

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023



Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

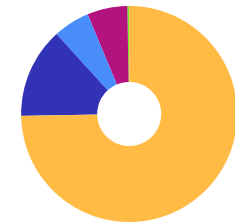
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			549.506.801,07	70,50%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.881.454,32	1,65%	925	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.218.082,18	0,16%	741	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	14.629.441,41	1,88%	998	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	786.536,07	0,10%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.599.945,95	0,33%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	D+1260	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	801.414,72	0,10%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	22.715.033,92	2,91%	20.881	1,61%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.162.445,52	0,41%	188	0,44%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	21.458.278,59	2,75%	16.614	1,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	11.651.635,50	1,49%	81	2,69%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	15.077.251,57	1,93%	1.222	1,16%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	18.117.710,14	2,32%	2.007	5,44%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	12.920.993,56	1,66%	3.606	13,05%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	9.027.757,68	1,16%	2.871	3,67%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	9.598.973,33	1,23%	8.693	1,45%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	12.891.997,42	1,65%	4.738	2,04%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	10.932.118,15	1,40%	488	0,53%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	18.910.335,48	2,43%	6.942	1,14%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	19.944.348,83	2,56%	645	1,71%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.199.618,38	0,28%	3.945	1,07%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	747.814,24	0,10%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	757.787,48	0,10%	22	0,56%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	4.286.515,52	0,55%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.189.928,85	0,28%		1,55%	Artigo 11º
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	434.904,22	0,06%		0,00%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			779.449.124,11				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	549.506.801,07	70,50%	30,00%	60,00%	80,00%	74.052.498,22
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	14.099.536,50	1,81%	0,00%	8,00%	60,00%	453.569.937,97
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.972.456,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	15.415.977,48	1,98%	0,00%	4,00%	30,00%	218.418.759,75
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	77.944.912,41
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	77.944.912,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	3.401.360,68	0,44%	0,00%	1,00%	5,00%	35.571.095,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.972.456,21
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.972.456,21
Total Renda Fixa	100,00%	582.423.675,73	74,72%	30,00%	73,00%	210,00%	

