

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	592.322,50	0,07%	783	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	163.440.351,85	18,66%	385	4,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA F...	D+0	15/05/2025	9.178.392,32	1,05%	124	1,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRDESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	34.299.004,62	3,92%	13	29,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	324.594.641,05	37,05%	226	13,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	6.636.114,87	0,76%	34	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	187.624,66	0,02%	20	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	804.724,10	0,09%	747	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.414.856,66	0,16%	813	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	353.245,94	0,04%	902	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.483.478,77	0,28%	267	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.669.248,92	0,65%	739	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	13.254.174,48	1,51%	30	5,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	393.315,61	0,04%	203	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.279.434,81	0,26%	23	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	886.852,19	0,10%	135	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.426.028,78	1,87%	60	6,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	114.039.128,88	13,02%	112	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.411.223,18	1,19%	91	2,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	14.694,91	0,00%	1.029	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

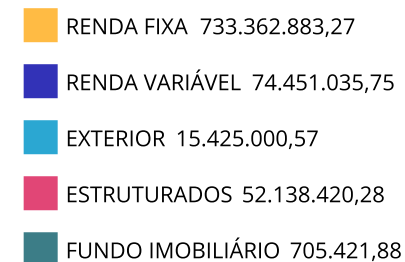
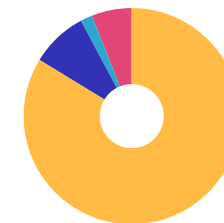
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.652.000,32	0,42%	93	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	3.413.961,62	0,39%	1.420	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	439.443,07	0,05%	507	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	8.910.138,25	1,02%	361	0,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	506.576,93	0,06%	1.022	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.950.914,16	0,34%	217	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	162.481,13	0,02%	66	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAU HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	5.968.508,69	0,68%	1.325	0,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	13.432.672,66	1,53%	21.327	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	10.882.304,16	1,24%	16.231	0,96%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.967.734,74	0,22%	853	0,36%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	2.902.562,62	0,33%	200	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	150.215,38	0,02%	79	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	107.320,85	0,01%	82	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.718.842,89	0,20%	5.608	1,79%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.849.064,22	0,44%	2.266	1,60%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.172.378,38	0,48%	1.963	2,19%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.138.150,15	1,50%	16.231	1,48%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	D+4	Não há	8.084.633,92	0,92%	14.221	1,35%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.537.804,89	0,18%	2.899	0,61%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.537.724,51	0,40%	111	2,48%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FI...	D+3 du	Não há	3.924.740,68	0,45%	2.508	7,49%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	5.044.885,70	0,58%	27	2,30%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3 du	Não há	15.425.000,57	1,76%	3.966	7,55%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	8.309.308,87	0,95%	7.906	0,43%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	17.611.379,18	2,01%	604	1,31%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	26.217.732,23	2,99%	109	3,10%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	705.421,88	0,08%		0,28%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			876.082.761,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			594.535,80				Artigo 6º
PL Total			876.677.297,55				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	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%	1,00%	40,00%	350.433.104,70
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	707.344.164,19	80,74%	15,00%	73,00%	90,00%	81.130.321,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	70,00%	20.050.210,39	2,29%	2,00%	9,00%	60,00%	505.599.446,66
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	175.216.552,35
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	10,00%	5.968.508,69	0,68%	0,00%	1,00%	5,00%	37.835.629,40
Total Renda Fixa	100,00%	733.362.883,27	83,71%	17,00%	87,00%	215,00%	



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!

