

## Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2023



Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

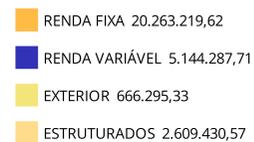
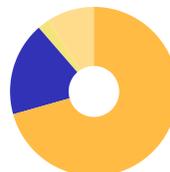
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.038.159,32	3,62%	914	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	727.542,02	2,54%	790	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.435,19	0,03%	1.128	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	149.240,64	0,52%	300	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	834.959,52	2,91%	370	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.201.445,87	4,19%	303	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.085.971,87	7,27%	793	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.290.329,45	4,50%	876	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	920.093,13	3,21%	924	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.589.866,04	5,54%	772	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.419.592,52	4,95%	1.188	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	99.636,44	0,35%	30	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	161.900,99	0,56%	3.058	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	188.865,17	0,66%	996	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	153.350,94	0,53%	151	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	21.217,69	0,07%	224	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASILATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.401.935,43	8,37%	118	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	611.000,85	2,13%	360	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	917.636,52	3,20%	279	0,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.121.597,52	10,88%	240	0,11%	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 ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.044.711,36	3,64%	69	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	276.731,14	0,96%	739	0,13%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	399.328,65	1,39%	20.355	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BRABESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	886.105,53	3,09%	260	2,52%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.364.329,50	4,76%	1.024	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.247.281,29	4,35%	201	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	385.796,69	1,35%	2.221	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	389.424,30	1,36%	2.674	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	472.021,75	1,65%	16.196	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	150.435,29	0,52%	11.068	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BRABESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	76.115,84	0,27%	70	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	439.744,20	1,53%	485	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BRABESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	D+0	Não há	676.175,56	2,36%	9	2,11%	Artigo 10º, Inciso I
BRABESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	57.705,66	0,20%	537	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	246.984,53	0,86%	5.567	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	400.090,83	1,39%	850	0,49%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	722.452,77	2,52%	2.987	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	506.021,22	1,76%	35	0,60%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>28.683.233,23</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	80,97%	23.224.813,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.526.173,00	40,18%	20,24%	22,85%	80,97%	11.698.640,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	8.460.315,48	29,50%	27,02%	33,15%	60,00%	8.749.624,46
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	276.731,14	0,96%	1,00%	2,00%	5,00%	1.157.430,52
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>20.263.219,62</b>	<b>70,64%</b>	<b>48,26%</b>	<b>78,00%</b>	<b>226,94%</b>	

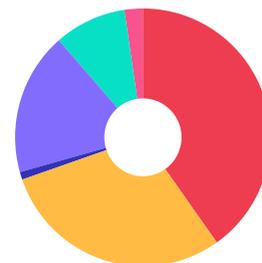


**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	5.144.287,71	17,93%	1,89%	14,00%	20,00%	592.358,94
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.609.430,57	9,10%	2,00%	5,00%	10,00%	258.892,75
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>35,00%</b>	<b>7.753.718,28</b>	<b>27,03%</b>	<b>3,89%</b>	<b>19,00%</b>	<b>30,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	666.295,33	2,32%	1,00%	3,00%	10,00%	2.202.027,99
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>666.295,33</b>	<b>2,32%</b>	<b>1,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>10,00%</b>	



**Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2023)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	17.265.769,18	60,19	-
BB ASSET MANAGEMENT	3.495.965,80	12,19	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.383.134,95	11,79	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.849.453,53	6,45	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.044.711,36	3,64	-
ITAÚ UNIBANCO	506.021,22	1,76	-
ITAÚ DTVM	472.021,75	1,65	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	389.424,30	1,36	-
SOMMA INVESTIMENTOS	276.731,14	0,96	-

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

**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 Agosto/2023 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,77%	8,66%	2,75%	5,42%	11,80%	22,33%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	8,36%	2,73%	5,26%	11,57%	21,91%	0,92%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	8,41%	2,76%	5,32%	11,53%	21,66%	0,90%	0,02%

