

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

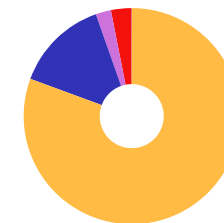
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	88.511.481,98	10,59%	675	1,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	59.677.203,48	7,14%	931	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	66.546.776,66	7,96%	786	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	2.065.914,37	0,25%	247	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	23.383.918,31	2,80%	589	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	38.415.096,59	4,60%	1.132	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	21.116.790,27	2,53%	552	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	D+0	Não há	97.516.590,61	11,67%	161	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	26.360.509,78	3,15%	292	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	23.069.466,07	2,76%	191	2,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	23.026.383,79	2,75%	40	11,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	16.249.351,19	1,94%	120	1,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.702.632,72	0,20%	53	3,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	10.649.286,88	1,27%	370	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	32.042.169,63	3,83%	225	4,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	39.126.808,79	4,68%	162	1,67%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	90.162.048,14	10,79%	1.126	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	14.180.169,63	1,70%	49	4,53%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	6.355.695,58	0,76%	20.876	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.055.697,69	0,60%	21.346	0,84%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	7.501.966,86	0,90%	1.332	0,92%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	14.134.050,67	1,69%	6.694	8,91%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.211.755,78	0,50%	10.641	1,20%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	15.946.560,53	1,91%	1.050	2,36%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	29.168.370,83	3,49%	188	4,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	7.622.939,86	0,91%	153	0,78%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	27.016.102,94	3,23%	122	3,81%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	14.758.157,47	1,77%	150	1,13%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.419.476,74	0,53%	488	0,21%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	11.709.436,06	1,40%	196.415	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.934.326,94	0,71%	48.530	0,24%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	3.283.884,89	0,39%	3.034	0,20%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.039.659,23	0,48%	5.706	0,70%	Artigo 10º, Inciso I
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	940.700,25	0,11%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			835.901.381,21				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			34.484,93				Artigo 6º
PL Total			835.935.866,14				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	0,00%	81,95%	685.021.181,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	498.291.402,70	59,61%	20,72%	36,34%	81,95%	186.729.779,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	161.331.026,56	19,30%	10,12%	25,42%	60,00%	340.209.802,17
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	167.180.276,24
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	14.180.169,63	1,70%	0,00%	2,78%	5,00%	27.614.899,43
Total Renda Fixa	100,00%	673.802.598,89	80,61%	30,84%	64,54%	248,90%	

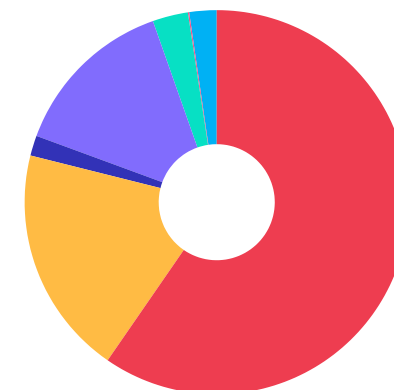


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º & 7º e Artigo 8º & 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

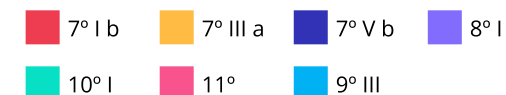


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	117.013.140,74	14,00%	11,21%	20,32%	30,00%	133.757.273,62
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	250.770.414,36
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	24.967.307,12	2,99%	2,09%	10,00%	10,00%	58.622.831,00
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,50%	20.897.534,53
Artigo 11º	5,00%	940.700,25	0,11%	0,00%	0,14%	2,50%	19.956.834,28
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	142.921.148,11	17,10%	13,30%	30,46%	75,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	19.177.634,21	2,29%	1,88%	5,00%	10,00%	64.412.503,91
Total Exterior	10,00%	19.177.634,21	2,29%	1,88%	5,00%	10,00%	