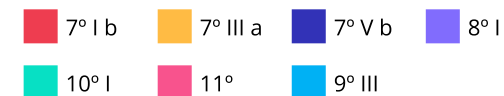
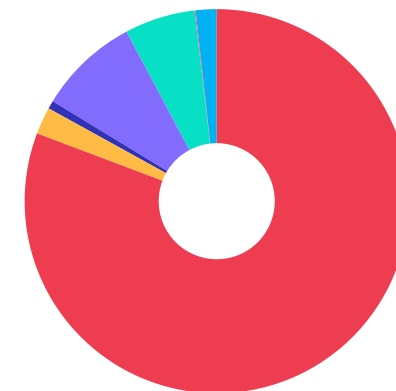


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	74.451.035,75	8,50%	0,00%	9,90%	30,00%	188.373.792,78
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	52.138.420,28	5,95%	0,00%	2,00%	10,00%	35.469.855,90
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	8.760.827,62
Artigo 11º	10,00%	705.421,88	0,08%	0,00%	0,10%	1,00%	8.055.405,74
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	127.294.877,91	14,53%	0,00%	12,00%	42,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	87.608.276,18
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	15.425.000,57	1,76%	0,00%	1,00%	10,00%	72.183.275,61
Total Exterior	10,00%	15.425.000,57	1,76%	0,00%	1,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	87.608.276,18



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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	707.344.164,19	80,74	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	20.050.210,39	2,29	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5.968.508,69	0,68	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	74.451.035,75	8,50	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	15.425.000,57	1,76	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	52.138.420,28	5,95	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 11º	705.421,88	0,08	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ASSET	398.911.776,33	45,53	2,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	197.540.738,40	22,55	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	149.846.007,22	17,10	0,03
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	46.846.350,97	5,35	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	38.152.409,31	4,35	0,56
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	34.459.548,63	3,93	-
ITAÚ UNIBANCO	5.968.508,69	0,68	0,00
BANCO BRADESCO	3.652.000,32	0,42	0,00
ZION INVEST	705.421,88	0,08	-

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 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,82%	-	-	-	-	-	0,36%	-
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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,92%	6,43%	2,54%	5,47%	10,77%	22,10%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,81%	3,63%	2,61%	2,53%	5,05%	8,88%	0,11%	3,81%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,91%	4,27%	2,37%	3,56%	8,16%	20,37%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,89%	4,12%	2,31%	3,44%	7,90%	19,83%	0,83%	1,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	4,12%	2,31%	3,44%	7,91%	19,88%	0,84%	1,74%
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%
IMA-B (Benchmark)	2,09%	0,97%	2,45%	1,43%	4,38%	20,51%	-	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2,04%	0,02%	2,19%	0,59%	3,30%	20,10%	2,27%	4,21%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,07%	0,81%	2,38%	1,29%	4,10%	19,90%	2,12%	3,92%

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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,08%	0,75%	2,29%	1,25%	4,14%	19,96%	2,25%	4,05%
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 FIC RENDA FIXA	2,06%	0,65%	2,29%	1,11%	3,75%	19,67%	2,17%	3,97%

CDI (Benchmark)	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	5,57%	2,29%	4,64%	10,41%	24,18%	0,00%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,93%	7,73%	2,97%	6,80%	12,49%	24,75%	0,56%	1,69%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,98%	6,76%	2,74%	5,67%	12,85%	28,88%	0,04%	0,15%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,98%	3,70%	3,06%	2,56%	4,97%	-	0,25%	4,14%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,00%	6,74%	2,74%	5,59%	12,51%	28,26%	0,05%	0,11%
BRADESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	0,98%	6,80%	3,07%	5,63%	11,35%	-	0,26%	0,84%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,89%	6,09%	2,52%	5,09%	11,33%	26,31%	0,00%	0,06%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,72%	4,93%	2,03%	4,11%	9,27%	21,47%	0,01%	0,06%
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 DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,81%	5,55%	2,29%	4,63%	10,40%	23,40%	0,00%	0,06%

IPCA (Benchmark)	0,38%	2,87%	1,05%	2,44%	4,50%	8,67%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,96%	3,35%	1,85%	2,67%	7,47%	23,28%	0,64%	1,34%
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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,04%	3,08%	2,05%	2,76%	7,62%	21,66%	0,66%	1,80%

