

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			536.444.465,22	31,40%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	69.862.465,84	4,09%	675	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.647.820,55	0,74%	786	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	16.826.625,99	0,99%	552	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	33.938.651,58	1,99%	777	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	38.988.814,84	2,28%	925	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.376.938,16	0,84%	381	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	33.788.293,55	1,98%	14	12,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.972.286,30	0,17%	1.566	1,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	76.378.010,55	4,47%	117	6,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	44.281.482,15	2,59%	65	11,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.139.457,78	0,83%	24	1,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.788.821,19	0,22%	4.164	2,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	16.416.963,95	0,96%	225	2,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	37.266.879,89	2,18%	138	3,94%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.147.067,10	1,35%	86	5,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	17.896.600,38	1,05%	228	1,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.346.250,23	0,66%	208	0,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	16.426.960,50	0,96%	14	11,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	8.090.657,36	0,47%	31	3,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '



Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	5.030.343,79	0,29%	471	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	D+45 a ...	01/08/2016	11.119.647,91	0,65%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	56.824,29	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	12.536.909,74	0,73%	50.825	1,02%	Artigo 8º, Inciso I
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	35.653.690,52	2,09%	12	6,90%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.367.528,64	0,67%	3.656	3,92%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	45.568.521,36	2,67%	3.004	3,34%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	9.869.497,25	0,58%	39	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	9.725.390,73	0,57%	4.811	2,50%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.875.077,37	0,11%	2.461	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	23.831.836,03	1,40%	188	3,29%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	16.607.562,18	0,97%	153	1,71%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	35.915.692,00	2,10%	122	5,06%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	16.151.001,91	0,95%	203	6,41%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	30.177.002,46	1,77%	16.614	1,64%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.190.182,18	0,42%	38	1,46%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	14.396.906,64	0,84%	1.355	1,49%	Artigo 8º, Inciso I
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+7 du	Não há	1.872.362,04	0,11%	3	11,51%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	24.274.645,81	1,42%	53	1,40%	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
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.280.108,08	0,25%	39	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	16.978.819,44	0,99%	3.306	5,10%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	11.682.204,85	0,68%	1.826	5,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	20.502.444,56	1,20%	103	1,73%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	13.170.661,58	0,77%	2	1,11%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.287.548,38	0,25%	1.604	5,81%	Artigo 9º, Inciso II
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO ...	D+11 du	Não há	14.680.640,22	0,86%	2	0,00%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	15.140.714,04	0,89%	4.738	2,39%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	5.446.546,84	0,32%	206	1,85%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO ...	D+8 du	Não há	10.686.508,47	0,63%	1.737	4,79%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+8 du	Não há	9.380.973,49	0,55%	484	4,20%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	24.125.839,38	1,41%	3.723	13,94%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	47.743.909,50	2,79%	2.345	8,99%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	14.411.563,57	0,84%	83	12,88%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	5.704.334,72	0,33%	583	3,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	8.346.351,71	0,49%	155	7,27%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	12.781.927,36	0,75%	28	14,16%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	21.746.560,75	1,27%	21	9,71%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.314.080,61	0,84%	22	10,31%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.692.941,39	0,86%	20	8,92%	Artigo 10º, Inciso I

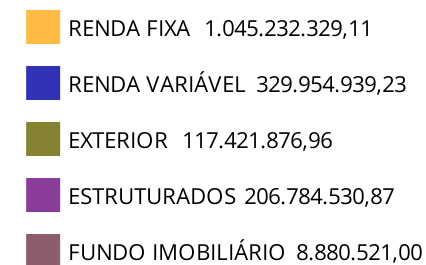
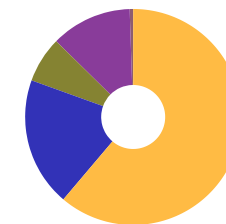


Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTR...	Não se ...	Não se aplica	579.704,97	0,03%	28	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	20.447.893,02	1,20%	99	0,70%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	95.861,82	0,01%	39	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	7.852.920,21	0,46%	38	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.950.783,52	0,11%		1,24%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	22.449.572,14	1,31%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	596.712,41	0,03%	18	0,13%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	12.212.010,06	0,71%		18,02%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	D+0	Não há	857.403,11	0,05%	10	2,91%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	3.993.521,00	0,23%		3,26%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.887.000,00	0,29%		2,02%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.708.274.197,17				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			211.935,68				Artigo 6º
PL Total			1.708.486.132,85				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	536.444.465,22	31,40%	17,00%	32,00%	100,00%	1.171.829.731,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	361.989.668,48	21,19%	10,00%	20,00%	100,00%	1.346.284.528,69
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.708.274.197,17
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	85.413.709,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	135.621.723,20	7,94%	1,00%	7,00%	60,00%	889.342.795,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.024.964.518,30
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	341.654.839,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	11.176.472,21	0,65%	0,00%	0,00%	5,00%	74.237.237,65
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	85.413.709,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	85.413.709,86
Total Renda Fixa	100,00%	1.045.232.329,11	61,19%	28,00%	59,00%	460,00%	



