

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

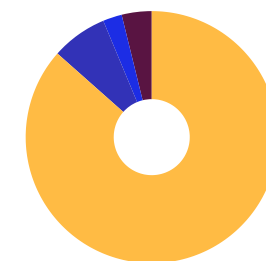
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	22.300.037,94	4,40%	675	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	33.128.076,27	6,54%	931	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	25.727.861,34	5,08%	786	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	16.023.590,38	3,16%	589	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	10.131.264,07	2,00%	91	4,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREV.I...	D+0	Não há	44.413.514,87	8,77%	1.132	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	10.935.344,11	2,16%	191	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	9.350.454,96	1,85%	370	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.315.673,33	1,84%	303	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	3.460.673,38	0,68%	83	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	24.921.785,23	4,92%	777	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	47.439.291,37	9,37%	892	0,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	24.291.159,76	4,80%	925	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.060.774,32	0,21%	270	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	9.574.264,33	1,89%	741	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	7.525.976,20	1,49%	147	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	27.718.620,61	5,47%	1.184	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	59.069.510,57	11,67%	1.126	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.436.322,85	2,06%	119	1,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	31.951.577,15	6,31%	998	0,21%	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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.410.413,86	0,28%	228	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	8.004.410,00	1,58%	471	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	D+3	Não há	9.086.115,70	1,79%	20.876	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIAÇÕES	D+33	Não há	12.089.347,36	2,39%	1.475	1,35%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIAÇÕES	D+3	Não há	1.688.078,63	0,33%	28.955	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIAÇÕES	D+3	Não há	280.711,25	0,06%	20.881	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIAÇÕES	D+15	Não há	4.333.482,13	0,86%	188	0,60%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIAÇÕES	D+23	Não há	8.862.109,31	1,75%	122	1,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	8.476.110,14	1,67%	150	0,65%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.873.152,68	0,76%	488	0,19%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.806.780,33	0,95%	48.530	0,19%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.349.900,97	1,65%	5.643	0,53%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	6.299.324,38	1,24%	6.942	0,38%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			506.335.709,78				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			73.342,90	Artigo 6º			
PL Total			506.409.052,68				

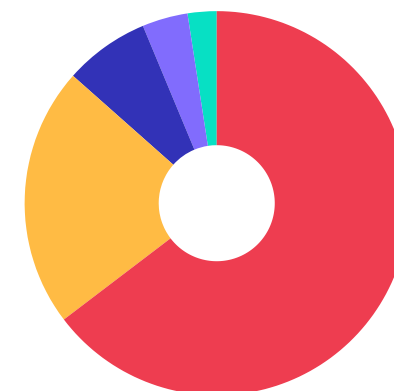
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2023)

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%	151.900.712,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	327.318.362,47	64,64%	35,00%	53,00%	95,00%	153.700.561,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	50.633.570,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	110.872.234,43	21,90%	10,00%	17,00%	60,00%	192.929.191,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	10.126.714,20
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	20,00%	101.267.141,96
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	25.316.785,49
Total Renda Fixa	100,00%	438.190.596,90	86,54%	45,00%	81,00%	222,00%	

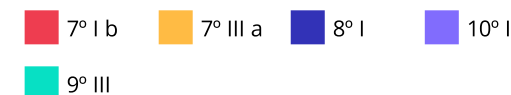


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	36.339.844,38	7,18%	0,00%	10,00%	30,00%	115.560.868,55
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	50.633.570,98
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.456.005,68	3,84%	0,00%	4,00%	10,00%	31.177.565,30
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	25.316.785,49
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	25.316.785,49
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	55.795.850,06	11,02%	0,00%	16,00%	60,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	50.633.570,98
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	12.349.262,82	2,44%	0,00%	2,00%	10,00%	38.284.308,16
Total Exterior	10,00%	12.349.262,82	2,44%	0,00%	3,00%	20,00%	



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'	327.318.362,47	64,64	35,00	95,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	110.872.234,43	21,90	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	36.339.844,38	7,18	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	12.349.262,82	2,44	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	19.456.005,68	3,84	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	267.506.797,92	52,83	-
CAIXA DTVM	230.824.501,86	45,59	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	8.004.410,00	1,58	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)

