

# 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
TÍTULOS PÚBLICOS			73.885.031,77	27,29%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	759.491,79	0,28%	783	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.591.047,46	1,70%	627	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	1.230.383,10	0,45%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2028	10.150.574,12	3,75%	116	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	22.344.819,96	8,25%	308	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	16.051.846,50	5,93%	226	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	31.937.464,96	11,79%	85	7,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	11.900.078,55	4,39%	92	2,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	10.593.500,98	3,91%	20	14,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	11.609.153,84	4,29%	813	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.612.486,64	0,60%	902	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.525.587,12	0,56%	1.152	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	876.329,93	0,32%	414	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	398.277,98	0,15%	203	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	507.578,55	0,19%	1.029	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.239.097,73	0,46%	146	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	67.694,95	0,03%	361	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	277.256,84	0,10%	204	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	Não se ...	27 meses	296.421,22	0,11%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

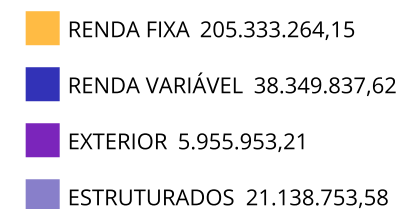
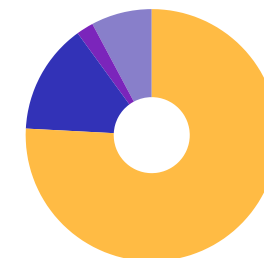
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.479.140,16	1,28%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.135.562,37	1,16%	1.153	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.269.565,35	1,95%	2.433	0,68%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.519.451,98	0,93%	16.231	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.158.690,80	1,17%	1.666	3,27%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	6.622.260,17	2,45%	1.773	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	4.149.792,72	1,53%	123	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.330.123,38	1,60%	2.052	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	3.550.073,98	1,31%	344	0,76%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.136.166,94	1,16%	11.470	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.478.149,93	0,92%	1.348	1,89%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	3.416.723,50	1,26%	22.365	0,52%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.539.229,71	0,94%	331	0,33%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.650.027,29	0,61%	4.293	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	3.642.456,00	1,35%	583	1,89%	Artigo 10º, Inciso I
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.947.319,28	2,57%	351	7,77%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	3.301.413,44	1,22%	109	0,39%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	4.320.584,99	1,60%	17	3,28%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.276.952,58	0,47%	28	2,32%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>270.777.808,56</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>2.963.791,53</b>				Artigo 6º
		<b>PL Total</b>	<b>273.741.600,09</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	73.885.031,77	27,29%	0,00%	10,00%	50,00%	61.503.872,51
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	125.581.042,93	46,38%	8,00%	27,00%	70,00%	63.963.423,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	2.091.628,07	0,77%	2,00%	16,00%	60,00%	160.375.057,07
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	54.155.561,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	3.775.561,38	1,39%	0,00%	2,00%	3,00%	4.347.772,88
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.538.890,43
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>205.333.264,15</b>	<b>75,83%</b>	<b>10,00%</b>	<b>60,00%</b>	<b>208,00%</b>	

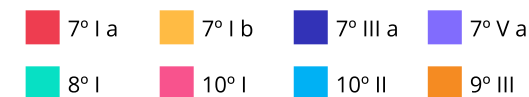
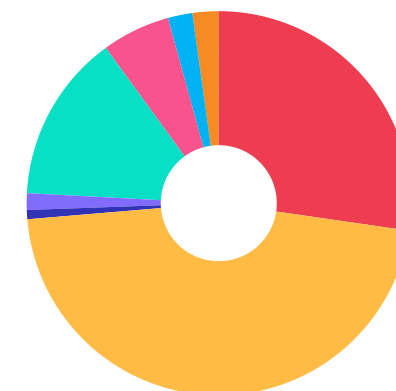


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	38.349.837,62	14,16%	5,00%	20,00%	30,00%	42.883.504,95
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	81.233.342,57
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	15.541.216,01	5,74%	1,00%	10,00%	10,00%	11.536.564,85
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	5.597.537,57	2,07%	1,00%	3,00%	5,00%	7.941.352,86
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.538.890,43
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>59.488.591,20</b>	<b>21,97%</b>	<b>7,00%</b>	<b>33,00%</b>	<b>80,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	27.077.780,86
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.955.953,21	2,20%	0,00%	2,00%	10,00%	21.121.827,65
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>5.955.953,21</b>	<b>2,20%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>20,00%</b>	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	13.538.890,43



