

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

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	1.444.999,70	3,03%	682	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	285.031,08	0,60%	849	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	550.791,40	1,16%	783	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	322.485,06	0,68%	621	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	536.539,26	1,13%	385	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	1.306.562,87	2,74%	172	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	990.041,77	2,08%	222	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	1.772.392,32	3,72%	370	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.115.331,29	2,34%	308	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	581.567,86	1,22%	226	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	15/05/2025	1.692.943,42	3,56%	55	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	Não há	2.329.484,23	4,89%	66	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.086.966,30	4,38%	747	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	208.711,04	0,44%	813	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.523.828,31	3,20%	902	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.076.084,73	4,36%	739	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	686.319,12	1,44%	1.152	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.668.218,78	3,50%	414	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	398.148,26	0,84%	731	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	292.863,93	0,62%	203	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

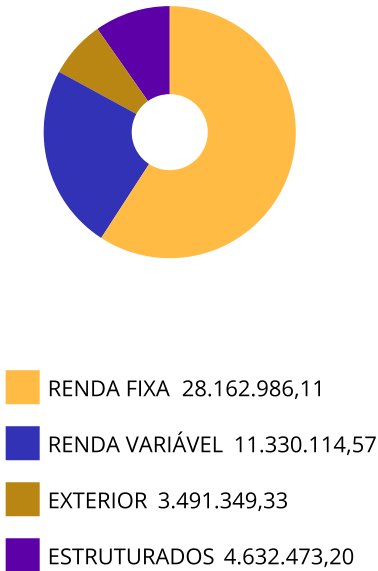
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.582.871,93	3,32%	234	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.091.739,25	2,29%	192	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.597.605,28	3,36%	461	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	2.021.458,92	4,25%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	934.194,09	1,96%	501	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.274.382,81	6,88%	2.433	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.518.907,82	3,19%	853	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.840.594,54	5,97%	123	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	456.700,37	0,96%	4.796	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	617.491,48	1,30%	11.470	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	930.894,53	1,95%	51	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	189.470,48	0,40%	256	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	567.478,45	1,19%	7.301	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	291.006,44	0,61%	40	0,08%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.388.591,05	2,92%	138	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.811.751,84	3,80%	448	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	734.959,03	1,54%	165	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	32.900,84	0,07%	4.293	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.616.179,09	5,49%	101	0,54%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC M...	D+2	Não há	751.930,69	1,58%	461	1,21%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	496.503,55	1,04%	4.568	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			47.616.923,21				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			9.475,35	Artigo 6º			
PL Total			47.626.398,56				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	7.142.538,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	21.869.310,73	45,93%	30,00%	40,00%	95,00%	23.366.766,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	65,00%	4.272.216,46	8,97%	10,00%	15,00%	60,00%	24.297.937,47
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	2.021.458,92	4,25%	0,00%	5,00%	20,00%	7.501.925,72
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.380.846,16
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.380.846,16
Total Renda Fixa	100,00%	28.162.986,11	59,14%	40,00%	65,00%	200,00%	

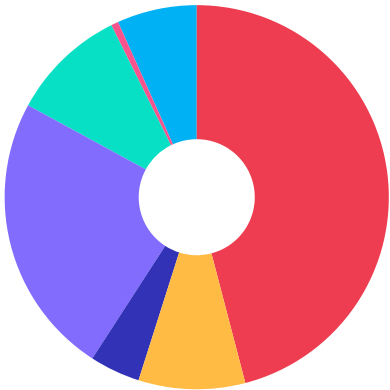


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



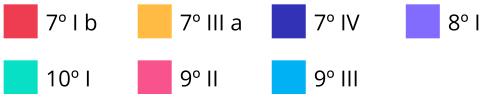
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	11.330.114,57	23,79%	11,00%	20,00%	35,00%	5.335.808,55
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	16.665.923,12
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.632.473,20	9,73%	5,00%	7,00%	10,00%	129.219,12
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.380.846,16
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.380.846,16
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	15.962.587,77	33,52%	16,00%	29,00%	90,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	291.006,44	0,61%	0,20%	1,00%	10,00%	4.470.685,88
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.200.342,89	6,72%	3,80%	5,00%	10,00%	1.561.349,43
Total Exterior	10,00%	3.491.349,33	7,33%	4,00%	6,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.761.692,32