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%	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%
IMA Geral (Benchmark)	0,98%	9,70%	4,55%	8,94%	14,59%	21,41%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	9,65%	4,52%	8,87%	14,78%	21,19%	0,72%	2,32%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,93%	9,73%	4,58%	8,98%	14,73%	21,19%	0,72%	2,47%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,73%	15,74%	8,42%	17,22%	19,37%	15,53%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	15,32%	8,21%	16,81%	18,84%	14,41%	2,23%	7,98%
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%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,95%	8,01%	2,61%	6,54%	11,10%	21,88%	0,74%	2,34%
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%	2,32%
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
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%	5,20%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,82%	12,21%	5,87%	12,31%	15,19%	18,62%	1,58%	5,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	12,10%	5,78%	12,11%	15,14%	18,55%	1,54%	5,15%

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%	2,46%
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%
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%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,14%	7,58%	3,52%	6,46%	13,70%	25,14%	0,02%	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,14%	7,64%	3,48%	6,47%	13,70%	24,83%	0,03%	0,06%

IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	6,67%	1,99%	5,21%	9,90%	-	0,42%	2,24%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,00%	8,84%	4,42%	7,78%	14,17%	21,28%	0,61%	1,61%
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 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	10,10%	3,35%	8,80%	12,42%	-	1,11%	4,37%

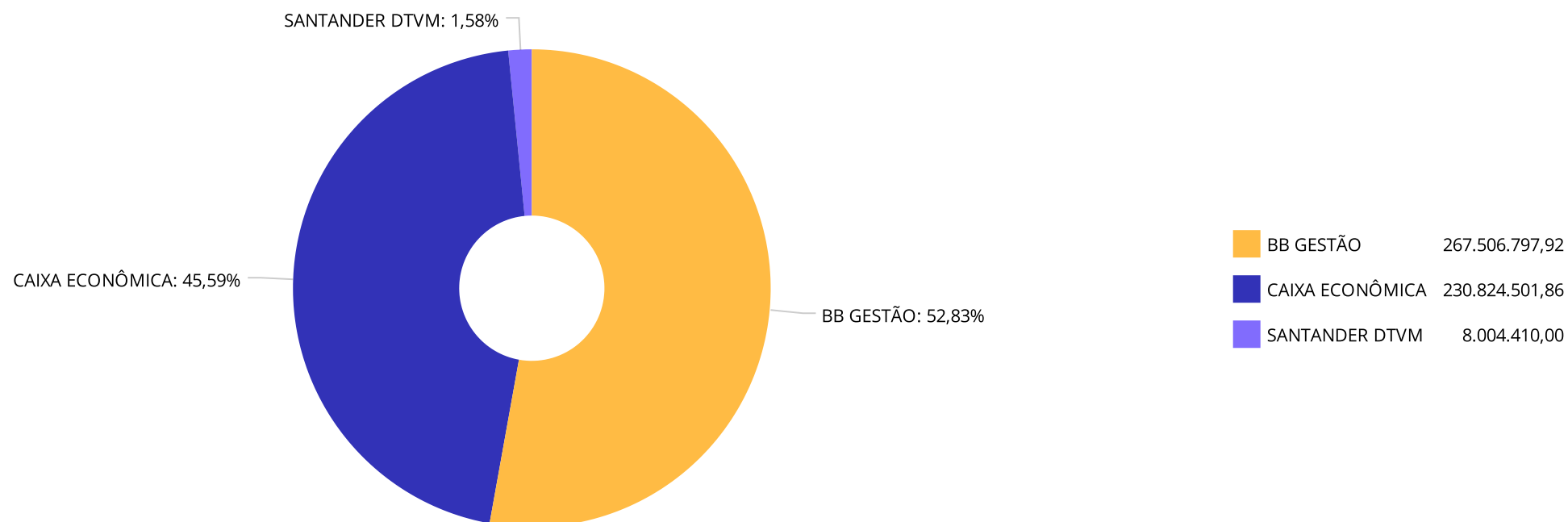
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,11%	19,52%	10,06%	12,57%	11,11%	4,41%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	3,28%	20,19%	10,09%	13,47%	15,98%	14,96%	3,57%	17,76%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,88%	6,14%	2,36%	1,41%	1,33%	-9,61%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,64%	24,55%	12,24%	16,92%	20,80%	22,16%	3,74%	18,83%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	1,90%	15,88%	18,79%	12,17%	18,29%	9,69%	6,37%	19,46%
BB AÇÕES VALOR FICAÇÕES	3,82%	8,04%	15,36%	4,55%	9,45%	-2,72%	7,64%	20,67%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	4,53%	7,41%	14,49%	0,67%	6,36%	-22,27%	7,87%	21,69%
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	3,27%	8,61%	15,99%	3,98%	11,69%	-1,78%	7,98%	20,99%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FICAÇÕES	3,47%	11,12%	16,28%	7,70%	13,56%	-2,35%	7,71%	21,43%
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FICAÇÕES 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%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,99%	6,30%	2,85%	5,18%	10,55%	18,69%	0,87%	1,83%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,48%	8,24%	5,19%	6,95%	14,09%	18,57%	1,54%	4,24%

