

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			527.225.814,50	31,11%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	70.588.375,18	4,16%	686	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.721.289,31	0,75%	790	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	16.948.493,31	1,00%	577	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	34.152.701,33	2,02%	793	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	39.221.612,35	2,31%	924	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.482.175,50	0,85%	409	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	33.991.189,00	2,01%	18	10,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.959.581,05	0,17%	1.677	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	76.830.800,47	4,53%	117	6,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	44.103.480,08	2,60%	67	10,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.242.548,30	0,84%	26	1,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.775.639,57	0,22%	4.123	2,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	16.342.396,04	0,96%	243	1,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	37.482.559,57	2,21%	148	3,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.056.600,05	1,36%	95	4,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	17.834.870,03	1,05%	231	1,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.388.264,32	0,67%	213	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	16.182.693,00	0,95%	14	11,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	8.156.805,91	0,48%	31	3,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '



Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 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	12.370.622,28	0,73%	469	0,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	D+45 a ...	01/08/2016	11.266.676,16	0,66%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	56.439,73	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	11.994.008,35	0,71%	50.967	1,01%	Artigo 8º, Inciso I
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	33.592.116,55	1,98%	11	7,22%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	10.668.787,69	0,63%	3.565	3,97%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	42.725.427,83	2,52%	2.982	3,35%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	9.297.686,96	0,55%	39	0,73%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	9.393.883,63	0,55%	4.732	2,53%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.740.366,17	0,10%	2.417	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	23.020.788,05	1,36%	201	3,18%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	16.034.858,89	0,95%	151	1,72%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	34.069.883,50	2,01%	122	5,07%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	15.659.718,22	0,92%	202	6,43%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	28.684.081,89	1,69%	16.196	1,68%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.819.959,92	0,40%	37	1,54%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	13.566.915,30	0,80%	1.302	1,58%	Artigo 8º, Inciso I
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+7 du	Não há	1.895.661,11	0,11%	3	11,51%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	23.756.489,24	1,40%	55	1,40%	Artigo 8º, Inciso I



Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 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	4.082.459,65	0,24%	32	0,60%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	16.351.230,62	0,96%	3.261	4,89%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	11.169.126,19	0,66%	1.812	5,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	21.041.134,76	1,24%	103	1,73%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	13.503.242,82	0,80%	2	1,11%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.349.247,81	0,26%	1.530	5,99%	Artigo 9º, Inciso II
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO ...	D+11 du	Não há	14.660.435,15	0,86%	2	82,18%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	15.457.910,72	0,91%	4.562	2,45%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	5.517.546,73	0,33%	201	1,85%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO ...	D+8 du	Não há	10.577.721,66	0,62%	1.633	4,95%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+8 du	Não há	9.637.583,40	0,57%	466	4,51%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	11.564.150,46	0,68%	3.622	7,17%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	13.213.655,74	0,78%	66.577	0,89%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	47.316.805,77	2,79%	2.339	8,96%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	13.937.013,83	0,82%	83	12,91%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	5.576.425,90	0,33%	583	3,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	8.229.486,12	0,49%	155	7,29%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	12.886.143,12	0,76%	28	14,16%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	21.979.752,41	1,30%	21	9,71%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	13.928.518,71	0,82%	22	10,31%	Artigo 10º, Inciso I

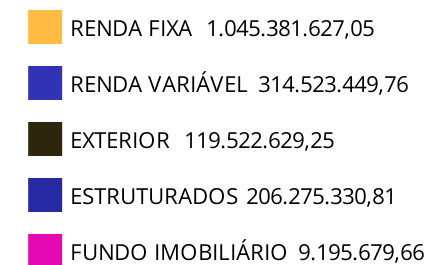
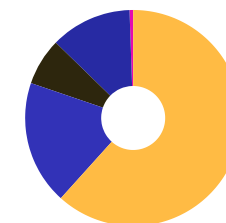


Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.685.057,49	0,87%	20	8,92%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	Não se ...	Não se aplica	579.571,00	0,03%	28	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	20.406.598,00	1,20%	99	0,70%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	93.482,19	0,01%	42	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	8.439.584,70	0,50%	38	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.969.403,83	0,12%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	22.594.136,86	1,33%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	592.818,23	0,03%	18	0,13%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	12.201.536,77	0,72%	46	18,02%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	D+0	Não há	858.995,88	0,05%	10	2,91%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	3.995.679,66	0,24%		3,26%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	5.200.000,00	0,31%		2,15%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.694.898.716,53				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			293.064,56				Artigo 6º
PL Total			1.695.191.781,09				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 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%	527.225.814,50	31,11%	17,00%	32,00%	100,00%	1.167.672.902,03
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	364.017.885,45	21,48%	10,00%	20,00%	100,00%	1.330.880.831,08
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.694.898.716,53
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	84.744.935,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	142.814.811,20	8,43%	1,00%	7,00%	60,00%	874.124.418,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.016.939.229,92
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	338.979.743,31
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	11.323.115,90	0,67%	0,00%	0,00%	5,00%	73.421.819,93
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	84.744.935,83
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	84.744.935,83
Total Renda Fixa	100,00%	1.045.381.627,05	61,68%	28,00%	59,00%	460,00%	



