

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

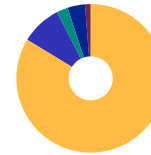
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	12.660.378,84	8,90%	675	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.447.476,03	2,42%	931	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.526.583,73	1,07%	589	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.012.306,13	0,71%	292	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	15.614.091,40	10,97%	88	2,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	6.215.623,38	4,37%	777	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.655.333,88	4,68%	892	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.175.029,48	5,04%	925	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FX...	D+0	Não há	1.647.695,02	1,16%	741	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.500.500,93	2,46%	1.184	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	5.940.975,26	4,17%	227	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FX...	D+0	Não há	4.498.577,89	3,16%	381	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.400.577,98	1,69%	1.126	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.679.281,90	3,29%	147	0,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.776.320,08	12,49%	138	1,88%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.459.555,02	14,38%	378	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.991.835,32	1,40%	998	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	184.078,25	0,13%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	149.320,85	0,10%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	14.611,43	0,01%		0,00%	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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	675.095,40	0,47%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	874.889,58	0,61%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.058.447,61	0,74%	3.004	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.986.056,83	1,40%	20.881	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.000.776,78	0,70%	263	2,74%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.076.167,03	2,16%	143	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.019.206,53	2,12%	271	0,92%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.409.202,95	1,69%	2.007	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.173.141,97	0,82%	17.282	0,25%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.299.396,91	1,62%	488	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.423.243,33	3,81%	48.530	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.769.662,91	1,24%		1,23%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			142.315.440,65				

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

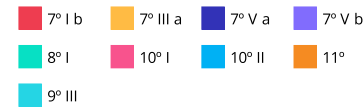
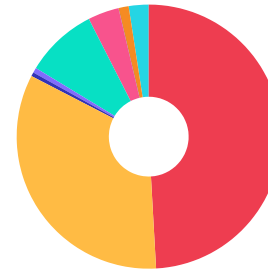
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,02%	81,95%	116.627.503,61
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	69.894.571,97	49,11%	20,49%	25,32%	81,95%	46.732.931,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	47.640.969,40	33,48%	20,89%	27,85%	60,00%	37.748.294,99
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	28.463.088,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	689.706,83	0,48%	0,60%	0,80%	5,00%	6.426.065,20
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	874.889,58	0,61%	0,73%	4,20%	5,00%	6.240.882,45
Total Renda Fixa	100,00%	119.100.137,78	83,69%	42,71%	75,19%	253,90%	



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%	12.549.857,73	8,82%	5,89%	11,81%	20,00%	15.913.230,40
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.423.243,34	3,81%	3,75%	5,00%	10,00%	8.808.300,73
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,01
Artigo 11º	5,00%	1.769.662,91	1,24%	0,00%	2,00%	5,00%	5.346.109,12
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	19.742.763,99	13,87%	9,64%	18,81%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.472.538,88	2,44%	0,00%	5,00%	10,00%	10.759.005,19
Total Exterior	10,00%	3.472.538,88	2,44%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	62.606.192,21	43,99	0,01
CAIXA DTVM	39.924.968,07	28,05	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.629.764,84	20,82	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.019.206,53	2,12	-
SOMMA INVESTIMENTOS	2.409.202,95	1,69	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.769.662,91	1,24	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.058.447,61	0,74	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	874.889,58	0,61	5,58
GRAPHEN INVESTIMENTOS	675.095,40	0,47	0,89
RJI CORRETORA DE VALORES	184.078,25	0,13	0,33
GENIAL GESTÃO LTDA	163.932,29	0,12	-
ARENA CAPITAL	0,01	0,00	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, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alinea ' a '	47.640.969,40	33,48	20,89	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea ' a '	689.706,83	0,48	0,60	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea ' b '	874.889,58	0,61	0,73	5,00
Artigo 8º, Inciso I	12.549.857,73	8,82	5,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	3.472.538,88	2,44	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.423.243,34	3,81	3,75	10,00
Artigo 11º	1.769.662,91	1,24	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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)

