

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

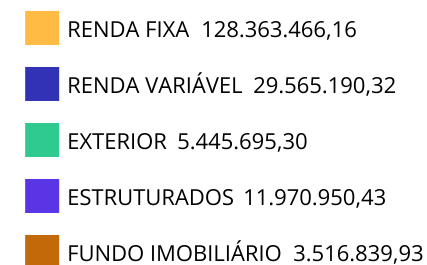
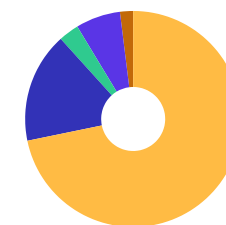
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	4.431.614,17	2,48%	675	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.048.528,66	2,82%	552	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	2.122.297,87	1,19%	191	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	2.186.688,86	1,22%	120	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	2.707.415,66	1,51%	34	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.634.121,49	6,50%	777	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	11.992.370,11	6,70%	892	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.397.795,61	9,17%	925	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.745.635,89	4,33%	741	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.147.545,03	3,44%	381	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.324.180,55	3,54%	74	1,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	5.491.473,42	3,07%	208	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	33.187.965,93	18,56%	377	0,63%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	6.107.567,37	3,41%	235	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	526.392,90	0,29%	607	4,73%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	6.311.872,64	3,53%	784	2,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.513.636,39	1,96%	478	1,52%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.212.139,43	0,68%	3.656	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	11.800.034,49	6,60%	2.744	0,86%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	Não há	1.630.672,47	0,91%	51	7,77%	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
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	1.753.766,30	0,98%	57	2,54%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	9.654.941,24	5,40%	2.007	2,90%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.885.402,50	2,17%	11.374	0,59%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	903.450,42	0,51%	17.282	0,19%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	656.842,38	0,37%	3.723	0,38%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	5.322.327,95	2,98%	183	1,61%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.038.612,58	1,14%	6.942	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.746.358,02	0,98%	645	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.863.651,88	1,60%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.050.484,98	0,59%		0,73%	Artigo 11º
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	641.934,20	0,36%		0,22%	Artigo 11º
MACAM SHOPPING FII	Não se ...	Não se aplica	1.824.420,75	1,02%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			178.862.142,14				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			192.703,93				Artigo 6º
PL Total			179.054.846,07				

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

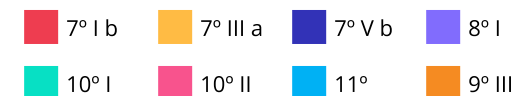
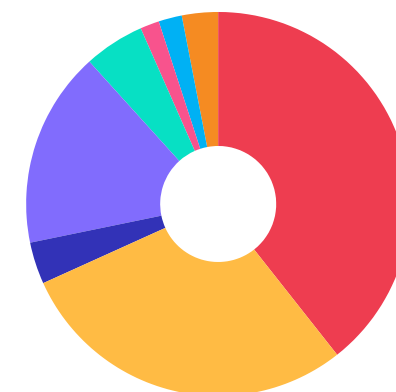
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	14,00%	81,95%	146.577.525,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	70.414.013,35	39,37%	19,09%	28,35%	81,95%	76.163.512,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	51.637.580,17	28,87%	20,86%	23,50%	60,00%	55.679.705,11
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	35.772.428,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	6.311.872,64	3,53%	0,00%	5,00%	5,00%	2.631.234,47
Total Renda Fixa	100,00%	128.363.466,16	71,77%	39,95%	70,85%	248,90%	



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%	29.565.190,32	16,53%	14,00%	19,60%	25,00%	15.150.345,22
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	9.107.298,55	5,09%	1,60%	2,70%	10,00%	8.778.915,66
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	2.863.651,88	1,60%	1,00%	2,35%	5,00%	6.079.455,23
Artigo 11º	5,00%	3.516.839,93	1,97%	1,00%	1,50%	5,00%	5.426.267,18
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	45.052.980,68	25,19%	17,60%	26,15%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.445.695,30	3,04%	2,00%	3,00%	10,00%	12.440.518,91
Total Exterior	10,00%	5.445.695,30	3,04%	2,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	58.663.496,37	32,80	-
ITAÚ UNIBANCO	35.591.166,33	19,90	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.900.310,43	13,36	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	17.923.221,34	10,02	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	15.966.813,88	8,93	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	11.800.034,49	6,60	0,58
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	3.513.636,39	1,96	0,12
KPTL	2.863.651,88	1,60	8,82
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	1.824.420,75	1,02	-
MOS CAPITAL	1.753.766,30	0,98	-
MULTINVEST CAPITAL	1.630.672,47	0,91	0,09
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.212.139,43	0,68	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.050.484,98	0,59	-
ZION INVEST	641.934,20	0,36	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	526.392,90	0,29	-