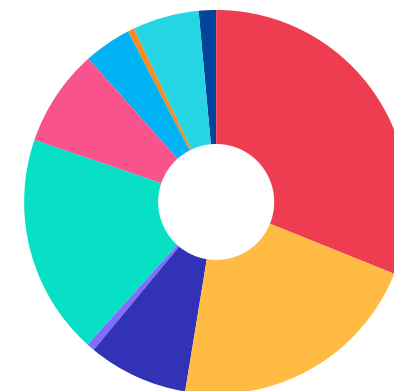
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



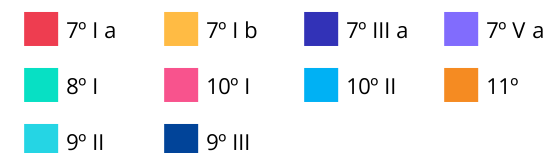


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2023)

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%	314.523.449,76	18,56%	6,00%	22,00%	35,00%	278.691.101,03
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	593.214.550,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	138.539.203,35	8,17%	1,00%	7,00%	10,00%	30.950.668,30
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	67.736.127,46	4,00%	1,00%	3,00%	5,00%	17.008.808,37
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	84.744.935,83
Artigo 11º	5,00%	9.195.679,66	0,54%	0,00%	0,00%	5,00%	75.549.256,17
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	529.994.460,23	31,27%	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%	94.744.823,05	5,59%	1,00%	7,00%	10,00%	74.745.048,60
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	24.777.806,20	1,46%	1,00%	2,00%	10,00%	144.712.065,45
Total Exterior	10,00%	119.522.629,25	7,05%	2,00%	9,00%	20,00%	





CRÉDITO
& MERCADO

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	527.225.814,50	31,11	-
CAIXA DTVM	206.559.815,50	12,19	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	163.005.361,85	9,62	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	160.538.815,05	9,47	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	91.488.923,78	5,40	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	62.691.902,48	3,70	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	60.539.159,62	3,57	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	49.057.171,94	2,89	-
ITAU DTVM	35.504.041,81	2,09	-
ICATU VANGUARDA	33.991.189,00	2,01	-
ARX INVESTIMENTOS	33.592.116,55	1,98	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	28.939.664,89	1,71	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	27.520.356,81	1,62	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	27.047.982,54	1,60	-
XP ASSET MANAGEMENT	24.564.552,87	1,45	-
TARPON INVESTIMENTOS	23.756.489,24	1,40	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	23.186.955,09	1,37	-
VINCI PARTNERS	17.142.992,30	1,01	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	15.845.724,17	0,93	-
OCCAM BRASIL	13.566.915,30	0,80	-
WESTERN ASSET	13.213.655,74	0,78	-
ALASKA ASSET MANAGEMENT	11.994.008,35	0,71	-
ITAU UNIBANCO	11.564.150,46	0,68	-
OLIVEIRA TRUST	11.266.676,16	0,66	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.517.546,73	0,33	-