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 + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,36%	9,79%	4,20%	8,29%	17,56%	33,10%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	2,80%	-52,51%	-34,62%	-37,49%	101,72%	273,69%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,98%	7,84%	2,26%	6,31%	10,55%	21,73%	-	-
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%
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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,82%	12,33%	6,44%	11,52%	18,36%	19,55%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	12,14%	6,40%	11,33%	17,85%	18,64%	1,52%	0,05%
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%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,95%	7,95%	2,60%	6,50%	10,99%	21,51%	0,77%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,23%	-5,79%	-0,67%	-1,24%	-20,63%	-28,10%	0,30%	0,15%
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%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,44%	3,11%	1,38%	2,52%	4,70%	7,04%	0,02%	0,01%
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	12,14%	5,79%	12,17%	15,29%	18,72%	1,55%	0,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,78%	12,08%	5,75%	12,11%	15,11%	18,43%	1,58%	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%

CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
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%
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%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,71%	4,90%	2,25%	4,14%	8,36%	11,43%	0,08%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,47%	-8,42%	-7,55%	-8,11%	0,74%	-59,56%	0,06%	0,14%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,14%	7,64%	3,48%	6,47%	13,70%	24,83%	0,03%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,18%	7,79%	3,52%	6,59%	13,99%	25,52%	0,06%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	-	-	-	-	-	0,42%	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,87%	10,40%	5,15%	9,78%	14,96%	21,08%	1,02%	0,03%
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%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,12%	14,11%	18,63%	11,16%	14,05%	-13,06%	8,72%	0,19%
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCA DO CRÉDITO PRIVA DO LP	1,30%	12,37%	3,99%	10,94%	20,57%	44,58%	0,00%	0,03%
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
IDIV (Benchmark)	2,84%	12,41%	12,81%	6,16%	18,72%	18,15%	-	-
BRADESCO H DIVIDENDOS FIA ÇÕES	2,75%	11,85%	12,69%	5,75%	17,80%	15,87%	6,93%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2,64%	8,36%	17,40%	4,26%	15,00%	-4,88%	7,36%	0,21%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3,27%	8,61%	15,99%	3,98%	11,69%	-1,78%	7,98%	0,21%
SOMMA BRASIL FIA ÇÕES	2,65%	4,56%	14,71%	0,82%	10,36%	-11,29%	7,68%	0,21%
FINACAP MAURITSSTAD FIA ÇÕES	2,56%	15,01%	20,21%	11,22%	21,28%	11,74%	6,40%	0,18%
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIA ÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	0,23%

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

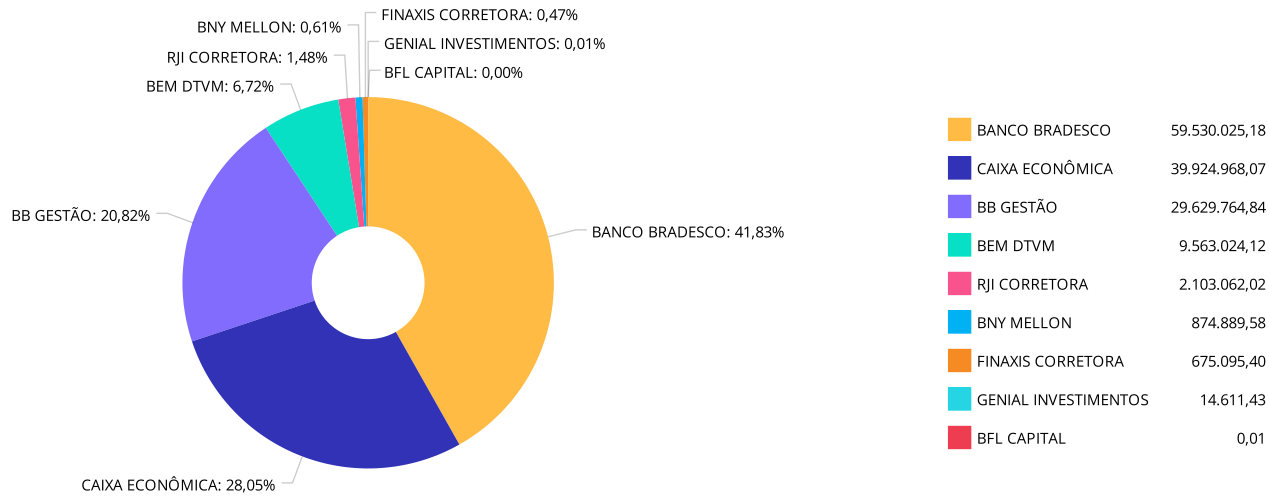
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,99%	6,30%	2,85%	5,18%	10,55%	18,69%	0,87%	0,02%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	0,80%	7,94%	2,34%	6,72%	12,83%	34,75%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-