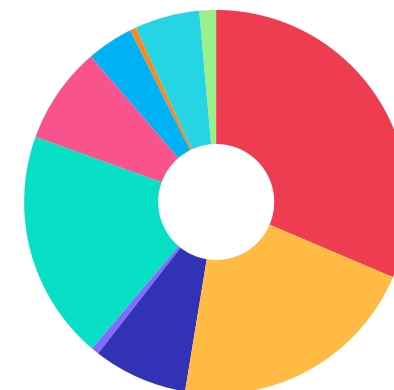
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



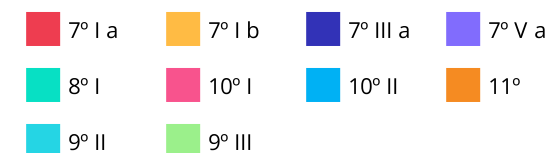


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2023)

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%	329.954.939,23	19,32%	6,00%	22,00%	35,00%	267.941.029,78
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	597.895.969,01
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	139.741.669,61	8,18%	1,00%	7,00%	10,00%	31.085.750,11
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	67.042.861,26	3,92%	1,00%	3,00%	5,00%	18.370.848,60
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	85.413.709,86
Artigo 11º	5,00%	8.880.521,00	0,52%	0,00%	0,00%	5,00%	76.533.188,86
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	545.619.991,10	31,94%	8,00%	32,00%	95,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	93.296.037,58	5,46%	1,00%	7,00%	10,00%	77.531.382,14
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	24.125.839,38	1,41%	1,00%	2,00%	10,00%	146.701.580,34
Total Exterior	10,00%	117.421.876,96	6,87%	2,00%	9,00%	20,00%	





CRÉDITO
& MERCADO

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	536.444.465,22	31,40	-
CAIXA DTVM	210.018.345,17	12,29	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	159.152.373,20	9,32	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	154.970.008,31	9,07	0,03
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	91.824.202,87	5,38	0,95
AZ QUEST INVESTIMENTOS	66.805.547,25	3,91	0,22
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	60.413.946,99	3,54	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	49.618.986,87	2,90	0,03
ITAÚ DTVM	37.367.184,64	2,19	0,01
ARX INVESTIMENTOS	35.653.690,52	2,09	0,09
ICATU VANGUARDA	33.788.293,55	1,98	0,06
XP GESTÃO DE RECURSOS	28.661.024,29	1,68	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	28.396.675,05	1,66	0,02
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	27.497.252,14	1,61	-
XP ASSET MANAGEMENT	24.355.030,34	1,43	-
TARPON INVESTIMENTOS	24.274.645,81	1,42	0,29
ITAÚ UNIBANCO	24.125.839,38	1,41	0,01
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	23.046.284,55	1,35	0,01
VINCI PARTNERS	17.349.521,25	1,02	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	15.754.213,66	0,92	0,13
OCCAM BRASIL	14.396.906,64	0,84	0,13
ALASKA ASSET MANAGEMENT	12.536.909,74	0,73	0,12
OLIVEIRA TRUST	11.119.647,91	0,65	0,08
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.446.546,84	0,32	0,07
REAG GESTORA DE RECURSOS	4.887.000,00	0,29	0,01

