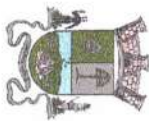


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

JULHO/2023

Este relatório tem como objetivo demonstrar a análise do relatório de investimentos, de acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento a Política de Investimentos do mês em referência, e a aprovação pelo Conselho Fiscal.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

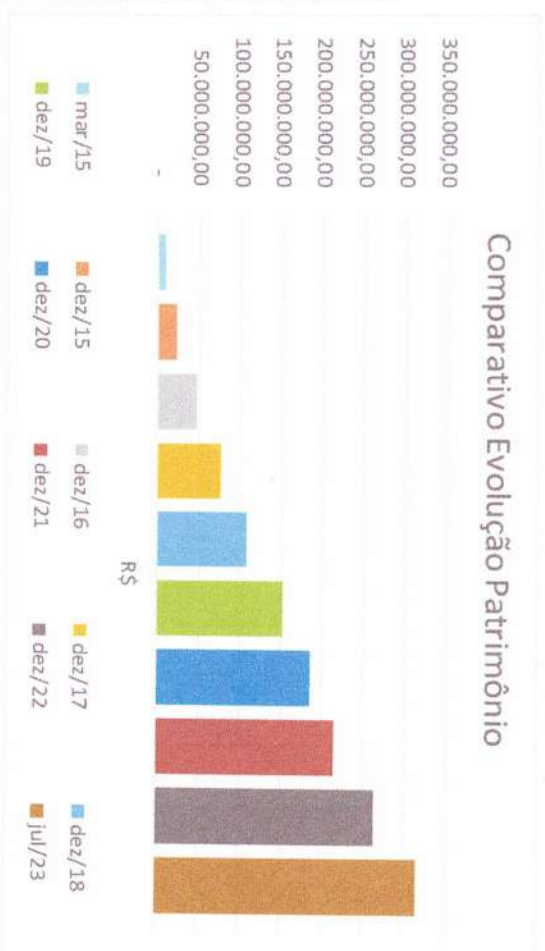
PARECER COMITE DE INVESTIMENTOS JUIHO/2023

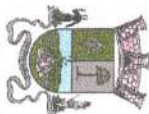
O comitê de investimentos do **INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPEÇERICA DA SERRA-ITAPREV**, fazendo uso de sua competência que lhe confere o Decreto Municipal Nº 2352/2015, em sua reunião ordinária do dia 16 de agosto de 2023, analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês de julho/2023 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

1) CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Instituto de Previdência do município de Itapeçerica da Serra-ITAPREV, no mês julho/2023 apresentou valorização de 1,61% encerrando o mês com recursos aplicados no valor total de R\$ 315.952.511,36 (Trezentos e quinze milhões, novecentos e cinquenta e dois mil, quinhentos e onze reais e seis centavos).

Ano	R\$
mar/15	9.333.541,95
dez/15	22.750.600,24
dez/16	47.169.736,15
dez/17	76.356.500,87
dez/18	107.384.837,09
dez/19	152.862.799,62
dez/20	186.459.080,35
dez/21	214.632.111,69
dez/22	263.411.729,77
jul/23	315.952.511,36





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

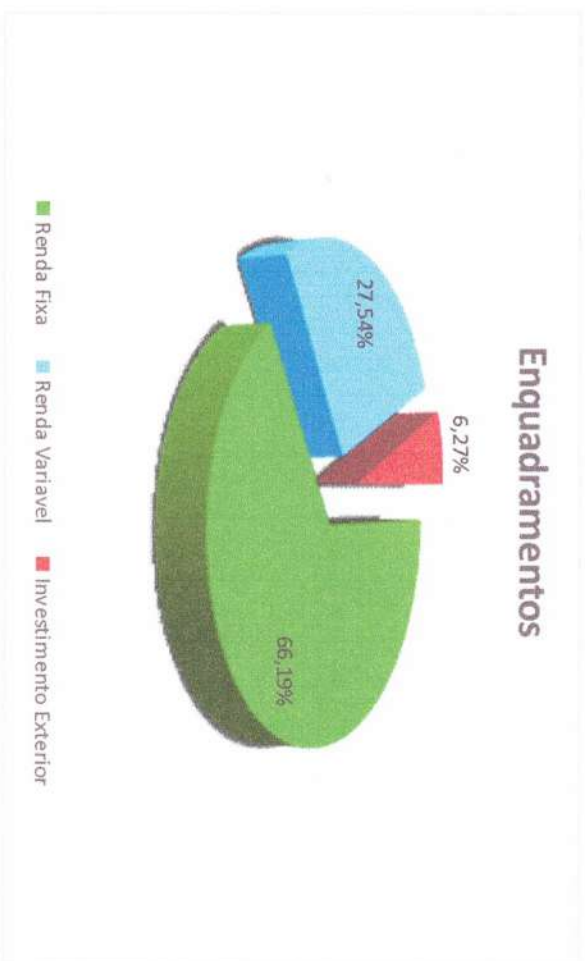
2) COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

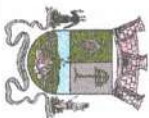
A carteira de investimentos do Instituto de Previdência do município de Itapeceira da Serra-ITAPREV, atende aos requisitos de limites e enquadramento da resolução Nº 3922/2010 e suas alterações e, aos limites e enquadramentos aprovados na política de investimentos vigente sendo composta por:

66,19% em investimentos denominados Renda fixa;

27,54% em investimentos denominados Renda Variável; e

6,27% em investimentos denominados exterior.