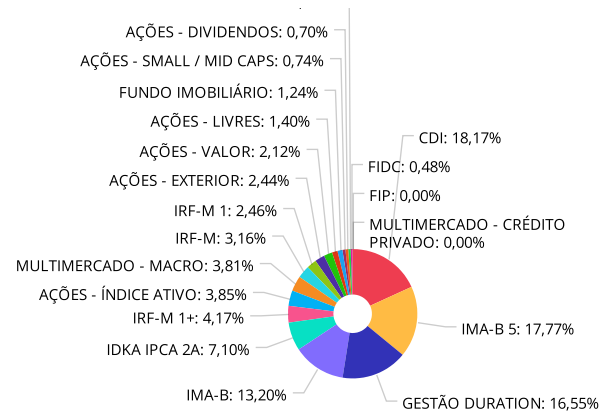
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	23,133%
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,44%	31,58%	20,31%	22,26%	20,43%	-22,82%	6,52%	19,388%

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



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

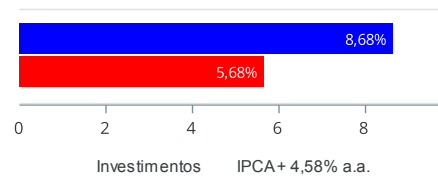


CDI	25.864.274,45	IMA-B 5	25.284.748,66	GESTÃO DURATION	23.555.284,12
IMA-B	18.788.370,15	IDKA IPCA 2A	10.102.809,91	IRF-M 1+	5.940.975,26
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.485.369,98	MULTIMERCADO - MACRO	5.423.243,33	IRF-M	4.498.577,89
IRF-M 1	3.500.500,93	AÇÕES - EXTERIOR	3.472.538,88	AÇÕES - VALOR	3.019.206,53
AÇÕES - LIVRES	1.986.056,83	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.769.662,91	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.058.447,61
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.000.776,78	CRÉDITO PRIVADO	874.889,58	FIDC	689.706,83
FIP	0,01	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	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	103.702.617,14	6.662.130,42	2.700.000,00	109.033.387,61	1.368.640,05	1.368.640,05	1,27%	1,27%	0,92%	0,92%	137,61%	2,39%
Fevereiro	109.033.387,61	0,00	0,00	109.049.471,45	16.083,84	1.384.723,89	0,01%	1,29%	1,16%	2,10%	61,31%	1,75%
Março	109.049.471,45	13.998.533,63	8.708.605,00	115.635.828,65	1.296.428,57	2.681.152,46	1,13%	2,43%	1,12%	3,24%	75,06%	1,92%
Abril	115.635.828,65	0,00	0,00	116.814.397,80	1.178.569,15	3.859.721,61	1,02%	3,48%	0,93%	4,21%	82,70%	1,48%
Maio	116.814.397,80	7.915.073,18	2.400.000,00	124.501.987,82	2.172.516,84	6.032.238,45	1,78%	5,32%	0,62%	4,86%	109,50%	1,41%
Junho	124.501.987,82	8.661.764,09	6.845.340,01	128.883.420,02	2.565.008,12	8.597.246,57	2,03%	7,45%	0,29%	5,16%	144,39%	1,58%
Julho	128.883.420,02	3.826.221,31	2.409.042,23	131.781.194,45	1.480.595,35	10.077.841,92	1,14%	8,68%	0,49%	5,68%	152,67%	1,45%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