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

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	73.885.031,77	27,29	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	125.581.042,93	46,38	8,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	2.091.628,07	0,77	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	3.775.561,38	1,39	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	38.349.837,62	14,16	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	5.955.953,21	2,20	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	15.541.216,01	5,74	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	5.597.537,57	2,07	1,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	117.961.239,44	43,56	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	73.885.031,77	27,29	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.580.378,22	11,66	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	6.947.319,28	2,57	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	6.622.260,17	2,45	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	5.840.643,15	2,16	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.330.123,38	1,60	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	4.320.584,99	1,60	-
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	3.811.701,76	1,41	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.550.073,98	1,31	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.479.140,16	1,28	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.158.690,80	1,17	-
PERFIN EQUITIES ADMINISTRAÇÃO ...	2.478.149,93	0,92	-
KPTL	1.276.952,58	0,47	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.239.097,73	0,46	-
GENIAL GESTÃO LTDA	296.421,22	0,11	-

**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
<b>IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,83%	5,84%	2,29%	4,97%	9,72%	19,81%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	1,65%	1,92%	1,57%	4,70%	-	1,81%	3,21%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,04%	-0,92%	-0,52%	0,37%	-	1,36%	4,58%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	-0,01%	-0,95%	-0,56%	0,31%	6,57%	1,36%	4,58%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,00%	7,01%	2,78%	5,97%	11,81%	24,42%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,19%	-4,60%	-0,62%	-4,24%	-5,01%	-13,38%	0,01%	3,50%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,91%	4,27%	2,37%	3,56%	8,16%	20,37%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	6,72%	3,04%	5,56%	11,20%	22,10%	0,25%	0,84%
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%
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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,09%	0,97%	2,45%	1,43%	4,38%	20,51%	-	-

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,07%	0,82%	2,39%	1,31%	4,13%	19,89%	2,11%	3,92%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,81%	5,55%	2,29%	4,63%	10,40%	23,40%	0,00%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	6,06%	2,70%	5,11%	10,50%	25,11%	0,19%	0,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	5,57%	2,29%	4,64%	10,41%	24,18%	0,00%	0,06%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	-0,44%	-3,24%	-1,60%	-2,88%	-5,38%	14,37%	0,02%	0,51%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,38%	2,87%	1,05%	2,44%	4,50%	8,67%	-	-
BRAPRESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,28%	3,11%	1,94%	2,64%	7,62%	23,72%	1,29%	1,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,88%	2,80%	1,43%	2,32%	7,03%	21,01%	0,56%	2,62%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,76%	-1,70%	2,43%	-1,36%	-1,72%	-	2,35%	5,53%
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
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	0,81%	4,26%	2,54%	3,72%	7,37%	21,60%	0,20%	0,89%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,34%	3,26%	1,85%	2,74%	8,42%	23,70%	1,70%	3,21%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	3,02%	-4,87%	1,37%	-0,08%	4,68%	23,74%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	1,46%	-3,99%	-0,62%	-1,69%	3,97%	20,92%	0,99%	9,50%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,82%	-6,68%	3,07%	-1,84%	-2,38%	8,45%	5,04%	13,40%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,16%	-5,94%	0,59%	-1,88%	2,09%	15,93%	4,70%	13,63%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,00%	-5,67%	1,39%	-3,79%	-0,45%	9,85%	5,70%	16,25%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,74%	-5,07%	1,51%	-0,53%	2,52%	12,21%	4,62%	13,28%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2,47%	-8,91%	1,38%	-2,62%	-0,25%	11,41%	5,03%	13,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,13%	4,28%	3,86%	6,72%	15,06%	26,25%	5,45%	12,63%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,35%	-5,43%	0,67%	-0,04%	3,56%	25,60%	5,76%	14,22%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,43%	-6,65%	0,60%	-3,34%	-1,61%	11,58%	5,76%	13,70%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,14%	-7,80%	0,25%	-4,58%	-2,85%	8,10%	5,51%	15,03%

<b>IDIV (Benchmark)</b>	1,89%	-1,58%	2,90%	2,00%	11,06%	31,85%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,90%	-4,06%	0,14%	-2,37%	1,06%	25,89%	6,65%	14,78%

<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	1,13%	15,78%	9,66%	13,96%	20,34%	33,70%	-	-
---	-------	--------	-------	--------	--------	--------	---	---