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	21.869.310,73	45,93	30,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.272.216,46	8,97	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	2.021.458,92	4,25	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	11.330.114,57	23,79	11,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	291.006,44	0,61	0,20	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.200.342,89	6,72	3,80	10,00
Artigo 10º, Inciso I	4.632.473,20	9,73	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	26.490.677,36	55,63	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.506.588,06	34,67	-
ITAÚ UNIBANCO	2.021.458,92	4,25	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.841.249,94	3,87	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	567.478,45	1,19	-
PRÓPIO CAPITAL	189.470,48	0,40	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,83%	5,84%	2,29%	4,97%	9,72%	19,81%	-	-
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,70%	-	1,94%	-	-	-	0,99%	-
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,82%	-	-0,31%	-	-	-	0,36%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,70%	-	-	-	-	-	0,99%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	2,89%	1,93%	2,33%	6,20%	19,39%	1,36%	2,73%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,75%	3,98%	2,01%	3,15%	8,12%	19,52%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	3,70%	1,96%	2,95%	7,87%	19,26%	1,03%	1,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	3,90%	2,08%	3,17%	7,92%	19,47%	0,94%	1,75%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,94%	5,49%	2,37%	4,62%	10,81%	26,14%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	5,46%	2,32%	4,50%	10,64%	25,71%	0,28%	0,38%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,91%	4,27%	2,37%	3,56%	8,16%	20,37%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	4,13%	2,31%	3,45%	7,93%	20,02%	0,84%	1,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	4,12%	2,31%	3,44%	7,91%	19,88%	0,84%	1,74%

IMA-B (Benchmark)	2,09%	0,97%	2,45%	1,43%	4,38%	20,51%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,07%	0,82%	2,37%	1,30%	4,17%	20,10%	2,12%	3,91%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,05%	0,74%	2,36%	1,24%	3,97%	19,78%	2,10%	3,93%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	1,34%	2,87%	1,71%	2,19%	8,37%	26,19%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	2,71%	1,64%	2,03%	8,10%	25,75%	1,41%	2,57%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	2,70%	1,64%	2,03%	8,07%	25,34%	1,41%	2,57%
CDI (Benchmark)	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	4,91%	2,15%	4,03%	10,06%	25,62%	0,44%	0,60%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,00%	6,52%	2,69%	5,44%	12,15%	26,91%	0,07%	0,13%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	5,96%	2,50%	4,96%	11,19%	26,26%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,96%	6,25%	2,61%	5,19%	11,83%	27,22%	0,03%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,98%	3,79%	3,05%	2,65%	5,37%	9,12%	0,25%	3,86%
IPCA (Benchmark)	0,38%	2,87%	1,05%	2,44%	4,50%	8,67%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,88%	2,80%	1,43%	2,32%	7,03%	21,01%	0,56%	2,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	6,82%	3,08%	5,64%	11,37%	-	0,25%	0,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	6,76%	3,05%	5,59%	11,26%	22,27%	0,25%	0,84%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,96%	3,35%	1,85%	2,67%	7,47%	23,28%	0,64%	1,34%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,98%	3,72%	3,07%	2,58%	5,09%	-	0,25%	4,10%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,08%	3,88%	1,71%	3,10%	9,27%	24,18%	0,88%	1,57%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,34%	3,26%	1,85%	2,74%	8,42%	23,70%	1,70%	3,21%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,40%	0,50%	0,74%	0,28%	5,99%	22,37%	3,01%	4,44%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,62%	-0,33%	0,85%	0,36%	5,91%	21,77%	2,77%	4,97%

Global BDRX (Benchmark)	0,29%	41,47%	21,39%	35,02%	51,99%	65,02%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,51%	40,23%	20,99%	34,11%	49,78%	60,78%	10,12%	14,93%

Ibovespa (Benchmark)	3,02%	-4,87%	1,37%	-0,08%	4,68%	23,74%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2,85%	-6,80%	1,03%	-2,77%	-1,94%	10,98%	5,67%	13,93%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	2,04%	0,98%	1,65%	2,08%	8,23%	7,94%	2,64%	5,43%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2,63%	-1,12%	2,55%	2,18%	11,11%	31,39%	4,51%	11,61%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,16%	-5,94%	0,59%	-1,88%	2,09%	15,93%	4,70%	13,63%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	5,60%	-6,38%	0,42%	0,41%	-7,96%	14,27%	9,68%	19,12%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,13%	4,28%	3,86%	6,72%	15,06%	26,25%	5,45%	12,63%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	4,50%	-11,45%	0,34%	-5,56%	-12,66%	-11,16%	5,02%	16,95%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1,65%	-7,86%	-0,29%	-3,36%	0,51%	15,25%	5,20%	12,92%

