

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

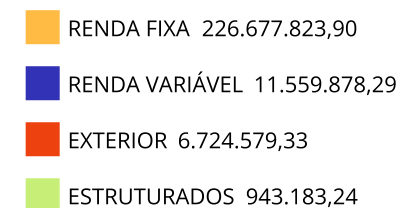
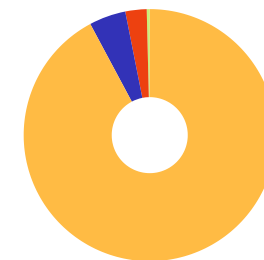
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			41.915.251,90	17,05%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	5.417.835,71	2,20%	269	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.006.127,35	2,44%	1.129	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.016.921,32	0,41%	308	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.172.658,53	0,48%	813	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	6.157.345,69	2,50%	267	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.355.704,81	2,99%	1.152	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	24.409.172,46	9,93%	203	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	500.589,91	0,20%	2.790	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.020.199,69	2,85%	234	0,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.002.749,90	4,47%	192	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	9.359.088,95	3,81%	1.167	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.367.413,22	4,62%	507	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	13.013.865,34	5,29%	1.022	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.356.495,37	2,18%	461	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.643.753,59	3,11%	217	0,70%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	27.162.440,52	11,05%	412	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	20.526.575,64	8,35%	204	0,96%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	9.803.515,81	3,99%	5.214	2,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info	Não se aplica	10.470.118,19	4,26%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.671.040,31	0,68%	3.859	1,19%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.328.210,49	0,54%	1.773	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.284.211,82	0,93%	853	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	410.915,61	0,17%	4.796	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	877.666,04	0,36%	98	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.769.870,52	1,13%	1.723	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.510.233,75	0,61%	256	1,81%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	707.729,75	0,29%	54	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	574.620,85	0,23%	41	0,85%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	2.779.168,22	1,13%	249	0,78%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.370.790,26	1,37%	448	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	943.183,24	0,38%	18	0,08%	Artigo 10º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			245.905.464,76				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			669.996,27				Artigo 6º
PL Total			246.575.461,03				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	41.915.251,90	17,05%	0,00%	30,00%	100,00%	203.990.212,86
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	52.036.355,78	21,16%	0,00%	36,50%	100,00%	193.869.108,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	100,00%	245.905.464,76
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.295.273,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	122.256.098,03	49,72%	0,00%	10,00%	70,00%	49.877.727,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	70,00%	172.133.825,33
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	10.470.118,19	4,26%	0,00%	2,00%	20,00%	38.710.974,76
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	24.590.546,48
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	24.590.546,48
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	24.590.546,48
Total Renda Fixa	100,00%	226.677.823,90	92,18%	0,00%	83,00%	495,00%	

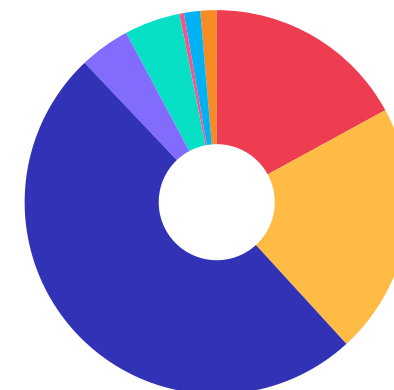


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

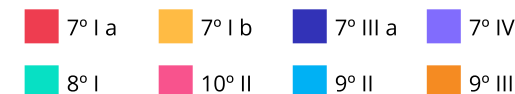


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	11.559.878,29	4,70%	0,00%	7,00%	40,00%	86.802.307,61
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	40,00%	98.362.185,90
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	24.590.546,48
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	943.183,24	0,38%	0,00%	0,50%	5,00%	11.352.090,00
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	12.295.273,24
Artigo 11º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	24.590.546,48
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	12.503.061,53	5,08%	0,00%	12,00%	110,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	24.590.546,48
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.353.789,07	1,36%	0,00%	2,00%	10,00%	21.236.757,41
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.370.790,26	1,37%	0,00%	2,00%	10,00%	21.219.756,22
Total Exterior	10,00%	6.724.579,33	2,73%	0,00%	5,00%	30,00%	