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 '	536.444.465,22	31,40	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	361.989.668,48	21,19	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	135.621.723,20	7,94	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	11.176.472,21	0,65	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	329.954.939,23	19,32	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	93.296.037,58	5,46	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	24.125.839,38	1,41	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	139.741.669,61	8,18	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	67.042.861,26	3,92	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	8.880.521,00	0,52	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	1,17%	8,38%	3,61%	7,08%	14,95%	27,25%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	1,24%	8,87%	3,82%	7,48%	15,85%	29,78%	0,00%	0,31%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,36%	9,79%	4,20%	8,29%	17,56%	33,10%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	2,80%	-52,51%	-34,62%	-37,49%	101,72%	273,69%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,95%	7,94%	2,56%	6,47%	11,06%	21,95%	0,74%	0,02%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	0,96%	7,94%	2,54%	6,48%	10,78%	21,59%	0,72%	0,02%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,95%	7,95%	2,60%	6,50%	10,99%	21,51%	0,77%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,95%	8,01%	2,61%	6,54%	11,10%	21,88%	0,74%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	0,89%	10,06%	4,35%	9,85%	13,40%	13,02%	1,46%	0,05%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,80%	12,11%	5,78%	12,15%	15,17%	18,63%	1,58%	0,05%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,69%	12,24%	6,17%	12,29%	15,12%	18,37%	1,58%	0,05%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,80%	12,35%	5,94%	12,34%	15,34%	18,39%	1,62%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	12,17%	5,90%	12,22%	15,20%	18,65%	1,58%	0,05%

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
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%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,88%	10,44%	5,23%	9,53%	16,13%	19,78%	1,08%	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%	-	-
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%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	900,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,14%	7,58%	3,52%	6,46%	13,70%	25,14%	0,02%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1,50%	-	-	-	-	-	1,12%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,90%	11,27%	5,57%	10,71%	13,06%	23,97%	1,15%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,89%	9,23%	4,88%	8,11%	14,71%	20,86%	1,04%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	1,31%	-	4,89%	-	-	-	3,03%	-



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 + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,69%	7,08%	1,98%	5,98%	11,27%	31,05%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	3,98%	-18,54%	6,24%	-6,00%	22,24%	28,30%	15,45%	0,62%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,61%	6,51%	1,74%	5,48%	10,23%	28,61%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,17%	16,12%	-0,52%	16,25%	15,07%	81,79%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	0,01%	-5,84%	1,37%	0,60%	-6,95%	-6,71%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,21%	10,72%	-0,67%	11,02%	7,31%	-	-	-
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,29%	11,62%	3,84%	9,87%	19,59%	51,38%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-2,25%	-34,11%	-14,37%	-34,07%	-59,00%	-94,91%	0,11%	0,33%
SMLL (Benchmark)	3,12%	16,80%	26,65%	13,48%	17,47%	-20,79%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,12%	14,11%	18,63%	11,16%	14,05%	-13,06%	8,72%	0,19%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,63%	13,32%	17,83%	10,39%	13,26%	-13,09%	7,93%	0,18%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,11%	19,52%	10,06%	12,57%	11,11%	4,41%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3,68%	24,80%	12,37%	17,32%	26,29%	28,16%	3,75%	0,18%
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-7,48%	-3,19%	7,87%	6,08%	-4,07%	-34,54%	12,00%	0,25%

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
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%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,17%	8,09%	9,14%	6,26%	-1,52%	-	4,91%	0,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	1,73%	-	-	-	-	-	3,32%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	4,37%	15,86%	11,65%	14,05%	16,31%	-	4,30%	0,08%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,84%	2,11%	0,45%	1,89%	5,61%	-	1,54%	0,07%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,99%	7,62%	7,94%	5,85%	13,12%	-	4,10%	0,07%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,90%	15,88%	18,79%	12,17%	18,29%	9,69%	6,37%	0,19%
OCCAM FIC AÇÕES	2,86%	7,54%	13,79%	4,66%	13,25%	-2,23%	8,94%	0,19%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,06%	9,92%	21,12%	5,03%	11,27%	-28,30%	7,52%	0,21%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3,40%	10,90%	17,00%	7,30%	17,12%	-4,39%	7,48%	0,20%
BB AGRO FIC AÇÕES	4,04%	4,60%	13,06%	3,70%	7,92%	2,18%	6,98%	0,17%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,61%	1,00%	8,70%	-1,38%	9,73%	-10,65%	7,35%	0,19%
XP INVESTOR FI AÇÕES	0,80%	13,45%	14,98%	9,66%	14,09%	3,18%	6,48%	0,20%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4,71%	10,76%	17,46%	6,76%	14,00%	-9,91%	9,32%	0,19%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,89%	13,01%	16,71%	8,22%	19,90%	14,12%	6,91%	0,19%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,35%	13,31%	13,01%	9,41%	14,23%	16,32%	5,36%	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
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,61%	6,41%	17,61%	4,07%	11,01%	-5,62%	7,34%	0,21%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,47%	11,12%	16,28%	7,70%	13,56%	-2,35%	7,71%	0,21%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3,90%	15,68%	21,67%	12,04%	15,83%	-4,62%	7,84%	0,23%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4,02%	22,33%	22,92%	15,73%	27,94%	21,34%	8,62%	0,22%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5,91%	32,21%	32,12%	29,17%	43,47%	42,26%	8,17%	0,22%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	1,07%	7,13%	3,63%	6,11%	12,55%	22,84%	0,38%	0,01%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,76%	7,66%	2,22%	6,47%	12,31%	33,51%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,04%	-3,69%	-0,63%	-3,65%	-2,44%	17,49%	-	-
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	0,88%	8,52%	2,57%	7,21%	13,87%	37,24%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,04%	47,82%	1,22%	47,92%	47,48%	20,34%	0,03%	0,47%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,89%	8,32%	4,19%	7,45%	-	-	0,59%	-
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-0,44%	-5,49%	-6,43%	-5,83%	-	-	4,55%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-



