
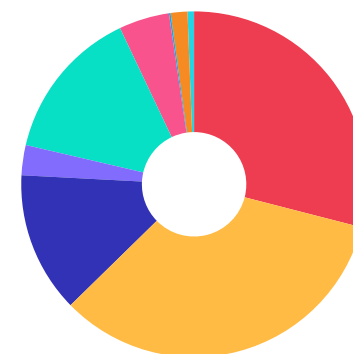


■	RENDA FIXA 351.762.965,29
■	RENDA VARIÁVEL 63.964.668,09
■	EXTERIOR 9.738.451,10
■	ESTRUTURADOS 21.117.693,69
■	FUNDO IMOBILIÁRIO 682.285,43

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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%	63.964.668,09	14,30%	10,00%	16,00%	35,00%	92.578.454,17
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	21.117.693,69	4,72%	3,00%	5,00%	10,00%	23.608.912,67
Artigo 11º	5,00%	682.285,43	0,15%	0,00%	0,50%	2,00%	8.263.035,84
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	85.764.647,21	19,18%	13,00%	21,50%	47,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	7.002.925,29	1,57%	0,00%	1,70%	5,00%	15.360.377,89
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.735.525,81	0,61%	0,00%	0,65%	5,00%	19.627.777,37
Total Exterior	10,00%	9.738.451,10	2,18%	0,00%	2,35%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	177.110.577,87	39,60	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	112.577.977,03	25,17	-
TRÍGONO CAPITAL	27.427.293,36	6,13	0,56
BANCO BTG PACTUAL	16.226.853,81	3,63	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	12.589.984,95	2,81	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	10.760.848,88	2,41	0,53
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	7.914.327,58	1,77	-
BANCO J. SAFRA S/A	7.604.618,40	1,70	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.860.811,26	1,53	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	6.456.287,43	1,44	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	6.139.855,69	1,37	0,00
4UM INVESTIMENTOS	5.644.654,53	1,26	0,18
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.561.351,67	1,24	0,34
ZION INVEST	682.285,43	0,15	-
MIRAE ASSET	629.717,14	0,14	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	419.208,33	0,09	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	30.438,77	0,01	0,00

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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	129.734.756,62	29,01	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	150.582.398,44	33,67	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	63.964.668,09	14,30	10,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	7.002.925,29	1,57	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	2.735.525,81	0,61	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	21.117.693,69	4,72	3,00	10,00
Artigo 11º	682.285,43	0,15	0,00	2,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	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 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%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	7,57%	2,37%	6,04%	10,71%	21,24%	0,66%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	3,59%	1,99%	2,17%	3,75%	7,10%	0,42%	0,05%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,95%	8,01%	2,61%	6,54%	11,10%	21,88%	0,74%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,02%	2,64%	6,56%	11,20%	22,15%	0,73%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	3,59%	1,99%	2,17%	3,56%	7,16%	0,42%	0,05%
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%
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%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,18%	7,79%	3,52%	6,59%	13,99%	25,52%	0,06%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,08%	7,09%	3,41%	6,22%	13,16%	24,26%	0,03%	0,00%

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,98%	7,02%	3,06%	5,93%	12,47%	21,74%	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%
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%
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,14%	7,71%	3,53%	6,52%	13,88%	25,39%	0,02%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,23%	3,11%	0,38%	2,56%	4,11%	14,59%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
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%

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%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2,97%	16,40%	25,91%	12,68%	16,58%	-22,65%	8,42%	0,26%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	6,72%	21,06%	33,24%	19,89%	19,92%	1,88%	7,81%	0,23%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,11%	19,52%	10,06%	12,57%	11,11%	4,41%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3,68%	24,80%	12,37%	17,32%	26,29%	28,16%	3,75%	0,18%
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-3,40%	-29,43%	5,29%	-21,65%	-56,65%	158,44%	8,52%	0,34%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,82%	8,04%	15,36%	4,55%	9,45%	-2,72%	7,64%	0,21%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,45%	13,46%	16,34%	9,27%	13,40%	2,04%	6,37%	0,19%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4,71%	10,76%	17,46%	6,76%	14,00%	-9,91%	9,32%	0,19%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2,65%	4,56%	14,71%	0,82%	10,36%	-11,29%	7,68%	0,21%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,51%	8,41%	21,72%	4,88%	17,68%	2,54%	6,90%	0,20%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,08%	11,94%	19,85%	6,38%	24,18%	21,15%	5,97%	0,22%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2,56%	9,60%	14,12%	5,00%	11,10%	-5,36%	7,19%	0,21%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-