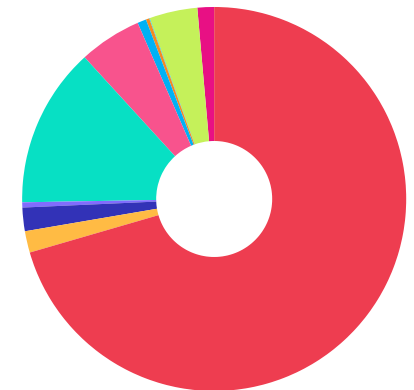


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

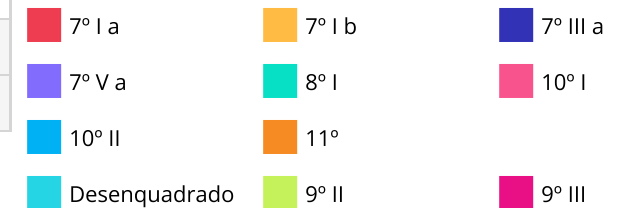


Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	105.103.348,80	13,48%	5,00%	15,00%	40,00%	206.676.300,84
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	77.944.912,41
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	41.054.302,69	5,27%	0,00%	5,00%	10,00%	36.890.609,72
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	5.792.117,24	0,74%	0,00%	1,00%	5,00%	33.180.338,97
Artigo 11º	10,00%	2.189.928,85	0,28%	0,00%	0,50%	5,00%	36.782.527,36
Desenquadrado - RV	0,00%	434.904,22	0,06%	0,00%	0,00%	0,00%	-434.904,22
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	154.574.601,80	19,83%	5,00%	21,50%	70,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	31.518.728,43	4,04%	0,00%	4,00%	10,00%	46.426.183,98
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	10.932.118,15	1,40%	0,00%	1,50%	5,00%	28.040.338,06
Total Exterior	10,00%	42.450.846,58	5,45%	0,00%	5,50%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	549.506.801,07	70,50	-
CAIXA DTVM	61.733.877,06	7,92	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	22.715.033,92	2,91	-
ITAÚ DTVM	21.458.278,59	2,75	0,00
ITAÚ UNIBANCO	19.944.348,83	2,56	0,00
XP ASSET MANAGEMENT	18.626.731,01	2,39	-
SOMMA INVESTIMENTOS	18.117.710,14	2,32	-
NAVI CAPITAL	15.077.251,57	1,93	0,99
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	12.920.993,56	1,66	0,03
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	12.891.997,42	1,65	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	11.651.635,50	1,49	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	6.377.825,59	0,82	8,38
KPTL	4.286.515,52	0,55	13,20
SICREDI	2.199.618,38	0,28	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.505.601,72	0,19	-
CADENCE GESTORA	434.904,22	0,06	-
GENIAL GESTÃO LTDA	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 '	549.506.801,07	70,50	30,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	14.099.536,50	1,81	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	15.415.977,48	1,98	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	3.401.360,68	0,44	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	105.103.348,80	13,48	5,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	31.518.728,43	4,04	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	10.932.118,15	1,40	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	41.054.302,69	5,27	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	5.792.117,24	0,74	0,00	5,00
Artigo 11º	2.189.928,85	0,28	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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
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%	0,02%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,31%	-1,36%	-0,98%	-1,80%	-0,90%	3,04%	0,06%	0,01%
120% do CDI (Benchmark)	1,29%	9,24%	3,97%	7,77%	16,50%	29,73%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-0,45%	-1,18%	-0,20%	-0,82%	13,40%	-1.186.890.000.100,00%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
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%
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,47%	3,24%	1,44%	3,16%	5,70%	5,29%	0,25%	0,01%
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%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,14%	7,64%	3,48%	6,47%	13,70%	24,83%	0,03%	0,00%

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,96%	9,08%	2,80%	7,70%	14,91%	39,76%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,00%	-0,87%	-0,30%	-0,71%	-8,41%	-10,01%	-	-
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,11%	19,52%	10,06%	12,57%	11,11%	4,41%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,69%	24,83%	12,35%	17,14%	21,31%	22,84%	3,75%	0,19%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3,64%	24,44%	12,13%	16,86%	20,80%	22,13%	3,74%	0,19%
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%	0,19%
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,43%	8,33%	19,68%	6,26%	14,78%	3,64%	8,36%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4,56%	8,65%	18,56%	4,23%	3,94%	-25,26%	7,55%	0,23%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3,27%	8,61%	15,99%	3,98%	11,69%	-1,78%	7,98%	0,21%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2,65%	4,56%	14,71%	0,82%	10,36%	-11,29%	7,68%	0,21%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	3,19%	10,26%	16,92%	7,19%	16,54%	-16,60%	7,68%	0,21%

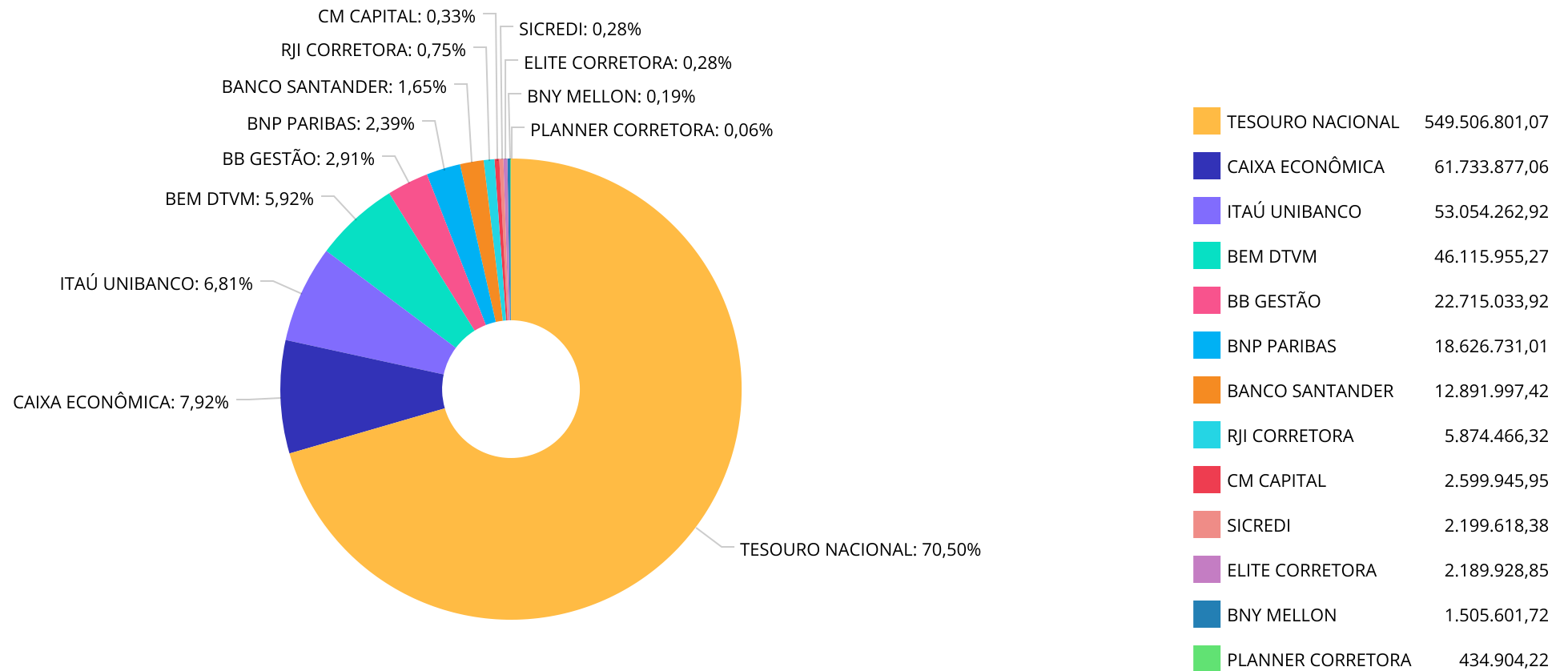
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,90%	15,88%	18,79%	12,17%	18,29%	9,69%	6,37%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,61%	1,00%	8,70%	-1,38%	9,73%	-10,65%	7,35%	0,19%
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%	0,23%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,84%	8,23%	2,45%	6,96%	13,35%	35,99%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,03%	-0,22%	-0,10%	-0,19%	-0,38%	-1,03%	-	-

