

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

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	1.280.543,90	1,80%	686	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.011.691,98	1,43%	914	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.186.892,36	1,67%	790	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	976.201,70	1,38%	280	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.388.508,82	1,96%	623	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.002.863,66	1,41%	81	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	574.576,04	0,81%	577	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	2.798.930,37	3,94%	300	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	1.806.595,83	2,54%	192	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	1.083.538,10	1,53%	41	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	6.067.528,03	8,55%	370	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	3.804.285,09	5,36%	199	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	1.450.903,35	2,04%	48	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.481.632,10	4,90%	793	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.620.685,23	3,69%	876	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.608.585,67	2,27%	243	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.723.179,58	5,24%	409	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.311.004,05	3,26%	30	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	863.127,08	1,22%	996	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.534.439,17	3,57%	161	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

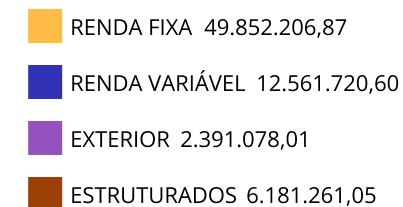
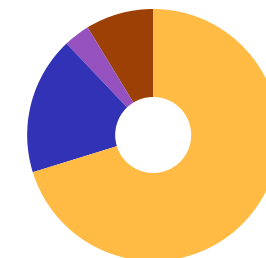
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.632.573,03	6,53%	424	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.482.371,89	2,09%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	350.539,92	0,49%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	327.333,86	0,46%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.326.140,82	1,87%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	Não se ...	Não se aplica	48.111,14	0,07%	20	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	101.304,21	0,14%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	8.119,89	0,01%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.998.745,29	2,82%	20.355	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.606.683,32	2,26%	201	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	193.763,28	0,27%	83	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.193.666,63	3,09%	2.674	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	D+4	Não há	552.600,01	0,78%	7	1,68%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	D+3	Não há	574.807,99	0,81%	352	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	469.754,43	0,66%	10.109	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.637.481,35	2,31%	130	0,87%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.785.345,50	2,52%	22	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	1.333.784,88	1,88%	31	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	436.058,51	0,61%	55	0,09%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	519.924,19	0,73%	21.672	0,14%	Artigo 9º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	926.012,06	1,30%	150	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	509.083,25	0,72%	485	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.872.517,23	2,64%	94	1,42%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.257.619,18	1,77%	46.531	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.519.647,53	2,14%	5.567	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	888.398,05	1,25%	6.794	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	643.079,06	0,91%	643	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	215.087,92	0,30%		0,00%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			70.986.266,53				

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

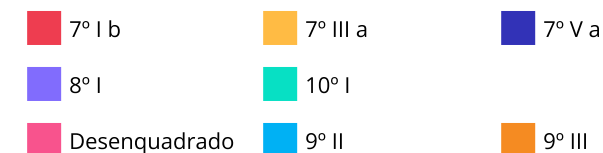
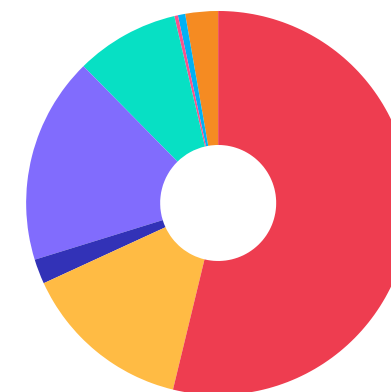
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	14.197.253,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	38.178.145,86	53,78%	15,00%	54,00%	90,00%	25.709.494,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	10.190.384,95	14,36%	4,00%	10,00%	60,00%	32.401.374,97
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.549.313,33
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.483.676,06	2,09%	0,00%	2,50%	5,00%	2.065.637,27
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	2.129.588,00
Total Renda Fixa	100,00%	49.852.206,87	70,23%	19,00%	69,50%	183,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	12.346.632,68	17,39%	0,00%	18,00%	30,00%	8.949.247,28
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	6.181.261,05	8,71%	0,00%	6,00%	10,00%	917.365,60
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.549.313,33
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.549.313,33
Desenquadrado - RV	0,00%	215.087,92	0,30%	0,00%	0,00%	0,00%	-215.087,92
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	18.742.981,65	26,40%	0,00%	27,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	436.058,51	0,61%	0,00%	0,50%	10,00%	6.662.568,14
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.955.019,50	2,75%	0,00%	3,00%	10,00%	5.143.607,15
Total Exterior	10,00%	2.391.078,01	3,37%	0,00%	3,50%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.586.313,50	41,68	-
CAIXA DTVM	26.039.419,48	36,68	-
TRÍGONO CAPITAL	3.119.130,38	4,39	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.954.083,11	4,16	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.917.936,81	4,11	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.193.666,63	3,09	-
META ASSET MANAGEMENT	1.637.481,35	2,31	-
ITAÚ UNIBANCO	1.597.162,43	2,25	-
PLURAL	375.445,00	0,53	-
RJI CORRETORA DE VALORES	350.539,92	0,49	-
CADENCE GESTORA	215.087,92	0,30	-