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	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	70.414.013,35	39,37	19,09	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	51.637.580,17	28,87	20,86	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	6.311.872,64	3,53	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	29.565.190,32	16,53	19,00	25,00
Artigo 9º, Inciso III	5.445.695,30	3,04	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	9.107.298,55	5,09	1,60	3,00
Artigo 10º, Inciso II	2.863.651,88	1,60	2,00	4,50
Artigo 11º	3.516.839,93	1,97	1,00	2,50

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%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,72%	6,62%	1,85%	5,60%	10,35%	28,75%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,51%	3,81%	2,10%	2,56%	3,65%	15,34%	0,03%	0,04%
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%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,76%	12,59%	6,21%	12,66%	14,67%	17,71%	1,75%	0,06%
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%	-	-
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%
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%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,15%	7,68%	3,52%	6,48%	13,85%	25,59%	0,02%	0,00%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,31%	5,01%	3,84%	4,91%	11,59%	23,51%	0,17%	0,01%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,99%	8,16%	3,83%	7,05%	13,23%	26,01%	0,43%	0,01%
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%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	-8,39%	-88,42%	-89,25%	-88,63%	-87,38%	-85,14%	13,60%	0,88%

IPCA (Benchmark)	0,23%	3,11%	0,38%	2,56%	4,11%	14,59%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,90%	11,27%	5,57%	10,71%	13,06%	23,97%	1,15%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	10,10%	3,35%	8,80%	12,42%	-	1,11%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	12,57%	5,83%	12,25%	15,21%	-	1,57%	0,06%
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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,07%	9,21%	2,92%	7,81%	15,04%	39,92%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	3,12%	16,80%	26,65%	13,48%	17,47%	-20,79%	-	-
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	3,49%	14,62%	23,41%	8,79%	14,31%	-14,83%	8,02%	0,25%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,11%	19,52%	10,06%	12,57%	11,11%	4,41%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	3,64%	24,44%	12,13%	16,86%	20,80%	22,13%	3,74%	0,19%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,71%	8,12%	4,44%	4,01%	0,56%	-7,12%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	9,42%	6,67%	7,40%	3,63%	-5,70%	5,15%	0,22%
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%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-3,40%	-29,43%	5,29%	-21,65%	-56,65%	158,44%	8,52%	0,34%
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-