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 TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	6,82%	3,08%	5,64%	11,37%	-	0,25%	0,84%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
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, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	3,02%	-4,87%	1,37%	-0,08%	4,68%	23,74%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3,19%	-5,07%	1,81%	-0,42%	3,87%	22,26%	4,60%	13,25%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,00%	-7,46%	0,52%	-3,91%	0,88%	21,54%	7,00%	14,71%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1,86%	-12,97%	0,06%	-4,95%	-16,20%	-16,85%	7,81%	20,49%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2,47%	-8,91%	1,38%	-2,62%	-0,25%	11,41%	5,03%	13,01%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2,95%	-4,96%	1,32%	-0,24%	4,51%	23,20%	4,68%	12,93%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,70%	-6,21%	-1,74%	-3,58%	3,53%	22,46%	7,34%	15,77%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2,85%	-6,80%	1,03%	-2,77%	-1,94%	10,98%	5,67%	13,93%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3,90%	-6,83%	-1,13%	-3,13%	-0,49%	16,35%	6,77%	15,44%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	3,69%	-5,51%	-0,26%	-1,79%	1,51%	14,71%	5,42%	14,33%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	-1,13%	-17,44%	-3,11%	-5,80%	-2,94%	2,17%	8,63%	21,46%
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FIC AÇÕES	3,53%	-7,09%	1,92%	-1,94%	-3,52%	7,55%	5,86%	15,80%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	0,40%	13,81%	-1,74%	5,64%	34,38%	90,93%	9,96%	28,37%
IBX-50 (Benchmark)	3,15%	-3,17%	1,57%	1,02%	6,82%	24,69%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3,79%	-3,88%	1,72%	0,30%	3,86%	19,24%	4,45%	13,05%
IDIV (Benchmark)	1,89%	-1,58%	2,90%	2,00%	11,06%	31,85%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,74%	-2,18%	2,55%	1,40%	9,81%	28,57%	4,92%	11,56%

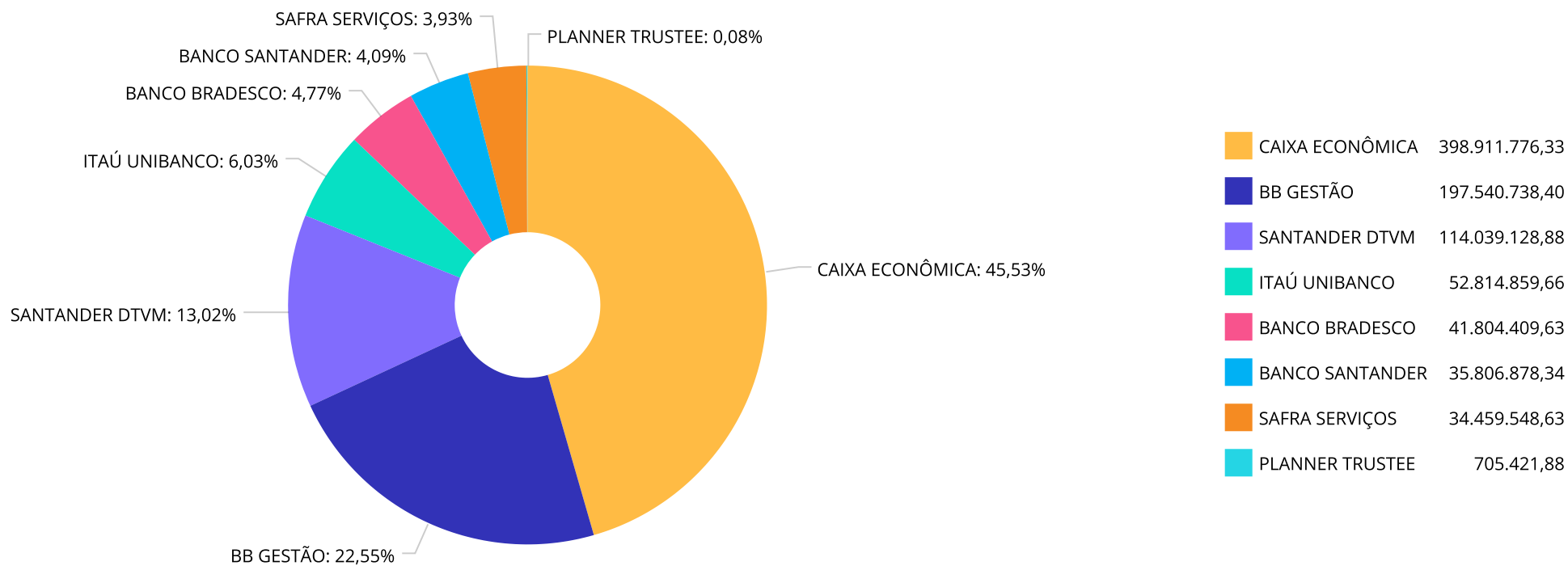
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	0,52%	1,61%	-0,50%	0,94%	5,24%	19,57%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	0,00%	25,55%	-9,00%	2,38%	-13,57%	-62,53%	15,20%	41,60%
MSCI ACWI (Benchmark)	3,40%	30,98%	17,81%	27,34%	37,49%	39,32%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,38%	18,31%	10,67%	16,35%	26,55%	52,86%	6,44%	11,50%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,13%	15,78%	9,66%	13,96%	20,34%	33,70%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	1,33%	17,93%	10,49%	16,04%	26,13%	51,83%	6,41%	11,44%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1,46%	17,93%	10,77%	15,99%	25,13%	45,13%	6,42%	11,49%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	1,38%	18,36%	10,74%	16,42%	26,57%	52,91%	6,44%	11,49%

