

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2024

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

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	13.933.572,93	9,26%	682	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.186.575,06	3,45%	849	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.280.624,05	2,18%	627	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.064.049,58	0,71%	385	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	500.664,79	0,33%	172	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FL...	D+1	Não há	8.167.320,35	5,43%	95	1,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.462.329,23	2,97%	747	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.620.669,57	4,40%	813	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.721.325,51	4,47%	902	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.716.414,47	1,14%	739	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.872.808,83	2,57%	1.152	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	10.529.381,60	7,00%	232	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.862.873,88	3,23%	414	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	814.208,58	0,54%	1.167	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.587.046,51	6,37%	146	1,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.413.226,42	8,25%	146	1,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA RE...	D+0	Não há	13.580.589,04	9,03%	507	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.230.939,85	1,48%	1.022	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	1.433.546,10	0,95%	470	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	133.905,11	0,09%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

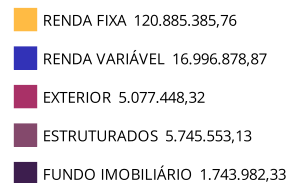
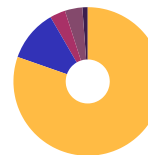
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	29.259,77	0,02%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	7.729.575,94	5,14%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 14,56%	D+0	Não se aplica	300.506,86	0,20%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	153.918,85	0,10%	35	1,10%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	623.771,30	0,41%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	936.281,58	0,62%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.067.529,89	0,71%	2.288	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.010.176,89	1,34%	16.231	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.865.051,97	2,57%	240	7,97%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.883.080,95	1,92%	116	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.126.723,35	2,08%	344	0,67%	Artigo 8º, Inciso I
MAG BRASIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.459.318,04	1,63%	1.438	0,84%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.584.997,78	1,05%	32	1,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.633.427,29	1,09%	22.365	0,25%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.444.021,03	2,29%	448	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.745.553,11	3,82%	33.881	0,47%	Artigo 10º, Inciso I
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.743.982,33	1,16%		1,23%	Artigo 11º

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			150.449.248,41				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.346.120,52				Artigo 6º
PL Total			151.795.368,93				

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%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	25,00%	37.612.312,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	70.918.609,85	47,14%	20,00%	30,00%	80,00%	49.440.788,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	40.222.721,38	26,74%	15,00%	20,00%	50,00%	35.001.902,83
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	8.030.082,80	5,34%	0,00%	15,00%	20,00%	22.059.766,88
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	777.690,15	0,52%	0,00%	1,00%	5,00%	6.744.772,27
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	936.281,58	0,62%	0,00%	1,00%	5,00%	6.586.180,84
Total Renda Fixa	100,00%	120.885.385,76	80,35%	35,00%	77,00%	185,00%	

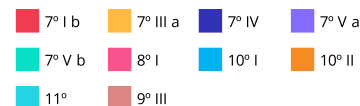
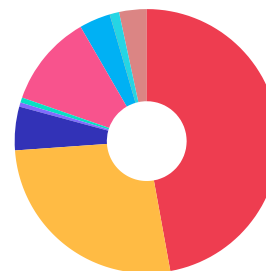


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	16.996.878,87	11,30%	5,00%	15,00%	30,00%	28.137.895,65
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	45.134.774,52
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.745.553,12	3,82%	1,00%	3,00%	10,00%	9.299.371,72
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.522.462,41
Artigo 11º	5,00%	1.743.982,33	1,16%	0,00%	2,00%	5,00%	5.778.480,09
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	24.486.414,33	16,28%	6,00%	20,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.077.448,32	3,37%	0,00%	2,00%	10,00%	9.967.476,52
Total Exterior	10,00%	5.077.448,32	3,37%	0,00%	2,00%	10,00%	