IDIV (Benchmark)	1,89%	-1,58%	2,90%	2,00%	11,06%	31,85%	-	-
-------------------------	-------	--------	-------	-------	--------	--------	---	---

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA VARIÁVEL

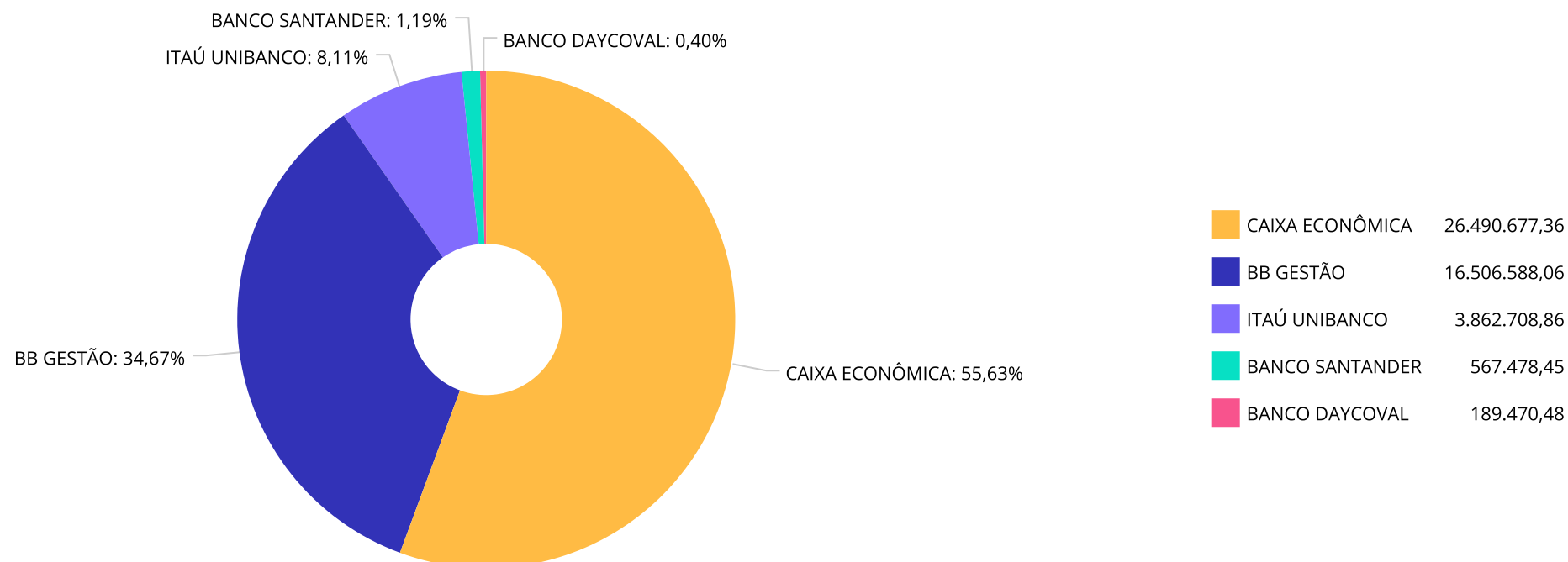
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,90%	-4,06%	0,14%	-2,37%	1,06%	25,89%	6,65%	14,78%
SMLL (Benchmark)	1,49%	-13,59%	-2,33%	-7,53%	-13,35%	1,79%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1,44%	-13,89%	-2,41%	-7,82%	-13,85%	0,43%	8,27%	19,28%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