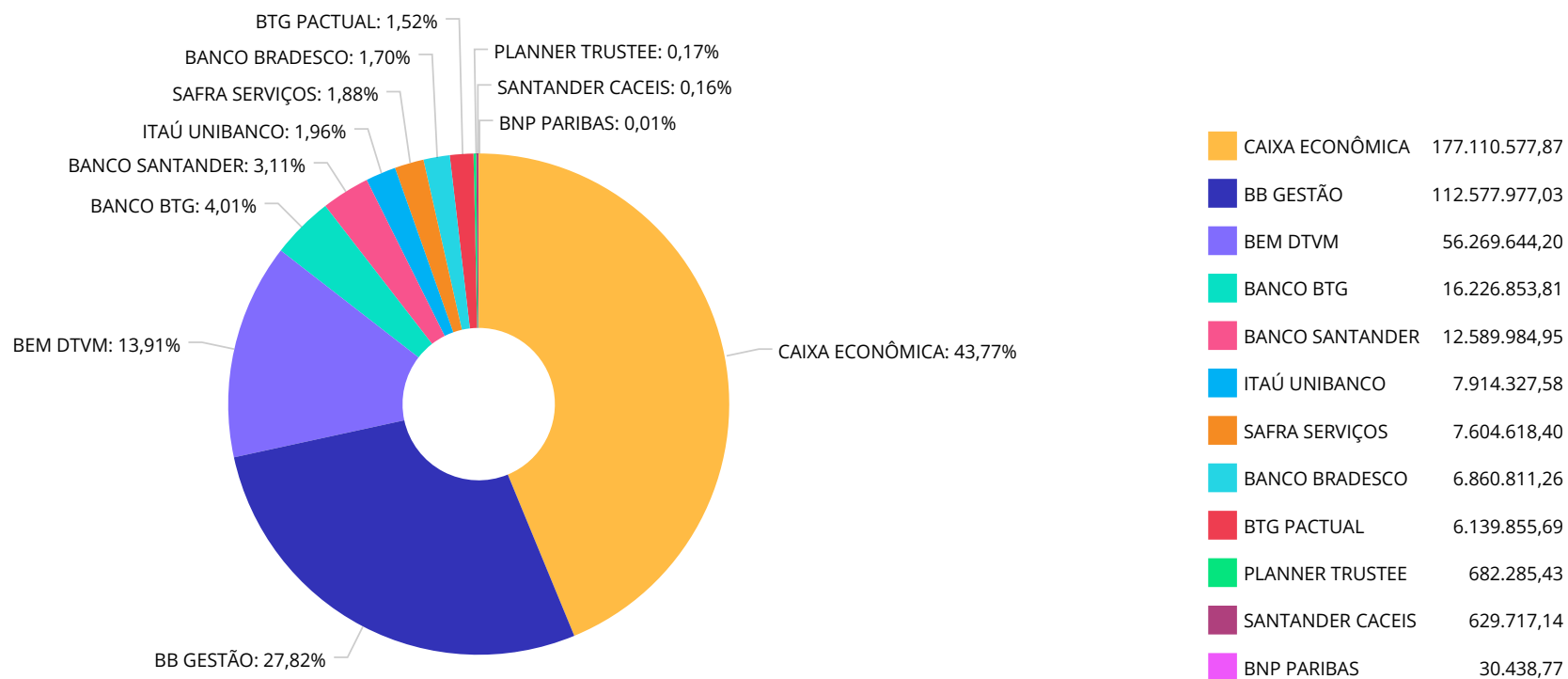
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,48%	8,24%	5,19%	6,95%	14,09%	18,57%	1,54%	0,04%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	3,60%	24,14%	11,99%	16,68%	20,38%	21,62%	3,71%	0,19%