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%	1,00%	5,00%	7.522.462,42



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	0,00	0,00	0,00	25,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	56.985.036,92	37,88	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	40.222.721,38	26,74	15,00	50,00
Artigo 7º, Inciso IV	8.030.082,80	5,34	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	777.690,15	0,52	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	936.281,58	0,62	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	16.996.878,87	11,30	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	5.077.448,32	3,37	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.745.553,12	3,82	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,01	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	1.743.982,33	1,16	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
BANCO BRADESCO	50.496.315,24	33,56	0,00
CAIXA DTVM	44.460.763,97	29,55	0,23
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.168.852,28	22,71	-
BANCO BTG PACTUAL	8.030.082,80	5,34	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.126.723,35	2,08	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	2.459.318,04	1,63	0,02
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.743.982,33	1,16	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.584.997,78	1,05	0,02
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.433.546,10	0,95	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.067.529,89	0,71	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	936.281,58	0,62	5,54
GRAPHEN INVESTIMENTOS	623.771,30	0,41	0,72
GENIAL GESTÃO LTDA	183.178,63	0,12	-
RJI CORRETORA DE VALORES	133.905,11	0,09	0,09
ARENA CAPITAL	0,01	0,00	0,00

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%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,70%	-	-	-	-	-	0,99%	-
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,22%	8,33%	3,44%	6,98%	15,41%	35,68%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1,05%	1.112,14%	0,03%	1.019,71%	953,41%	2.024,99%	-	-
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)	1,55%	1,77%	1,44%	1,17%	7,38%	27,10%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54%	1,62%	1,37%	1,03%	7,10%	26,22%	1,99%	3,60%
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%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,36%	-7,53%	1,02%	1,88%	-27,26%	-23,84%	0,08%	23,12%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,89%	4,07%	2,29%	3,39%	7,81%	19,66%	0,87%	1,74%

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,18%	-75,80%	-3,65%	-69,74%	-80,41%	-84,45%	0,17%	65,85%

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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,06%	0,77%	2,36%	1,26%	4,04%	19,75%	2,12%	3,92%
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%

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%

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	6,26%	2,62%	5,25%	11,61%	26,75%	0,04%	0,06%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,64%	3,81%	1,61%	3,17%	7,02%	15,96%	0,07%	0,14%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94%	6,47%	2,61%	5,37%	12,17%	27,54%	0,01%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,97%	6,39%	2,66%	5,33%	12,00%	27,35%	0,03%	0,08%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,00%	6,74%	2,74%	5,59%	12,51%	28,26%	0,05%	0,11%

IPCA (Benchmark)	0,38%	2,87%	1,05%	2,44%	4,50%	8,67%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	6,82%	3,08%	5,64%	11,37%	-	0,25%	0,84%

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
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 14,56%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,28%	3,11%	1,94%	2,64%	7,62%	23,72%	1,29%	1,98%
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)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,49%	-1,17%	-1,28%	-0,42%	-7,60%	-6,92%	0,06%	4,95%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	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 MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,31%	1,89%	1,24%	1,87%	5,94%	17,12%	1,79%	3,04%
Global BDRX (Benchmark)	0,29%	41,47%	21,39%	35,02%	51,99%	65,02%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES 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%	-	-
BRADESCO SELECTION FICAÇÕES	4,15%	-9,73%	-0,20%	-5,69%	-6,28%	7,78%	5,76%	14,63%
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	2,47%	-8,91%	1,38%	-2,62%	-0,25%	11,41%	5,03%	13,01%
MAG BRASIL FICAÇÕES	3,09%	-5,70%	1,11%	-1,17%	2,08%	12,65%	4,49%	12,74%
FINACAP MAURITSSTAD FICAÇÕES	1,35%	-5,43%	0,67%	-0,04%	3,56%	25,60%	5,76%	14,22%
SCHRODER BEST IDEAS FICAÇÕES	5,58%	-7,19%	2,24%	-2,37%	0,07%	17,80%	5,16%	13,75%
IDIV (Benchmark)	1,89%	-1,58%	2,90%	2,00%	11,06%	31,85%	-	-
BRADESCO H DIVIDENDOS FICAÇÕES	1,82%	-2,18%	2,63%	1,50%	10,07%	29,67%	4,99%	11,84%
IFIX (Benchmark)	0,52%	1,61%	-0,50%	0,94%	5,24%	19,57%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,38%	2,87%	1,05%	2,44%	4,50%	8,67%	-	-