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	38.178.145,86	53,78	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	10.190.384,95	14,36	4,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.483.676,06	2,09	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	12.346.632,68	17,39	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	436.058,51	0,61	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	1.955.019,50	2,75	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	6.181.261,05	8,71	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,77%	8,66%	2,75%	5,42%	11,80%	22,33%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	8,41%	2,76%	5,32%	11,53%	21,66%	0,90%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	8,36%	2,73%	5,26%	11,57%	21,91%	0,92%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	7,99%	1,98%	5,34%	11,93%	30,22%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,38%	-1,74%	-1,07%	-1,89%	-1,06%	2,90%	0,13%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,45%	-2,17%	0,42%	1,08%	-2,67%	-17,73%	1,12%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,59%	12,99%	4,10%	11,31%	16,04%	21,61%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	12,76%	4,03%	11,11%	15,53%	20,69%	1,47%	0,05%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	12,68%	4,02%	11,14%	15,43%	20,74%	1,49%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,27%	14,28%	2,80%	14,40%	15,00%	16,66%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,29%	13,97%	2,68%	14,11%	14,56%	15,81%	2,67%	0,08%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,61%	8,75%	2,66%	5,76%	11,97%	23,03%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-13,31%	-10,61%	-12,57%	-11,43%	-9,13%	-7,16%	26,09%	0,16%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,20%	-5,98%	-0,66%	-1,18%	-18,19%	-24,93%	0,14%	0,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	8,63%	2,58%	5,68%	11,73%	22,46%	0,95%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)	-0,38%	11,84%	2,83%	10,43%	13,76%	20,07%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,39%	3,64%	1,17%	3,10%	6,06%	7,21%	0,65%	0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	11,65%	2,71%	10,26%	13,45%	19,42%	1,74%	0,05%

IRF-M (Benchmark)	0,76%	11,43%	3,81%	9,56%	14,96%	22,06%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	11,33%	3,76%	9,45%	14,84%	21,77%	1,04%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	11,10%	3,63%	9,30%	14,47%	21,30%	1,05%	0,03%

CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	10,75%	3,67%	8,97%	14,02%	22,87%	0,10%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05%	8,15%	3,07%	6,14%	12,44%	22,66%	0,01%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,20%	8,37%	3,43%	6,74%	13,13%	25,12%	0,04%	0,00%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-0,59%	-14,82%	-1,50%	-3,36%	-16,10%	-22,07%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,45%	-8,83%	-1,41%	-8,73%	0,99%	-59,62%	0,07%	0,14%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,22%	9,04%	3,56%	7,00%	13,78%	25,89%	0,05%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,23%	3,23%	0,27%	1,83%	4,61%	13,74%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-	2,44%	-	-	-	1,36%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	10,54%	2,18%	7,40%	12,28%	-	1,31%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	7,64%	2,92%	4,76%	11,09%	-	0,62%	0,02%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,63%	9,92%	3,67%	7,75%	13,76%	23,41%	0,58%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-	2,95%	-	-	-	0,62%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,39%	7,82%	2,92%	6,69%	11,19%	19,74%	1,49%	0,04%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,30%	7,95%	2,26%	5,85%	11,98%	21,17%	0,76%	0,01%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,14%	6,15%	1,68%	4,70%	8,27%	18,22%	1,10%	0,02%
Global BDRX (Benchmark)	3,26%	21,43%	5,97%	15,02%	15,64%	-2,06%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	20,35%	5,57%	14,51%	14,97%	-4,08%	8,36%	0,23%
Ibovespa (Benchmark)	-5,09%	5,47%	6,84%	10,30%	5,68%	-2,56%	-	-
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	-5,02%	5,78%	6,97%	10,53%	6,15%	-1,86%	6,40%	0,21%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,40%	11,93%	8,05%	15,08%	7,42%	9,18%	6,67%	0,19%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-4,30%	3,94%	7,69%	8,76%	1,10%	-4,03%	6,30%	0,21%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,28%	14,49%	10,93%	13,55%	16,54%	21,49%	9,55%	0,22%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,42%	11,03%	9,01%	11,89%	10,23%	3,90%	10,45%	0,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,87%	7,93%	4,38%	10,78%	0,94%	0,29%	6,14%	0,18%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	-4,93%	5,49%	7,24%	10,30%	4,56%	-4,77%	6,45%	0,21%
IBX (Benchmark)	-5,01%	4,62%	6,85%	9,37%	4,16%	-4,36%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-9,25%	-7,22%	0,30%	-2,69%	-9,71%	-19,53%	7,21%	0,25%