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 '	527.225.814,50	31,11	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	364.017.885,45	21,48	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 '	142.814.811,20	8,43	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	11.323.115,90	0,67	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	314.523.449,76	18,56	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	94.744.823,05	5,59	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	24.777.806,20	1,46	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	138.539.203,35	8,17	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	67.736.127,46	4,00	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	9.195.679,66	0,54	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 Agosto/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	1,25%	9,74%	3,63%	7,32%	14,92%	28,16%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	1,32%	10,31%	3,85%	7,76%	15,82%	30,66%	0,00%	0,31%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,46%	11,39%	4,21%	8,53%	17,53%	34,05%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,68%	-52,83%	-18,48%	-19,24%	147,14%	321,18%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	0,61%	8,75%	2,66%	5,76%	11,97%	23,03%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,59%	8,58%	2,60%	5,64%	11,72%	22,51%	0,94%	0,02%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	0,60%	8,59%	2,58%	5,65%	11,43%	22,21%	0,93%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,60%	8,67%	2,60%	5,72%	11,81%	22,71%	0,94%	0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,58%	8,58%	2,58%	5,65%	11,66%	22,12%	0,91%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	8,63%	2,58%	5,68%	11,73%	22,46%	0,95%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,38%	11,84%	2,83%	10,43%	13,76%	20,07%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,35%	11,82%	2,86%	10,57%	13,46%	19,55%	1,75%	0,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,39%	11,92%	2,79%	10,53%	13,59%	19,32%	1,71%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45%	11,66%	2,71%	10,34%	13,48%	19,44%	1,77%	0,05%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,35%	9,68%	2,40%	7,98%	11,58%	14,64%	1,66%	0,05%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,40%	11,66%	2,78%	10,30%	13,48%	19,48%	1,74%	0,05%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,43%	11,76%	2,78%	10,43%	13,29%	19,18%	1,72%	0,05%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	0,76%	11,43%	3,81%	9,56%	14,96%	22,06%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	11,10%	3,63%	9,30%	14,47%	21,30%	1,05%	0,03%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	11,25%	3,74%	9,42%	14,65%	21,46%	1,05%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	11,33%	3,76%	9,45%	14,84%	21,77%	1,04%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,33%	9,01%	3,65%	7,01%	13,83%	26,19%	0,06%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	10,75%	3,67%	8,97%	14,02%	22,87%	0,10%	0,02%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	900,00%	0,00%	-	-	0,00%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,23%	3,23%	0,27%	1,83%	4,61%	13,74%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,63%	9,92%	3,67%	7,75%	13,76%	23,41%	0,58%	0,01%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,82%	-	1,75%	-	-	-	1,60%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,37%	11,68%	3,52%	9,87%	12,79%	24,05%	1,25%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	-1,49%	-	1,40%	7,27%	-	-	3,19%	-



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	0,82%	8,01%	3,19%	5,71%	11,59%	23,81%	0,38%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	-5,09%	5,47%	6,84%	10,30%	5,68%	-2,56%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	-1,40%	-	2,52%	-	-	-	2,80%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	-2,24%	13,26%	6,88%	11,13%	19,68%	-	3,76%	0,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	-3,29%	4,53%	2,99%	5,05%	-5,13%	-	4,30%	0,07%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	-0,05%	2,06%	-0,01%	1,55%	1,15%	-	1,56%	0,05%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,33%	17,04%	8,67%	19,35%	16,34%	19,10%	6,05%	0,21%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,62%	10,34%	9,34%	14,26%	4,33%	-6,98%	7,45%	0,23%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-2,14%	29,39%	14,14%	29,69%	27,48%	48,69%	7,37%	0,22%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,40%	11,93%	8,05%	15,08%	7,42%	9,18%	6,67%	0,19%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-2,69%	4,72%	3,18%	5,54%	6,91%	-	3,07%	0,07%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,18%	2,03%	4,64%	4,03%	-2,33%	-28,58%	6,91%	0,20%
OCCAM FIC AÇÕES	-5,77%	1,34%	6,76%	5,41%	-0,36%	-5,56%	6,59%	0,19%
BB AGRO FIC AÇÕES	-3,41%	1,03%	6,38%	3,48%	-2,53%	2,21%	6,57%	0,16%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-5,15%	5,19%	5,98%	9,32%	4,45%	-6,38%	6,05%	0,20%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-6,15%	3,95%	8,03%	8,06%	0,15%	-10,75%	8,01%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,95%	-3,99%	2,67%	0,58%	-2,10%	-13,16%	4,56%	0,19%
XP INVESTOR FI AÇÕES	-4,39%	8,47%	4,49%	11,18%	1,99%	7,51%	5,23%	0,20%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,78%	0,26%	6,07%	8,21%	-2,61%	-8,70%	6,38%	0,20%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-5,14%	5,41%	6,37%	9,72%	2,29%	-4,62%	6,76%	0,21%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,70%	9,12%	4,63%	11,06%	3,31%	16,03%	4,96%	0,19%
IDIV (Benchmark)	-2,83%	9,22%	8,71%	11,58%	10,64%	15,38%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,04%	9,57%	8,95%	13,25%	9,27%	11,41%	6,00%	0,19%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,45%	9,24%	7,22%	12,59%	9,27%	6,96%	5,71%	0,18%
IFIX (Benchmark)	0,49%	12,06%	6,62%	14,40%	7,95%	16,84%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	0,05%	-3,14%	-2,58%	9,85%	-11,82%	-26,61%	10,07%	0,25%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-1,77%	17,40%	7,84%	13,54%	13,97%	-0,33%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-0,90%	23,69%	10,02%	18,33%	29,21%	22,85%	5,72%	0,18%
SMLL (Benchmark)	-7,43%	8,13%	3,26%	17,40%	-1,94%	-23,76%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,79%	6,75%	6,16%	9,59%	0,68%	-13,76%	7,58%	0,18%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-6,24%	6,99%	6,37%	10,14%	0,90%	-14,13%	8,39%	0,19%
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,52%	13,31%	3,84%	9,20%	20,30%	50,42%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-2,48%	-35,74%	-14,45%	-18,88%	-47,89%	-95,03%	0,04%	0,22%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,76%	7,32%	1,74%	4,84%	10,88%	27,80%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,20%	15,89%	-0,63%	16,12%	15,41%	66,13%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	0,64%	-5,23%	1,21%	0,60%	-7,16%	-5,20%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	-1,18%	9,42%	-1,60%	9,76%	5,79%	-	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	7,99%	1,98%	5,34%	11,93%	30,22%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	6,41%	-13,32%	11,88%	6,12%	22,35%	49,00%	23,35%	0,59%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,94%	8,67%	2,22%	5,83%	12,98%	32,66%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,09%	-3,77%	-0,02%	-3,70%	-2,32%	18,34%	-	-
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,06%	9,67%	2,57%	6,56%	14,55%	36,37%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,02%	47,79%	-2,74%	47,97%	47,52%	20,41%	0,00%	0,47%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,07%	9,48%	3,85%	7,63%	-	-	0,64%	-
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1,24%	-4,31%	-3,59%	-2,01%	-	-	4,25%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-



