

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

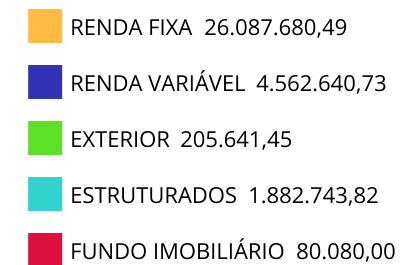
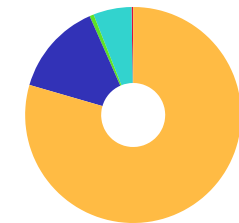
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.530.783,70	4,66%	675	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	730.931,44	2,23%	931	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.506.822,03	4,59%	247	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.396.110,56	4,25%	589	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.289.136,06	3,93%	552	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	1.063.741,64	3,24%	191	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.396.783,89	4,26%	303	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	2.365.766,40	7,21%	187	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	1.303.998,79	3,97%	83	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.851.517,48	5,64%	777	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.555.729,83	4,74%	892	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.775.531,02	5,41%	925	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.313.683,33	4,00%	270	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.510.976,60	4,60%	741	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	154.029,93	0,47%	1.184	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.359.619,52	4,14%	227	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.334.463,88	4,07%	980	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	820.342,73	2,50%	147	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.785.757,93	5,44%	228	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	41.953,73	0,13%	98	0,13%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	960.460,29	2,93%	585	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	516.160,17	1,57%	1.475	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	358.330,32	1,09%	2.762	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	298.217,12	0,91%	28.955	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	416.889,01	1,27%	20.881	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	336.836,76	1,03%	1.050	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	616.618,06	1,88%	83	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	164.544,39	0,50%	6.527	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	236.636,90	0,72%	2.343	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	657.947,71	2,00%	5.925	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	205.641,45	0,63%	488	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	456.641,09	1,39%	183	0,14%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.426.102,73	4,35%	5.643	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	80.080,00	0,24%		0,06%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			32.818.786,49				

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

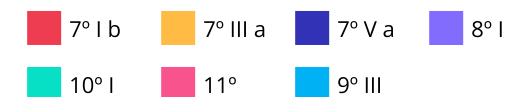
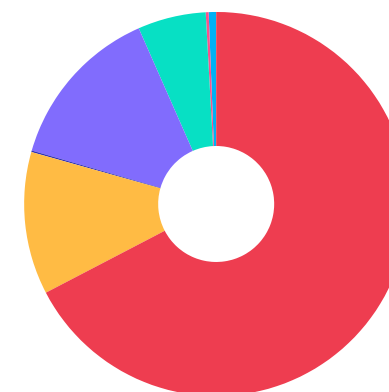
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	12,00%	40,00%	13.127.514,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	22.105.162,22	67,36%	20,00%	40,00%	90,00%	7.431.745,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	3.940.564,54	12,01%	2,00%	15,00%	40,00%	9.186.950,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.640.939,32
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,85%	10,00%	3.281.878,65
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	41.953,73	0,13%	0,00%	0,15%	2,00%	614.422,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	1.640.939,32
Total Renda Fixa	100,00%	26.087.680,49	79,49%	22,00%	75,00%	192,00%	



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%	4.562.640,73	13,90%	5,00%	15,00%	30,00%	5.282.995,22
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	656.375,73
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.882.743,82	5,74%	0,00%	4,50%	10,00%	1.399.134,83
Artigo 11º	5,00%	80.080,00	0,24%	0,00%	0,50%	5,00%	1.560.859,32
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	6.525.464,55	19,88%	5,00%	20,00%	47,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	205.641,45	0,63%	0,00%	3,00%	10,00%	3.076.237,20
Total Exterior	10,00%	205.641,45	0,63%	0,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	20.097.802,72	61,24	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.858.687,31	36,13	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	820.342,73	2,50	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	41.953,73	0,13	0,06

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)