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	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	498.291.402,70	59,61	20,72	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	161.331.026,56	19,30	10,12	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	14.180.169,63	1,70	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	117.013.140,74	14,00	11,21	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	19.177.634,21	2,29	1,88	10,00
Artigo 10º, Inciso I	24.967.307,12	2,99	2,09	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,50
Artigo 11º	940.700,25	0,11	0,00	2,50
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	743.463.685,94	88,94	-
CAIXA DTVM	91.496.995,02	10,95	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	940.700,25	0,11	0,01

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%	-	-
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-B 5+ (Benchmark)	0,73%	15,74%	8,42%	17,22%	19,37%	15,53%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	15,45%	8,30%	16,93%	18,90%	14,69%	2,28%	8,01%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,07%	7,81%	3,44%	6,64%	13,84%	23,07%	-	-
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%
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	12,17%	5,90%	12,22%	15,20%	18,65%	1,58%	5,17%
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%	3,37%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06%	7,61%	3,32%	6,42%	13,56%	24,30%	0,01%	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%	0,08%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,08%	7,09%	3,41%	6,22%	13,16%	24,26%	0,03%	0,27%

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%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	-	-	-	-	-	1,27%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	12,57%	5,83%	12,25%	15,21%	-	1,57%	5,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	10,10%	3,35%	8,80%	12,42%	-	1,11%	4,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	6,67%	1,99%	5,21%	9,90%	-	0,42%	2,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	7,48%	3,24%	6,31%	13,37%	26,93%	0,00%	0,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,98%	7,72%	2,54%	6,30%	10,98%	21,92%	0,53%	2,20%

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%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	3,62%	18,90%	29,78%	15,66%	18,71%	-22,19%	8,75%	27,08%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,11%	19,52%	10,06%	12,57%	11,11%	4,41%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,28%	20,19%	10,09%	13,47%	15,98%	14,96%	3,57%	17,76%
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-
IDIV (Benchmark)	2,84%	12,41%	12,81%	6,16%	18,72%	18,15%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2,74%	13,14%	13,61%	9,28%	17,20%	9,32%	6,66%	18,60%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2,74%	10,22%	13,43%	6,27%	14,39%	0,77%	6,75%	18,98%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	3,45%	10,18%	17,22%	6,33%	15,96%	-4,59%	7,97%	21,13%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3,47%	10,34%	17,34%	6,52%	16,68%	-3,02%	8,18%	21,06%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,90%	15,88%	18,79%	12,17%	18,29%	9,69%	6,37%	19,46%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,04%	11,34%	19,10%	7,56%	13,18%	-9,95%	7,22%	20,22%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,47%	11,12%	16,28%	7,70%	13,56%	-2,35%	7,71%	21,43%