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%	24.590.546,48

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 '	41.915.251,90	17,05	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	52.036.355,78	21,16	0,00	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 '	122.256.098,03	49,72	0,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	70,00
Artigo 7º, Inciso IV	10.470.118,19	4,26	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I	11.559.878,29	4,70	0,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	3.353.789,07	1,36	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.370.790,26	1,37	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	943.183,24	0,38	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	72.098.188,62	29,32	-
CAIXA DTVM	47.782.662,34	19,43	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	41.915.251,90	17,05	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	40.477.041,91	16,46	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.367.413,22	4,62	-
BANCO BRADESCO	10.470.118,19	4,26	-
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	9.803.515,81	3,99	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	2.779.168,22	1,13	-
ICATU VANGUARDA	2.769.870,52	1,13	-
PRÓPIO CAPITAL	1.510.233,75	0,61	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	1.328.210,49	0,54	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	943.183,24	0,38	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	877.666,04	0,36	-
TARPON INVESTIMENTOS	707.729,75	0,29	-
SICREDI	500.589,91	0,20	-

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
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,24%	-1,97%	2,52%	-0,51%	1,03%	20,60%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,20%	-2,04%	2,45%	-0,60%	1,00%	20,02%	3,38%	6,12%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,20%	-2,18%	2,43%	-0,68%	0,72%	19,75%	3,40%	6,19%
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	5,35%	2,27%	4,44%	10,50%	25,41%	0,28%	0,38%
IMA-B (Benchmark)	2,09%	0,97%	2,45%	1,43%	4,38%	20,51%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,08%	0,75%	2,29%	1,25%	4,14%	19,96%	2,25%	4,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,05%	0,74%	2,36%	1,24%	3,97%	19,78%	2,10%	3,93%
CDI (Benchmark)	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,92%	6,19%	2,55%	5,17%	11,51%	26,61%	0,01%	0,06%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,00%	6,74%	2,74%	5,59%	12,51%	28,26%	0,05%	0,11%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	1,20%	4,91%	2,27%	4,07%	10,66%	24,85%	0,48%	1,07%
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%

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,97%	6,39%	2,66%	5,33%	12,00%	27,35%	0,03%	0,08%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,96%	6,25%	2,61%	5,19%	11,83%	27,22%	0,03%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	6,06%	2,70%	5,11%	10,50%	25,11%	0,19%	0,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	6,49%	2,66%	5,43%	12,31%	27,86%	0,03%	0,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	6,26%	2,62%	5,25%	11,61%	26,75%	0,04%	0,06%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,00%	6,52%	2,69%	5,44%	12,15%	26,91%	0,07%	0,13%
IPCA (Benchmark)	0,38%	2,87%	1,05%	2,44%	4,50%	8,67%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,88%	2,80%	1,43%	2,32%	7,03%	21,01%	0,56%	2,62%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-