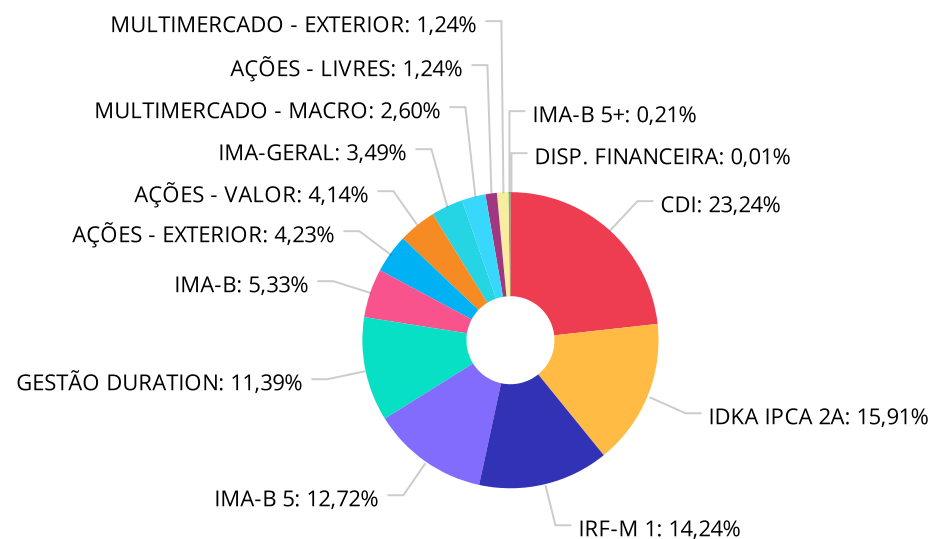
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,20%	10,06%	6,95%	7,93%	4,67%	-3,79%	5,15%	21,523%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES 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)

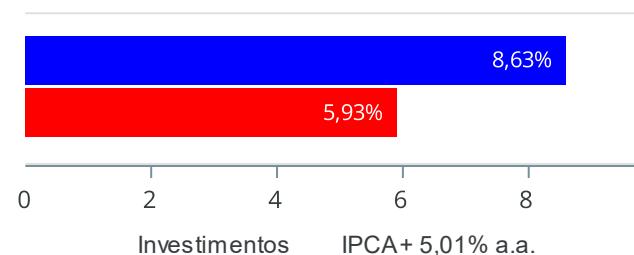


■ CDI	117.691.626,01	■ IDKA IPCA 2A	80.567.367,64	■ IRF-M 1	72.132.135,48	■ IMA-B 5	64.415.038,59
■ GESTÃO DURATION	57.658.146,02	■ IMA-B	27.008.268,57	■ AÇÕES - EXTERIOR	21.435.378,52	■ AÇÕES - VALOR	20.951.456,67
■ IMA-GERAL	17.657.240,27	■ MULTIMERCADO - MACRO	13.156.681,30	■ AÇÕES - LIVRES	6.302.272,01	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.299.324,38
■ IMA-B 5+	1.060.774,32	■ DISP. FINANCEIRA	73.342,90				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