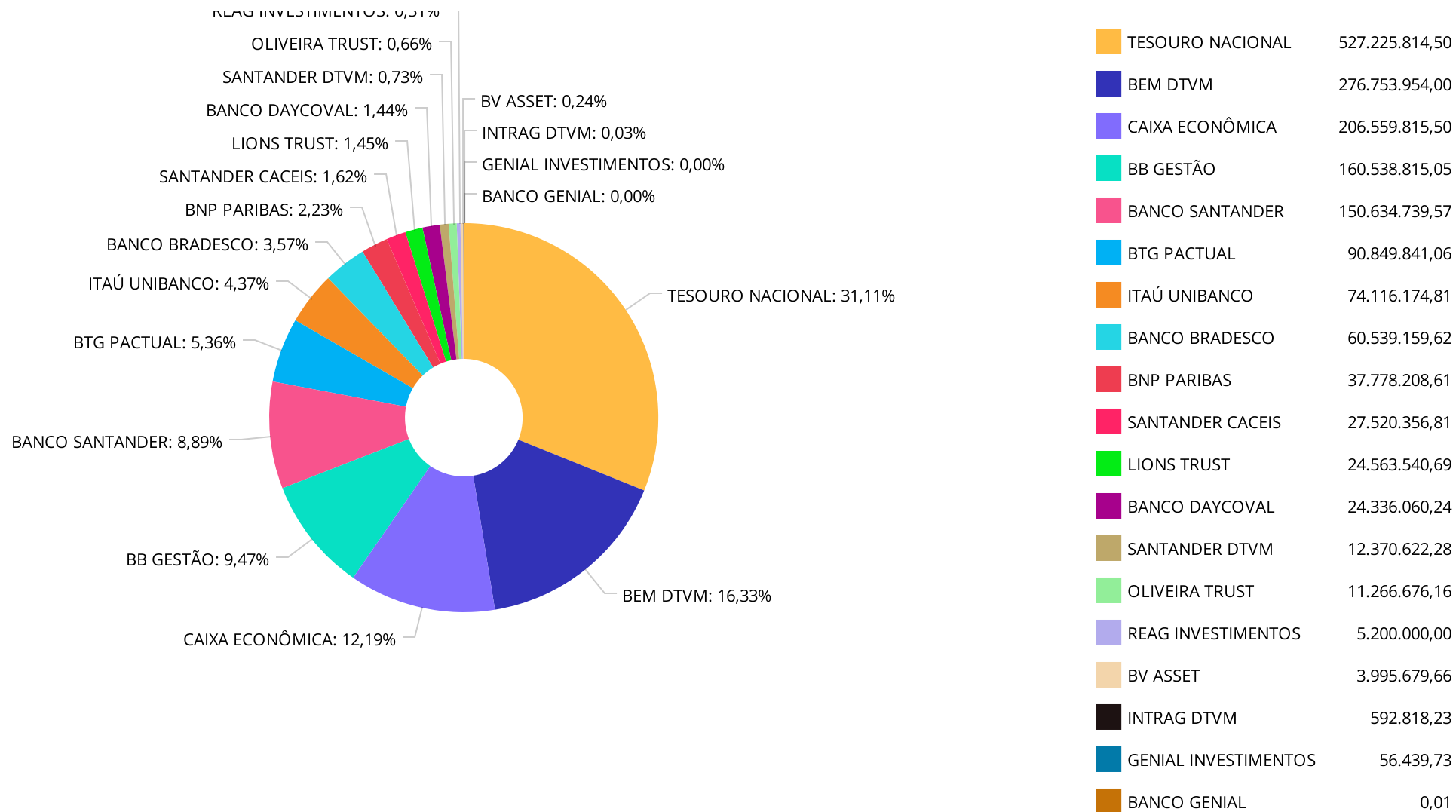
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	0,19%	-	1,10%	-	-	-	2,47%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	0,96%	-2,10%	-4,42%	-3,97%	-4,90%	-60,72%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,65%	-6,77%	-1,96%	-4,29%	-	-	-	-