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

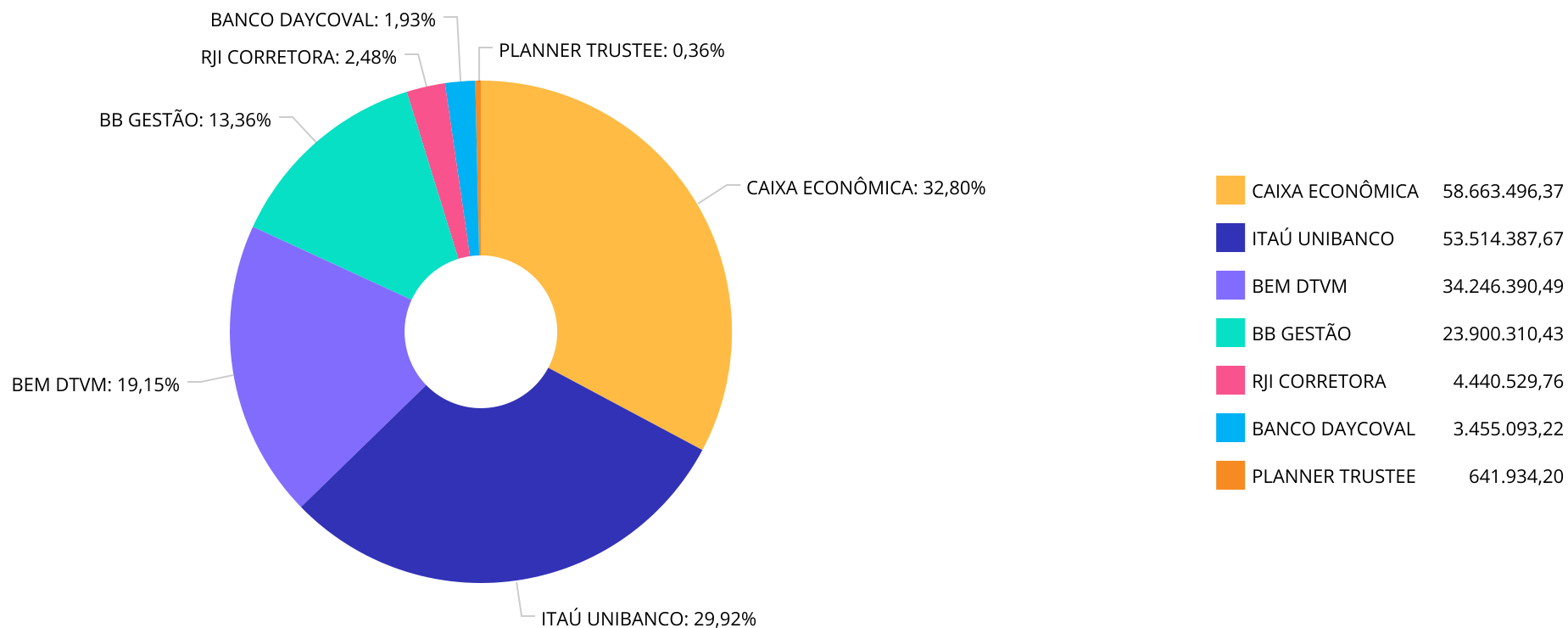
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,97%	13,88%	14,30%	9,56%	17,55%	10,05%	5,40%	0,18%
QLZ MOS FI AÇÕES	-	-	-	-	-	-	7,88%	-
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2,65%	4,56%	14,71%	0,82%	10,36%	-11,29%	7,68%	0,21%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4,71%	10,76%	17,46%	6,76%	14,00%	-9,91%	9,32%	0,19%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,45%	13,46%	16,34%	9,27%	13,40%	2,04%	6,37%	0,19%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,01%	7,64%	3,27%	6,40%	13,65%	22,93%	0,44%	0,01%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,88%	7,78%	2,33%	6,59%	12,44%	33,66%	-	-
MACAM SHOPPING FII	-	-	-	-	-	-	-	-



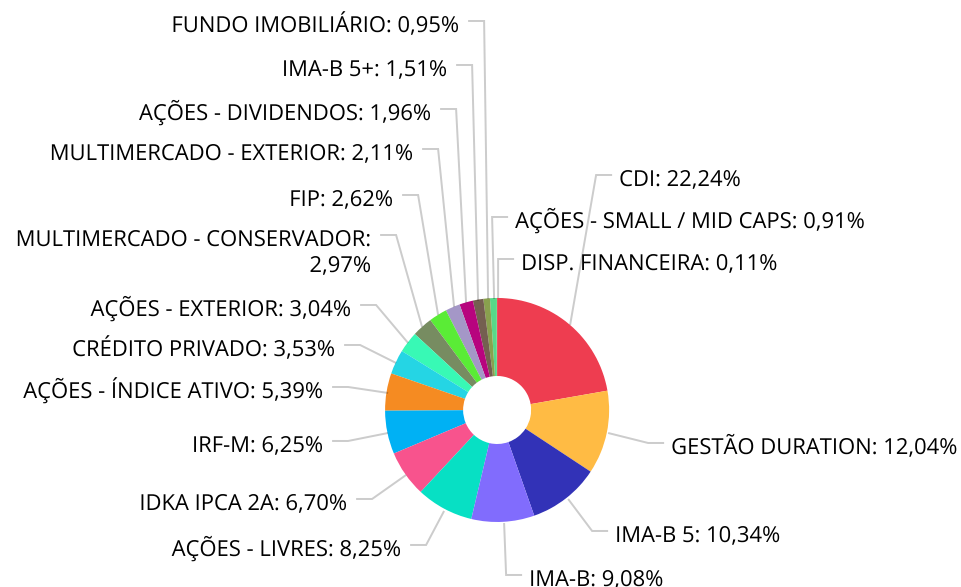
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,71%	8,12%	4,44%	4,01%	0,56%	-7,12%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	9,42%	6,67%	7,40%	3,63%	-5,70%	5,15%	21,524%
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	1,90%	1,74%	2,50%	1,58%	-1,05%	-1,08%	4,45%	20,064%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES 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)