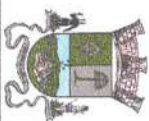




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Recursos por fundo de Investimento

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	10.404.330,28	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	30.565,23	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.723.364,98	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	9.277.825,36	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.863.054,00	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.101.976,32	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	46980	16.422.130,98	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	16.162.686,37	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	15.908.336,30	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	21.185.139,35	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.159.440,24	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.570.082,11	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.872.798,42	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.983.980,23	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.053.390,47	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.670.920,87	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	10.697.430,17	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.067.430,61	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.649.949,91	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	845.880,06	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.488.623,35	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	10.946.164,49	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	D+0		8.095.969,90	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	D+0		8.106.669,42	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	D+0		10.132.423,58	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	D+0		10.147.219,41	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	18/04/2018	6.609.458,27	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	Renda Fixa
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	3.319.027,96	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	Renda Fixa
Renda Fixa			212.496.268,64		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.037.123,69	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.789.627,86	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	D+15	Não há	6.509.371,37	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	7.013.063,51	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
FINACAP MAURITSTAD FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.305.390,87	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.538.071,43	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
QLZ MOS FIC AÇÕES	D+10	Não há	1.393.452,77	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.505.683,06	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
SOI FIC AÇÕES	D+0	Não há	4.195.942,46	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TARPPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.337.609,17	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TARPPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	D+4 du	Não há	2.498.269,16	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	11.379.028,48	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.491.976,50	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BB ALOCAÇÃO FII MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.155.913,37	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FII MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	3.029.530,27	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
CAIXA JUROS E MOEDAS FII MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	4.304.309,84	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FII MULTIMERCADO	D+3 du	25 meses	3.264.971,05	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FII MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	4.197.983,25	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	464.348,59	Artigo 11º	Renda Variável
		Renda variável	88.411.666,70		
Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.366.093,29	Artigo 9º, Inciso II	Invest exterior
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	D+4 du	Não há	1.433.503,12	Artigo 9º, Inciso II	Invest exterior
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.315.872,97	Artigo 9º, Inciso III	Invest exterior
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	9.027.102,48	Artigo 9º, Inciso III	Invest exterior
		Invest. Exterior	20.142.571,86		



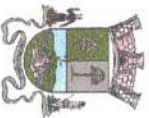
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Renda Fixa	212.496.268,64
Renda variavel	88.411.666,70
Invest.Exterior	20.142.571,86
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	4.853,74
Total de Recursos	321.055.360,94

RECURSOS PREVIDENCIARIOS	315.952.511,36
RECURSOS TAXA ADMINISTRATIVA	5.097.995,84
TOTAL DE RECURSOS ITAPREV	321.050.507,20

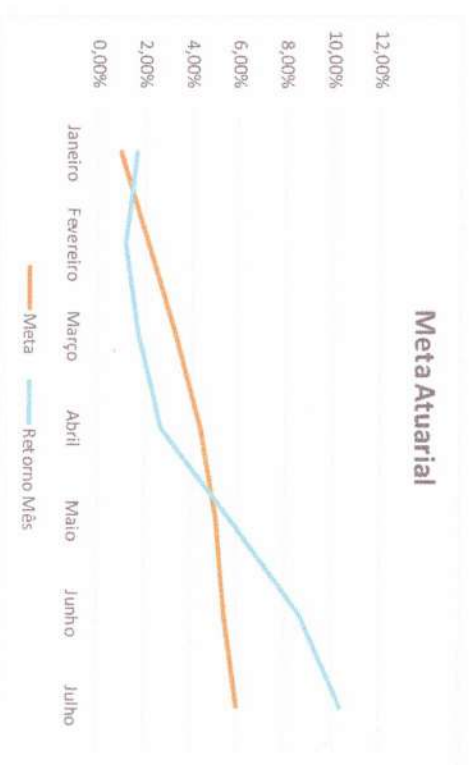
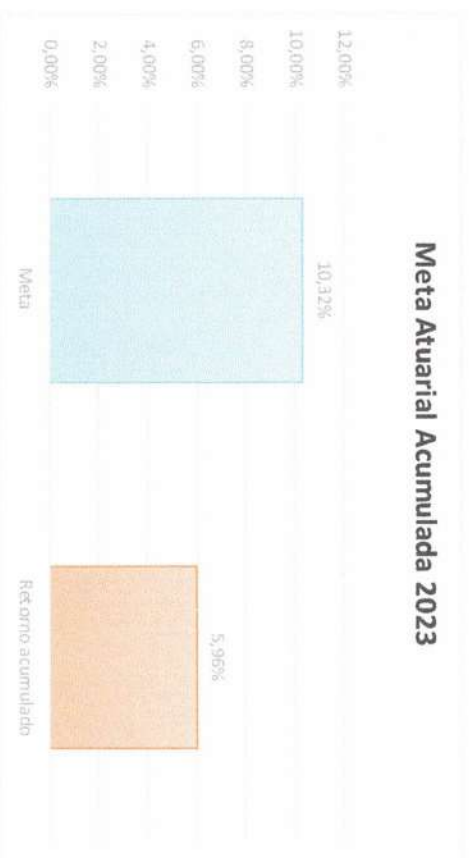
3) META ATUARIAL