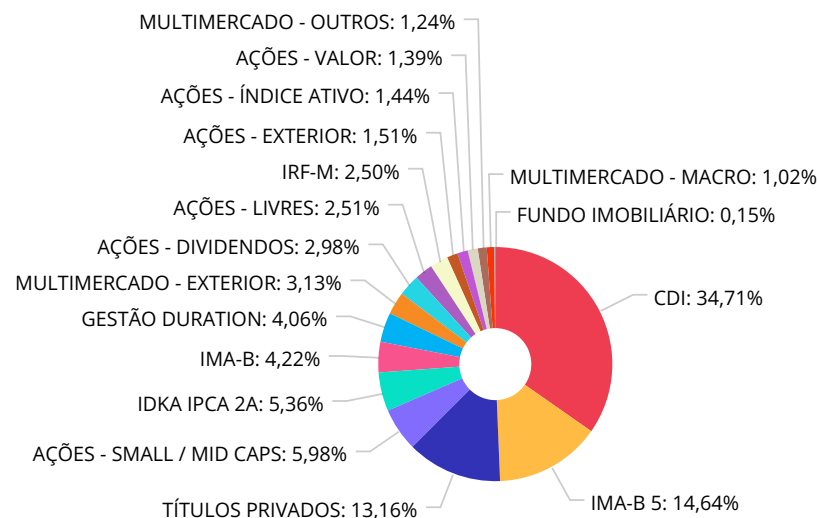
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,55%	9,12%	3,22%	6,40%	0,96%	-13,34%	4,91%	21,724%
MSCI WORLD (Benchmark)	1,62%	6,99%	2,45%	2,31%	1,97%	-7,57%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,04%	6,42%	2,78%	3,76%	7,11%	-2,39%	5,56%	22,500%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,83%	-1,03%	-0,46%	-1,96%	-2,95%	-13,97%	5,29%	22,140%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5,83%	17,74%	19,70%	9,49%	10,07%	-32,52%	11,19%	35,670%
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO E...	0,15%	26,00%	10,81%	13,35%	16,50%	-24,70%	9,30%	29,446%

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



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

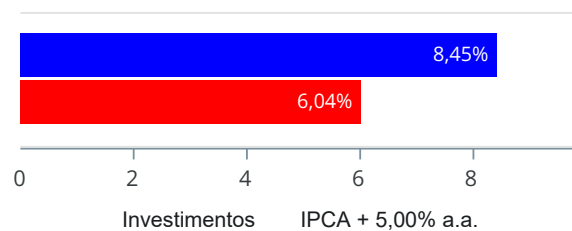


■ CDI	155.258.055,81	■ IMA-B 5	65.474.343,01	■ TÍTULOS PRIVADOS	58.855.825,28	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	26.762.879,33
■ IDKA IPCA 2A	23.974.348,29	■ IMA-B	18.885.084,01	■ GESTÃO DURATION	18.140.896,50	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	13.989.355,82
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	13.314.547,49	■ AÇÕES - LIVRES	11.210.495,98	■ IRF-M	11.174.412,39	■ AÇÕES - EXTERIOR	6.758.043,56
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.456.287,43	■ AÇÕES - VALOR	6.220.457,86	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.561.351,67	■ MULTIMERCADO - MACRO	4.547.393,74
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	682.285,43						