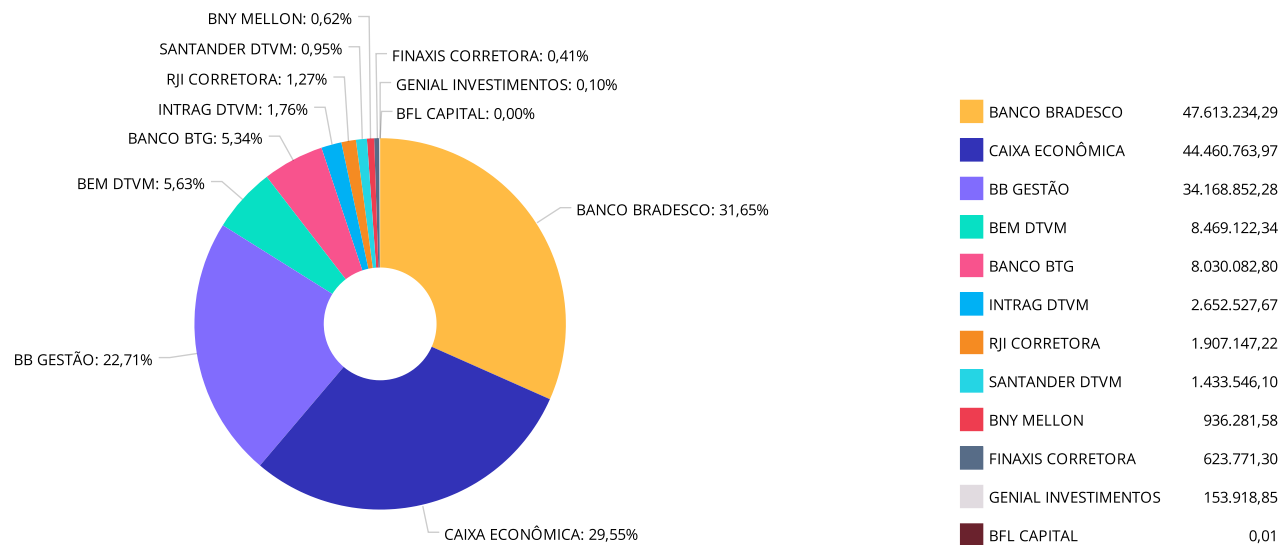
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	1,49%	-13,59%	-2,33%	-7,53%	-13,35%	1,79%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,73%	-0,18%	2,58%	2,98%	0,86%	15,02%	5,31%	15,88%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	1,13%	7,89%	3,14%	6,71%	13,38%	27,93%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-

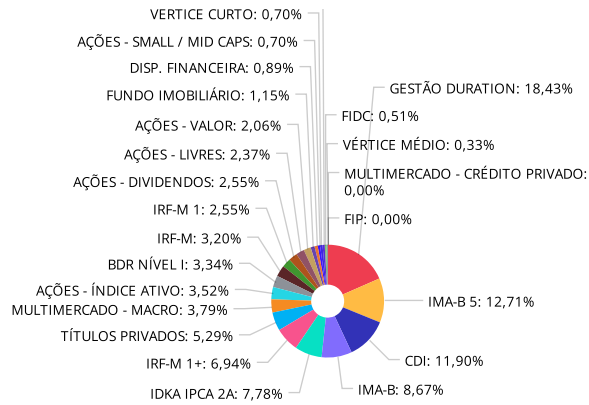
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,51%	40,23%	20,99%	34,11%	49,78%	60,78%	10,12%	14,934%
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-0,75%	25,46%	11,51%	20,87%	39,24%	67,67%	11,29%	16,021%