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

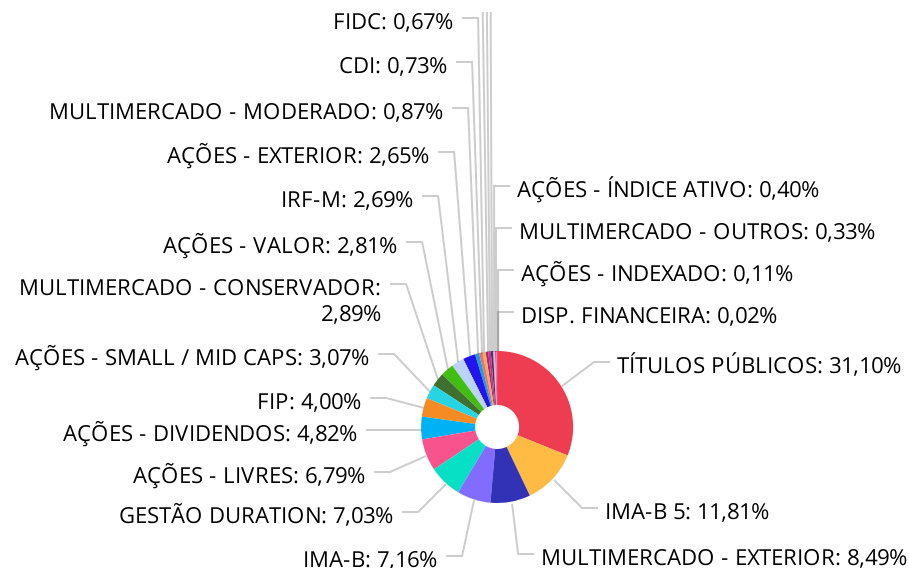
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	3,26%	21,43%	5,97%	15,02%	15,64%	-2,06%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,20%	24,50%	4,58%	15,55%	17,44%	-13,80%	8,50%	24,349%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	2,72%	4,50%	3,60%	5,19%	5,66%	-0,24%	8,29%	19,686%
MSCI WORLD (Benchmark)	1,15%	8,22%	2,98%	3,96%	8,01%	-9,04%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,63%	9,22%	3,26%	3,85%	11,71%	-0,73%	7,32%	21,708%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2,09%	4,97%	3,10%	2,54%	7,73%	-15,57%	5,87%	18,367%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,73%	6,92%	2,53%	3,09%	6,36%	-11,42%	-	-
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	1,44%	3,89%	2,93%	3,60%	6,19%	-9,81%	6,73%	20,717%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1,30%	6,09%	0,49%	3,91%	9,30%	-10,65%	7,87%	22,651%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	2,74%	-17,15%	-5,21%	-14,59%	-15,12%	3,83%	9,57%	20,325%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULT...	-1,02%	-8,07%	-1,17%	-7,07%	-4,95%	25,08%	6,51%	13,877%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	-0,14%	3,36%	-1,36%	-4,73%	7,68%	-	6,85%	18,912%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIM...	2,53%	8,55%	3,05%	3,49%	-	-	7,20%	-

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





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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	527.225.814,50	■ IMA-B 5	200.247.450,70	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	143.863.399,35
■ IMA-B	121.295.678,77	■ GESTÃO DURATION	119.088.921,88	■ AÇÕES - LIVRES	115.116.107,23
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	81.637.924,28	■ FIP	67.736.127,46	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	52.023.114,79
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	48.981.161,78	■ AÇÕES - VALOR	47.636.798,80	■ IRF-M	45.673.217,11
■ AÇÕES - EXTERIOR	44.955.788,08	■ MULTIMERCADO - MODERADO	14.685.057,49	■ CDI	12.370.622,28
■ FIDC	11.323.115,90	■ AÇÕES - SETORIAIS	9.393.883,63	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	9.195.679,66
■ IDKA IPCA 2A	8.156.805,91	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.819.959,92	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.576.425,90
■ AÇÕES - INDEXADO	1.895.661,11	■ DISP. FINANCEIRA	293.064,56		