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

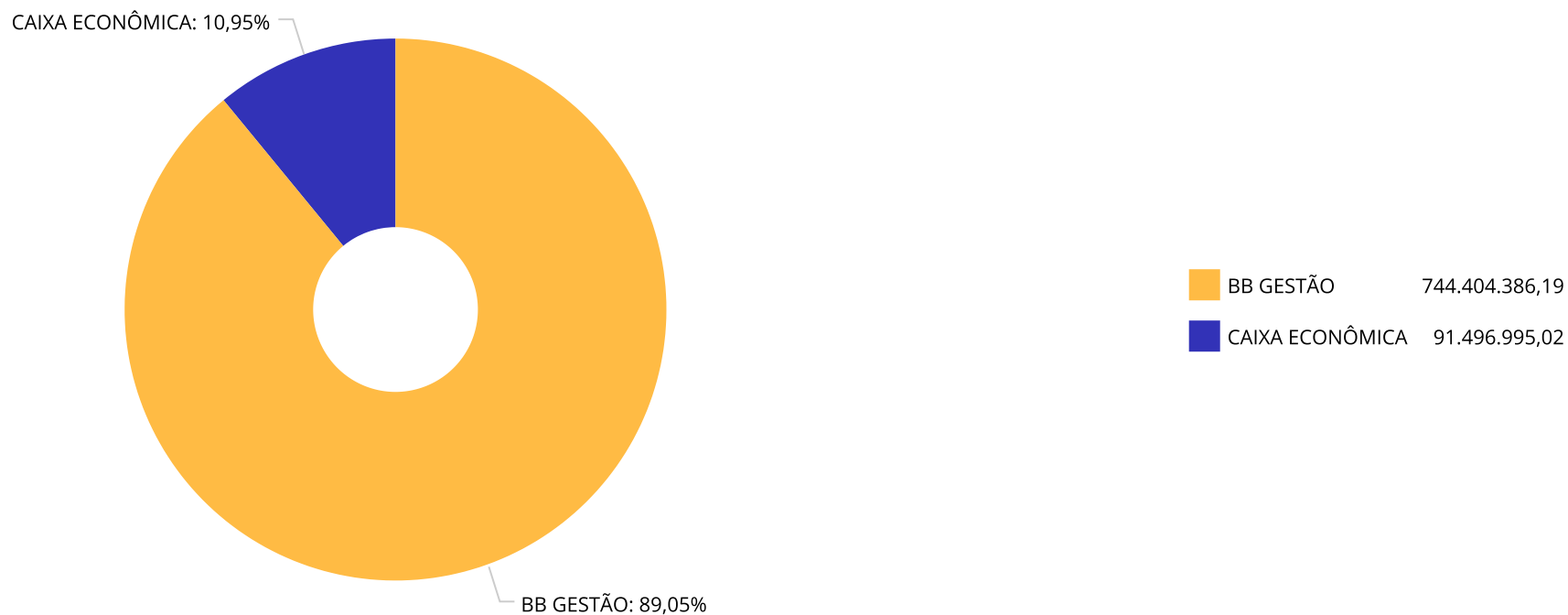
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	23,13%

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,64%	7,75%	6,38%	5,93%	14,97%	18,02%	2,38%	6,20%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,99%	7,62%	3,61%	6,45%	13,69%	25,44%	0,10%	0,46%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,01%	7,45%	3,38%	6,47%	12,87%	23,00%	0,23%	0,42%

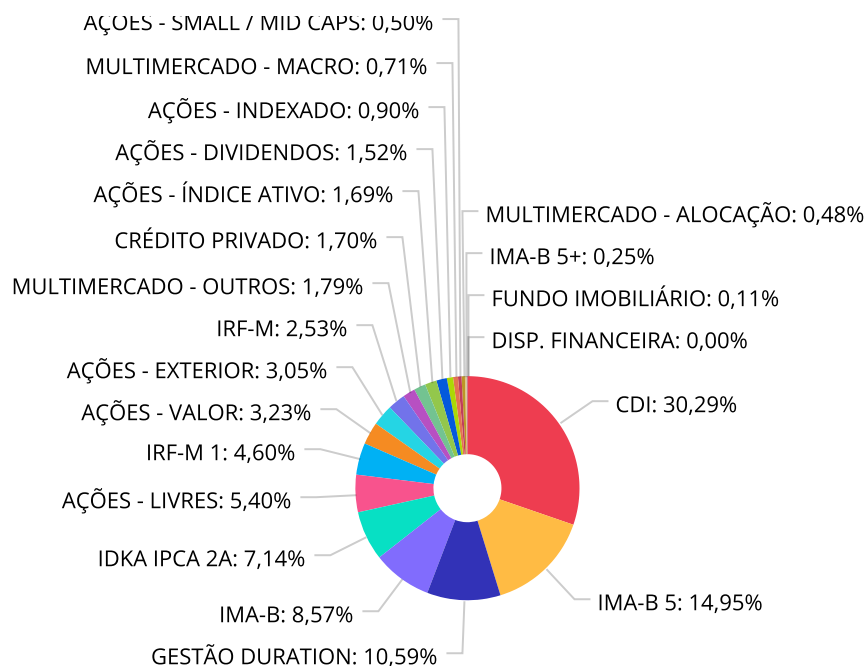
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,20%	10,06%	6,95%	7,93%	4,67%	-3,79%	5,15%	21,523%