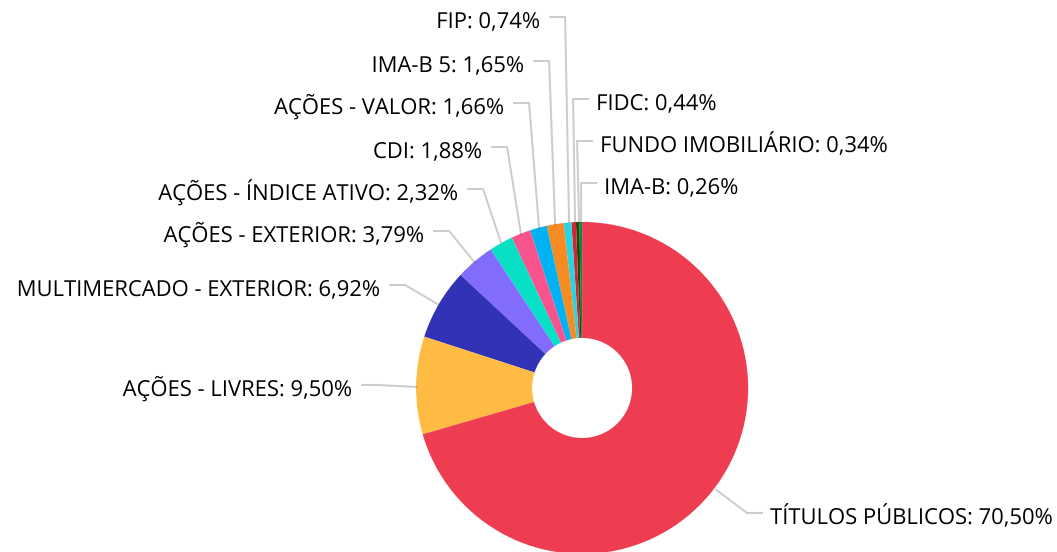
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	23,133%
MSCI WORLD (Benchmark)	1,62%	6,99%	2,45%	2,31%	1,97%	-7,57%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1,78%	2,82%	2,03%	0,88%	2,22%	-16,22%	4,18%	19,057%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3,57%	26,07%	11,27%	13,57%	16,70%	-28,42%	7,80%	31,725%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,88%	6,14%	2,36%	1,41%	1,33%	-9,61%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	6,12%	31,63%	17,33%	17,55%	14,28%	-14,93%	7,19%	24,551%