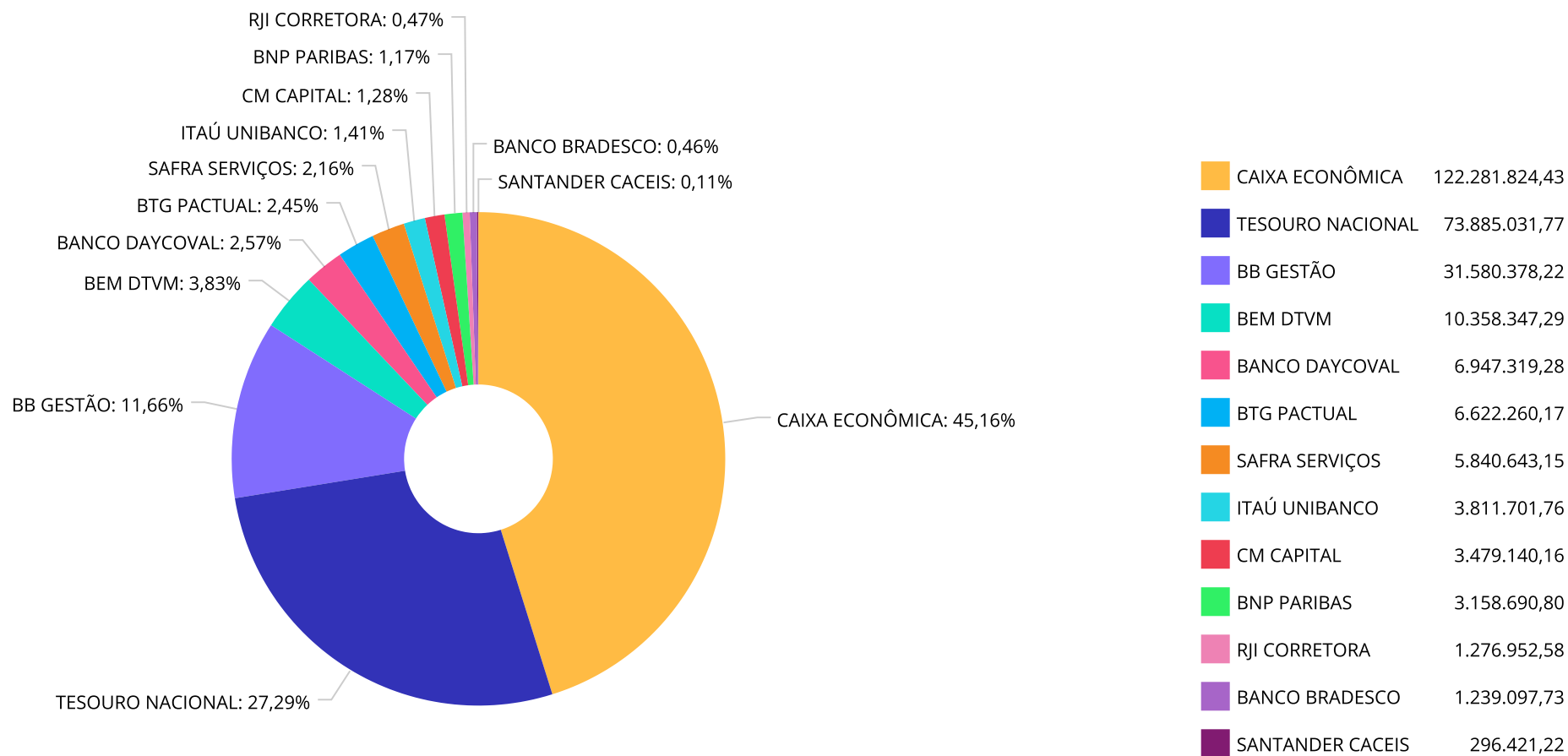
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	1,33%	17,93%	10,49%	16,04%	26,13%	51,83%	6,41%	11,44%
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,30%	9,04%	3,61%	7,69%	15,47%	32,69%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-19,54%	-55,08%	-19,75%	-55,02%	-55,41%	-59,22%	-	-
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,09%	7,60%	3,02%	6,46%	12,86%	26,75%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	27,44%	36,82%	26,93%	37,10%	36,77%	37,04%	43,54%	28,87%