<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	1,15%	9,05%	3,44%	6,81%	13,74%	24,03%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	8,82%	3,37%	6,66%	13,40%	23,37%	0,18%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	8,92%	3,38%	6,69%	13,51%	23,50%	0,18%	0,00%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,61%	8,75%	2,66%	5,76%	11,97%	23,03%	-	-
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%
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%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,70%	1,82%	0,26%	2,05%	5,09%	8,21%	4,08%	0,04%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,38%	11,84%	2,83%	10,43%	13,76%	20,07%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,37%	11,72%	2,79%	10,37%	13,51%	19,64%	1,71%	0,05%

<b>CDI (Benchmark)</b>	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05%	8,15%	3,07%	6,14%	12,44%	22,66%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,05%	7,80%	3,06%	5,94%	11,81%	21,38%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,65%	8,87%	2,97%	6,83%	12,95%	25,95%	0,68%	0,01%

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
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,56%	6,65%	3,97%	6,69%	11,84%	24,69%	0,15%	0,01%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,14%	8,83%	3,32%	6,64%	13,49%	25,10%	0,01%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,12%	8,70%	3,26%	6,55%	13,29%	24,56%	0,00%	0,00%

<b>IPCA (Benchmark)</b>	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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,23%	8,85%	2,82%	6,80%	12,20%	21,19%	1,11%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	11,03%	3,48%	9,41%	14,11%	22,39%	0,97%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,62%	9,51%	3,34%	7,38%	13,10%	23,77%	0,50%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	7,64%	2,92%	4,76%	11,09%	-	0,62%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-	2,95%	-	-	-	0,62%	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,61%	8,35%	2,58%	5,48%	11,53%	21,81%	0,95%	0,02%

<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	-2,01%	-	-0,04%	-	-	-	4,55%	-

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
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	1,11%	8,97%	3,40%	6,87%	13,48%	24,80%	0,15%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1,11%	9,08%	3,58%	7,11%	13,61%	25,84%	0,18%	0,00%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,90%	8,59%	3,15%	6,54%	13,08%	26,10%	0,23%	0,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,39%	7,82%	2,92%	6,69%	11,19%	19,74%	1,49%	0,04%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	2,49%	8,34%	2,03%	4,71%	14,82%	26,69%	1,13%	0,04%

<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	3,26%	21,43%	5,97%	15,02%	15,64%	-2,06%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	20,35%	5,57%	14,51%	14,97%	-4,08%	8,36%	0,23%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,30%	11,42%	4,90%	9,48%	8,87%	-5,06%	7,32%	0,20%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-5,09%	5,47%	6,84%	10,30%	5,68%	-2,56%	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,87%	7,93%	4,38%	10,78%	0,94%	0,29%	6,14%	0,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,95%	-3,99%	2,67%	0,58%	-2,10%	-13,16%	4,56%	0,19%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,72%	6,08%	6,90%	10,12%	0,88%	-11,75%	6,25%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,40%	11,93%	8,05%	15,08%	7,42%	9,18%	6,67%	0,19%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-4,30%	3,94%	7,69%	8,76%	1,10%	-4,03%	6,30%	0,21%

<b>IDIV (Benchmark)</b>	-2,83%	9,22%	8,71%	11,58%	10,64%	15,38%	-	-
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,92%	8,59%	8,48%	11,15%	9,72%	13,18%	5,34%	0,19%