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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	22.105.162,22	67,36	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	3.940.564,54	12,01	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	41.953,73	0,13	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	4.562.640,73	13,90	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 9º, Inciso III	205.641,45	0,63	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.882.743,82	5,74	0,00	10,00
Artigo 11º	80.080,00	0,24	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
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	7,57%	2,37%	6,04%	10,71%	21,24%	0,66%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,82%	12,33%	6,44%	11,52%	18,36%	19,55%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	12,14%	6,40%	11,33%	17,85%	18,64%	1,52%	0,05%
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%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	15,45%	8,30%	16,93%	18,90%	14,69%	2,28%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,07%	7,81%	3,44%	6,64%	13,84%	23,07%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,07%	7,73%	3,39%	6,53%	13,63%	22,57%	0,16%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
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%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,82%	6,89%	0,35%	5,64%	6,24%	-	1,11%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	3,59%	1,99%	2,17%	3,56%	7,16%	0,42%	0,05%
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,82%	12,21%	5,87%	12,31%	15,19%	18,62%	1,58%	0,05%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	12,10%	5,78%	12,11%	15,14%	18,55%	1,54%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,89%	10,59%	5,29%	9,67%	16,44%	20,41%	-	-
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%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,98%	7,02%	3,06%	5,93%	12,47%	21,74%	0,01%	0,00%
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%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,47%	-8,42%	-7,55%	-8,11%	0,74%	-59,56%	0,06%	0,14%
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,89%	9,23%	4,88%	8,11%	14,71%	20,86%	1,04%	0,01%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,87%	10,40%	5,15%	9,78%	14,96%	21,08%	1,02%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	10,10%	3,35%	8,80%	12,42%	-	1,11%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,07%	-	-	-	-	-	0,42%	-

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%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2,97%	16,40%	25,91%	12,68%	16,58%	-22,65%	8,42%	0,26%
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,78%	27,11%	26,83%	26,31%	27,11%	7,85%	8,94%	0,23%
IDIV (Benchmark)	2,84%	12,41%	12,81%	6,16%	18,72%	18,15%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,98%	21,19%	18,82%	15,27%	24,57%	8,49%	5,51%	0,19%
IBX-50 (Benchmark)	3,70%	8,84%	16,09%	5,28%	16,73%	-1,88%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3,47%	9,13%	15,56%	4,14%	14,82%	-6,18%	7,77%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1,24%	20,13%	17,02%	15,50%	20,49%	17,40%	7,51%	0,23%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	4,91%	42,33%	33,62%	34,44%	38,83%	-0,27%	9,57%	0,32%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,04%	11,34%	19,10%	7,56%	13,18%	-9,95%	7,22%	0,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3,27%	8,61%	15,99%	3,98%	11,69%	-1,78%	7,98%	0,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4,53%	7,41%	14,49%	0,67%	6,36%	-22,27%	7,87%	0,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,82%	8,04%	15,36%	4,55%	9,45%	-2,72%	7,64%	0,21%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,65%	10,45%	16,02%	6,90%	14,66%	-2,73%	7,43%	0,20%

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
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%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,48%	8,24%	5,19%	6,95%	14,09%	18,57%	1,54%	0,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,01%	7,64%	3,27%	6,40%	13,65%	22,93%	0,44%	0,01%