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

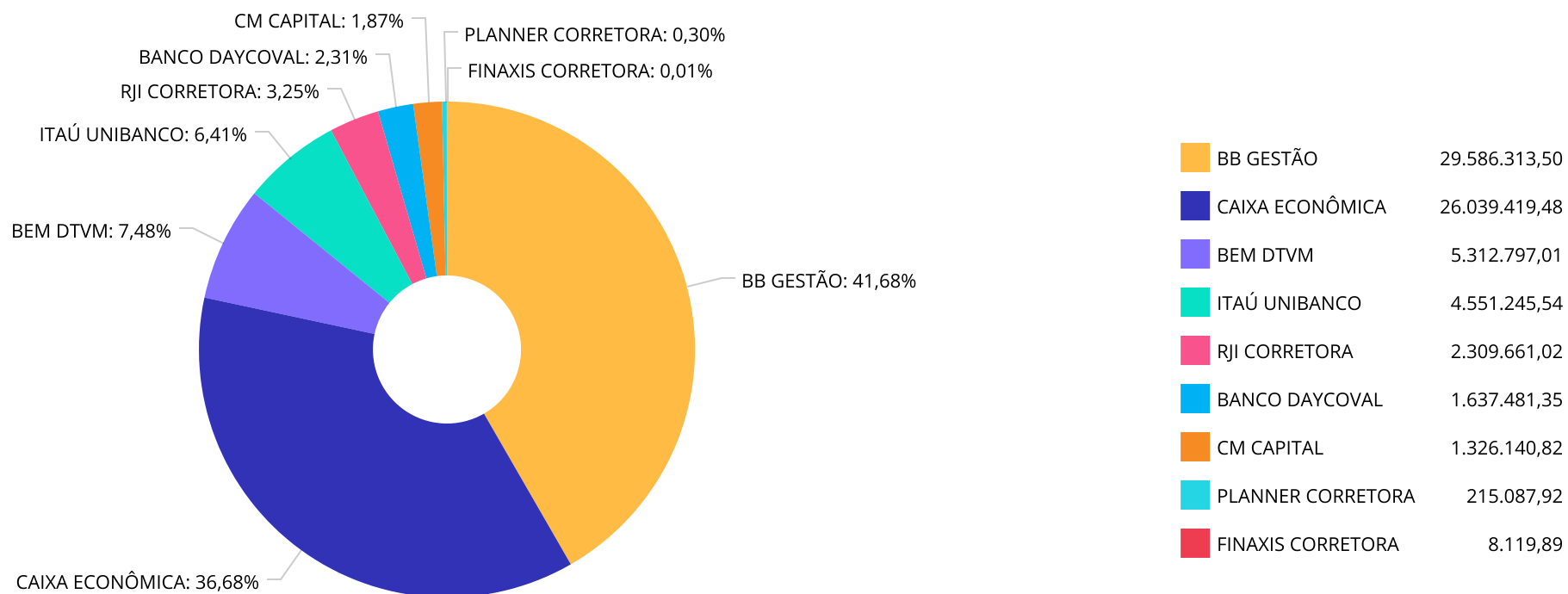
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	-4,76%	3,66%	7,43%	8,45%	4,56%	-3,16%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-5,86%	2,74%	5,34%	5,93%	1,74%	-7,94%	6,32%	0,20%
IFIX (Benchmark)	0,49%	12,06%	6,62%	14,40%	7,95%	16,84%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-	-	-	-	-	-	-	-
MSCI ACWI (Benchmark)	0,73%	6,92%	2,53%	3,09%	6,36%	-11,42%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,92%	23,40%	9,88%	17,91%	23,70%	17,13%	5,71%	0,18%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-1,77%	17,40%	7,84%	13,54%	13,97%	-0,33%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-0,95%	23,26%	9,83%	17,85%	23,63%	17,05%	5,70%	0,18%
SMLL (Benchmark)	-7,43%	8,13%	3,26%	17,40%	-1,94%	-23,76%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-7,11%	6,14%	1,78%	13,53%	-2,18%	-17,47%	7,70%	0,23%