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



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

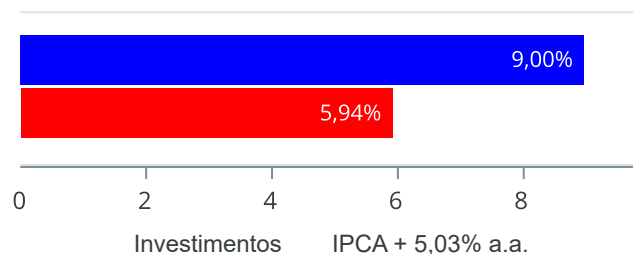


■ CDI	253.165.957,32	■ IMA-B 5	124.994.546,12	■ GESTÃO DURATION	88.511.481,98	■ IMA-B	71.675.439,13
■ IDKA IPCA 2A	59.677.203,48	■ AÇÕES - LIVRES	45.114.931,36	■ IRF-M 1	38.415.096,59	■ AÇÕES - VALOR	27.016.102,94
■ AÇÕES - EXTERIOR	25.533.329,79	■ IRF-M	21.116.790,27	■ MULTIMERCADO - OUTROS	14.993.320,95	■ CRÉDITO PRIVADO	14.180.169,63
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.134.050,67	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	12.678.637,55	■ AÇÕES - INDEXADO	7.501.966,86	■ MULTIMERCADO - MACRO	5.934.326,94
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.211.755,78	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	4.039.659,23	■ IMA-B 5+	2.065.914,37	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	940.700,25
■ DISP. FINANCEIRA	34.484,93						

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

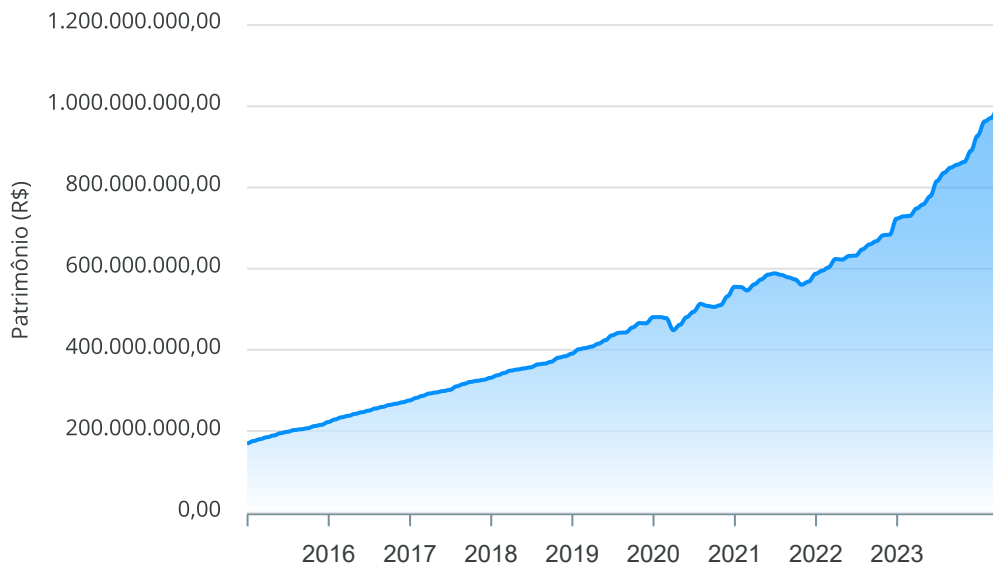
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	723.332.719,71	1.474.732,68	6.193.500,00	728.848.223,34	10.234.270,95	10.234.270,95	1,41%	1,41%	0,96%	0,96%	147,13%	2,30%
Fevereiro	728.848.223,34	10.355.551,56	8.450.650,84	730.080.047,03	-673.077,03	9.561.193,92	-0,09%	1,32%	1,19%	2,17%	60,98%	1,99%
Março	730.080.047,03	19.687.072,12	7.916.278,45	748.415.568,58	6.564.727,88	16.125.921,80	0,88%	2,22%	1,16%	3,35%	66,12%	1,81%
Abril	748.415.568,58	9.053.978,76	8.124.000,00	758.122.815,18	8.777.267,84	24.903.189,64	1,17%	3,42%	0,96%	4,35%	78,51%	1,80%
Mai	758.122.815,18	66.938.095,23	60.446.913,22	778.121.892,34	13.507.895,15	38.411.084,79	1,77%	5,24%	0,66%	5,04%	104,03%	1,73%
Junho	778.121.892,34	28.761.363,13	9.454.106,40	815.726.481,76	18.297.332,69	56.708.417,48	2,29%	7,66%	0,33%	5,39%	142,19%	1,81%
Julho	815.726.481,76	38.146.523,51	28.274.492,48	835.901.381,21	10.302.868,42	67.011.285,90	1,25%	9,00%	0,53%	5,94%	151,42%	1,56%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