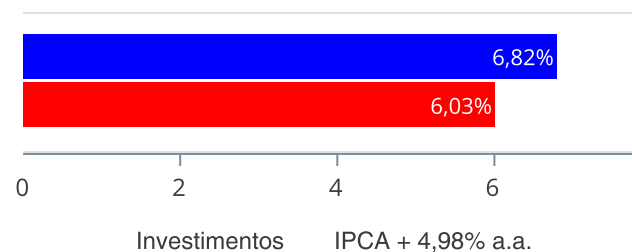


CDI	39.821.926,20	GESTÃO DURATION	21.557.209,08	IMA-B 5	18.520.093,48
IMA-B	16.256.505,30	AÇÕES - LIVRES	14.765.940,22	IDKA IPCA 2A	11.992.370,11
IRF-M	11.196.073,69	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	9.654.941,24	CRÉDITO PRIVADO	6.311.872,64
AÇÕES - EXTERIOR	5.445.695,30	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.322.327,95	FIP	4.688.072,63
MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.784.970,60	AÇÕES - DIVIDENDOS	3.513.636,39	IMA-B 5+	2.707.415,66
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.692.419,18	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.630.672,47	DISP. FINANCEIRA	192.703,93

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	163.444.886,17	12.606.458,22	11.034.186,59	168.444.557,99	3.427.400,19	3.427.400,19	2,08%	2,08%	0,96%	0,96%	216,93%	2,80%
Fevereiro	168.444.557,99	11.553.393,00	10.882.600,77	168.106.417,11	-1.008.933,11	2.418.467,08	-0,60%	1,47%	1,19%	2,16%	67,98%	2,60%
Março	168.106.417,11	2.321.975,87	758.254,23	170.806.544,04	1.136.405,29	3.554.872,37	0,67%	2,15%	1,16%	3,34%	64,26%	2,36%
Abril	170.806.544,04	1.214.844,06	766.434,57	173.074.494,61	1.819.541,08	5.374.413,45	1,06%	3,23%	0,96%	4,33%	74,59%	2,18%
Mai	173.074.494,61	1.817.837,95	1.467.213,38	172.930.545,85	-494.573,33	4.879.840,12	-0,29%	2,94%	0,66%	5,02%	58,55%	2,65%
Junho	172.930.545,85	5.662.425,54	5.784.453,32	177.258.107,92	4.449.589,85	9.329.429,97	2,57%	5,59%	0,33%	5,36%	104,23%	2,42%
Julho	177.258.107,92	15.176.553,81	15.636.196,14	178.862.142,14	2.063.676,55	11.393.106,52	1,16%	6,82%	0,64%	6,03%	113,00%	2,01%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