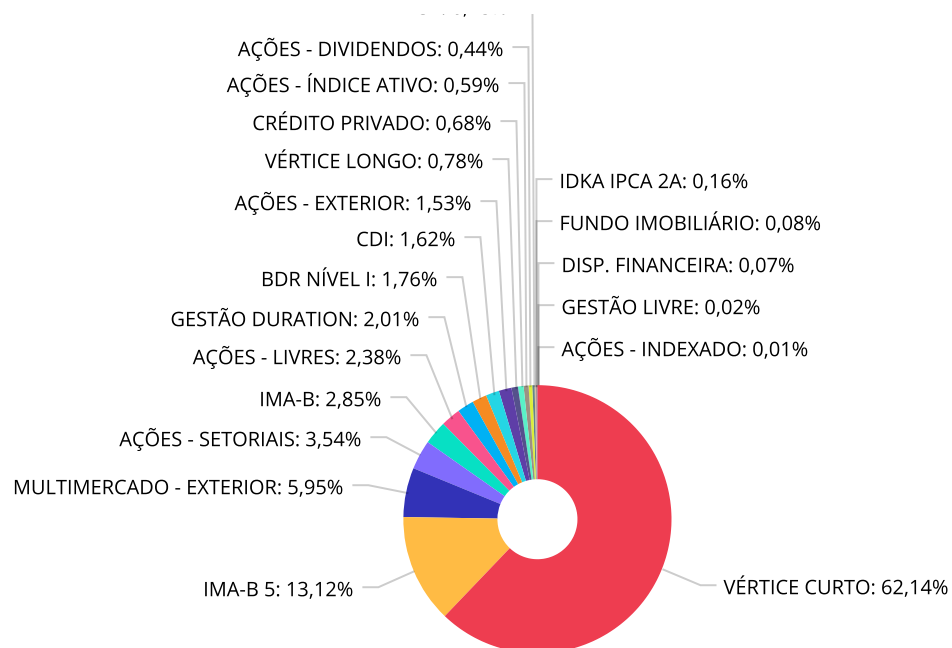
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3,67%	35,56%	19,23%	29,14%	46,46%	44,93%	6,90%	12,315%