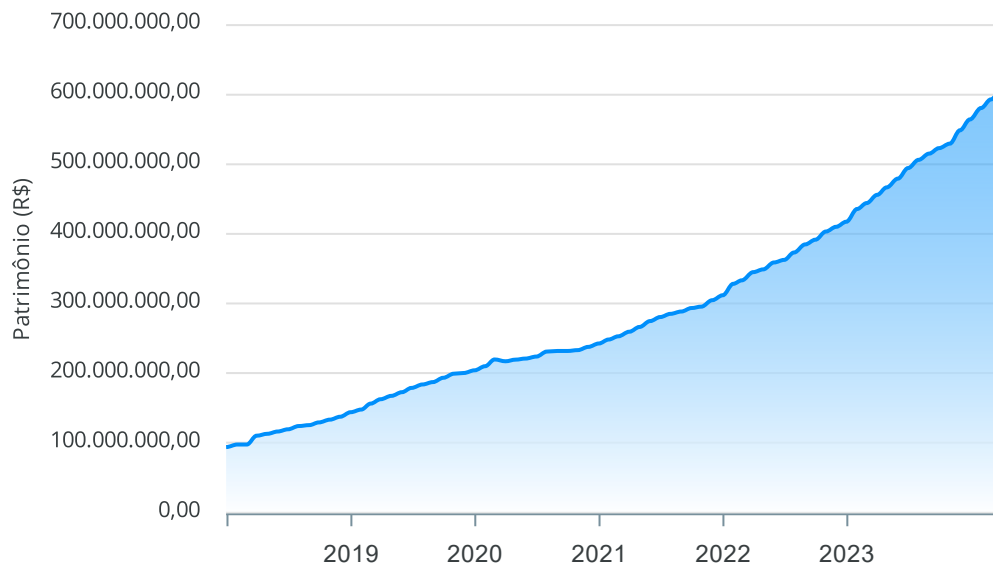
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	411.686.332,84	13.696.873,13	1.717.754,18	429.743.601,00	6.078.149,21	6.078.149,21	1,43%	1,43%	0,96%	0,96%	149,45%	1,76%
Fevereiro	429.743.601,00	8.760.753,37	2.585.380,55	438.097.745,96	2.178.772,14	8.256.921,35	0,50%	1,94%	1,19%	2,16%	89,72%	1,76%
Março	438.097.745,96	8.386.254,91	2.111.452,63	449.764.092,60	5.391.544,36	13.648.465,71	1,21%	3,18%	1,16%	3,35%	94,89%	1,44%
Abril	449.764.092,60	8.440.072,43	2.174.271,28	460.351.725,99	4.321.832,24	17.970.297,95	0,95%	4,16%	0,96%	4,34%	95,69%	1,24%
Maio	460.351.725,99	21.918.818,12	15.410.214,11	472.793.079,50	5.932.749,50	23.903.047,45	1,27%	5,48%	0,66%	5,03%	108,92%	1,21%
Junho	472.793.079,50	8.785.151,22	2.250.818,77	487.769.348,78	8.441.936,83	32.344.984,28	1,76%	7,34%	0,33%	5,38%	136,50%	1,30%
Julho	487.769.348,78	8.817.716,56	3.088.168,28	499.462.532,61	5.963.635,55	38.308.619,83	1,21%	8,63%	0,53%	5,93%	145,55%	1,13%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