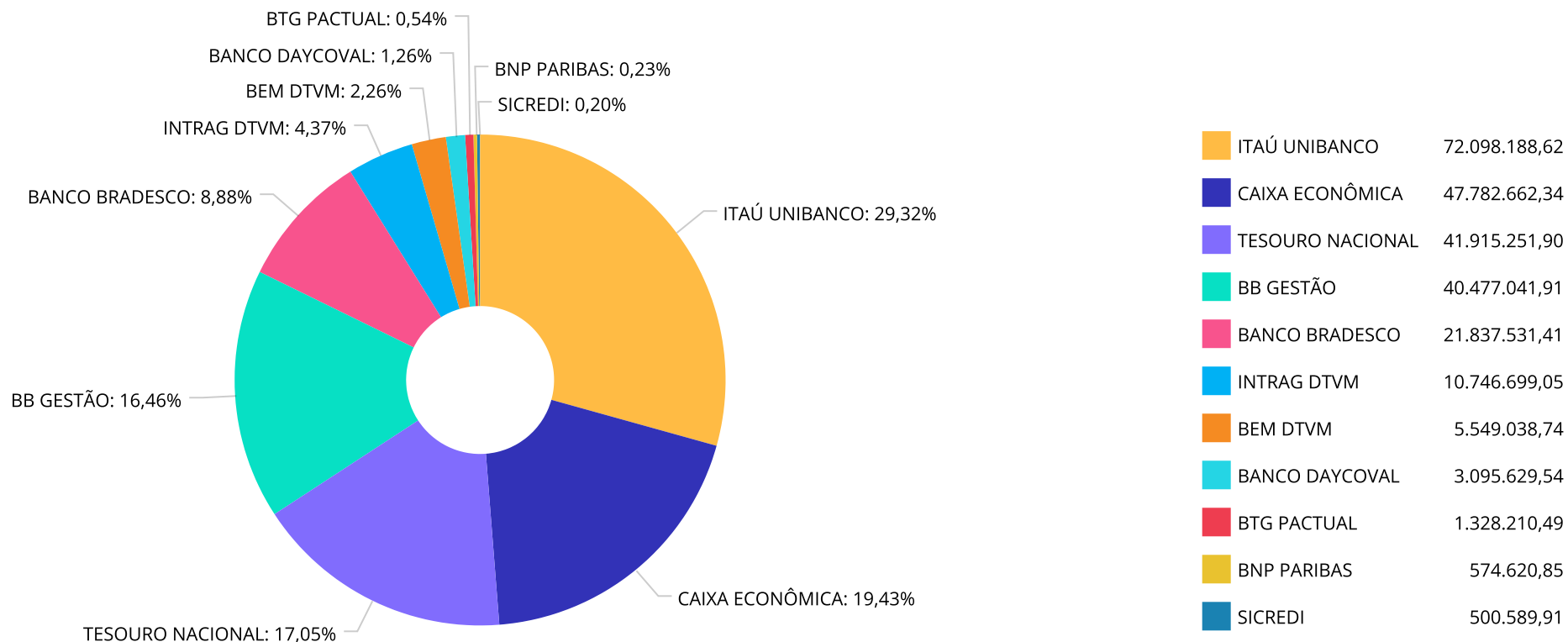
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	7,37%	12,54%	5,83%	13,46%	12,71%	-	-	-
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%	-	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,57%	-2,24%	2,62%	-0,76%	7,93%	47,85%	5,60%	15,02%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,10%	-0,99%	-0,99%	5,50%	16,35%	66,92%	6,82%	15,89%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2,85%	-6,80%	1,03%	-2,77%	-1,94%	10,98%	5,67%	13,93%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,14%	-7,80%	0,25%	-4,58%	-2,85%	8,10%	5,51%	15,03%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	5,60%	-6,38%	0,42%	0,41%	-7,96%	14,27%	9,68%	19,12%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	2,95%	-10,25%	-0,04%	-5,47%	-0,69%	24,87%	4,63%	16,53%
IDIV (Benchmark)	1,89%	-1,58%	2,90%	2,00%	11,06%	31,85%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,09%	-4,20%	2,86%	0,06%	3,70%	19,05%	5,13%	12,06%
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%