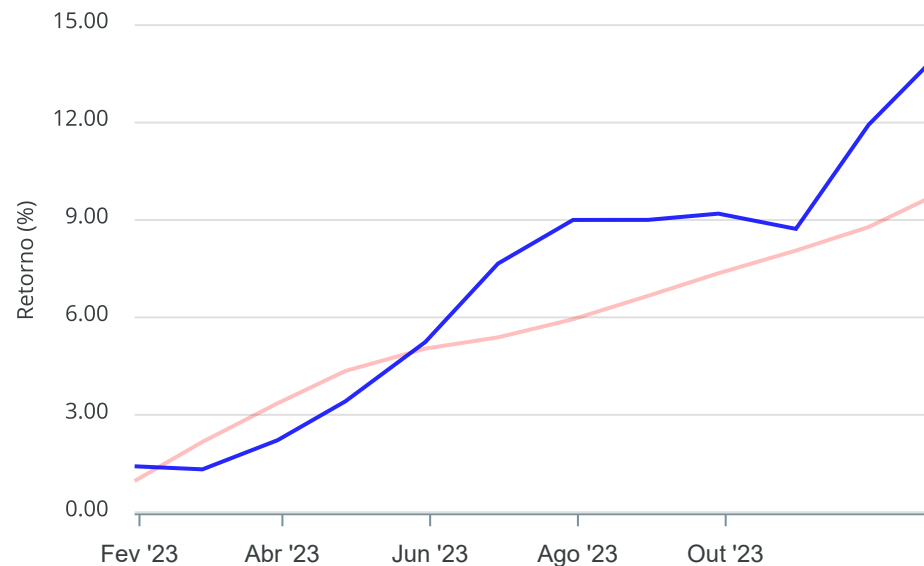
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	38.710.309,46	0,00	0,00	39.126.808,79	416.499,33	1,08%	1,08%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	26.082.516,35	0,00	0,00	26.360.509,78	277.993,43	1,07%	1,07%	0,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	10.537.867,23	0,00	0,00	10.649.286,88	111.419,65	1,06%	1,06%	0,42%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	88.695.164,70	752.835,49	229.000,00	90.162.048,14	943.047,95	1,05%	1,06%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.684.958,61	0,00	0,00	1.702.632,72	17.674,11	1,05%	1,05%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	104.541.243,06	0,00	8.100.000,00	97.516.590,61	1.075.347,55	1,03%	1,06%	0,01%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	14.042.599,92	0,00	0,00	14.180.169,63	137.569,71	0,98%	0,98%	0,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	65.920.438,44	0,00	0,00	66.546.776,66	626.338,22	0,95%	0,95%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	59.119.527,32	0,00	0,00	59.677.203,48	557.676,16	0,94%	0,94%	0,66%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	14.879.888,23	8.297.118,53	0,00	23.383.918,31	206.911,55	0,89%	0,73%	1,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.419.825,74	0,00	3.449.122,68	0,00	29.296,94	0,86%	1,14%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	22.882.080,95	0,00	0,00	23.069.466,07	187.385,12	0,82%	0,82%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	22.841.396,91	0,00	0,00	23.026.383,79	184.986,88	0,81%	0,81%	1,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	87.820.710,86	0,00	0,00	88.511.481,98	690.771,12	0,79%	0,79%	0,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	20.953.416,98	0,00	0,00	21.116.790,27	163.373,29	0,78%	0,78%	1,06%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.797.249,45	0,00	0,00	32.042.169,63	244.920,18	0,77%	0,77%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	16.134.176,62	0,00	0,00	16.249.351,19	115.174,57	0,71%	0,71%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.101.819,05	0,00	7.143.109,03	0,00	41.289,98	0,58%	0,92%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	11.446.584,71	26.765.978,25	0,00	38.415.096,59	202.533,63	0,53%	1,06%	0,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.304.549,20	0,00	9.349.960,77	0,00	45.411,57	0,49%	0,89%	1,04%