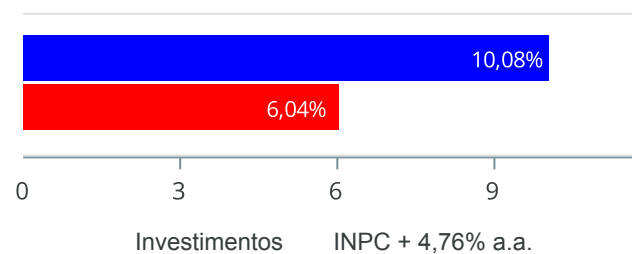
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2023)

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	4.232,051048	10.048.181,87	14.388.973,56	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	13/12/2022	12.000	3959,170000	4.309,369858	47.510.040,00	51.712.438,30	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.421,601238	14.651.394,86	15.254.524,27	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.421,601238	7.520.551,00	14.149.123,96	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.421,601238	13.087.396,08	17.686.404,95	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.421,601238	25.480.686,71	26.529.607,43	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.421,601238	36.097.639,50	37.583.610,52	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.421,601238	55.208.154,53	57.480.816,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.378,884829	24.699.419,65	26.273.308,97	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.378,884829	20.000.340,99	21.566.007,78	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.378,884829	20.609.488,43	22.222.840,51	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.378,884829	25.008.464,96	27.149.085,94	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.420,749309	25.347.747,49	26.524.495,85	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.420,749309	41.512.279,91	44.207.493,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.420,749309	25.038.468,13	27.850.720,65	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/04/2022	12.000	4159,261023	4.420,749309	49.911.132,28	53.048.991,71	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	16/05/2023	10.000	428.739,166800	4.359,737091	4.287.391.668,00	43.597.370,91	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%
Agosto	1.708.274.197,17	29.708.078,12	26.370.545,70	1.694.898.716,53	-16.713.013,06	154.524.566,85	-0,98%	10,08%	0,63%	6,04%	166,90%	3,72%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