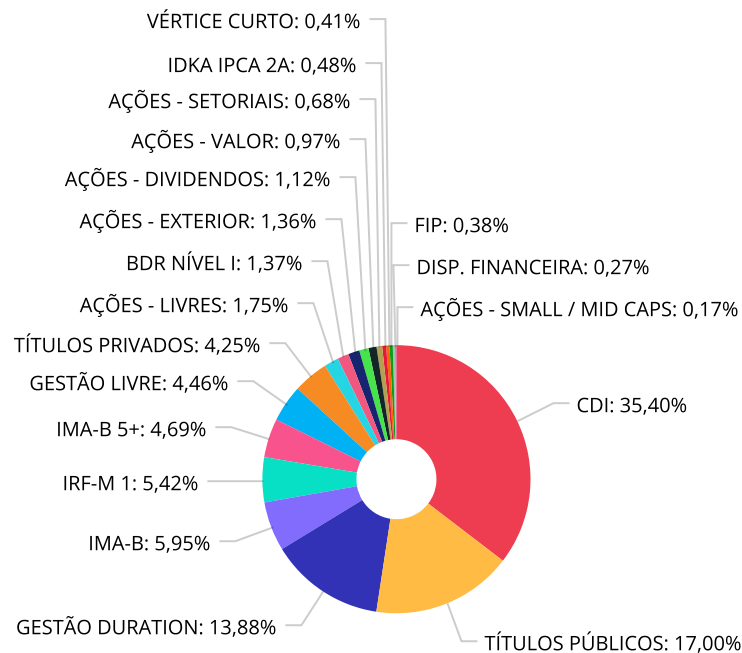
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
MSCI ACWI (Benchmark)	3,40%	30,98%	17,81%	27,34%	37,49%	39,32%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	3,99%	22,20%	15,30%	16,64%	28,85%	25,37%	7,68%	12,789%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	2,36%	27,27%	15,51%	23,81%	36,07%	41,58%	6,32%	13,470%

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



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



■ CDI	87.286.468,95	■ TÍTULOS PÚBLICOS	41.915.251,90	■ GESTÃO DURATION	34.212.688,27	■ IMA-B	14.663.953,28
■ IRF-M 1	13.361.832,16	■ IMA-B 5+	11.575.181,40	■ GESTÃO LIVRE	11.002.749,90	■ TÍTULOS PRIVADOS	10.470.118,19
■ AÇÕES - LIVRES	4.320.152,06	■ BDR NÍVEL I	3.370.790,26	■ AÇÕES - EXTERIOR	3.353.789,07	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.769.870,52
■ AÇÕES - VALOR	2.387.899,79	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.671.040,31	■ IDKA IPCA 2A	1.172.658,53	■ VÉRTICE CURTO	1.016.921,32
■ FIP	943.183,24	■ DISP. FINANCEIRA	669.996,27	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	410.915,61		

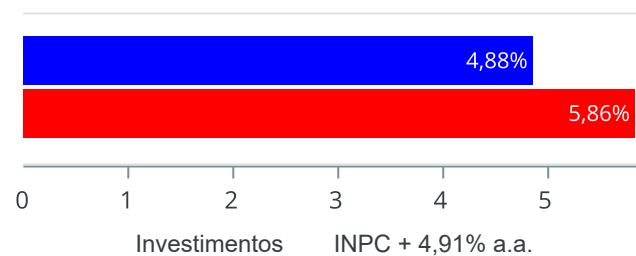
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	20/06/2023	2.260	4.345,212923	4.648,109886	9.820.181,21	10.504.728,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	20/06/2023	2.290	4.339,506607	4.582,905232	9.937.470,13	10.494.852,98	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	28/09/2023	2.333	4.192,636257	4.416,900384	9.781.420,39	10.304.628,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	26/09/2023	2.326	4.267,688168	4.561,926905	9.926.642,68	10.611.041,98	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