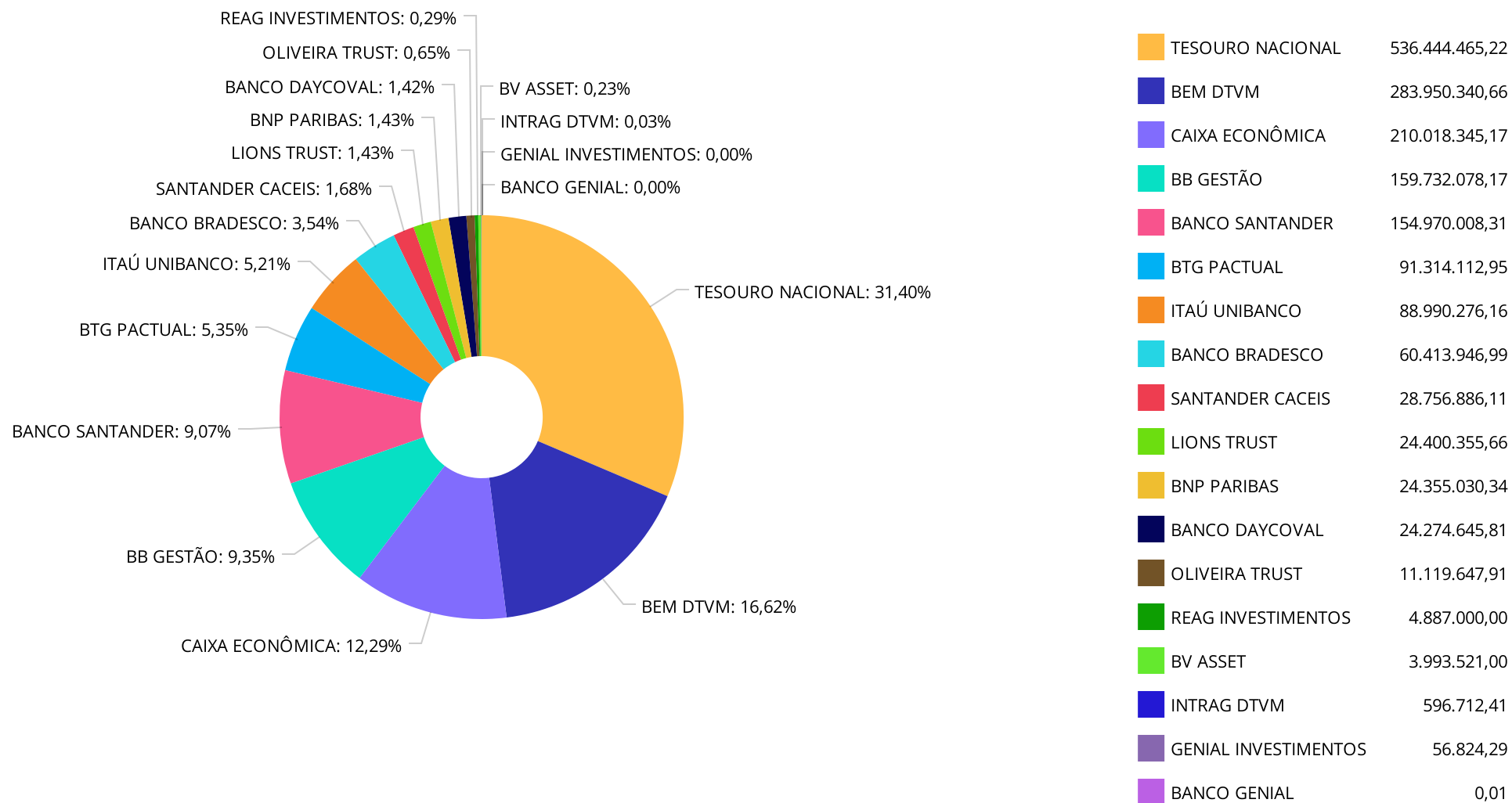
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	3,40%	-	-	-	-	-	8,81%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	-6,22%	-3,02%	-4,73%	-4,10%	-5,15%	-61,09%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,80%	-6,16%	7,00%	-5,24%	-	-	-	-