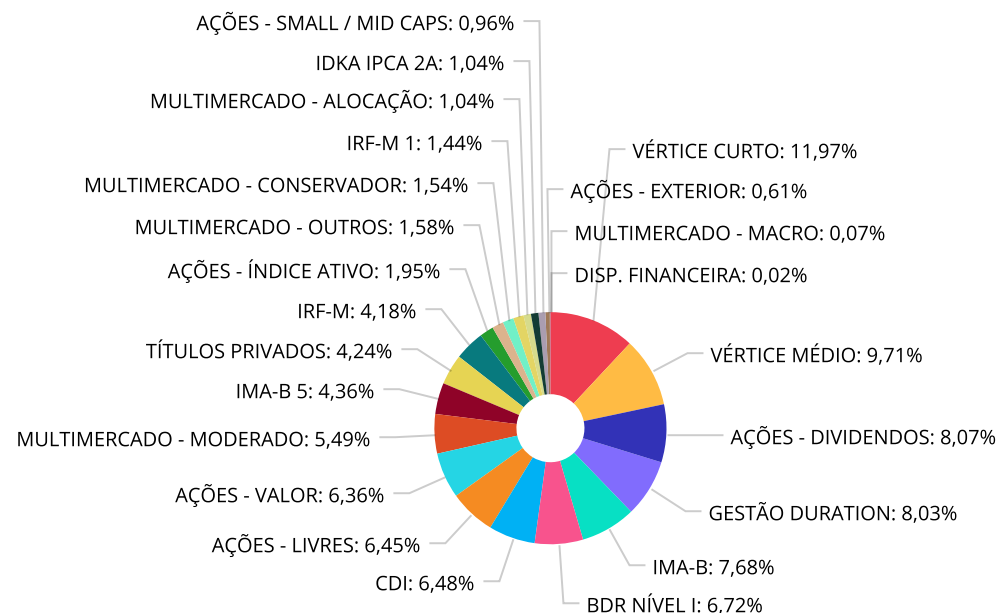
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,29%	41,47%	21,39%	35,02%	51,99%	65,02%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,51%	40,23%	20,99%	34,11%	49,78%	60,78%	10,12%	14,934%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,49%	29,54%	16,07%	24,15%	38,62%	45,10%	9,94%	14,619%

MSCI WORLD (Benchmark)	3,59%	31,80%	18,30%	27,37%	39,18%	41,92%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	2,25%	24,94%	13,31%	25,88%	28,14%	24,36%	7,07%	13,680%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Julho / 2024)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Julho / 2024)

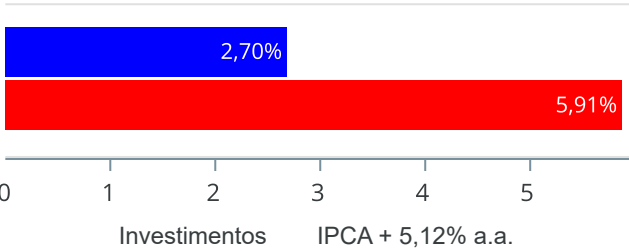


■ VÉRTICE CURTO	5.698.774,15	■ VÉRTICE MÉDIO	4.626.088,87	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.841.861,26	■ GESTÃO DURATION	3.824.829,93
■ IMA-B	3.658.956,66	■ BDR NÍVEL I	3.200.342,89	■ CDI	3.087.492,79	■ AÇÕES - LIVRES	3.070.593,39
■ AÇÕES - VALOR	3.030.065,02	■ MULTIMERCADO - MODERADO	2.616.179,09	■ IMA-B 5	2.074.619,71	■ TÍTULOS PRIVADOS	2.021.458,92
■ IRF-M	1.990.703,84	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	930.894,53	■ MULTIMERCADO - OUTROS	751.930,69	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	734.959,03
■ IRF-M 1	686.319,12	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	496.503,55	■ IDKA IPCA 2A	493.742,12	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	456.700,37
■ AÇÕES - EXTERIOR	291.006,44	■ MULTIMERCADO - MACRO	32.900,84	■ DISP. FINANCEIRA	9.475,35		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