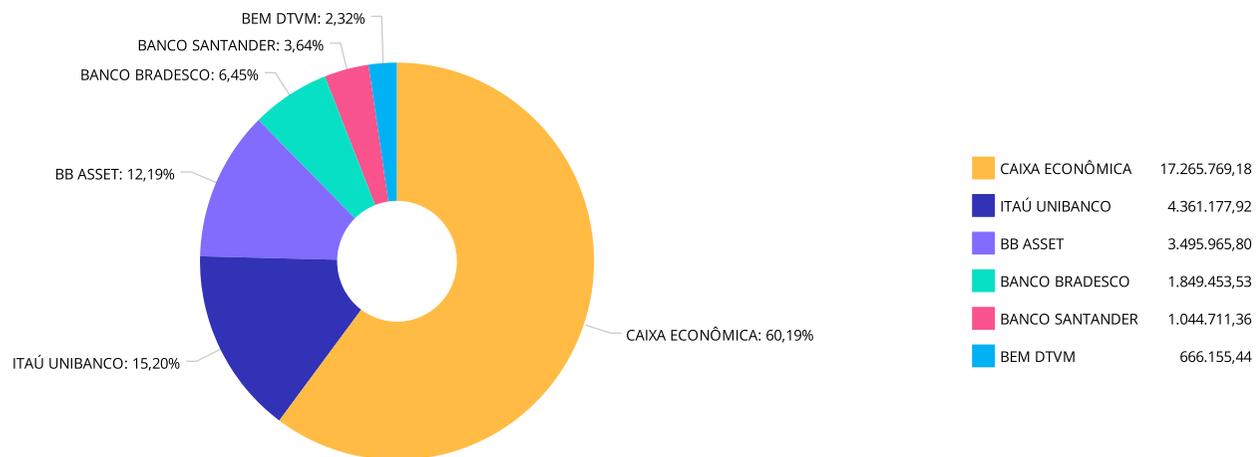
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,83%	8,19%	8,28%	10,70%	9,25%	12,71%	5,18%	0,18%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,94%	10,22%	4,26%	6,72%	7,19%	-8,38%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,73%	12,41%	6,36%	10,00%	11,02%	-5,94%	7,31%	0,21%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-1,77%	17,40%	7,84%	13,54%	13,97%	-0,33%	-	-
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	-1,02%	19,24%	9,71%	14,18%	19,23%	11,83%	5,72%	0,18%

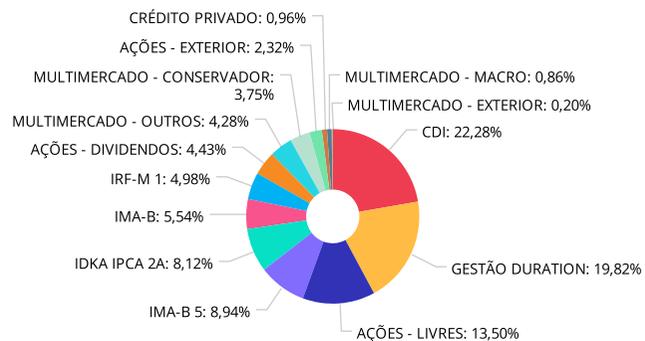
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,94%	10,22%	4,26%	6,72%	7,19%	-8,38%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,73%	12,41%	6,36%	10,00%	11,02%	-5,94%	7,31%	20,748%
Global BDRX (Benchmark)	3,26%	21,43%	5,97%	15,02%	15,64%	-2,06%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	20,35%	5,57%	14,51%	14,97%	-4,08%	8,36%	22,747%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,30%	11,42%	4,90%	9,48%	8,87%	-5,06%	7,32%	20,496%

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



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

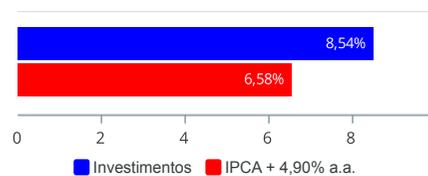


■ CDI	6.389.864,69	■ GESTÃO DURATION	5.685.969,60	■ AÇÕES - LIVRES	3.872.385,49
■ IMA-B 5	2.565.271,67	■ IDKA IPCA 2A	2.328.488,77	■ IMA-B	1.589.866,04
■ IRF-M 1	1.427.027,71	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.271.902,22	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.228.473,99
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.076.266,39	■ AÇÕES - EXTERIOR	666.295,33	■ CRÉDITO PRIVADO	276.731,14
■ MULTIMERCADO - MACRO	246.984,53	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	57.705,66		