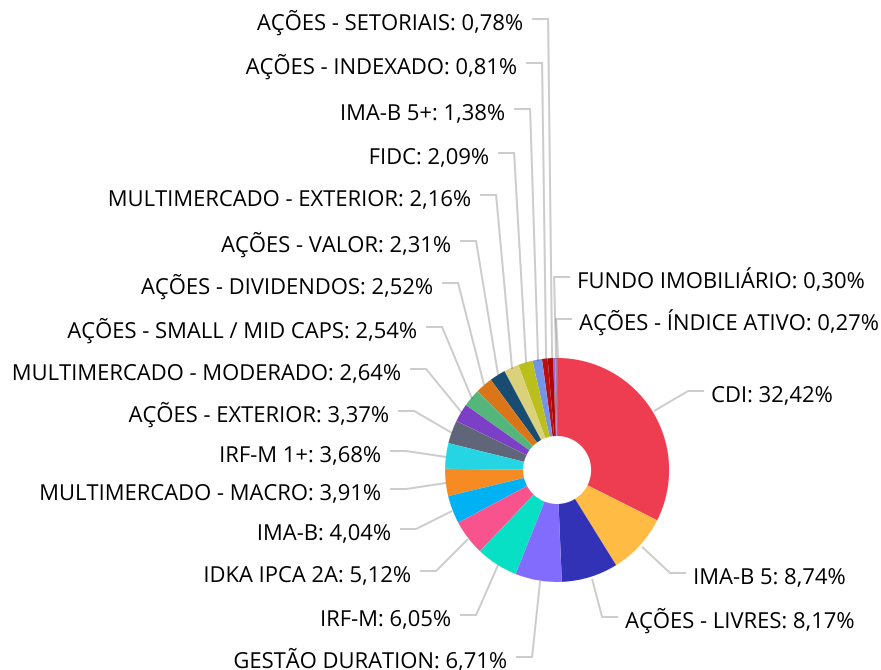
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	3,26%	21,43%	5,97%	15,02%	15,64%	-2,06%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	20,35%	5,57%	14,51%	14,97%	-4,08%	8,36%	22,747%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,33%	14,47%	6,54%	10,66%	15,12%	3,42%	5,01%	16,156%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,83%	13,17%	6,63%	10,56%	12,14%	-4,03%	7,31%	20,747%
MSCI WORLD (Benchmark)	1,15%	8,22%	2,98%	3,96%	8,01%	-9,04%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,14%	-0,89%	0,36%	-3,36%	-0,55%	-16,24%	7,30%	21,419%

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



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

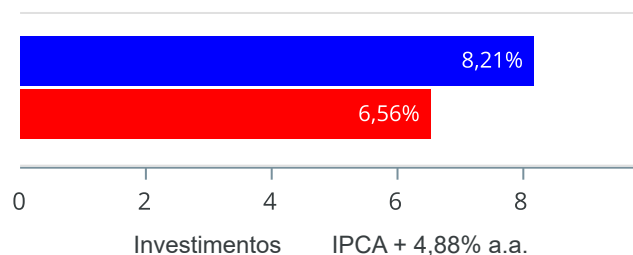


■ CDI	23.011.886,82	■ IMA-B 5	6.205.803,42	■ AÇÕES - LIVRES	5.799.095,24	■ GESTÃO DURATION	4.762.176,00
■ IRF-M	4.297.755,62	■ IDKA IPCA 2A	3.632.377,21	■ IMA-B	2.870.880,71	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.777.266,71
■ IRF-M 1+	2.611.449,33	■ AÇÕES - EXTERIOR	2.391.078,01	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.872.517,23	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.803.539,31
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.785.345,50	■ AÇÕES - VALOR	1.637.481,35	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.531.477,11	■ FIDC	1.483.676,06
■ IMA-B 5+	976.201,70	■ AÇÕES - INDEXADO	574.807,99	■ AÇÕES - SETORIAIS	552.600,01	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	215.087,92
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	193.763,28						