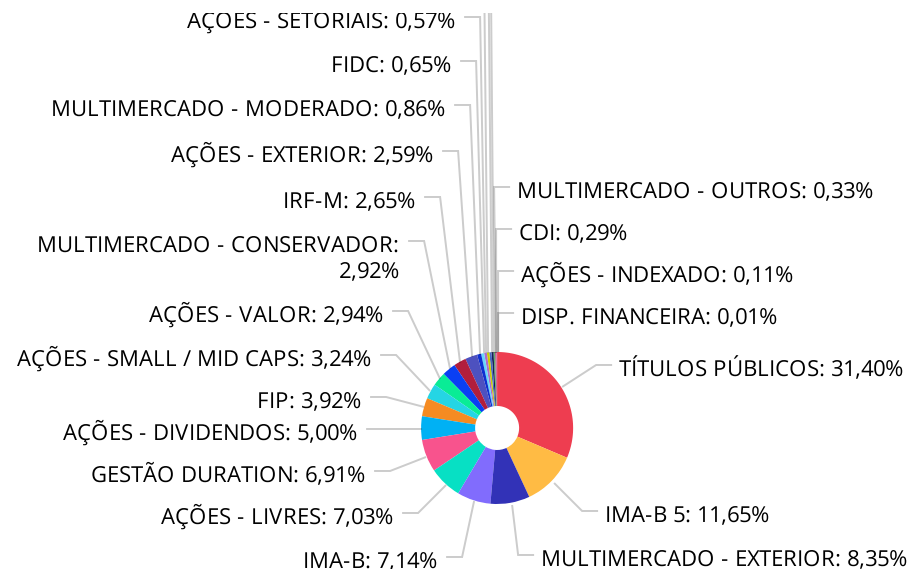
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	1,90%	1,74%	2,50%	1,58%	-1,05%	-1,08%	4,45%	20,064%
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%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,04%	6,42%	2,78%	3,76%	7,11%	-2,39%	5,56%	22,500%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,88%	6,14%	2,36%	1,41%	1,33%	-9,61%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1,81%	4,72%	1,78%	2,93%	4,05%	-10,02%	6,18%	23,316%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	1,06%	2,41%	2,35%	0,72%	1,93%	-7,92%	4,49%	21,574%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULT...	-1,73%	-7,13%	4,30%	-4,96%	1,46%	26,02%	4,28%	13,621%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	-3,28%	-19,36%	-2,55%	-13,82%	-13,22%	0,15%	7,46%	20,269%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	1,98%	3,50%	2,31%	-2,77%	5,25%	-	4,99%	19,617%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIM...	1,95%	5,88%	2,58%	3,40%	-	-	5,46%	-

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	536.444.465,22	■ IMA-B 5	199.069.819,38	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	142.659.320,77
■ IMA-B	121.957.895,27	■ AÇÕES - LIVRES	120.025.312,98	■ GESTÃO DURATION	118.119.653,95
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	85.391.074,05	■ FIP	67.042.861,26	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	55.438.018,61
■ AÇÕES - VALOR	50.312.598,64	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	49.853.923,25	■ IRF-M	45.343.021,93
■ AÇÕES - EXTERIOR	44.253.026,44	■ MULTIMERCADO - MODERADO	14.692.941,39	■ FIDC	11.176.472,21
■ AÇÕES - SETORIAIS	9.725.390,73	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	8.880.521,00	■ IDKA IPCA 2A	8.090.657,36
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.190.182,18	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.704.334,72	■ CDI	5.030.343,79
■ AÇÕES - INDEXADO	1.872.362,04	■ DISP. FINANCEIRA	211.935,68		