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



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



TÍTULOS PÚBLICOS	549.506.801,07	AÇÕES - LIVRES	74.064.645,10	MULTIMERCADO - EXTERIOR	53.946.300,11	AÇÕES - EXTERIOR	29.558.849,16
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	18.117.710,14	CDI	14.629.441,41	AÇÕES - VALOR	12.920.993,56	IMA-B 5	12.881.454,32
FIP	5.792.117,24	FIDC	3.401.360,68	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.624.833,07	IMA-B	2.004.618,25

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	13.717	4.009,617406	4.268,395058	54.999.921,96	58.549.575,01	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/10/2022	1.592	4080,866490	4.333,892605	6.496.739,45	6.899.557,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	09/11/2022	1.600	4060,354006	4.282,973451	6.496.566,41	6.852.757,52	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	02/12/2022	1.724	4.059,444003	4.245,539208	6.998.481,46	7.319.309,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	29/12/2022	3.200	4.062,499278	4.219,26674	12.999.997,69	13.501.653,56	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	24/05/2022	10.309	4.151,368820	4.361,180155	42.796.461,17	44.959.406,21	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	01/06/2022	1.942	4119,013540	4.317,721441	7.999.124,29	8.385.015,03	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	18/08/2022	2.161	4.003,343810	4.304,397458	8.651.225,97	9.301.802,90	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	23/08/2022	3.607	4.003,343810	4.281,145478	14.440.061,12	15.442.091,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	28/10/2021	1.449	3977,478261	4.538,976307	5.763.366,00	6.576.976,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	30/11/2021	1.387	4169,633376	4.538,976307	5.783.281,49	6.295.560,14	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/11/2021	303	4.128,989331	4.538,976307	1.251.083,77	1.375.309,82	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/12/2021	1.452	4200,155373	4.538,976307	6.098.625,60	6.590.593,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	13.639	4.193,558503	4.408,620797	57.195.944,42	60.129.179,05	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/07/2022	2.940	4081,521882	4.234,001934	11.999.674,33	12.447.965,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/08/2022	803	4.010,486989	4.326,865432	3.220.421,05	3.474.472,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/03/2023	7.730	3.880,60527900	4.054,373683	29.997.078,81	31.340.308,56	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2023	5.532	3.886,16363200	4.054,691412	21.498.257,21	22.430.552,89	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	27/03/2023	13.187	4.011,33	4.145,900244	52.897.408,71	54.671.986,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2023	5.530	3.887,58634400	4.051,377954	21.498.352,48	22.404.120,08	Curva

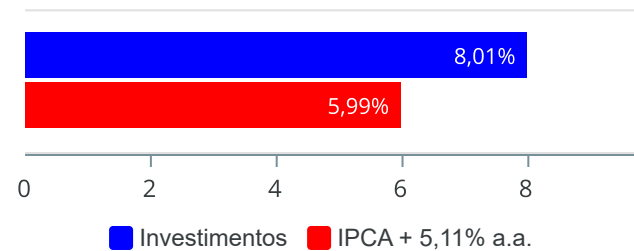
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	28/10/2021	1.449	3977,478261	4.538,976307	5.763.366,00	6.576.976,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	30/11/2021	1.387	4169,633376	4.538,976307	5.783.281,49	6.295.560,14	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/11/2021	303	4.128,989331	4.538,976307	1.251.083,77	1.375.309,82	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	28/11/2022	428	3886,763534	4.075,186991	1.663.534,79	1.744.180,03	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	01/02/2023	1.766	3.849,911563	3.947,431081	6.798.943,82	6.971.163,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	7.752	3.869,91365700	3.920,044499	29.999.570,67	30.388.184,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	11/05/2023	1.735	4.263,612425	4.208,670274	7.397.367,56	7.302.042,92	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	10/07/2023	11.310	4.472,934683	4.488,457409	50.588.891,26	50.764.453,29	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	04/07/2023	1.618	4.511,125907	4.529,687894	7.299.001,72	7.329.035,01	Curva