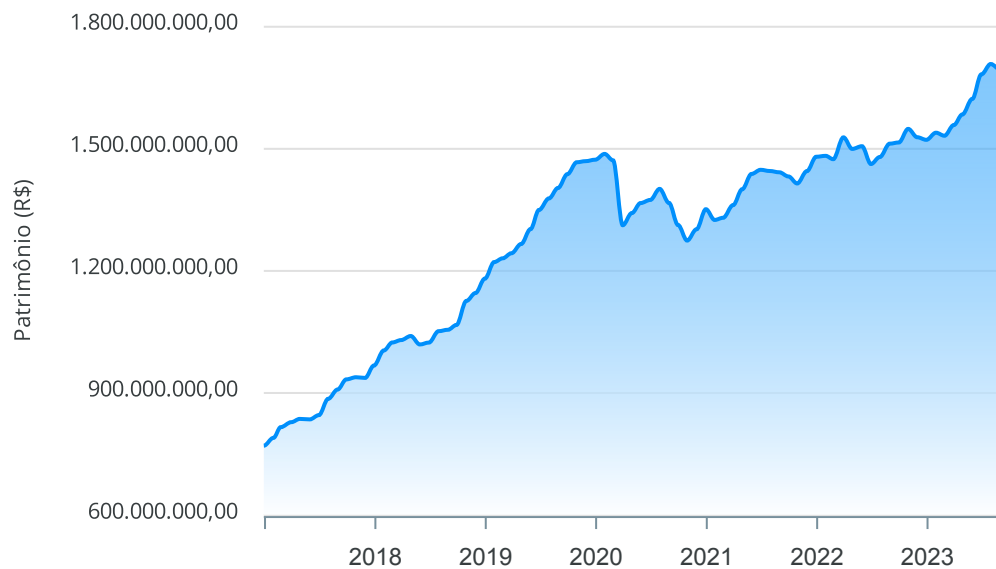




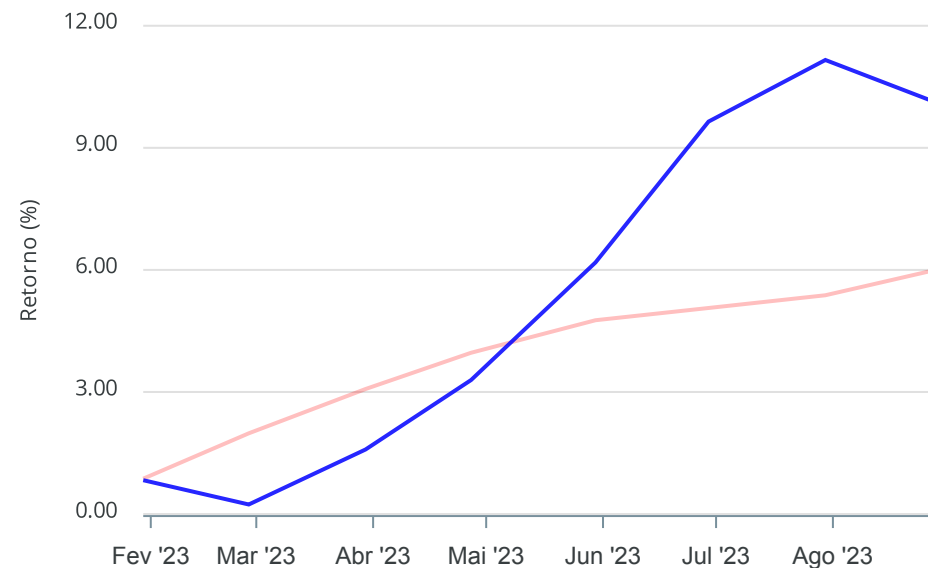
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/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	56.824,29	0,00	11.545,45	56.439,73	11.160,89	19,64%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	11.119.647,91	0,00	0,00	11.266.676,16	147.028,25	1,32%	1,32%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	69.862.465,84	0,00	0,00	70.588.375,18	725.909,34	1,04%	1,04%	0,10%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.030.343,79	16.105.000,00	8.950.000,00	12.370.622,28	185.278,49	0,88%	1,33%	0,06%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	8.090.657,36	0,00	0,00	8.156.805,91	66.148,55	0,82%	0,82%	1,60%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.376.938,16	0,00	0,00	14.482.175,50	105.237,34	0,73%	0,73%	1,04%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.139.457,78	0,00	0,00	14.242.548,30	103.090,52	0,73%	0,73%	1,05%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	16.826.625,99	0,00	0,00	16.948.493,31	121.867,32	0,72%	0,72%	1,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	33.938.651,58	0,00	0,00	34.152.701,33	214.049,75	0,63%	0,63%	0,58%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	33.788.293,55	0,00	0,00	33.991.189,00	202.895,45	0,60%	0,60%	0,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	38.988.814,84	0,00	0,00	39.221.612,35	232.797,51	0,60%	0,60%	0,94%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	76.378.010,55	0,00	0,00	76.830.800,47	452.789,92	0,59%	0,59%	0,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.647.820,55	0,00	0,00	12.721.289,31	73.468,76	0,58%	0,58%	0,95%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	37.266.879,89	0,00	0,00	37.482.559,57	215.679,68	0,58%	0,58%	0,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.346.250,23	0,00	0,00	11.388.264,32	42.014,09	0,37%	0,37%	1,25%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	17.896.600,38	0,00	0,00	17.834.870,03	-61.730,35	-0,34%	-0,34%	1,75%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.788.821,19	0,00	0,00	3.775.639,57	-13.181,62	-0,35%	-0,35%	1,66%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	23.147.067,10	0,00	0,00	23.056.600,05	-90.467,05	-0,39%	-0,39%	1,71%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	44.281.482,15	0,00	0,00	44.103.480,08	-178.002,07	-0,40%	-0,40%	1,74%