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	2.065.914,37	0,00	2.065.914,37	0,00	0,00%	0,69%	2,28%
Total Renda Fixa	657.916.323,79	37.881.846,64	28.271.192,48	673.802.598,89	6.275.620,94	0,94%		0,53%

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 SMALL CAPS FIC AÇÕES	4.064.718,67	0,00	0,00	4.211.755,78	147.037,11	3,62%	3,62%	8,75%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	13.659.845,20	0,00	0,00	14.134.050,67	474.205,47	3,47%	3,47%	8,18%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	26.110.094,86	0,00	0,00	27.016.102,94	906.008,08	3,47%	3,47%	7,71%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.252.068,80	0,00	0,00	7.501.966,86	249.898,06	3,45%	3,45%	7,97%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	6.153.604,00	0,00	0,00	6.355.695,58	202.091,58	3,28%	3,28%	3,57%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	15.476.524,14	0,00	0,00	15.946.560,53	470.036,39	3,04%	3,04%	7,22%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7.419.406,52	0,00	0,00	7.622.939,86	203.533,34	2,74%	2,74%	6,66%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.920.798,60	0,00	0,00	5.055.697,69	134.899,09	2,74%	2,74%	6,75%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	28.624.913,78	0,00	0,00	29.168.370,83	543.457,05	1,90%	1,90%	6,37%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.974.466,50	0,00	0,00	4.039.659,23	65.192,73	1,64%	1,64%	2,38%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	930.068,60	0,00	3.300,00	940.700,25	13.931,65	1,50%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	11.591.959,19	0,00	0,00	11.709.436,06	117.476,87	1,01%	1,01%	0,23%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.876.246,73	0,00	0,00	5.934.326,94	58.080,21	0,99%	0,99%	0,87%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.987.368,36	264.676,87	0,00	3.283.884,89	31.839,66	0,98%	0,99%	0,10%
Total Renda Variável	139.042.083,95	264.676,87	3.300,00	142.921.148,11	3.617.687,29	2,60%		5,96%

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 FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	14.440.166,16	0,00	0,00	14.758.157,47	317.991,31	2,20%	2,20%	5,15%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.327.907,86	0,00	0,00	4.419.476,74	91.568,88	2,12%	2,12%	5,49%
Total Exterior	18.768.074,02	0,00	0,00	19.177.634,21	409.560,19	2,18%		5,23%

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.