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

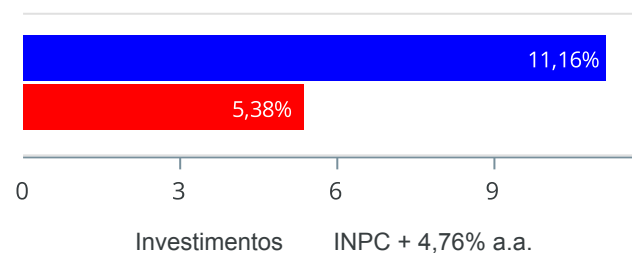
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.324,439138	10.048.181,87	14.703.093,07	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	13/12/2022	12.000	3959,170000	4.291,374699	47.510.040,00	51.496.496,39	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.450,932385	14.651.394,86	15.355.716,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.450,932385	7.520.551,00	14.242.983,63	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.450,932385	13.087.396,08	17.803.729,54	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.450,932385	25.480.686,71	26.705.594,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.450,932385	36.097.639,50	37.832.925,27	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.450,932385	55.208.154,53	57.862.121,01	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.538,976307	24.699.419,65	27.233.857,84	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.538,976307	20.000.340,99	22.354.458,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.538,976307	20.609.488,43	23.035.304,76	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.538,976307	25.008.464,96	28.141.653,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.490,590731	25.347.747,49	26.943.544,39	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.490,590731	41.512.279,91	44.905.907,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.490,590731	25.038.468,13	28.290.721,61	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/04/2022	12.000	4159,261023	4.490,590731	49.911.132,28	53.887.088,77	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	16/05/2023	10.000	428.739,166800	4.564,926919	4.287.391.668,00	45.649.269,19	Mercado



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	1.521.923.415,51	19.745.851,98	15.034.568,84	1.539.330.940,80	12.696.242,15	12.696.242,15	0,83%	0,83%	0,87%	0,87%	95,74%	5,49%
Fevereiro	1.539.330.940,80	164.546.755,80	162.749.949,62	1.532.011.715,31	-9.116.031,67	3.580.210,48	-0,59%	0,24%	1,11%	1,98%	11,86%	4,56%
Março	1.532.011.715,31	42.891.324,38	37.407.841,36	1.558.225.520,96	20.730.322,63	24.310.533,11	1,35%	1,59%	1,07%	3,07%	51,64%	4,33%
Abril	1.558.225.520,96	42.954.742,00	43.288.697,99	1.584.077.622,79	26.186.057,82	50.496.590,93	1,68%	3,29%	0,86%	3,96%	83,10%	3,89%
Mai	1.584.077.622,79	143.992.950,33	149.974.636,62	1.622.403.232,64	44.307.296,14	94.803.887,07	2,80%	6,18%	0,77%	4,76%	129,83%	3,88%
Junho	1.622.403.232,64	20.114.029,88	12.907.496,29	1.682.737.151,27	53.127.385,04	147.931.272,11	3,26%	9,64%	0,29%	5,06%	190,45%	4,10%
Julho	1.682.737.151,27	14.500.000,00	12.269.261,90	1.708.274.197,17	23.306.307,80	171.237.579,91	1,38%	11,16%	0,30%	5,38%	207,57%	3,74%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