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.972.286,30	0,00	0,00	2.959.581,05	-12.705,25	-0,43%	-0,43%	1,72%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.416.963,95	0,00	0,00	16.342.396,04	-74.567,91	-0,45%	-0,45%	1,77%
TÍTULOS PÚBLICOS	536.444.465,22	0,00	4.346.303,03	527.225.814,50	-4.872.347,69	-0,91%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.426.960,50	0,00	0,00	16.182.693,00	-244.267,50	-1,49%	-1,49%	3,19%
Total Renda Fixa	1.045.232.329,11	16.105.000,00	13.307.848,48	1.045.381.627,05	-2.647.853,58	-0,25%		1,02%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.887.000,00	0,00	26.000,00	5.200.000,00	339.000,00	6,94%	6,97%	23,35%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.872.362,04	0,00	0,00	1.895.661,11	23.299,07	1,24%	1,24%	4,25%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	21.746.560,75	0,00	0,00	21.979.752,41	233.191,66	1,07%	1,07%	0,64%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	3.993.521,00	0,00	36.697,22	3.995.679,66	38.855,88	0,97%	0,98%	10,07%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	1.950.783,52	0,00	0,00	1.969.403,83	18.620,31	0,95%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	12.781.927,36	0,00	0,00	12.886.143,12	104.215,76	0,82%	0,82%	0,38%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.449.572,14	0,00	0,00	22.594.136,86	144.564,72	0,64%	-	-
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	857.403,11	0,00	0,00	858.995,88	1.592,77	0,19%	0,19%	2,47%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	579.704,97	0,00	0,00	579.571,00	-133,97	-0,02%	-0,02%	0,00%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.692.941,39	0,00	0,00	14.685.057,49	-7.883,90	-0,05%	-0,05%	1,56%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	12.212.010,06	0,00	0,00	12.201.536,77	-10.473,29	-0,09%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	7.852.920,21	603.078,12	0,00	8.439.584,70	-16.413,63	-0,19%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.447.893,02	0,00	0,00	20.406.598,00	-41.295,02	-0,20%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	596.712,41	0,00	0,00	592.818,23	-3.894,18	-0,65%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	47.743.909,50	0,00	0,00	47.316.805,77	-427.103,73	-0,89%	-0,89%	5,72%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	8.346.351,71	0,00	0,00	8.229.486,12	-116.865,59	-1,40%	-1,40%	2,80%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	24.274.645,81	0,00	0,00	23.756.489,24	-518.156,57	-2,13%	-2,13%	7,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.704.334,72	0,00	0,00	5.576.425,90	-127.908,82	-2,24%	-2,24%	3,76%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	95.861,82	0,00	0,00	93.482,19	-2.379,63	-2,48%	-2,48%	0,04%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	14.314.080,61	0,00	0,00	13.928.518,71	-385.561,90	-2,69%	-2,69%	3,07%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	16.151.001,91	0,00	0,00	15.659.718,22	-491.283,69	-3,04%	-3,04%	6,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	14.411.563,57	0,00	0,00	13.937.013,83	-474.549,74	-3,29%	-3,29%	4,30%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	23.831.836,03	0,00	0,00	23.020.788,05	-811.047,98	-3,40%	-3,40%	6,67%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.725.390,73	0,00	0,00	9.393.883,63	-331.507,10	-3,41%	-3,41%	6,57%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	16.607.562,18	0,00	0,00	16.034.858,89	-572.703,29	-3,45%	-3,45%	5,71%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	16.978.819,44	0,00	0,00	16.351.230,62	-627.588,82	-3,70%	-3,70%	4,96%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	12.536.909,74	0,00	0,00	11.994.008,35	-542.901,39	-4,33%	-4,33%	6,05%
XP INVESTOR FI AÇÕES	11.682.204,85	0,00	0,00	11.169.126,19	-513.078,66	-4,39%	-4,39%	5,23%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.280.108,08	0,00	0,00	4.082.459,65	-197.648,43	-4,62%	-4,62%	7,45%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	30.177.002,46	0,00	0,00	28.684.081,89	-1.492.920,57	-4,95%	-4,95%	4,56%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	35.915.692,00	0,00	0,00	34.069.883,50	-1.845.808,50	-5,14%	-5,14%	6,76%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.190.182,18	0,00	0,00	6.819.959,92	-370.222,26	-5,15%	-5,15%	6,05%
OCCAM FIC AÇÕES	14.396.906,64	0,00	0,00	13.566.915,30	-829.991,34	-5,77%	-5,77%	6,59%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	35.653.690,52	0,00	0,00	33.592.116,55	-2.061.573,97	-5,78%	-5,78%	6,38%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.869.497,25	0,00	0,00	9.297.686,96	-571.810,29	-5,79%	-5,79%	7,58%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.367.528,64	0,00	0,00	10.668.787,69	-698.740,95	-6,15%	-6,15%	8,01%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	45.568.521,36	0,00	0,00	42.725.427,83	-2.843.093,53	-6,24%	-6,24%	8,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.875.077,37	0,00	0,00	1.740.366,17	-134.711,20	-7,18%	-7,18%	6,91%
Total Renda Variável	545.619.991,10	603.078,12	62.697,22	529.994.460,23	-16.165.911,77	-2,96%		5,78%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	9.380.973,49	0,00	0,00	9.637.583,40	256.609,91	2,74%	2,74%	9,57%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	20.502.444,56	0,00	0,00	21.041.134,76	538.690,20	2,63%	2,63%	7,32%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	13.170.661,58	0,00	0,00	13.503.242,82	332.581,24	2,53%	2,53%	7,20%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.140.714,04	0,00	0,00	15.457.910,72	317.196,68	2,09%	2,09%	5,87%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	24.125.839,38	0,00	13.000.000,00	11.564.150,46	438.311,08	1,82%	2,72%	8,29%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	13.000.000,00	0,00	13.213.655,74	213.655,74	1,64%	3,20%	8,50%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.287.548,38	0,00	0,00	4.349.247,81	61.699,43	1,44%	1,44%	6,73%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.446.546,84	0,00	0,00	5.517.546,73	70.999,89	1,30%	1,30%	7,87%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	14.680.640,22	0,00	0,00	14.660.435,15	-20.205,07	-0,14%	-0,14%	6,85%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	10.686.508,47	0,00	0,00	10.577.721,66	-108.786,81	-1,02%	-1,02%	6,51%
Total Exterior	117.421.876,96	13.000.000,00	13.000.000,00	119.522.629,25	2.100.752,29	1,61%		7,40%

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.