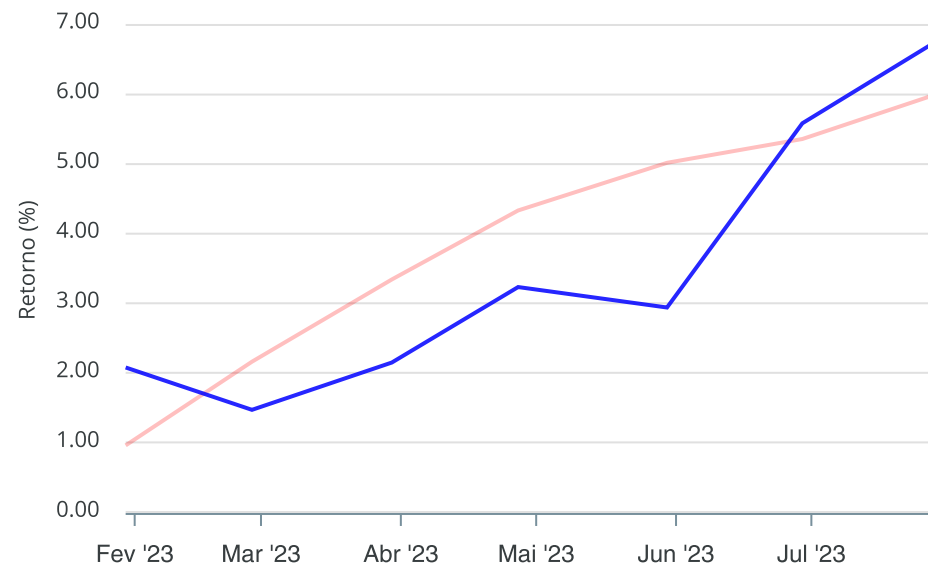
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	6.230.067,61	0,00	0,00	6.311.872,64	81.805,03	1,31%	1,31%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.603.445,42	3.441.581,79	1.208.106,98	33.187.965,93	351.045,70	1,03%	1,15%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	6.047.883,43	0,00	0,00	6.107.567,37	59.683,94	0,99%	0,99%	0,43%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.048.528,66	48.528,66	0,97%	0,78%	1,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.243.226,07	0,00	0,00	16.397.795,61	154.569,54	0,95%	0,95%	0,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.883.495,81	0,00	0,00	11.992.370,11	108.874,30	0,92%	0,92%	0,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.442.594,15	0,00	0,00	5.491.473,42	48.879,27	0,90%	0,90%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.105.059,20	0,00	0,00	2.122.297,87	17.238,67	0,82%	0,82%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.684.048,26	0,00	0,00	7.745.635,89	61.587,63	0,80%	0,80%	1,55%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.276.221,87	0,00	0,00	6.324.180,55	47.958,68	0,76%	0,76%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.100.981,96	5.000.000,00	0,00	6.147.545,03	46.563,07	0,76%	0,88%	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	2.171.189,73	0,00	0,00	2.186.688,86	15.499,13	0,71%	0,71%	1,57%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.518.850,76	0,00	5.000.000,00	11.634.121,49	115.270,73	0,70%	0,89%	1,04%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.693.777,43	0,00	0,00	2.707.415,66	13.638,23	0,51%	0,51%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	9.399.005,03	0,00	5.000.000,00	4.431.614,17	32.609,14	0,35%	0,79%	0,49%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	574.621,51	0,00	0,00	526.392,90	-48.228,61	-8,39%	-8,39%	13,60%
Total Renda Fixa	124.974.468,24	13.441.581,79	11.208.106,98	128.363.466,16	1.155.523,11	0,91%		0,73%

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 AÇÕES FIC AÇÕES	1.157.645,96	0,00	0,00	1.212.139,43	54.493,47	4,71%	4,71%	9,32%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.967.008,74	0,00	0,00	2.038.612,58	71.603,84	3,64%	3,64%	3,74%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.685.062,71	0,00	0,00	1.746.358,02	61.295,31	3,64%	3,64%	3,74%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	1.575.700,46	0,00	0,00	1.630.672,47	54.972,01	3,49%	3,49%	8,02%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.412.301,64	0,00	0,00	3.513.636,39	101.334,75	2,97%	2,97%	5,40%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	9.406.192,05	0,00	0,00	9.654.941,24	248.749,19	2,64%	2,64%	7,68%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.631.830,43	0,00	0,00	11.800.034,49	168.204,06	1,45%	1,45%	6,37%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.712.266,58	0,00	1.734.972,02	0,00	22.705,44	1,33%	-	-
QLZ MOS FI AÇÕES	0,00	1.734.972,02	0,00	1.753.766,30	18.794,28	1,08%	3,01%	7,88%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5.269.245,37	0,00	0,00	5.322.327,95	53.082,58	1,01%	1,01%	0,44%
MACAM SHOPPING FII	1.826.415,52	0,00	0,00	1.824.420,75	-1.994,77	-0,11%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.867.847,13	0,00	0,00	2.863.651,88	-4.195,25	-0,15%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.052.114,61	0,00	0,00	1.050.484,98	-1.629,63	-0,15%	0,00%	0,00%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	2.724.050,00	0,00	2.693.117,14	0,00	-30.932,86	-1,14%	2,51%	6,90%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	664.514,80	0,00	0,00	641.934,20	-22.580,60	-3,40%	-3,40%	8,52%
Total Renda Variável	46.952.196,00	1.734.972,02	4.428.089,16	45.052.980,68	793.901,82	1,63%		5,66%



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 FI AÇÕES BDR NÍVEL I	881.970,60	0,00	0,00	903.450,42	21.479,82	2,44%	2,44%	6,52%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.804.887,01	0,00	0,00	3.885.402,50	80.515,49	2,12%	2,12%	5,15%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	644.586,07	0,00	0,00	656.842,38	12.256,31	1,90%	1,90%	4,45%
Total Exterior	5.331.443,68	0,00	0,00	5.445.695,30	114.251,62	2,14%		5,30%

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.