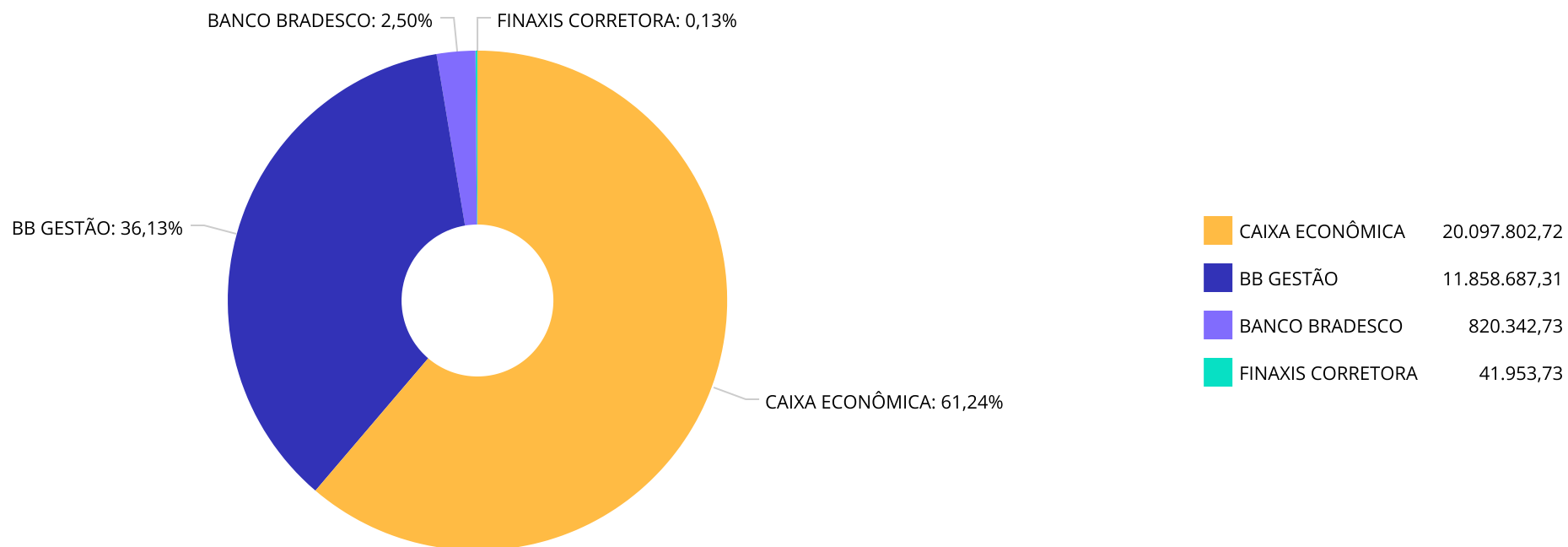


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

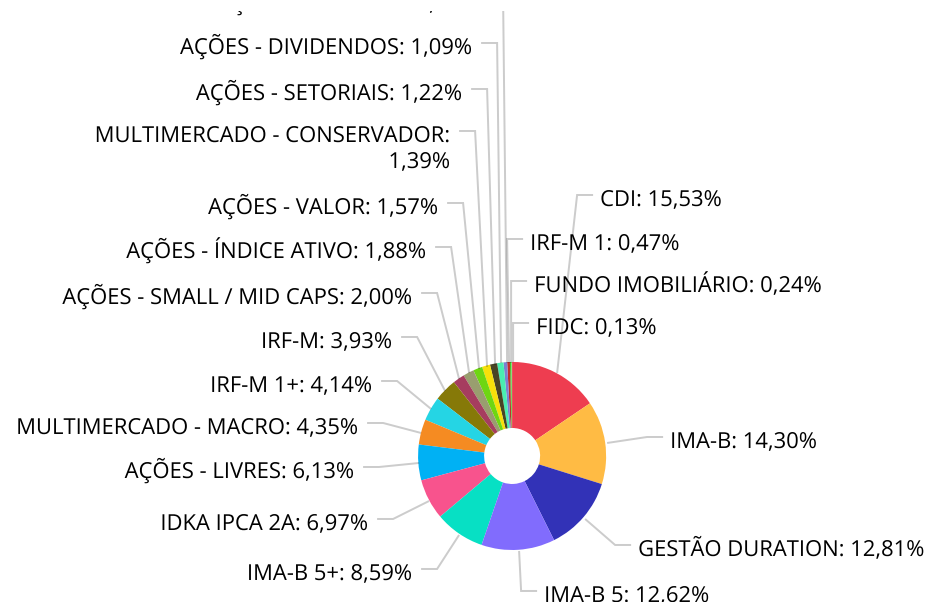
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	23,133%



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



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

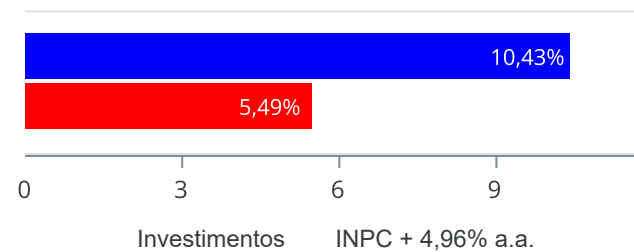


CDI	5.097.014,17	IMA-B	4.692.845,09	GESTÃO DURATION	4.202.643,91
IMA-B 5	4.143.271,45	IMA-B 5+	2.820.505,36	IDKA IPCA 2A	2.286.661,27
AÇÕES - LIVRES	2.012.403,18	MULTIMERCADO - MACRO	1.426.102,73	IRF-M 1+	1.359.619,52
IRF-M	1.289.136,06	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	657.947,71	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	616.618,06
AÇÕES - VALOR	516.160,17	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	456.641,09	AÇÕES - SETORIAIS	401.181,29
AÇÕES - DIVIDENDOS	358.330,32	AÇÕES - EXTERIOR	205.641,45	IRF-M 1	154.029,93
FUNDO IMOBILIÁRIO	80.080,00	FIDC	41.953,73		