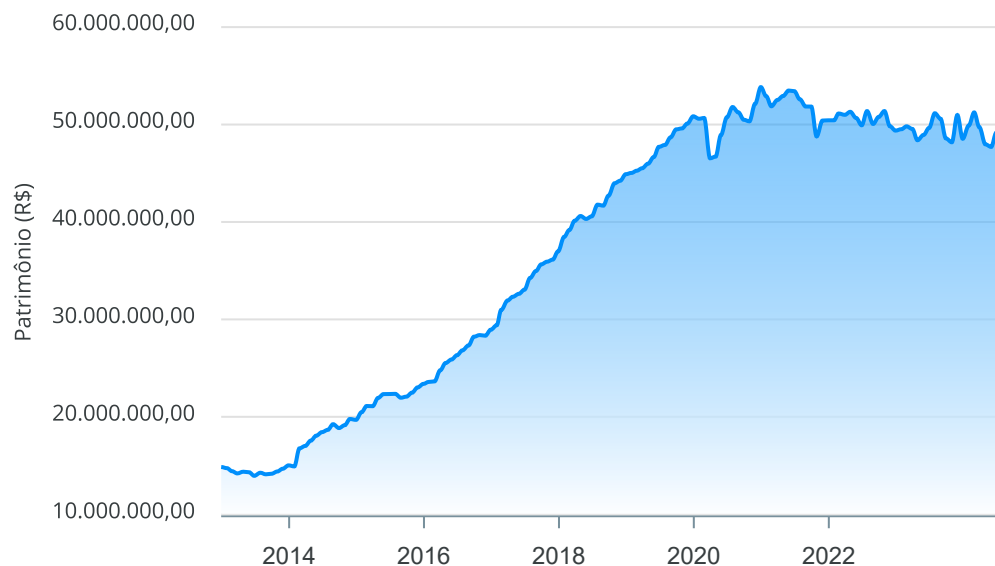
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	48.452.028,05	2.154.000,00	1.179.474,13	49.139.202,34	-287.351,58	-287.351,58	-0,58%	-0,58%	0,86%	0,86%	-67,70%	2,57%
Fevereiro	49.139.202,34	1.819.890,94	1.547.337,95	49.954.288,83	542.533,50	255.181,92	1,10%	0,51%	1,21%	2,08%	24,54%	2,93%
Março	49.954.288,83	6.091.500,00	7.222.162,45	49.163.433,24	339.806,86	594.988,78	0,68%	1,19%	0,56%	2,65%	45,08%	1,93%
Abril	49.163.433,24	3.437.715,85	4.600.410,63	47.388.077,73	-612.660,73	-17.671,95	-1,25%	-0,07%	0,82%	3,49%	-1,92%	2,78%
Maiο	47.388.077,73	5.115.062,88	4.901.716,75	47.687.408,94	85.985,08	68.313,13	0,18%	0,11%	0,88%	4,40%	2,58%	2,35%
Junho	47.687.408,94	4.871.112,36	4.638.053,80	48.499.343,02	578.875,52	647.188,65	1,21%	1,32%	0,61%	5,03%	26,28%	2,77%
Julho	48.499.343,02	4.083.068,30	5.626.231,68	47.616.923,21	660.743,57	1.307.932,22	1,36%	2,70%	0,84%	5,91%	45,71%	2,91%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