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	63.080.883,61	7.645.059,03	8.409.259,70	63.433.808,80	1.117.125,86	1.117.125,86	1,77%	1,77%	0,95%	0,95%	186,60%	3,03%
Fevereiro	63.433.808,80	6.748.190,39	6.107.126,78	63.714.242,22	-360.630,19	756.495,67	-0,56%	1,20%	1,18%	2,14%	55,88%	2,51%
Março	63.714.242,22	1.257.802,15	808.842,82	64.499.603,07	336.401,52	1.092.897,19	0,52%	1,73%	1,15%	3,32%	52,11%	2,44%
Abril	64.499.603,07	3.353.235,51	2.850.732,42	65.531.905,85	529.799,69	1.622.696,88	0,82%	2,56%	0,95%	4,30%	59,45%	2,28%
Mai	65.531.905,85	16.046.408,45	16.323.192,99	66.472.763,93	1.217.642,62	2.840.339,50	1,86%	4,46%	0,65%	4,98%	89,67%	2,43%
Junho	66.472.763,93	4.316.863,51	3.149.721,25	69.215.581,25	1.575.675,06	4.416.014,56	2,33%	6,90%	0,32%	5,31%	129,86%	2,12%
Julho	69.215.581,25	1.378.657,99	898.168,43	70.613.226,62	917.155,81	5.333.170,37	1,32%	8,30%	0,52%	5,86%	141,77%	1,99%
Agosto	70.613.226,62	5.609.333,87	5.174.293,67	70.986.266,53	-62.000,29	5.271.170,08	-0,09%	8,21%	0,67%	6,56%	125,08%	2,73%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