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



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

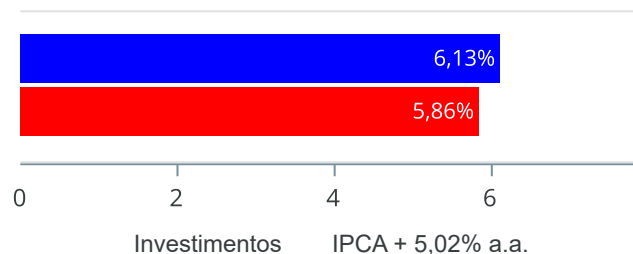


■ VÉRTICE CURTO	544.766.564,32	■ IMA-B 5	114.984.697,32	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	52.138.420,28	■ AÇÕES - SETORIAIS	31.038.746,02
■ IMA-B	24.962.821,39	■ AÇÕES - LIVRES	20.828.130,92	■ GESTÃO DURATION	17.624.068,49	■ BDR NÍVEL I	15.425.000,57
■ CDI	14.171.666,97	■ AÇÕES - EXTERIOR	13.432.672,66	■ VÉRTICE LONGO	6.823.739,53	■ CRÉDITO PRIVADO	5.968.508,69
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.195.101,08	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.849.064,22	■ IMA-B 5+	2.483.478,77	■ IDKA IPCA 2A	1.414.856,66
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	705.421,88	■ DISP. FINANCEIRA	594.535,80	■ GESTÃO LIVRE	162.481,13	■ AÇÕES - INDEXADO	107.320,85

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

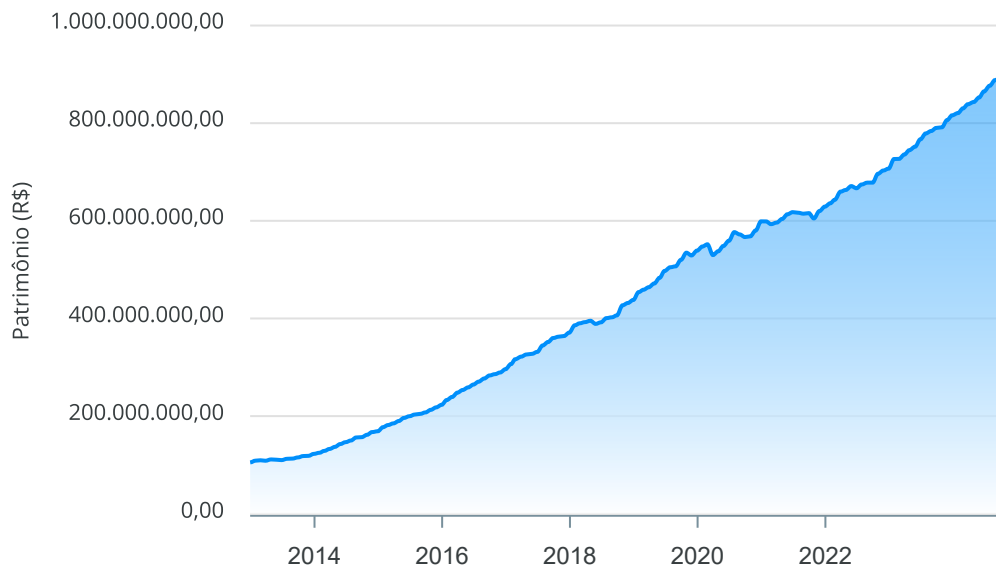
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	815.459.060,46	5.843.434,05	6.667.030,67	820.025.866,71	5.390.402,87	5.390.402,87	0,66%	0,66%	0,85%	0,85%	77,74%	1,25%
Fevereiro	820.025.866,71	27.096.214,82	25.027.641,67	829.671.554,41	7.577.114,55	12.967.517,42	0,92%	1,59%	1,20%	2,06%	76,99%	3,15%
Março	829.671.554,41	12.201.692,97	10.191.560,82	838.166.939,56	6.485.253,00	19.452.770,42	0,78%	2,38%	0,55%	2,63%	90,70%	1,16%
Abril	838.166.939,56	28.164.040,91	26.461.333,75	842.643.986,59	2.774.339,87	22.227.110,29	0,33%	2,72%	0,81%	3,46%	78,67%	1,37%
Mai	842.643.986,59	39.303.413,95	37.644.011,57	851.980.727,53	7.677.338,56	29.904.448,85	0,91%	3,65%	0,87%	4,36%	83,84%	1,48%
Junho	851.980.727,53	11.366.306,84	9.634.964,41	864.376.435,76	10.664.365,80	40.568.814,65	1,25%	4,95%	0,60%	4,98%	99,28%	1,36%
Julho	864.376.435,76	11.734.055,28	9.761.378,21	876.082.761,75	9.733.648,92	50.302.463,57	1,12%	6,13%	0,83%	5,86%	104,65%	1,46%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