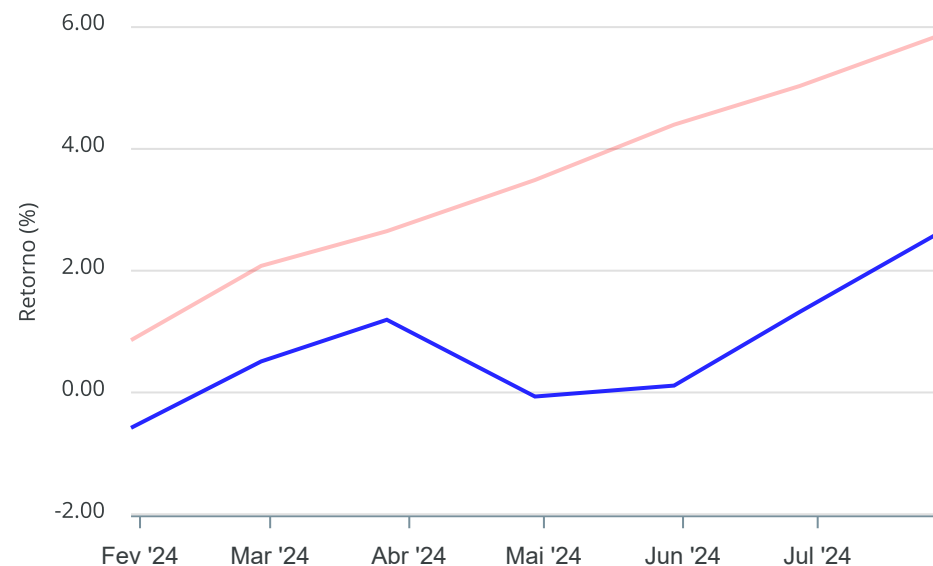
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2024**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.646.369,19	0,00	0,00	1.668.218,78	21.849,59	1,33%	1,33%	1,41%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	339.827,20	13.900,00	35.566,52	322.485,06	4.324,38	1,22%	1,32%	1,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.430.186,30	0,00	0,00	1.444.999,70	14.813,40	1,04%	1,04%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	531.309,18	0,00	0,00	536.539,26	5.230,08	0,98%	0,98%	0,25%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	575.901,06	0,00	0,00	581.567,86	5.666,80	0,98%	0,98%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.755.274,12	0,00	0,00	1.772.392,32	17.118,20	0,98%	0,98%	0,25%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.104.560,65	0,00	0,00	1.115.331,29	10.770,64	0,98%	0,98%	0,25%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.067.038,60	0,00	0,00	2.086.966,30	19.927,70	0,96%	0,96%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	981.169,83	0,00	0,00	990.041,77	8.871,94	0,90%	0,90%	1,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	545.913,49	0,00	0,00	550.791,40	4.877,91	0,89%	0,89%	0,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.510.343,42	0,00	0,00	1.523.828,31	13.484,89	0,89%	0,89%	0,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	290.316,21	0,00	0,00	292.863,93	2.547,72	0,88%	0,88%	0,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	558.965,53	1.500.000,00	0,00	2.076.084,73	17.119,20	0,83%	2,07%	2,12%
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	1.679.253,48	0,00	0,00	1.692.943,42	13.689,94	0,82%	0,82%	0,36%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	2.005.289,09	0,00	0,00	2.021.458,92	16.169,83	0,81%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.372.725,64	0,00	1.300.000,00	1.091.739,25	19.013,61	0,80%	1,00%	0,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.073.540,50	0,00	1.500.000,00	1.597.605,28	24.064,78	0,78%	0,96%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	282.871,04	0,00	0,00	285.031,08	2.160,04	0,76%	0,76%	0,94%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	207.206,51	0,00	0,00	208.711,04	1.504,53	0,73%	0,73%	1,03%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	2.313.237,17	0,00	0,00	2.329.484,23	16.247,06	0,70%	0,70%	0,99%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	1.297.482,47	0,00	0,00	1.306.562,87	9.080,40	0,70%	0,70%	0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.473.102,12	0,00	796.991,76	686.319,12	10.208,76	0,69%	0,93%	0,28%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	270.590,78	1.301.843,81	0,00	1.582.871,93	10.437,34	0,66%	2,05%	2,10%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.115.307,40	1.265.481,99	1.991.829,59	398.148,26	9.188,46	0,39%	0,91%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.842,50	1.843,81	0,00	1,31	0,07%	0,82%	0,00%
Total Renda Fixa	29.427.780,98	4.083.068,30	5.626.231,68	28.162.986,11	278.368,51	0,95%		0,83%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	179.429,20	0,00	0,00	189.470,48	10.041,28	5,60%	5,60%	9,68%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	587.338,51	0,00	0,00	617.491,48	30.152,97	5,13%	5,13%	5,45%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	890.823,76	0,00	0,00	930.894,53	40.070,77	4,50%	4,50%	5,02%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.753.613,91	0,00	0,00	2.840.594,54	86.980,63	3,16%	3,16%	4,70%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.476.886,61	0,00	0,00	1.518.907,82	42.021,21	2,85%	2,85%	5,67%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	552.924,54	0,00	0,00	567.478,45	14.553,91	2,63%	2,63%	4,51%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MUL...	736.894,44	0,00	0,00	751.930,69	15.036,25	2,04%	2,04%	2,64%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.213.426,51	0,00	0,00	3.274.382,81	60.956,30	1,90%	1,90%	6,65%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	919.031,25	0,00	0,00	934.194,09	15.162,84	1,65%	1,65%	5,20%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	488.598,26	0,00	0,00	496.503,55	7.905,29	1,62%	1,62%	2,77%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	450.217,86	0,00	0,00	456.700,37	6.482,51	1,44%	1,44%	8,27%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.580.125,84	0,00	0,00	2.616.179,09	36.053,25	1,40%	1,40%	3,01%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	32.466,09	0,00	0,00	32.900,84	434,75	1,34%	1,34%	1,70%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	727.134,10	0,00	0,00	734.959,03	7.824,93	1,08%	1,08%	0,88%
Total Renda Variável	15.588.910,88	0,00	0,00	15.962.587,77	373.676,89	2,40%		4,81%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Julho / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	284.616,71	0,00	0,00	291.006,44	6.389,73	2,25%	2,25%	7,07%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.802.594,78	0,00	0,00	1.811.751,84	9.157,06	0,51%	0,51%	10,12%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.395.439,67	0,00	0,00	1.388.591,05	-6.848,62	-0,49%	-0,49%	9,94%
Total Exterior	3.482.651,16	0,00	0,00	3.491.349,33	8.698,17	0,25%		9,80%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