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

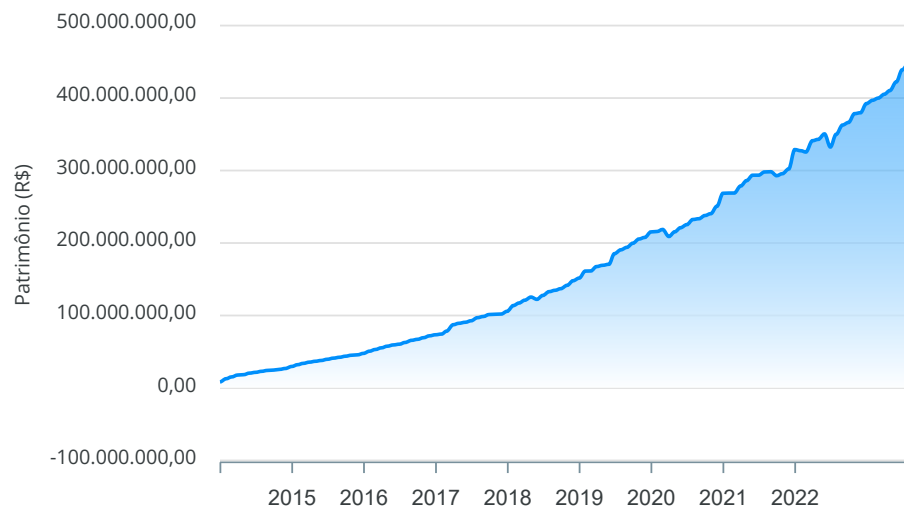
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	392.355.656,83	458.633,10	2.330.723,72	396.999.742,95	6.516.176,74	6.516.176,74	1,66%	1,66%	0,96%	0,96%	173,16%	2,55%
Fevereiro	396.999.742,95	6.812.733,03	3.327.223,55	399.934.272,51	-550.979,92	5.965.196,82	-0,14%	1,52%	1,19%	2,16%	70,33%	2,46%
Março	399.934.272,51	7.317.069,32	4.160.969,66	405.240.103,35	2.149.731,18	8.114.928,00	0,53%	2,06%	1,16%	3,35%	61,62%	2,40%
Abril	405.240.103,35	5.312.044,94	3.074.085,29	410.282.701,00	2.804.638,00	10.919.566,00	0,69%	2,76%	0,96%	4,34%	63,70%	2,03%
Mai	410.282.701,00	121.702.849,23	118.830.594,22	422.304.385,08	9.149.429,07	20.068.995,07	2,21%	5,04%	0,66%	5,03%	100,27%	2,43%
Junho	422.304.385,08	9.781.023,47	1.742.986,13	438.912.725,07	8.570.302,65	28.639.297,72	1,99%	7,13%	0,33%	5,37%	132,81%	1,92%
Julho	438.912.725,07	5.581.706,88	2.649.703,45	447.266.063,60	5.421.335,10	34.060.632,82	1,23%	8,45%	0,64%	6,04%	139,76%	1,79%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