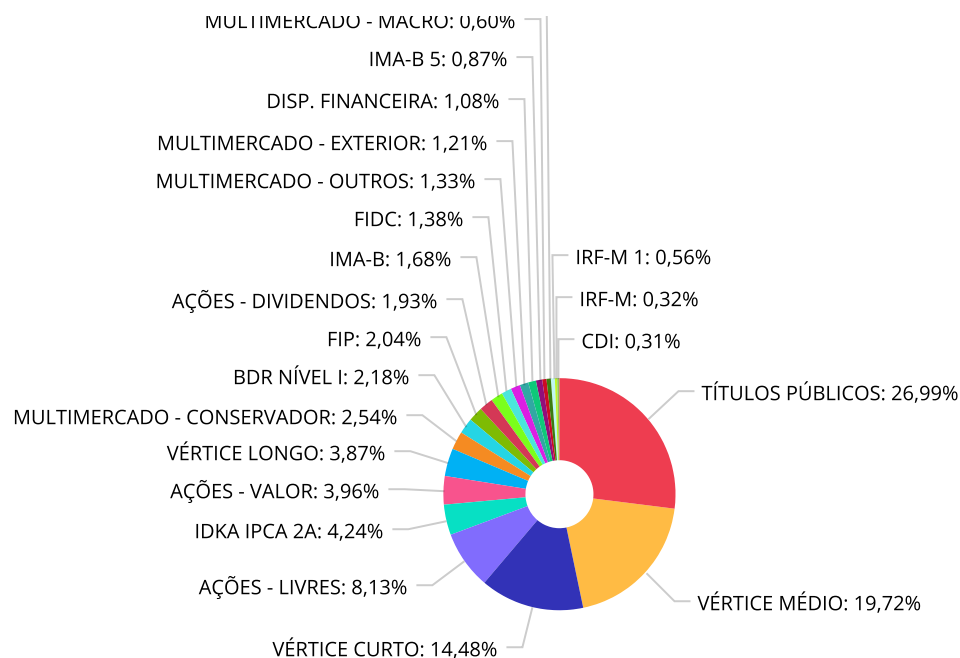
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,75%	25,46%	11,51%	20,87%	39,24%	67,67%	11,29%	16,021%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,62%	28,86%	17,65%	25,43%	38,64%	39,96%	7,44%	12,916%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	73.885.031,77	■ VÉRTICE MÉDIO	53.988.117,63	■ VÉRTICE CURTO	39.627.049,56	■ AÇÕES - LIVRES	22.244.843,20
■ IDKA IPCA 2A	11.609.153,84	■ AÇÕES - VALOR	10.835.429,07	■ VÉRTICE LONGO	10.593.500,98	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	6.947.319,28
■ BDR NÍVEL I	5.955.953,21	■ FIP	5.597.537,57	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	5.269.565,35	■ IMA-B	4.591.047,46
■ FIDC	3.775.561,38	■ MULTIMERCADO - OUTROS	3.642.456,00	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.301.413,44	■ DISP. FINANCEIRA	2.963.791,53
■ IMA-B 5	2.371.978,43	■ MULTIMERCADO - MACRO	1.650.027,29	■ GESTÃO DURATION	1.637.375,71	■ IRF-M 1	1.525.587,12
■ IRF-M	876.329,93	■ CDI	852.530,34				

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2024)

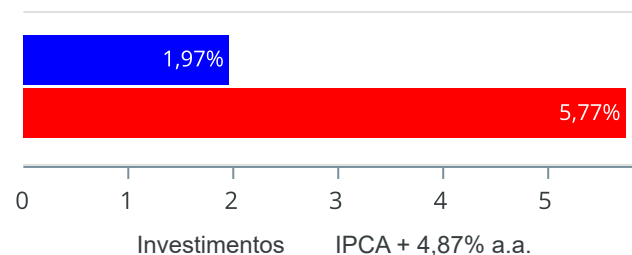
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	04/07/2024	2.647	4.344,312936	4.374,078068	11.499.396,34	11.578.184,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	04/07/2024	117	4.271,346157	4.300,513953	499.747,50	503.160,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	26/06/2024	2.539	4.292,963338	4.330,700176	10.899.833,92	10.995.647,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/07/2024	115	4.340,532858	4.364,241382	499.161,28	501.887,75	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	26/06/2024	2.485	4.341,924875	4.379,844847	10.789.683,31	10.883.914,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	09/07/2024	115	4.316,172797	4.339,81763	496.359,87	499.079,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	26/06/2024	2.435	4.310,371980	4.348,301988	10.495.755,77	10.588.115,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/07/2024	119	4.185,841436	4.214,098406	498.115,13	501.477,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	26/06/2024	2.401	4.230,974313	4.268,204487	10.158.569,33	10.247.958,97	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	04/07/2024	2.235	4.241,967744	4.270,332037	9.480.797,91	9.544.192,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/07/2024	1.911	4.185,041277	4.207,961244	7.997.613,88	8.041.413,93	Curva