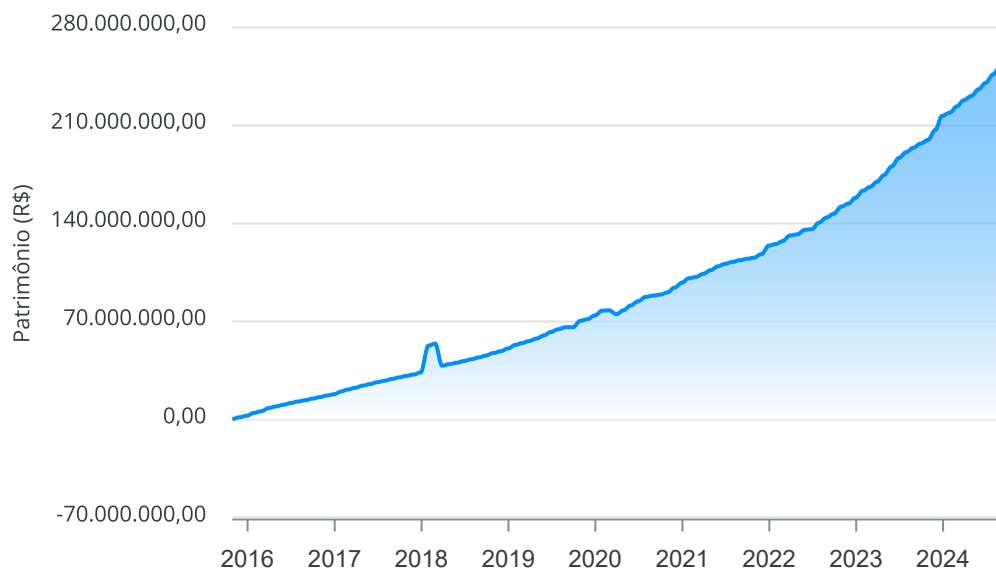
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	216.477.198,98	2.474.696,14	1.308.315,22	218.535.637,48	892.057,58	892.057,58	0,41%	0,41%	0,99%	0,99%	41,33%	1,06%
Fevereiro	218.535.637,48	15.475.414,98	13.362.703,20	222.597.204,24	1.948.854,98	2.840.912,56	0,88%	1,30%	1,17%	2,18%	59,53%	1,05%
Março	222.597.204,24	4.237.070,01	1.084.377,04	227.564.729,64	1.814.832,43	4.655.744,99	0,80%	2,11%	0,57%	2,76%	76,41%	0,87%
Abril	227.564.729,64	4.010.564,29	1.107.380,11	230.513.615,79	45.701,97	4.701.446,96	0,02%	2,13%	0,79%	3,58%	59,61%	1,20%
Mai	230.513.615,79	4.792.895,38	1.738.495,09	235.419.265,13	1.851.249,05	6.552.696,01	0,79%	2,94%	0,86%	4,47%	65,81%	1,01%
Junho	235.419.265,13	4.490.874,44	1.702.611,74	239.840.703,46	1.633.175,63	8.185.871,64	0,69%	3,65%	0,63%	5,13%	71,10%	1,26%
Julho	239.840.703,46	4.322.397,29	1.158.896,15	245.905.464,76	2.901.260,16	11.087.131,80	1,19%	4,88%	0,70%	5,86%	83,29%	1,18%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