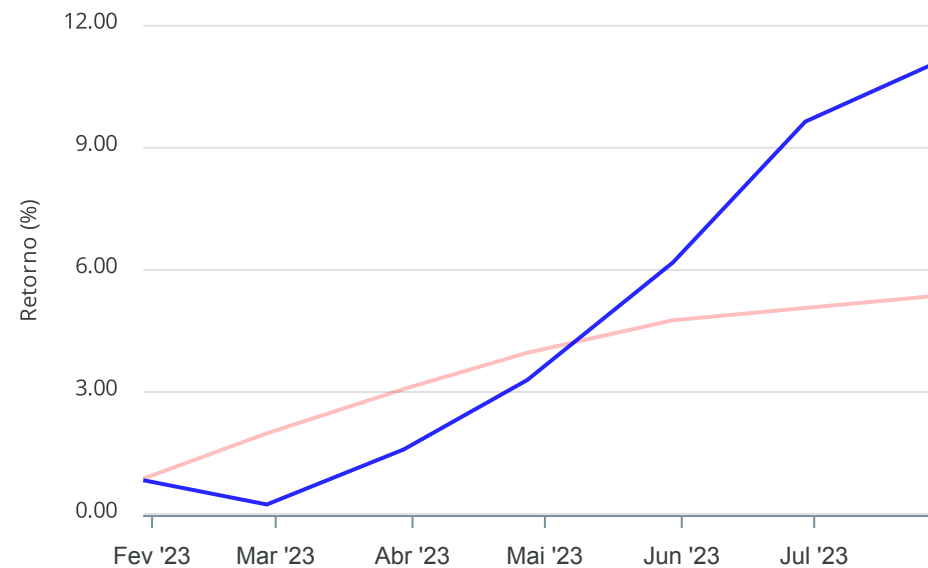
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	55.277,22	0,00	20.101,85	56.824,29	21.648,92	39,16%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	7.970.910,76	0,00	0,00	8.090.657,36	119.746,60	1,50%	1,50%	1,12%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.215.417,00	0,00	0,00	16.426.960,50	211.543,50	1,30%	1,30%	3,03%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	10.983.571,17	0,00	0,00	11.119.647,91	136.076,74	1,24%	1,24%	0,00%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	33.466.324,75	0,00	0,00	33.788.293,55	321.968,80	0,96%	0,96%	0,72%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	75.656.486,10	0,00	0,00	76.378.010,55	721.524,45	0,95%	0,95%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	38.621.296,93	0,00	0,00	38.988.814,84	367.517,91	0,95%	0,95%	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.528.779,27	0,00	0,00	12.647.820,55	119.041,28	0,95%	0,95%	0,74%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	36.916.969,62	0,00	0,00	37.266.879,89	349.910,27	0,95%	0,95%	0,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.245.257,92	0,00	0,00	11.346.250,23	100.992,31	0,90%	0,90%	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	33.638.247,12	0,00	0,00	33.938.651,58	300.404,46	0,89%	0,89%	1,04%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.755.447,29	0,00	0,00	3.788.821,19	33.373,90	0,89%	0,89%	1,46%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.251.175,82	0,00	0,00	14.376.938,16	125.762,34	0,88%	0,88%	1,08%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.016.429,10	0,00	0,00	14.139.457,78	123.028,68	0,88%	0,88%	1,08%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	17.750.412,06	0,00	0,00	17.896.600,38	146.188,32	0,82%	0,82%	1,58%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	43.930.695,94	0,00	0,00	44.281.482,15	350.786,21	0,80%	0,80%	1,58%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	22.964.376,80	0,00	0,00	23.147.067,10	182.690,30	0,80%	0,80%	1,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	69.317.237,44	0,00	0,00	69.862.465,84	545.228,40	0,79%	0,79%	0,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	16.696.444,21	0,00	0,00	16.826.625,99	130.181,78	0,78%	0,78%	1,06%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.291.477,89	0,00	0,00	16.416.963,95	125.486,06	0,77%	0,77%	1,58%



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
TÍTULOS PÚBLICOS	532.552.263,40	0,00	0,00	536.444.465,22	3.892.201,82	0,73%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.951.808,14	0,00	0,00	2.972.286,30	20.478,16	0,69%	0,69%	1,58%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	2.584.826,95	14.500.000,00	12.150.000,00	5.030.343,79	95.516,84	0,56%	1,13%	0,02%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	1.034.361.132,91	14.500.000,00	12.170.101,85	1.045.232.329,11	8.541.298,05	0,82%		1,00%

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	22.920.736,19	0,00	0,00	24.274.645,81	1.353.909,62	5,91%	5,91%	8,17%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.856.485,09	0,00	0,00	11.367.528,64	511.043,55	4,71%	4,71%	9,32%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.700.000,00	0,00	26.000,00	4.887.000,00	213.000,00	4,53%	4,56%	15,45%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.465.681,66	0,00	0,00	5.704.334,72	238.653,06	4,37%	4,37%	4,30%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	43.765.361,56	0,00	0,00	45.568.521,36	1.803.159,80	4,12%	4,12%	8,72%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.347.654,89	0,00	0,00	9.725.390,73	377.735,84	4,04%	4,04%	6,98%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	12.052.818,73	0,00	0,00	12.536.909,74	484.091,01	4,02%	4,02%	8,62%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.119.432,77	0,00	0,00	4.280.108,08	160.675,31	3,90%	3,90%	7,84%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	46.051.277,36	0,00	0,00	47.743.909,50	1.692.632,14	3,68%	3,68%	3,75%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.523.474,91	0,00	0,00	9.869.497,25	346.022,34	3,63%	3,63%	7,93%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	34.410.828,85	0,00	0,00	35.653.690,52	1.242.861,67	3,61%	3,61%	7,34%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	34.711.228,60	0,00	0,00	35.915.692,00	1.204.463,40	3,47%	3,47%	7,71%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.953.951,11	0,00	0,00	7.190.182,18	236.231,07	3,40%	3,40%	7,48%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATÉGIA	829.237,15	0,00	0,00	857.403,11	28.165,96	3,40%	3,40%	8,81%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.819.327,99	0,00	0,00	1.875.077,37	55.749,38	3,06%	3,06%	7,52%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.696.662,07	0,00	0,00	16.151.001,91	454.339,84	2,89%	2,89%	6,91%
OCCAM FIC AÇÕES	13.997.302,11	0,00	0,00	14.396.906,64	399.604,53	2,85%	2,85%	8,94%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	16.164.138,41	0,00	0,00	16.607.562,18	443.423,77	2,74%	2,74%	6,66%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	29.408.653,61	0,00	0,00	30.177.002,46	768.348,85	2,61%	2,61%	7,35%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	14.105.995,16	0,00	0,00	14.411.563,57	305.568,41	2,17%	2,17%	4,91%