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	29.845.849,01	571.931,67	656.188,48	30.123.601,47	362.009,27	362.009,27	1,21%	1,21%	0,89%	0,89%	136,98%	3,14%
Fevereiro	30.123.601,47	646.321,24	704.253,00	30.029.044,89	-36.624,82	325.384,45	-0,12%	1,09%	1,12%	2,01%	54,10%	2,73%
Março	30.029.044,89	653.742,31	673.764,46	30.409.532,44	400.509,70	725.894,15	1,33%	2,44%	1,09%	3,12%	78,10%	2,21%
Abril	30.409.532,44	679.220,96	683.938,17	30.833.935,13	429.119,90	1.155.014,05	1,41%	3,88%	0,88%	4,03%	96,43%	2,29%
Mai	30.833.935,13	3.457.608,52	3.534.766,03	31.457.420,66	700.643,04	1.855.657,09	2,27%	6,24%	0,79%	4,84%	128,90%	2,32%
Junho	31.457.420,66	652.166,46	694.931,25	32.256.344,54	841.688,67	2.697.345,76	2,68%	9,09%	0,30%	5,16%	176,01%	2,29%
Julho	32.256.344,54	863.144,51	701.164,49	32.818.786,49	400.461,93	3.097.807,69	1,24%	10,43%	0,31%	5,49%	189,97%	2,04%