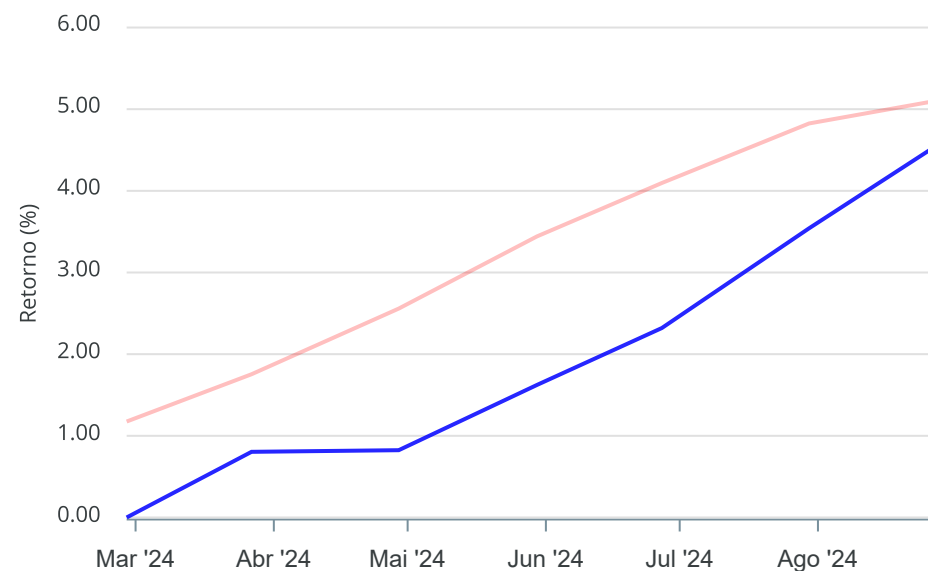
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.966.550,43	0,00	0,00	6.157.345,69	190.795,26	3,20%	3,20%	3,38%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	5.249.996,35	0,00	0,00	5.417.835,71	167.839,36	3,20%	3,20%	3,40%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.488.022,16	0,00	0,00	7.643.753,59	155.731,43	2,08%	2,08%	2,25%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.879.287,82	0,00	0,00	7.020.199,69	140.911,87	2,05%	2,05%	2,10%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	9.687.415,91	0,00	0,00	9.803.515,81	116.099,90	1,20%	1,20%	0,48%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	10.894.280,52	0,00	0,00	11.002.749,90	108.469,38	1,00%	1,00%	0,07%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.007.101,02	0,00	0,00	1.016.921,32	9.820,30	0,98%	0,98%	0,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	9.268.974,48	0,00	0,00	9.359.088,95	90.114,47	0,97%	0,97%	0,04%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.305.495,81	0,00	0,00	5.356.495,37	50.999,56	0,96%	0,96%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	26.907.584,58	0,00	0,00	27.162.440,52	254.855,94	0,95%	0,95%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.288.020,00	0,00	0,00	7.355.704,81	67.684,81	0,93%	0,93%	0,28%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.952.205,05	0,00	0,00	6.006.127,35	53.922,30	0,91%	0,91%	0,28%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.980.548,08	1.065.065,13	1.158.896,15	13.013.865,34	127.148,28	0,91%	0,97%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	20.342.629,66	0,00	0,00	20.526.575,64	183.945,98	0,90%	0,90%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	24.196.828,71	0,00	0,00	24.409.172,46	212.343,75	0,88%	0,88%	0,56%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.466.168,69	1.803.384,37	0,00	11.367.413,22	97.860,16	0,87%	1,00%	0,05%
LETRA FINANCEIRA BRANCO	10.389.674,58	0,00	0,00	10.470.118,19	80.443,61	0,77%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	41.596.568,14	0,00	0,00	41.915.251,90	318.683,76	0,77%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.164.205,23	0,00	0,00	1.172.658,53	8.453,30	0,73%	0,73%	1,03%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	500.589,91	589,91	0,12%	0,91%	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
Total Renda Fixa	222.031.557,22	3.368.449,50	1.158.896,15	226.677.823,90	2.436.713,33	1,09%		0,58%

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	1.188.547,93	250.000,00	0,00	1.510.233,75	71.685,82	4,98%	5,60%	9,68%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.660.988,08	0,00	0,00	2.769.870,52	108.882,44	4,09%	4,09%	5,13%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.623.094,47	0,00	0,00	1.671.040,31	47.945,84	2,95%	2,95%	4,63%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.221.018,17	0,00	0,00	2.284.211,82	63.193,65	2,85%	2,85%	5,67%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	604.006,37	250.000,00	0,00	877.666,04	23.659,67	2,77%	3,57%	5,60%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.300.329,04	0,00	0,00	1.328.210,49	27.881,45	2,14%	2,14%	5,51%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	693.187,15	0,00	0,00	707.729,75	14.542,60	2,10%	2,10%	6,82%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	405.082,99	0,00	0,00	410.915,61	5.832,62	1,44%	1,44%	8,27%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	491.471,54	453.947,79	0,00	943.183,24	-2.236,09	-0,24%	-	-
Total Renda Variável	11.187.725,74	953.947,79	0,00	12.503.061,53	361.388,00	2,98%		6,05%

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
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	552.569,06	0,00	0,00	574.620,85	22.051,79	3,99%	3,99%	7,68%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	2.715.098,03	0,00	0,00	2.779.168,22	64.070,19	2,36%	2,36%	6,32%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.353.753,41	0,00	0,00	3.370.790,26	17.036,85	0,51%	0,51%	10,12%
Total Exterior	6.621.420,50	0,00	0,00	6.724.579,33	103.158,83	1,56%		8,34%

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.