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	671.383.822,37	8.458.835,49	668.824,98	691.351.415,74	12.177.582,86	12.177.582,86	1,79%	1,79%	0,97%	0,97%	185,16%	6,78%
Fevereiro	691.351.415,74	26.072.745,92	17.430.082,46	692.616.110,99	-7.377.968,21	4.799.614,65	-1,05%	0,72%	1,20%	2,18%	33,04%	5,69%
Março	692.616.110,99	213.834.015,77	212.822.035,70	698.789.161,84	5.161.070,78	9.960.685,43	0,74%	1,47%	1,17%	3,37%	43,55%	7,15%
Abril	698.789.161,84	37.424.640,43	24.761.833,48	720.229.823,99	8.777.855,20	18.738.540,63	1,23%	2,72%	0,97%	4,38%	62,20%	6,62%
Maio	720.229.823,99	33.529.164,17	26.886.338,91	740.283.589,20	13.410.939,95	32.149.480,58	1,85%	4,62%	0,67%	5,07%	91,02%	6,40%
Junho	740.283.589,20	21.660.213,55	10.942.037,53	767.076.743,31	16.074.978,09	48.224.458,67	2,14%	6,86%	0,34%	5,42%	126,38%	5,78%
Julho	767.076.743,31	68.387.691,98	64.323.654,23	779.449.124,11	8.308.343,05	56.532.801,72	1,08%	8,01%	0,54%	5,99%	133,66%	5,51%