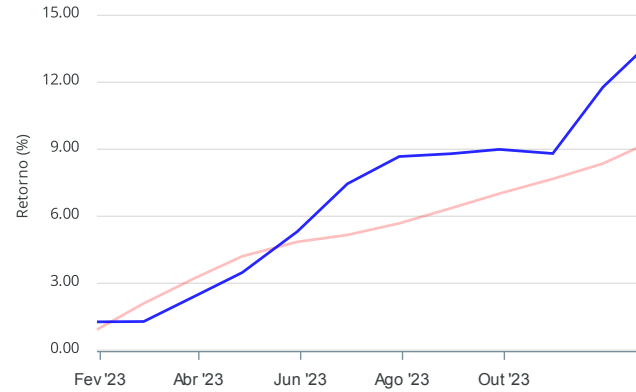
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	14.213,62	0,00	5.168,86	14.611,43	5.566,67	39,16%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	20.220.293,80	0,00	0,00	20.459.555,02	239.261,22	1,18%	1,18%	0,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.969.362,46	0,00	0,00	1.991.835,32	22.472,86	1,14%	1,14%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.463.396,28	0,00	0,00	3.500.500,93	37.104,65	1,07%	1,07%	0,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.001.630,52	0,00	0,00	1.012.306,13	10.675,61	1,07%	1,07%	0,42%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENC...	2.375.292,22	0,00	0,00	2.400.577,98	25.285,76	1,06%	1,06%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.107.395,91	0,00	0,00	7.175.029,48	67.633,57	0,95%	0,95%	0,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.415.259,79	0,00	0,00	3.447.476,03	32.216,24	0,94%	0,94%	0,66%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	19.993.327,12	0,00	2.403.873,37	17.776.320,08	186.866,33	0,93%	0,95%	0,77%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.594.912,58	0,00	0,00	6.655.333,88	60.421,30	0,92%	0,92%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	6.160.606,44	0,00	0,00	6.215.623,38	55.016,94	0,89%	0,89%	1,04%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.459.226,56	0,00	0,00	4.498.577,89	39.351,33	0,88%	0,88%	1,08%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.639.089,54	0,00	0,00	4.679.281,90	40.192,36	0,87%	0,87%	1,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	11.658.534,97	3.826.221,31	0,00	15.614.091,40	129.335,12	0,84%	0,78%	1,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.893.576,36	0,00	0,00	5.940.975,26	47.398,90	0,80%	0,80%	1,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.634.593,75	0,00	0,00	1.647.695,02	13.101,27	0,80%	0,80%	1,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	12.561.573,31	0,00	0,00	12.660.378,84	98.805,53	0,79%	0,79%	0,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.515.470,55	0,00	0,00	1.526.583,73	11.113,18	0,73%	0,73%	1,54%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI CRÉDITO PRI...	868.752,94	0,00	0,00	874.889,58	6.136,64	0,71%	0,71%	0,08%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	183.237,87	0,00	0,00	184.078,25	840,38	0,46%	0,44%	0,02%



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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	149.674,90	0,00	0,00	149.320,85	-354,05	-0,24%	-0,23%	0,30%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	678.286,55	0,00	0,00	675.095,40	-3.191,15	-0,47%	-0,47%	0,06%
Total Renda Fixa	116.557.708,04	3.826.221,31	2.409.042,23	119.100.137,78	1.125.250,66	0,95%		0,75%

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 SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.016.564,53	0,00	0,00	1.058.447,61	41.883,08	4,12%	4,12%	8,72%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.923.101,29	0,00	0,00	1.986.056,83	62.955,54	3,27%	3,27%	7,98%
BRADESCO H DIVIDENDOS FIAÇÕES	974.039,92	0,00	0,00	1.000.776,78	26.736,86	2,74%	2,74%	6,93%
SOMMA BRASIL FIAÇÕES	2.347.132,42	0,00	0,00	2.409.202,95	62.070,53	2,64%	2,64%	7,68%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.997.095,55	0,00	0,00	3.076.167,03	79.071,48	2,64%	2,64%	7,36%
FINACAP MAURITSSTAD FIAÇÕES	2.943.900,23	0,00	0,00	3.019.206,53	75.306,30	2,56%	2,56%	6,40%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.370.165,18	0,00	0,00	5.423.243,33	53.078,15	0,99%	0,99%	0,87%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	1,30%	0,00%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.772.596,59	0,00	0,00	1.769.662,91	-2.933,68	-0,17%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	19.344.595,73	0,00	0,00	19.742.763,99	398.168,26	2,06%		4,92%

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 TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.145.250,15	0,00	0,00	1.173.141,97	27.891,82	2,44%	2,44%	6,52%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.251.754,80	0,00	0,00	2.299.396,91	47.642,11	2,12%	2,12%	5,49%
Total Exterior	3.397.004,95	0,00	0,00	3.472.538,88	75.533,93	2,22%		5,84%

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 reflète 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.