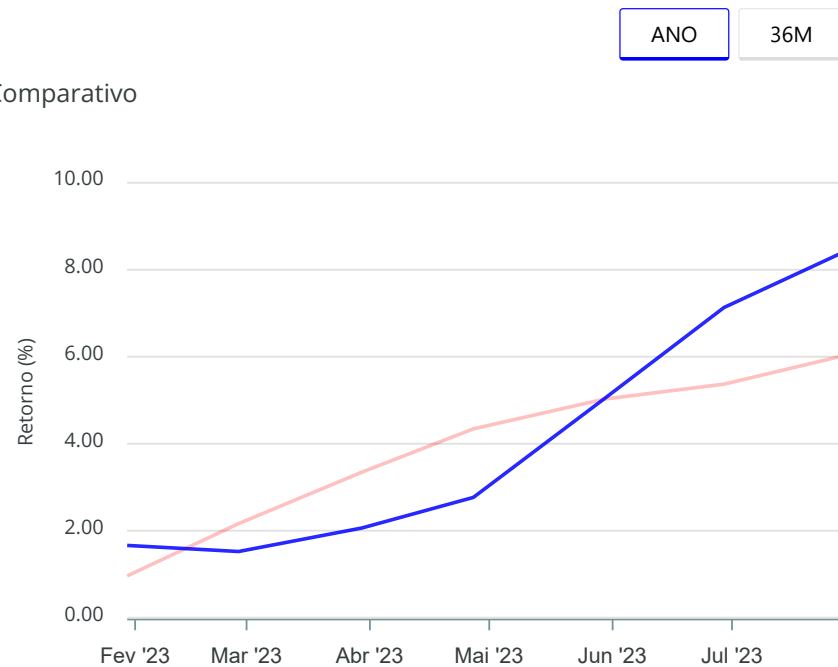


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.780.578,52	0,00	0,00	6.860.811,26	80.232,74	1,18%	1,18%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	70.693.155,62	0,00	23.000,00	71.480.685,00	810.529,38	1,15%	1,15%	0,04%
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.447.790,54	0,00	0,00	12.589.984,95	142.194,41	1,14%	1,14%	0,02%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	38.582.220,67	0,00	0,00	38.997.341,84	415.121,17	1,08%	1,08%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.186.743,88	0,00	0,00	22.421.328,95	234.585,07	1,06%	1,06%	0,42%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.664.026,11	0,00	0,00	8.755.531,68	91.505,57	1,06%	1,06%	0,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	20.963.114,39	0,00	0,00	21.162.598,12	199.483,73	0,95%	0,95%	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	21.684.383,36	0,00	0,00	21.890.415,94	206.032,58	0,95%	0,95%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.534.699,85	0,00	0,00	7.605.774,89	71.075,04	0,94%	0,94%	0,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.219.969,18	0,00	0,00	16.368.573,40	148.604,22	0,92%	0,92%	0,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	7.843.882,61	0,00	0,00	7.914.327,58	70.444,97	0,90%	0,90%	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.558.460,55	0,00	0,00	9.643.821,83	85.361,28	0,89%	0,89%	1,04%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.546.666,23	0,00	0,00	5.595.613,89	48.947,66	0,88%	0,88%	1,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.049.009,55	0,00	0,00	10.129.552,33	80.542,78	0,80%	0,80%	1,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	578.199,15	0,00	0,00	582.747,09	4.547,94	0,79%	0,79%	0,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.535.637,27	0,00	0,00	5.578.798,50	43.161,23	0,78%	0,78%	1,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	22.159.219,46	5.581.706,88	2.626.703,45	25.329.232,76	215.009,87	0,78%	0,98%	0,01%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	42.403.799,70	0,00	0,00	42.628.971,47	225.171,77	0,53%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	16.146.715,47	0,00	0,00	16.226.853,81	80.138,34	0,50%	-	-
Total Renda Fixa	345.578.272,11	5.581.706,88	2.649.703,45	351.762.965,29	3.252.689,75	0,93%		0,39%

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
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	5.289.045,59	0,00	0,00	5.644.654,53	355.608,94	6,72%	6,72%	7,81%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	400.362,22	0,00	0,00	419.208,33	18.846,11	4,71%	4,71%	9,32%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.991.324,81	0,00	0,00	6.220.457,86	229.133,05	3,82%	3,82%	7,64%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5.922.183,59	0,00	0,00	6.139.855,69	217.672,10	3,68%	3,68%	3,75%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	4.700.123,96	0,00	0,00	4.869.092,59	168.968,63	3,59%	3,59%	3,71%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6.803.440,97	0,00	0,00	7.005.478,93	202.037,96	2,97%	2,97%	8,42%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6.289.948,10	0,00	0,00	6.456.287,43	166.339,33	2,64%	2,64%	7,68%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	29.679,61	0,00	0,00	30.438,77	759,16	2,56%	2,56%	7,19%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	13.767.048,56	0,00	0,00	14.112.745,87	345.697,31	2,51%	2,51%	6,90%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.481.209,95	0,00	0,00	4.547.393,74	66.183,79	1,48%	1,48%	1,54%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.607.457,95	0,00	0,00	10.760.848,88	153.390,93	1,45%	1,45%	6,37%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.172.076,17	0,00	0,00	13.314.547,49	142.471,32	1,08%	1,08%	5,97%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.582.454,96	0,00	0,00	5.561.351,67	-21.103,29	-0,38%	-0,38%	4,10%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	706.285,42	0,00	0,00	682.285,43	-23.999,99	-3,40%	-3,40%	8,52%
Total Renda Variável	83.742.641,86	0,00	0,00	85.764.647,21	2.022.005,35	2,41%		6,14%

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
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	288.482,63	0,00	0,00	305.309,36	16.826,73	5,83%	5,83%	11,19%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.920.719,81	0,00	0,00	2.980.407,54	59.687,73	2,04%	2,04%	5,56%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.693.872,96	0,00	0,00	2.735.525,81	41.652,85	1,55%	1,55%	4,91%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	3.364.827,85	0,00	0,00	3.392.800,61	27.972,76	0,83%	0,83%	5,29%
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD IN...	323.907,85	0,00	0,00	324.407,78	499,93	0,15%	0,15%	9,30%
Total Exterior	9.591.811,10	0,00	0,00	9.738.451,10	146.640,00	1,53%		5,58%

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 GESTÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.. 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 das outras providências.