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
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	14.034.763,34	0,00	0,00	14.314.080,61	279.317,27	1,99%	1,99%	4,10%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	23.387.807,81	0,00	0,00	23.831.836,03	444.028,22	1,90%	1,90%	6,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	8.204.602,02	0,00	0,00	8.346.351,71	141.749,69	1,73%	1,73%	3,32%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	12.646.853,56	0,00	0,00	12.781.927,36	135.073,80	1,07%	1,07%	0,38%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	21.555.475,24	0,00	0,00	21.746.560,75	191.085,51	0,89%	0,89%	0,59%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.570.865,41	0,00	0,00	14.692.941,39	122.075,98	0,84%	0,84%	1,54%
XP INVESTOR FI AÇÕES	11.589.984,97	0,00	0,00	11.682.204,85	92.219,88	0,80%	0,80%	6,48%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	16.919.055,37	0,00	0,00	16.978.819,44	59.764,07	0,35%	0,35%	5,36%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.448.356,02	0,00	38.621,49	22.449.572,14	39.837,61	0,18%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	579.920,96	0,00	0,00	579.704,97	-215,99	-0,04%	-0,04%	0,03%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	12.216.769,03	0,00	0,00	12.212.010,06	-4.758,97	-0,04%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.482.588,01	0,00	0,00	20.447.893,02	-34.694,99	-0,17%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	7.869.564,81	0,00	0,00	7.852.920,21	-16.644,60	-0,21%	-	-
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.880.544,05	0,00	0,00	1.872.362,04	-8.182,01	-0,44%	-0,44%	4,55%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	601.507,88	0,00	0,00	596.712,41	-4.795,47	-0,80%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	98.070,75	0,00	0,00	95.861,82	-2.208,93	-2,25%	-2,25%	0,11%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.080.106,34	0,00	0,00	1.950.783,52	-129.322,82	-6,22%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.316.240,67	0,00	34.538,56	3.993.521,00	-288.181,11	-6,68%	-6,73%	12,00%
Total Renda Variável	532.383.324,46	0,00	99.160,05	545.619.991,10	13.335.826,69	2,50%		6,31%

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
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	14.264.265,84	0,00	0,00	14.680.640,22	416.374,38	2,92%	1,98%	4,99%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	20.091.848,18	0,00	0,00	20.502.444,56	410.596,38	2,04%	2,04%	5,56%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	12.918.183,89	0,00	0,00	13.170.661,58	252.477,69	1,95%	1,95%	5,46%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	23.675.665,00	0,00	0,00	24.125.839,38	450.174,38	1,90%	1,90%	4,45%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.349.620,91	0,00	0,00	5.446.546,84	96.925,93	1,81%	1,81%	6,18%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.876.448,74	0,00	0,00	15.140.714,04	264.265,30	1,78%	1,78%	4,18%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.242.499,93	0,00	0,00	4.287.548,38	45.048,45	1,06%	1,06%	4,49%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	10.874.902,20	0,00	0,00	10.686.508,47	-188.393,73	-1,73%	-1,73%	4,28%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	9.699.259,21	0,00	0,00	9.380.973,49	-318.285,72	-3,28%	-3,28%	7,46%
Total Exterior	115.992.693,90	0,00	0,00	117.421.876,96	1.429.183,06	1,23%		5,10%

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 ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