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	262.588.417,28	13.304.514,97	9.901.084,94	264.939.005,41	-1.052.841,90	-1.052.841,90	-0,40%	-0,40%	0,84%	0,84%	-47,25%	1,99%
Fevereiro	264.939.005,41	30.502.448,14	30.033.713,68	266.775.669,17	1.367.929,30	315.087,40	0,52%	0,12%	1,19%	2,04%	5,76%	2,95%
Março	266.775.669,17	7.687.942,07	7.244.174,87	268.904.957,09	1.685.520,72	2.000.608,12	0,63%	0,75%	0,54%	2,59%	28,93%	1,70%
Abril	268.904.957,09	6.028.079,58	5.119.710,95	266.522.435,27	-3.290.890,45	-1.290.282,33	-1,22%	-0,48%	0,80%	3,41%	-14,08%	2,26%
Mai	266.522.435,27	17.982.545,57	19.254.977,39	265.880.981,16	630.977,71	-659.304,62	0,24%	-0,24%	0,86%	4,30%	-5,68%	2,42%
Junho	265.880.981,16	75.259.481,15	81.692.827,99	261.311.207,21	1.863.572,89	1.204.268,27	0,70%	0,46%	0,59%	4,91%	9,27%	2,27%
Julho	261.311.207,21	83.183.591,84	77.729.937,28	270.777.808,56	4.012.946,79	5.217.215,06	1,50%	1,97%	0,82%	5,77%	34,09%	3,20%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



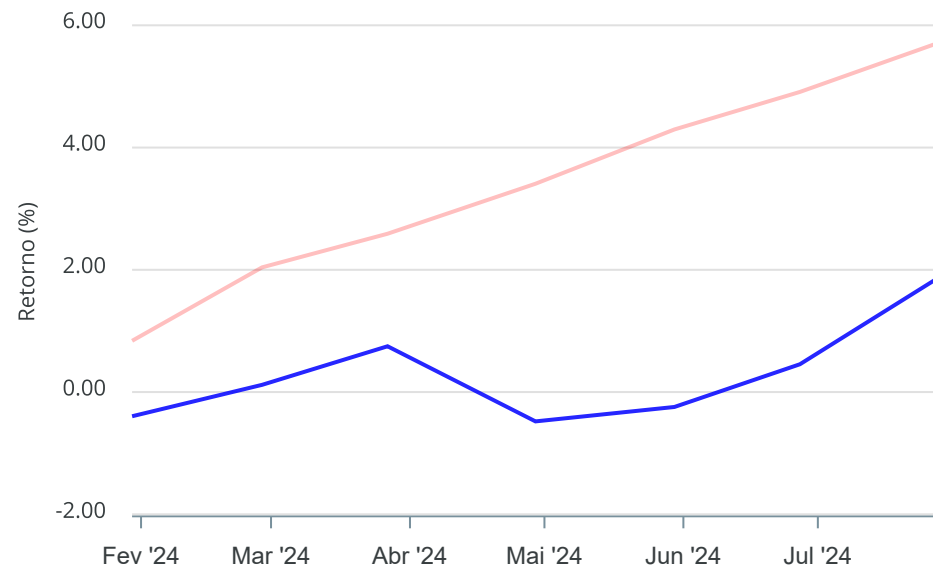
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.497.749,12	0,00	0,00	4.591.047,46	93.298,34	2,07%	2,07%	2,11%
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.410.355,19	0,00	0,00	10.593.500,98	183.145,79	1,76%	1,76%	2,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	10.042.924,29	0,00	0,00	10.150.574,12	107.649,83	1,07%	1,07%	1,81%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	624.150,59	243.331,91	25,42	876.329,93	8.872,85	1,02%	1,33%	1,41%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.895.437,30	0,00	0,00	16.051.846,50	156.409,20	0,98%	0,98%	0,25%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.129.045,95	0,00	0,00	22.344.819,96	215.774,01	0,98%	0,98%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.218.568,79	0,00	0,00	1.230.383,10	11.814,31	0,97%	0,97%	0,25%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.792.732,41	0,00	0,00	11.900.078,55	107.346,14	0,91%	0,91%	1,36%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.651.962,20	0,00	0,00	31.937.464,96	285.502,76	0,90%	0,90%	1,36%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.207.345,52	0,00	3.000.000,00	1.239.097,73	31.752,21	0,75%	1,28%	1,29%
TÍTULOS PÚBLICOS	42.369.262,06	30.971.191,89	0,00	73.885.031,77	544.577,82	0,74%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	873.708,22	729.629,76	0,00	1.612.486,64	9.148,66	0,57%	0,89%	0,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	279.083,86	1.280.000,00	42.298,75	1.525.587,12	8.802,01	0,56%	0,93%	0,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.752.205,40	31.238.550,84	25.543.029,43	11.609.153,84	161.427,03	0,44%	0,73%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	477.445,75	3.044.741,83	3.020.531,08	507.578,55	5.922,05	0,17%	0,82%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	7.924.531,11	15.676.145,61	23.548.851,34	67.694,95	15.869,57	0,07%	0,81%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	7.273.746,91	0,00	7.000.000,00	277.256,84	3.509,93	0,05%	0,90%	0,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.758.836,23	0,00	3.000.000,00	759.491,79	655,56	0,02%	0,89%	0,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	7.403.962,20	0,00	7.000.000,00	398.277,98	-5.684,22	-0,08%	0,88%	0,56%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.485.660,36	0,00	0,00	3.479.140,16	-6.520,20	-0,19%	-0,19%	0,01%