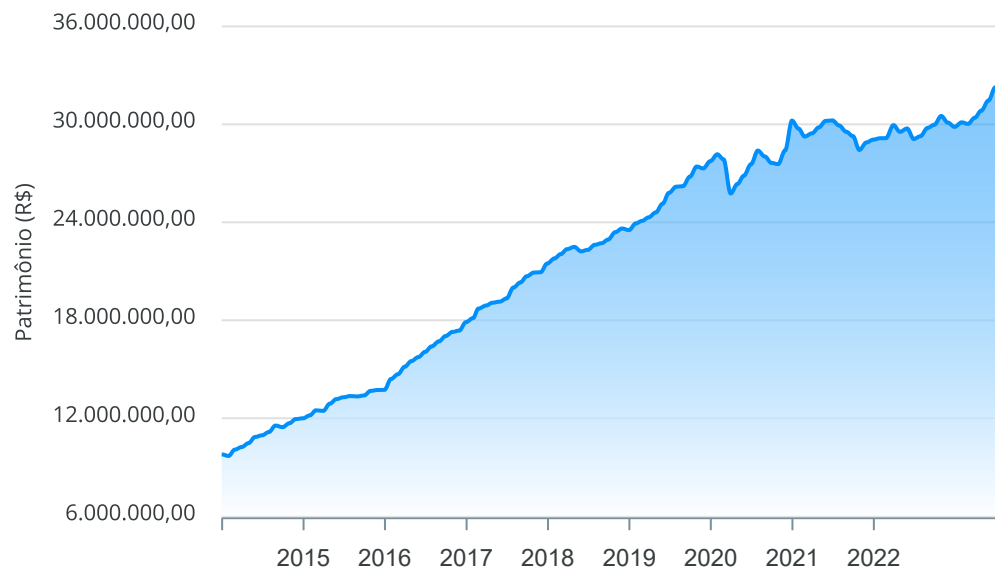
Investimentos x Meta de Rentabilidade



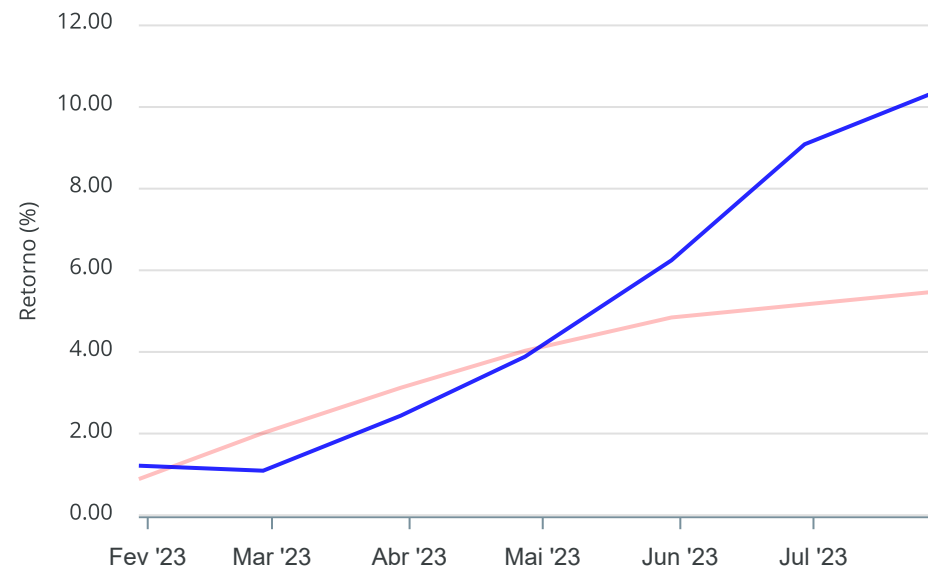
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.382.169,91	0,00	0,00	1.396.783,89	14.613,98	1,06%	1,06%	0,42%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.057.566,53	284.844,10	0,00	2.365.766,40	23.355,77	1,00%	1,07%	0,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	141.374,95	11.140,38	0,00	154.029,93	1.514,60	0,99%	1,07%	0,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.856.875,59	0,00	98.899,64	1.775.531,02	17.555,07	0,95%	0,95%	0,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	724.100,98	0,00	0,00	730.931,44	6.830,46	0,94%	0,94%	0,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.541.605,93	0,00	0,00	1.555.729,83	14.123,90	0,92%	0,92%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.835.128,96	0,00	0,00	1.851.517,48	16.388,52	0,89%	0,89%	1,04%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	813.296,46	0,00	0,00	820.342,73	7.046,27	0,87%	0,87%	1,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.363.531,74	556.160,03	601.664,85	1.334.463,88	16.436,96	0,86%	0,98%	0,01%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.771.170,96	0,00	0,00	1.785.757,93	14.586,97	0,82%	0,82%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.055.101,25	0,00	0,00	1.063.741,64	8.640,39	0,82%	0,82%	1,11%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.293.412,12	0,00	0,00	1.303.998,79	10.586,67	0,82%	0,82%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.348.772,07	0,00	0,00	1.359.619,52	10.847,45	0,80%	0,80%	1,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.498.962,42	0,00	0,00	1.510.976,60	12.014,18	0,80%	0,80%	1,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.518.836,99	0,00	0,00	1.530.783,70	11.946,71	0,79%	0,79%	0,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.279.162,46	0,00	0,00	1.289.136,06	9.973,60	0,78%	0,78%	1,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.304.063,77	0,00	0,00	1.313.683,33	9.619,56	0,74%	0,74%	2,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.375.027,27	11.000,00	0,00	1.396.110,56	10.083,29	0,73%	0,73%	1,54%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.496.512,43	0,00	0,00	1.506.822,03	10.309,60	0,69%	0,69%	2,28%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	42.152,05	0,00	0,00	41.953,73	-198,32	-0,47%	-0,47%	0,06%



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
Total Renda Fixa	25.698.824,84	863.144,51	700.564,49	26.087.680,49	226.275,63	0,87%		1,06%

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
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	156.846,28	0,00	0,00	164.544,39	7.698,11	4,91%	4,91%	9,57%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	285.289,59	0,00	0,00	298.217,12	12.927,53	4,53%	4,53%	7,87%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	497.147,20	0,00	0,00	516.160,17	19.012,97	3,82%	3,82%	7,64%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	926.656,13	0,00	0,00	960.460,29	33.804,16	3,65%	3,65%	7,43%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	595.948,73	0,00	0,00	616.618,06	20.669,33	3,47%	3,47%	7,77%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	403.674,15	0,00	0,00	416.889,01	13.214,86	3,27%	3,27%	7,98%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	326.908,26	0,00	0,00	336.836,76	9.928,50	3,04%	3,04%	7,22%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	638.972,50	0,00	0,00	657.947,71	18.975,21	2,97%	2,97%	8,42%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	78.680,00	0,00	600,00	80.080,00	2.000,00	2,54%	2,57%	8,94%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.405.346,92	0,00	0,00	1.426.102,73	20.755,81	1,48%	1,48%	1,54%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	233.736,01	0,00	0,00	236.636,90	2.900,89	1,24%	1,24%	7,51%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	452.086,75	0,00	0,00	456.641,09	4.554,34	1,01%	1,01%	0,44%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	354.846,50	0,00	0,00	358.330,32	3.483,82	0,98%	0,98%	5,51%
Total Renda Variável	6.356.139,02	0,00	600,00	6.525.464,55	169.925,53	2,67%		5,81%



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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	201.380,68	0,00	0,00	205.641,45	4.260,77	2,12%	2,12%	5,49%
Total Exterior	201.380,68	0,00	0,00	205.641,45	4.260,77	2,12%		5,49%

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.