**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023**

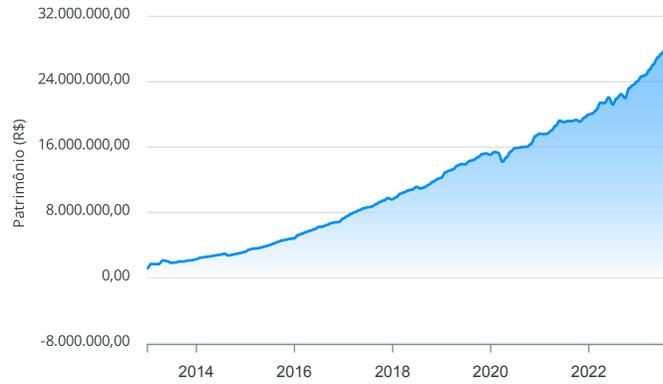
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	24.056.086,72	202.334,54	10.807,71	24.648.586,85	400.973,30	400.973,30	1,65%	1,65%	0,95%	0,95%	173,94%	2,83%
Fevereiro	24.648.586,85	3.594.115,74	3.362.649,31	24.797.315,58	-82.737,70	318.235,60	-0,33%	1,32%	1,19%	2,15%	61,27%	2,64%
Março	24.797.315,58	2.112.414,44	1.588.621,53	25.476.851,82	155.743,33	473.978,93	0,62%	1,94%	1,15%	3,32%	58,35%	1,99%
Abril	25.476.851,82	962.543,58	618.935,75	26.097.785,46	277.325,81	751.304,74	1,07%	3,03%	0,95%	4,31%	70,41%	1,92%
Mai	26.097.785,46	557.334,89	117.450,09	26.968.773,61	431.103,35	1.182.408,09	1,62%	4,71%	0,65%	4,99%	94,41%	1,76%
Junho	26.968.773,61	1.346.451,71	1.530.795,30	27.448.644,49	664.214,47	1.846.622,56	2,46%	7,29%	0,32%	5,32%	136,93%	1,97%
Julho	27.448.644,49	967.109,56	571.841,92	28.199.680,16	355.768,03	2.202.390,59	1,28%	8,66%	0,52%	5,87%	147,51%	1,89%
Agosto	28.199.680,16	898.649,66	383.336,44	28.683.233,23	-31.760,15	2.170.630,44	-0,11%	8,54%	0,67%	6,58%	129,81%	1,98%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos  Meta de Rentabilidade  CDI  IMA-B
- IMA-B 5  IMA-B 5+  IMA Geral  IRF-M  IRF-M 1
- IRF-M 1+  Ibovespa  IBX  SMLL  IDIV
- Investimentos  Meta de Rentabilidade  CDI  IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+  IMA Geral  IRF-M  IRF-M 1  IRF-M 1+
- Ibovespa  IBX  SMLL  IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	272.485,07	0,00	0,00	276.731,14	4.246,07	1,56%	1,56%	0,15%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	169.351,82	0,00	9.386,71	161.900,99	1.935,88	1,14%	1,14%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	20.983,14	0,00	0,00	21.217,69	234,55	1,12%	1,12%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.353,15	0,00	0,00	7.435,19	82,04	1,12%	1,12%	0,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.403.998,91	0,00	0,00	1.419.592,52	15.593,61	1,11%	1,11%	0,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	93.912,30	93.203,58	0,00	188.865,17	1.749,29	0,93%	1,05%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	152.260,44	0,00	4.394,36	149.240,64	1.374,56	0,90%	0,91%	0,62%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.222.277,38	0,00	31.789,95	1.201.445,87	10.958,44	0,90%	-1,70%	4,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	850.708,75	0,00	23.359,96	834.959,52	7.610,73	0,89%	0,90%	0,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.280.413,58	0,00	0,00	1.290.329,45	9.915,87	0,77%	0,77%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.030.541,22	0,00	0,00	1.038.159,32	7.618,10	0,74%	0,74%	0,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.101.300,20	0,00	0,00	3.121.597,52	20.297,32	0,65%	0,65%	0,68%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	460.318,86	264.323,69	118.347,49	611.000,85	4.705,79	0,65%	1,05%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.072.898,18	0,00	0,00	2.085.971,87	13.073,69	0,63%	0,63%	0,58%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.387.100,20	0,00	0,00	2.401.935,43	14.835,23	0,62%	0,62%	0,50%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	912.121,75	0,00	0,00	917.636,52	5.514,77	0,60%	0,60%	0,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	914.631,98	0,00	0,00	920.093,13	5.461,15	0,60%	0,60%	0,94%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	152.487,07	0,00	0,00	153.350,94	863,87	0,57%	0,57%	0,97%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	692.847,83	30.705,27	0,00	727.542,02	3.988,92	0,55%	0,58%	0,95%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.042.306,93	0,00	0,00	1.044.711,36	2.404,43	0,23%	0,23%	1,11%