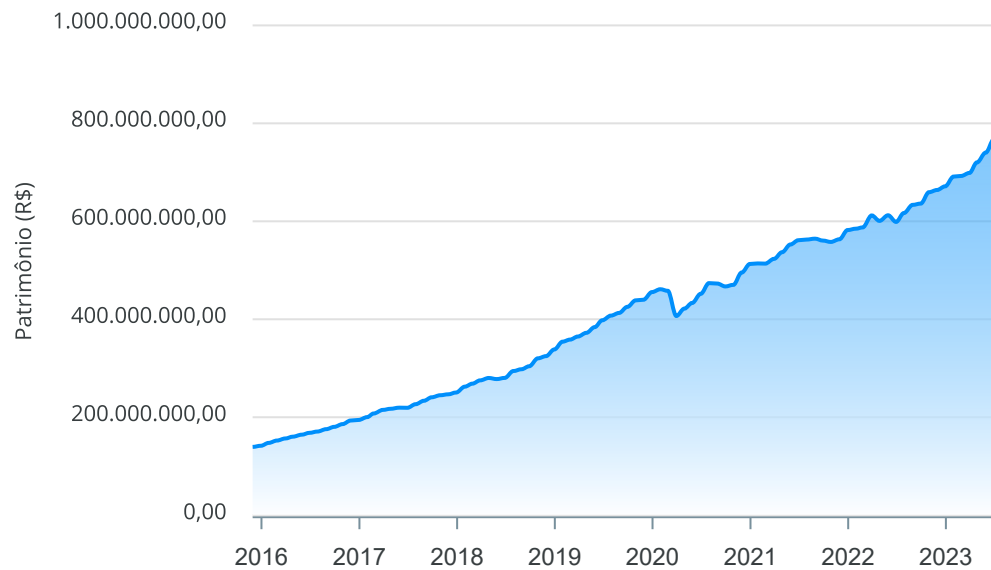
Investimentos x Meta de Rentabilidade



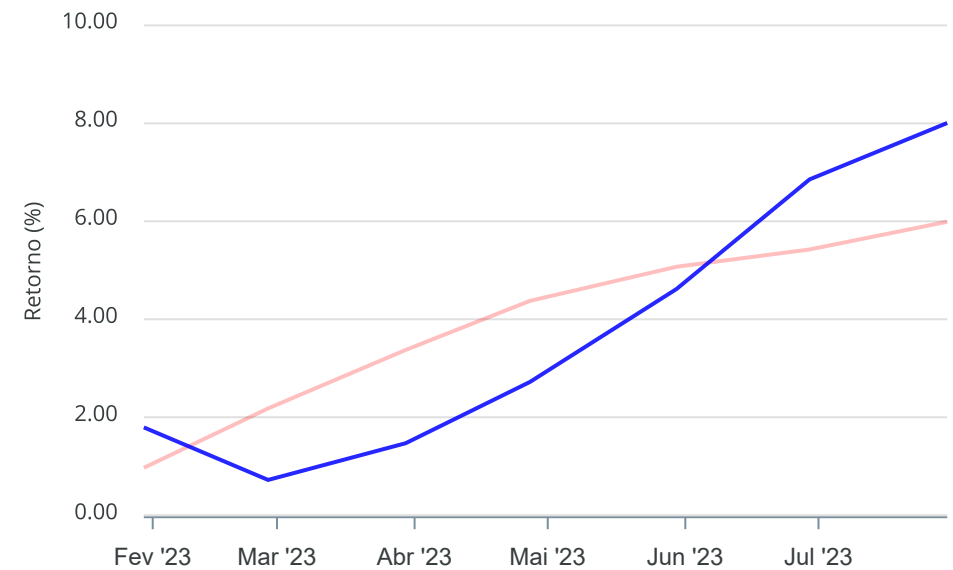
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- ☒ Investimentos
 ☒ Meta de Rentabilidade
 ☐ CDI
 ☐ IMA-B
- ☐ IMA-B 5
 ☐ IMA-B 5+
 ☐ IMA Geral
 ☐ IRF-M
 ☐ IRF-M 1
- ☐ IRF-M 1+
 ☐ Ibovespa
 ☐ IBX
 ☐ SMLL
 ☐ IDIV
- ☒ Investimentos
 ☒ Meta de Rentabilidade
 ☐ CDI
 ☐ IMA-B
- ☐ IMA-B 5
- ☐ IMA-B 5+
 ☐ IMA Geral
 ☐ IRF-M
 ☐ IRF-M 1
 ☐ IRF-M 1+
- ☐ Ibovespa
 ☐ IBX
 ☐ SMLL
 ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.760.030,64	0,00	0,00	12.881.454,32	121.423,68	0,95%	0,95%	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.208.396,89	0,00	0,00	1.218.082,18	9.685,29	0,80%	0,80%	1,55%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	782.879,13	0,00	0,00	786.536,07	3.656,94	0,47%	0,47%	0,25%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.751.482,88	10.499.799,00	13.732.337,96	14.629.441,41	110.497,49	0,39%	1,14%	0,03%
TÍTULOS PÚBLICOS	540.082.065,57	57.887.892,98	50.591.316,27	549.506.801,07	2.128.158,79	0,36%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.599.586,19	0,00	0,00	2.599.945,95	359,76	0,01%	0,01%	0,39%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	803.939,19	0,00	0,00	801.414,72	-2.524,47	-0,31%	-0,31%	0,06%
Total Renda Fixa	575.988.380,50	68.387.691,98	64.323.654,23	582.423.675,73	2.371.257,48	0,41%		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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.143.094,73	0,00	0,00	11.651.635,50	508.540,77	4,56%	4,56%	7,55%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.121.302,33	0,00	0,00	2.199.618,38	78.316,05	3,69%	3,69%	3,75%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18.246.132,45	0,00	0,00	18.910.335,48	664.203,03	3,64%	3,64%	3,74%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	19.244.323,31	0,00	0,00	19.944.348,83	700.025,52	3,64%	3,64%	3,74%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.576.786,10	0,00	0,00	15.077.251,57	500.465,47	3,43%	3,43%	8,36%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	21.994.995,44	0,00	0,00	22.715.033,92	720.038,48	3,27%	3,27%	7,98%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	12.521.137,25	0,00	0,00	12.920.993,56	399.856,31	3,19%	3,19%	7,68%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	17.650.926,77	0,00	0,00	18.117.710,14	466.783,37	2,64%	2,64%	7,68%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	20.911.920,70	0,00	0,00	21.458.278,59	546.357,89	2,61%	2,61%	7,35%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.103.523,70	0,00	0,00	3.162.445,52	58.921,82	1,90%	1,90%	6,37%
OSASCO PROPERTIES FII	435.006,84	0,00	0,00	434.904,22	-102,62	-0,02%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	758.026,25	0,00	0,00	757.787,48	-238,77	-0,03%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	748.234,89	0,00	0,00	747.814,24	-420,65	-0,06%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.192.379,22	0,00	0,00	2.189.928,85	-2.450,37	-0,11%	0,00%	0,00%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.292.795,26	0,00	0,00	4.286.515,52	-6.279,74	-0,15%	-	-
Total Renda Variável	149.940.585,24	0,00	0,00	154.574.601,80	4.634.016,56	3,09%		6,51%

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
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	8.507.122,63	0,00	0,00	9.027.757,68	520.635,05	6,12%	6,12%	7,19%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	9.268.062,54	0,00	0,00	9.598.973,33	330.910,79	3,57%	3,57%	7,80%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	10.705.611,28	0,00	0,00	10.932.118,15	226.506,87	2,12%	2,12%	5,49%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	12.666.981,12	0,00	0,00	12.891.997,42	225.016,30	1,78%	1,78%	4,18%
Total Exterior	41.147.777,57	0,00	0,00	42.450.846,58	1.303.069,01	3,17%		5,98%

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 dá outras providências.