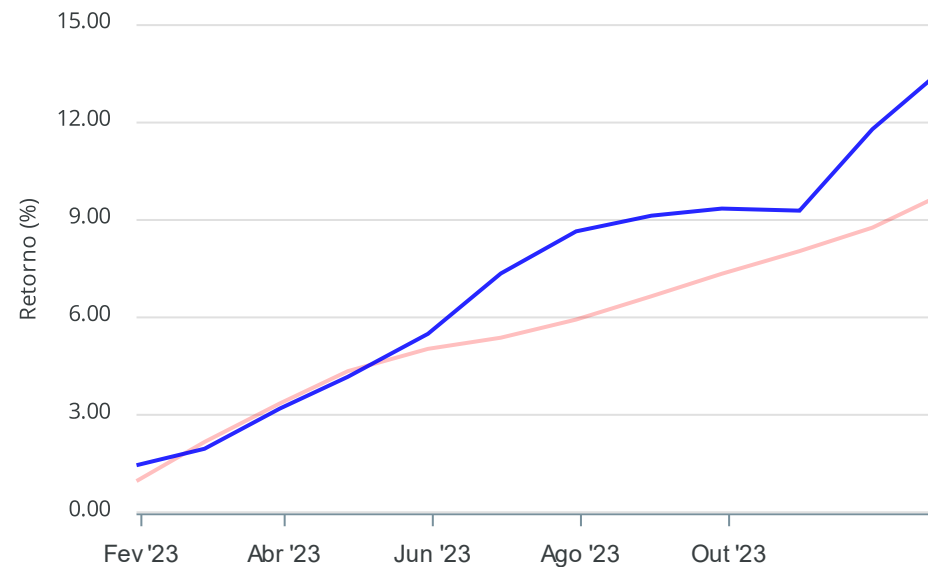
Evolução do Patrimônio



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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	31.620.955,84	0,00	30.000,00	31.951.577,15	360.621,31	1,14%	1,14%	0,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	7.914.590,70	0,00	0,00	8.004.410,00	89.819,30	1,13%	1,13%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	27.424.808,38	0,00	0,00	27.718.620,61	293.812,23	1,07%	1,07%	0,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.252.624,53	0,00	0,00	9.350.454,96	97.830,43	1,06%	1,06%	0,42%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.218.207,30	0,00	0,00	9.315.673,33	97.466,03	1,06%	1,06%	0,42%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	43.876.851,43	108.000,00	36.000,00	44.413.514,87	464.663,44	1,06%	1,06%	0,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	61.500.614,48	0,00	3.058.168,28	59.069.510,57	627.064,37	1,02%	1,06%	0,01%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.333.466,52	0,00	0,00	10.436.322,85	102.856,33	1,00%	1,00%	0,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	24.062.185,46	0,00	0,00	24.291.159,76	228.974,30	0,95%	0,95%	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	25.485.710,73	0,00	0,00	25.727.861,34	242.150,61	0,95%	0,95%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	32.818.498,45	0,00	0,00	33.128.076,27	309.577,82	0,94%	0,94%	0,66%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	7.456.979,02	0,00	0,00	7.525.976,20	68.997,18	0,93%	0,93%	0,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	47.008.607,58	0,00	0,00	47.439.291,37	430.683,79	0,92%	0,92%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	24.701.192,65	0,00	0,00	24.921.785,23	220.592,58	0,89%	0,89%	1,04%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.398.892,93	0,00	0,00	1.410.413,86	11.520,93	0,82%	0,82%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	10.846.520,18	0,00	0,00	10.935.344,11	88.823,93	0,82%	0,82%	1,11%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.432.577,52	0,00	0,00	3.460.673,38	28.095,86	0,82%	0,82%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.498.136,77	0,00	0,00	9.574.264,33	76.127,56	0,80%	0,80%	1,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	22.126.001,51	0,00	0,00	22.300.037,94	174.036,43	0,79%	0,79%	0,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.053.006,71	0,00	0,00	1.060.774,32	7.767,61	0,74%	0,74%	2,23%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.906.942,30	0,00	0,00	16.023.590,38	116.648,08	0,73%	0,73%	1,54%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	1.263.122,18	8.817.716,56	0,00	10.131.264,07	50.425,33	0,50%	0,92%	0,72%
Total Renda Fixa	428.200.493,17	8.925.716,56	3.124.168,28	438.190.596,90	4.188.555,45	0,97%		0,52%

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 RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.614.901,41	0,00	0,00	1.688.078,63	73.177,22	4,53%	4,53%	7,87%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	11.644.031,43	0,00	0,00	12.089.347,36	445.315,93	3,82%	3,82%	7,64%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.078.068,10	0,00	0,00	6.299.324,38	221.256,28	3,64%	3,64%	3,74%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8.564.910,90	0,00	0,00	8.862.109,31	297.198,41	3,47%	3,47%	7,71%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	8.797.205,15	0,00	0,00	9.086.115,70	288.910,55	3,28%	3,28%	3,57%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	271.813,05	0,00	0,00	280.711,25	8.898,20	3,27%	3,27%	7,98%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.252.741,88	0,00	0,00	4.333.482,13	80.740,25	1,90%	1,90%	6,37%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.228.374,65	0,00	0,00	8.349.900,97	121.526,32	1,48%	1,48%	1,54%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.759.735,59	0,00	0,00	4.806.780,33	47.044,74	0,99%	0,99%	0,87%
Total Renda Variável	54.211.782,16	0,00	0,00	55.795.850,06	1.584.067,90	2,92%		4,96%

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 INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL ...	8.293.476,95	0,00	0,00	8.476.110,14	182.633,19	2,20%	2,20%	5,15%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3.792.903,31	0,00	0,00	3.873.152,68	80.249,37	2,12%	2,12%	5,49%
Total Exterior	12.086.380,26	0,00	0,00	12.349.262,82	262.882,56	2,18%		5,26%

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.