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
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	297.717,83	0,00	0,00	296.421,22	-1.296,61	-0,44%	-0,44%	0,02%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>192.366.431,29</b>	<b>83.183.591,84</b>	<b>72.154.736,02</b>	<b>205.333.264,15</b>	<b>1.937.977,04</b>	<b>0,95%</b>		<b>1,07%</b>

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
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.390.426,39	0,00	0,00	4.320.584,99	930.158,60	27,43%	27,43%	43,54%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕE...	2.466.813,12	0,00	2.611.409,73	0,00	144.596,61	5,86%	3,33%	8,65%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.983.023,54	0,00	0,00	3.136.166,94	153.143,40	5,13%	5,13%	5,45%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.013.540,02	0,00	0,00	3.158.690,80	145.150,78	4,82%	4,82%	5,04%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.382.755,32	0,00	0,00	2.478.149,93	95.394,61	4,00%	4,00%	5,70%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.186.490,58	0,00	0,00	4.330.123,38	143.632,80	3,43%	3,43%	5,76%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	4.022.723,69	0,00	0,00	4.149.792,72	127.069,03	3,16%	3,16%	4,70%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.052.007,63	0,00	0,00	3.135.562,37	83.554,74	2,74%	2,74%	4,62%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.458.777,28	0,00	0,00	2.519.451,98	60.674,70	2,47%	2,47%	5,03%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.483.247,29	0,00	0,00	6.622.260,17	139.012,88	2,14%	2,14%	5,51%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.171.466,49	0,00	0,00	5.269.565,35	98.098,86	1,90%	1,90%	6,65%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2.909.803,06	0,00	2.963.791,53	0,00	53.988,47	1,86%	1,55%	8,18%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	3.590.127,00	0,00	0,00	3.642.456,00	52.329,00	1,46%	1,46%	0,99%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.502.839,78	0,00	0,00	3.550.073,98	47.234,20	1,35%	1,35%	5,76%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.628.223,97	0,00	0,00	1.650.027,29	21.803,32	1,34%	1,34%	1,70%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	3.258.124,94	0,00	0,00	3.301.413,44	43.288,50	1,33%	1,33%	6,41%
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	6.891.437,67	0,00	0,00	6.947.319,28	55.881,61	0,81%	0,81%	0,20%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	1.586.985,98	0,00	0,00	1.276.952,58	-310.033,40	-19,54%	-	-
<b>Total Renda Variável</b>	<b>62.978.813,75</b>	<b>0,00</b>	<b>5.575.201,26</b>	<b>59.488.591,20</b>	<b>2.084.978,71</b>	<b>3,31%</b>		<b>7,35%</b>

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.523.519,45	0,00	0,00	2.539.229,71	15.710,26	0,62%	0,62%	7,44%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.442.442,72	0,00	0,00	3.416.723,50	-25.719,22	-0,75%	-0,75%	11,29%
<b>Total Exterior</b>	<b>5.965.962,17</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>5.955.953,21</b>	<b>-10.008,96</b>	<b>-0,17%</b>		<b>9,64%</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 & 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.