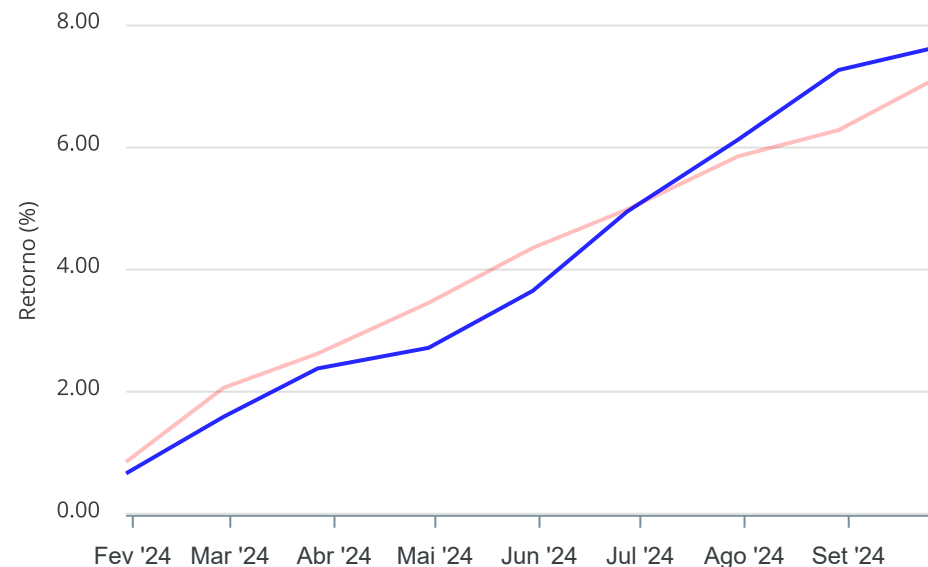
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	2.406.524,18	0,00	0,00	2.483.478,77	76.954,59	3,20%	3,20%	3,38%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.890.793,17	0,00	0,00	2.950.914,16	60.120,99	2,08%	2,08%	2,25%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.554.126,16	0,00	0,00	5.669.248,92	115.122,76	2,07%	2,07%	2,12%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	10.200.093,99	0,00	0,00	10.411.223,18	211.129,19	2,07%	2,07%	2,12%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.578.398,45	0,00	0,00	3.652.000,32	73.601,87	2,06%	2,06%	2,17%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.233.845,69	0,00	0,00	2.279.434,81	45.589,12	2,04%	2,04%	2,27%
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	184.380,91	0,00	0,00	187.624,66	3.243,75	1,76%	1,76%	2,35%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	16.257.002,55	0,00	0,00	16.426.028,78	169.026,23	1,04%	1,04%	0,66%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	435.111,65	0,00	0,00	439.443,07	4.331,42	1,00%	1,00%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	161.847.167,68	0,00	0,00	163.440.351,85	1.593.184,17	0,98%	0,98%	0,25%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	321.431.790,70	0,00	0,00	324.594.641,05	3.162.850,35	0,98%	0,98%	0,25%
BRDESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	33.966.965,46	0,00	0,00	34.299.004,62	332.039,16	0,98%	0,98%	0,26%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	13.125.883,96	0,00	0,00	13.254.174,48	128.290,52	0,98%	0,98%	0,25%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.910.787,47	0,00	0,00	5.968.508,69	57.721,22	0,98%	0,98%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	501.699,36	0,00	0,00	506.576,93	4.877,57	0,97%	0,97%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	797.040,07	0,00	0,00	804.724,10	7.684,03	0,96%	0,96%	0,64%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	160.991,06	0,00	0,00	162.481,13	1.490,07	0,93%	0,93%	0,56%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	113.028.653,86	0,00	0,00	114.039.128,88	1.010.475,02	0,89%	0,89%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	587.076,78	0,00	0,00	592.322,50	5.245,72	0,89%	0,89%	0,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	350.119,94	0,00	0,00	353.245,94	3.126,00	0,89%	0,89%	0,84%