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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.564.203,20	31.789,95	0,00	1.589.866,04	-6.127,11	-0,38%	-0,37%	1,71%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	101.675,13	0,00	0,00	99.636,44	-2.038,69	-2,01%	-2,01%	4,55%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>19.906.177,09</b>	<b>420.022,49</b>	<b>187.278,47</b>	<b>20.263.219,62</b>	<b>124.298,51</b>	<b>0,62%</b>		<b>0,96%</b>

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
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	390.379,60	0,00	0,00	400.090,83	9.711,23	2,49%	2,49%	1,13%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	668.762,09	0,00	0,00	676.175,56	7.413,47	1,11%	1,11%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	500.481,01	0,00	0,00	506.021,22	5.540,21	1,11%	1,11%	0,18%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	715.993,33	0,00	0,00	722.452,77	6.459,44	0,90%	0,90%	0,23%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	247.942,04	0,00	0,00	246.984,53	-957,51	-0,39%	-0,39%	1,49%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	58.301,32	0,00	0,00	57.705,66	-595,66	-1,02%	-1,02%	5,72%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	397.031,93	0,00	0,00	385.796,69	-11.235,24	-2,83%	-2,83%	5,18%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	912.710,50	0,00	0,00	886.105,53	-26.604,97	-2,91%	-2,91%	5,34%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.004.015,84	282.569,20	0,00	1.247.281,29	-39.303,75	-3,05%	-3,40%	6,67%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	417.267,12	0,00	0,00	399.328,65	-17.938,47	-4,30%	-4,30%	6,30%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.431.917,65	0,00	0,00	1.364.329,50	-67.588,15	-4,72%	-4,72%	6,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	409.351,46	0,00	0,00	389.424,30	-19.927,16	-4,87%	-4,87%	6,14%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	496.589,07	0,00	0,00	472.021,75	-24.567,32	-4,95%	-4,95%	4,56%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.650.742,96</b>	<b>282.569,20</b>	<b>0,00</b>	<b>7.753.718,28</b>	<b>-179.593,88</b>	<b>-2,26%</b>		<b>4,15%</b>

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	229.526,09	196.057,97	0,00	439.744,20	14.160,14	3,33%	2,90%	8,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	73.683,11	0,00	0,00	76.115,84	2.432,73	3,30%	3,30%	7,32%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	146.434,84	0,00	0,00	150.435,29	4.000,45	2,73%	2,73%	7,31%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	193.116,07	0,00	196.057,97	0,00	2.941,90	1,52%	2,61%	8,30%
<b>Total Exterior</b>	<b>642.760,11</b>	<b>196.057,97</b>	<b>196.057,97</b>	<b>666.295,33</b>	<b>23.535,22</b>	<b>2,81%</b>		<b>8,00%</b>

#### 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.