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



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

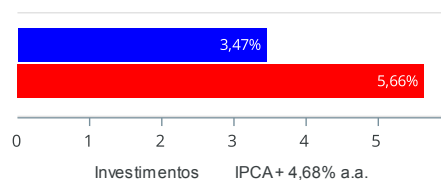


■ GESTÃO DURATION	27.982.948,67	■ IMA-B 5	19.297.716,81	■ CDI	18.059.283,57
■ IMA-B	13.164.358,87	■ IDKA IPCA 2A	11.807.244,63	■ IRF-M 1+	10.529.381,60
■ TÍTULOS PRIVADOS	8.030.082,80	■ MULTIMERCADO - MACRO	5.745.553,11	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.342.398,99
■ BDR NÍVEL I	5.077.448,32	■ IRF-M	4.862.873,88	■ IRF-M 1	3.872.808,83
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.865.051,97	■ AÇÕES - LIVRES	3.595.174,67	■ AÇÕES - VALOR	3.126.723,35
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.743.982,33	■ DISP. FINANCEIRA	1.346.120,52	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.067.529,89
■ VÉRTICE CURTO	1.064.049,58	■ CRÉDITO PRIVADO	936.281,58	■ FIDC	777.690,15
■ VÉRTICE MÉDIO	500.664,79	■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	0,01	■ FIP	0,01

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	131.921.519,37	5.400.000,00	3.100.000,00	134.359.826,23	138.306,86	138.306,86	0,10%	0,10%	0,82%	0,82%	12,54%	1,31%
Fevereiro	134.359.826,23	2.750.000,00	3.329.427,64	134.956.658,54	1.176.259,95	1.314.566,81	0,88%	0,98%	1,18%	2,01%	48,73%	1,48%
Março	134.956.658,54	6.009.427,64	3.342.028,30	138.717.712,10	1.093.654,22	2.408.221,03	0,79%	1,78%	0,52%	2,54%	70,03%	1,29%
Abril	138.717.712,10	0,00	310.000,00	137.292.029,03	-1.115.683,07	1.292.537,96	-0,80%	0,96%	0,78%	3,35%	28,79%	1,89%
Mai	137.292.029,03	2.000.000,00	2.800.000,00	137.296.883,50	804.854,47	2.097.392,43	0,59%	1,56%	0,84%	4,22%	36,87%	1,46%
Junho	137.296.883,50	0,00	4.550.000,00	133.497.603,98	750.720,48	2.848.112,91	0,55%	2,11%	0,57%	4,82%	43,82%	1,86%
Julho	133.497.603,98	4.199.988,01	3.150.000,00	136.343.882,10	1.796.290,11	4.644.403,02	1,34%	3,47%	0,80%	5,66%	61,43%	1,83%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