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
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	879.060,84	0,00	0,00	886.852,19	7.791,35	0,89%	0,89%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	389.894,02	0,00	0,00	393.315,61	3.421,59	0,88%	0,88%	0,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.575,55	0,00	0,00	14.694,91	119,36	0,82%	0,82%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	9.104.226,84	0,00	0,00	9.178.392,32	74.165,48	0,81%	0,81%	0,36%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.582.796,29	0,00	0,00	6.636.114,87	53.318,58	0,81%	0,81%	0,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.404.657,45	0,00	0,00	1.414.856,66	10.199,21	0,73%	0,73%	1,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	9.127.860,07	5.734.055,28	6.039.667,51	8.910.138,25	87.890,41	0,59%	0,81%	0,00%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.105.398,14	3.000.000,00	3.721.710,70	3.413.961,62	30.274,18	0,43%	0,72%	0,01%
Total Renda Fixa	727.056.922,29	8.734.055,28	9.761.378,21	733.362.883,27	7.333.283,91	1,01%		0,43%

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
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4.011.835,44	0,00	0,00	4.172.378,38	160.542,94	4,00%	4,00%	7,00%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.480.092,69	0,00	0,00	1.537.804,89	57.712,20	3,90%	3,90%	6,77%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	144.731,77	0,00	0,00	150.215,38	5.483,61	3,79%	3,79%	4,45%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	3.411.970,37	0,00	0,00	3.537.724,51	125.754,14	3,69%	3,69%	5,42%
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FIC ...	3.790.961,16	0,00	0,00	3.924.740,68	133.779,52	3,53%	3,53%	5,86%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.889.084,32	0,00	0,00	5.044.885,70	155.801,38	3,19%	3,19%	4,60%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	104.249,97	0,00	0,00	107.320,85	3.070,88	2,95%	2,95%	4,68%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.913.296,55	0,00	0,00	1.967.734,74	54.438,19	2,85%	2,85%	5,67%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	10.620.231,09	0,00	0,00	10.882.304,16	262.073,07	2,47%	2,47%	5,03%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1.687.433,92	0,00	0,00	1.718.842,89	31.408,97	1,86%	1,86%	7,81%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.783.195,58	0,00	0,00	3.849.064,22	65.868,64	1,74%	1,74%	4,92%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	13.239.912,06	0,00	0,00	13.432.672,66	192.760,60	1,46%	1,46%	6,42%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8.196.278,35	0,00	0,00	8.309.308,87	113.030,52	1,38%	1,38%	6,44%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	25.873.962,38	0,00	0,00	26.217.732,23	343.769,85	1,33%	1,33%	6,41%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	14.442.617,42	3.000.000,00	0,00	17.611.379,18	168.761,76	0,97%	1,38%	6,44%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.882.373,36	0,00	0,00	2.902.562,62	20.189,26	0,70%	0,70%	7,34%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	13.086.132,84	0,00	0,00	13.138.150,15	52.017,31	0,40%	0,40%	9,96%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	705.421,88	0,00	0,00	705.421,88	0,00	0,00%	0,00%	15,20%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	8.176.645,34	0,00	0,00	8.084.633,92	-92.011,42	-1,13%	-1,13%	8,63%
Total Renda Variável	122.440.426,49	3.000.000,00	0,00	127.294.877,91	1.854.451,42	1,48%		6,74%

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	14.879.086,98	0,00	0,00	15.425.000,57	545.913,59	3,67%	3,67%	6,90%
Total Exterior	14.879.086,98	0,00	0,00	15.425.000,57	545.913,59	3,67%		6,90%

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.