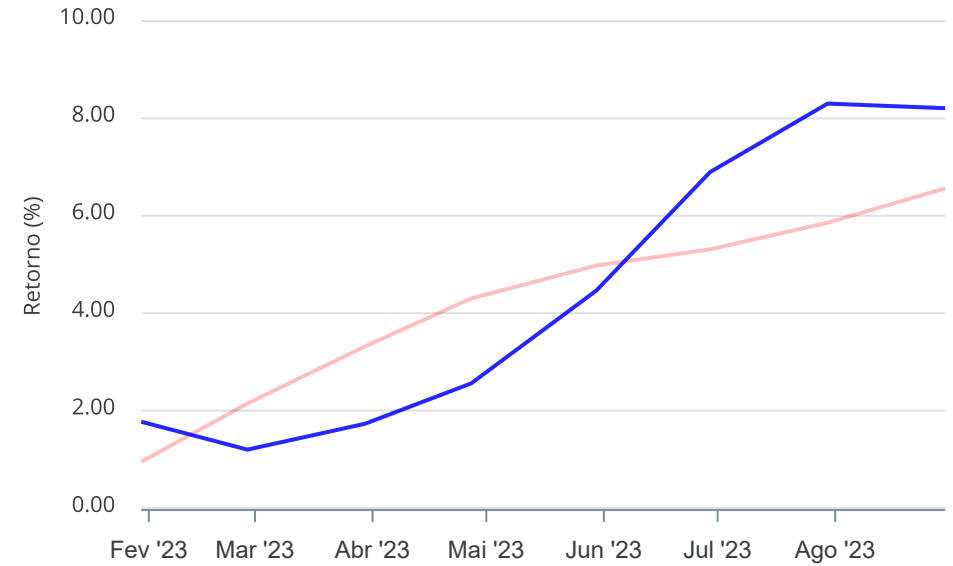
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	404.348,10	0,00	67.836,87	350.539,92	14.028,69	3,47%	-13,31%	26,09%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6.069.227,29	0,00	1.500.000,00	4.632.573,03	63.345,74	1,04%	1,22%	0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.267.375,18	0,00	0,00	1.280.543,90	13.168,72	1,04%	1,04%	0,10%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	4.491.672,01	0,00	2.000.000,00	2.534.439,17	42.767,16	0,95%	1,20%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.879.352,18	0,00	110.165,29	3.804.285,09	35.098,20	0,90%	-1,94%	4,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.855.565,25	0,00	82.413,92	2.798.930,37	25.779,04	0,90%	0,91%	0,62%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	2.358.290,07	0,00	68.445,46	2.311.004,05	21.159,44	0,90%	-2,01%	4,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.181.975,41	0,00	169.753,39	6.067.528,03	55.306,01	0,89%	0,90%	0,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.600.545,95	0,00	0,00	2.620.685,23	20.139,28	0,77%	0,77%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.004.268,11	0,00	0,00	1.011.691,98	7.423,87	0,74%	0,74%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.696.124,40	0,00	0,00	3.723.179,58	27.055,18	0,73%	0,73%	1,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	570.444,58	0,00	0,00	574.576,04	4.131,46	0,72%	0,72%	1,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.459.811,19	0,00	0,00	3.481.632,10	21.820,91	0,63%	0,63%	0,58%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	348.452,98	1.647.706,54	1.144.829,47	863.127,08	11.797,03	0,59%	1,05%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.180.037,75	0,00	0,00	1.186.892,36	6.854,61	0,58%	0,58%	0,95%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.320.203,01	0,00	0,00	1.326.140,82	5.937,81	0,45%	0,45%	1,12%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.445.031,27	0,00	0,00	1.450.903,35	5.872,08	0,41%	0,41%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.799.392,18	0,00	0,00	1.806.595,83	7.203,65	0,40%	0,40%	1,31%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.476.631,95	0,00	0,00	1.482.371,89	5.739,94	0,39%	0,39%	0,65%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.002.863,66	2.863,66	0,29%	0,55%	1,49%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.114.221,20	0,00	30.849,27	1.083.538,10	166,17	0,01%	-0,01%	1,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	1.610.165,29	0,00	1.608.585,67	-1.579,62	-0,10%	0,55%	1,47%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	327.999,64	0,00	0,00	327.333,86	-665,78	-0,20%	-0,20%	0,14%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	101.688,75	0,00	0,00	101.304,21	-384,54	-0,38%	-0,38%	0,13%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.394.102,99	0,00	0,00	1.388.508,82	-5.594,17	-0,40%	-0,40%	1,74%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.156,40	0,00	0,00	8.119,89	-36,51	-0,45%	-0,45%	0,07%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	48.397,90	0,00	0,00	48.111,14	-286,76	-0,59%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	1.000.000,00	0,00	976.201,70	-23.798,30	-2,38%	-1,29%	2,67%
Total Renda Fixa	49.403.315,74	5.257.871,83	5.174.293,67	49.852.206,87	365.312,97	0,74%		1,42%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.302.338,49	0,00	0,00	1.333.784,88	31.446,39	2,41%	2,41%	10,45%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.745.611,19	0,00	0,00	1.785.345,50	39.734,31	2,28%	2,28%	9,55%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.866.859,20	0,00	0,00	1.872.517,23	5.658,03	0,30%	0,30%	0,76%
OSASCO PROPERTIES FII	215.162,20	0,00	0,00	215.087,92	-74,28	-0,03%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.259.438,60	0,00	0,00	1.257.619,18	-1.819,42	-0,14%	-0,14%	1,10%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.525.538,91	0,00	0,00	1.519.647,53	-5.891,38	-0,39%	-0,39%	1,49%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	896.618,18	0,00	0,00	888.398,05	-8.220,13	-0,92%	-0,92%	5,71%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	649.217,40	0,00	0,00	643.079,06	-6.138,34	-0,95%	-0,95%	5,70%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.663.288,56	0,00	0,00	1.606.683,32	-56.605,24	-3,40%	-3,40%	6,67%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.791.215,72	283.016,58	0,00	1.998.745,29	-75.487,01	-3,64%	-4,30%	6,30%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.305.918,33	0,00	0,00	2.193.666,63	-112.251,70	-4,87%	-4,87%	6,14%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	581.265,54	0,00	0,00	552.600,01	-28.665,53	-4,93%	-4,93%	6,45%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	605.178,37	0,00	0,00	574.807,99	-30.370,38	-5,02%	-5,02%	6,40%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	205.815,73	0,00	0,00	193.763,28	-12.052,45	-5,86%	-5,86%	6,32%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	434.479,60	68.445,46	0,00	469.754,43	-33.170,63	-6,60%	-7,11%	7,70%
META VALOR FI AÇÕES	1.804.284,27	0,00	0,00	1.637.481,35	-166.802,92	-9,24%	-9,24%	7,21%
Total Renda Variável	18.852.230,29	351.462,04	0,00	18.742.981,65	-460.710,68	-2,40%		5,69%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	494.718,07	0,00	0,00	509.083,25	14.365,18	2,90%	2,90%	8,36%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	900.557,91	0,00	0,00	926.012,06	25.454,15	2,83%	2,83%	7,31%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	435.455,67	0,00	0,00	436.058,51	602,84	0,14%	0,14%	7,30%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	526.948,94	0,00	0,00	519.924,19	-7.024,75	-1,33%	-1,33%	5,01%
Total Exterior	2.357.680,59	0,00	0,00	2.391.078,01	33.397,42	1,42%		7,03%

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 GESTÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.. 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.