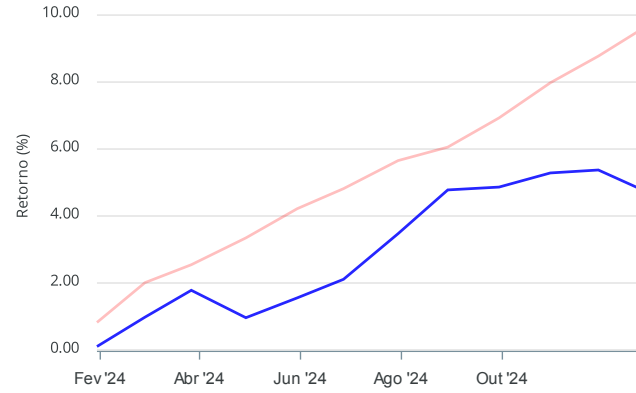
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 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...	3.213.955,86	0,00	0,00	3.280.624,05	66.668,19	2,07%	2,07%	2,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.681.560,05	0,00	0,00	1.716.414,47	34.854,42	2,07%	2,07%	2,12%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	11.097.505,20	0,00	3.150.000,00	8.167.320,35	219.815,15	1,98%	2,06%	2,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FL...	10.369.963,59	0,00	0,00	10.529.381,60	159.418,01	1,54%	1,54%	1,99%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.799.182,08	0,00	0,00	4.862.873,88	63.691,80	1,33%	1,33%	1,41%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.466.311,32	0,00	0,00	9.587.046,51	120.735,19	1,28%	1,28%	1,29%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	152.324,03	0,00	0,00	153.918,85	1.594,82	1,05%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	13.790.733,04	0,00	0,00	13.933.572,93	142.839,89	1,04%	1,04%	0,44%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFE...	13.446.730,48	0,00	0,00	13.580.589,04	133.858,56	1,00%	1,00%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.053.677,43	0,00	0,00	1.064.049,58	10.372,15	0,98%	0,98%	0,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	806.368,93	0,00	0,00	814.208,58	7.839,65	0,97%	0,97%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.209.459,26	0,00	0,00	2.230.939,85	21.480,59	0,97%	0,97%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.419.720,02	0,00	0,00	4.462.329,23	42.609,21	0,96%	0,96%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.837.172,49	0,00	0,00	3.872.808,83	35.636,34	0,93%	0,93%	0,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.781.097,55	0,00	120.000,00	6.721.325,51	60.227,96	0,89%	0,89%	0,84%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	12.303.984,70	0,00	0,00	12.413.226,42	109.241,72	0,89%	0,89%	0,87%
LETRA FINANCEIRA BTG	7.667.843,88	0,00	0,00	7.729.575,94	61.732,06	0,81%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.147.269,79	0,00	0,00	5.186.575,06	39.305,27	0,76%	0,76%	0,94%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI CRÉDITO PRI...	930.338,42	0,00	0,00	936.281,58	5.943,16	0,64%	0,64%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.781.468,16	2.800.000,01	0,00	6.620.669,57	39.201,40	0,60%	0,73%	1,03%

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
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	133.420,01	0,00	0,00	133.905,11	485,10	0,36%	0,36%	0,08%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	0,00	1.430.000,00	0,00	1.433.546,10	3.546,10	0,25%	0,94%	0,01%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 14,56%	0,00	300.000,00	0,00	300.506,86	506,86	0,17%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	499.988,00	0,00	500.664,79	676,79	0,14%	0,70%	0,99%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	626.815,97	0,00	0,00	623.771,30	-3.044,67	-0,49%	-0,49%	0,06%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	29.607,64	0,00	0,00	29.259,77	-347,87	-1,17%	-1,17%	0,17%
Total Renda Fixa	117.746.509,90	5.029.988,01	3.270.000,00	120.885.385,76	1.378.887,85	1,15%		0,96%

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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.009.720,48	0,00	0,00	1.067.529,89	57.809,41	5,73%	5,73%	5,31%
SCHRODER BEST IDEAS FIAÇÕES	1.501.241,89	0,00	0,00	1.584.997,78	83.755,89	5,58%	5,58%	5,16%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.768.101,69	0,00	0,00	2.883.080,95	114.979,26	4,15%	4,15%	5,76%
MAG BRASIL FIAÇÕES	2.385.655,97	0,00	0,00	2.459.318,04	73.662,07	3,09%	3,09%	4,49%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.961.766,81	0,00	0,00	2.010.176,89	48.410,08	2,47%	2,47%	5,03%
BRADESCO H DIV IDENDOS FIAÇÕES	3.796.149,15	0,00	0,00	3.865.051,97	68.902,82	1,82%	1,82%	4,99%
FINACAP MAURITSSTAD FIAÇÕES	3.085.121,89	0,00	0,00	3.126.723,35	41.601,46	1,35%	1,35%	5,76%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.671.088,59	0,00	0,00	5.745.553,11	74.464,52	1,31%	1,31%	1,79%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.746.011,06	0,00	0,00	1.743.982,33	-2.028,73	-0,12%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	23.924.857,55	0,00	0,00	24.486.414,33	561.556,78	2,35%		4,05%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3.426.614,05	0,00	0,00	3.444.021,03	17.406,98	0,51%	0,51%	10,12%
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.645.722,84	0,00	0,00	1.633.427,29	-12.295,55	-0,75%	-0,75%	11,29%
Total Exterior	5.072.336,89	0,00	0,00	5.077.448,32	5.111,43	0,10%		10,50%

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.