O retorno da carteira de investimentos do Instituto de Previdência do Município de ITAPEÇERICA DA SERRA – ITAPREV, no acumulado do ano é positivo em 8,57 % (Oito virgula cinquenta e sete por cento), acima da meta atuarial acumulada de IPCA+5,06% que em maio ficou acumulada 5,40% (Cinco virgula quatro por cento)

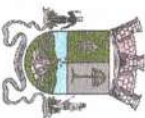


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno no Mês	Retorno Mês	Meta	Retorno acumulado	Retorno acum.	Meta acum.	Gap (%)
Janeiro	263.411.729,77	10.897.991,24	5.634.066,11	273.219.972,55	4.544.317,65	1,69%	0,96%	4.544.317,65	1,69%	0,96%	176,19%
Fevereiro	273.219.972,55	32.905.272,17	31.765.834,85	273.027.916,94	-1.331.492,93	-0,49%	1,20%	3.212.824,72	1,20%	2,17%	55,26%
Março	273.027.916,94	11.968.923,75	8.506.551,08	278.020.384,65	1.530.095,04	0,55%	1,16%	4.742.919,76	1,76%	3,36%	52,35%
Abril	278.020.384,65	9.345.173,87	5.758.660,02	284.167.653,13	2.560.754,63	0,91%	0,97%	7.303.674,39	2,68%	4,36%	61,61%
Mai	384.167.653,13	50.702.981,48	47.175.001,29	296.155.658,46	8.460.025,14	2,94%	0,66%	15.763.699,53	5,70%	5,05%	112,99%
Junho	296.155.658,46	9.751.606,73	6.358.483,81	307.673.371,48	8.124.590,10	2,71%	0,33%	23.888.289,63	8,57%	5,40%	158,82%
Julho	307.673.371,48	11.019.271,69	7.756.562,83	315.952.511,36	5.016.431,02	1,61%	0,53%	28.904.720,65	10,32%	5,96%	173,26%
						1,61%	0,53%	28.904.720,65	10,32%	5,96%	173,26%



Retorno obtido no mês	1,61%
Meta atuarial do mês	0,53%
Retorno da carteira em 2023	10,32%
Meta atuarial em 2023	5,96%



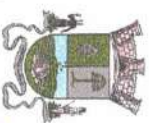
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

4) RETORNO ACUMULADO POR FUNDO DE INVESTIMENTO

GESTOR	Sub-Segmento	Produto / Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922 / 4.392 / 4.604	SEGMENTO	RENT. (ESTIM.)	META (2023)
TARPON	ACÇÕES INDÍGE ATIVO	SOL FIC ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	39,86%	4,95%
TARPON	ACÇÕES LIVRES	TARPON GT 30 FIC ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	32,21%	5,95%
GUERPARDO	ACÇÕES VALOR	GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	28,12%	5,95%
CAIXA	MULTIMERCADO EXTERIOR	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	24,02%	5,95%
CAIXA	ACÇÕES EXTERIOR	CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I FI ACÇÕES	Artigo 9º, Inciso III	RENDA VARIÁVEL	16,95%	5,95%
FINACAP	ACÇÕES VALOR	FINACAP MAURITSSAD FI ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	15,01%	5,95%
AZQUEST	ACÇÕES SMALL MID CAPS	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	14,10%	5,95%
CONSTANÇIA	ACÇÕES LIVRES	CONSTANÇIA FUNDAMENTO FI ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	13,47%	5,95%
CAIXA	IMA-B 5+	CAIXA BRASIL 2030 II TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	12,57%	5,95%
BB	IMA-B	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	12,09%	5,95%
TRIGONO	ACÇÕES DIVIDENDOS	TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	11,93%	5,95%
SCHRODER	ACÇÕES LIVRES	SCHRODER BEST IDEAS	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	11,17%	5,95%
CAIXA	IDKA PRÉ 2A	CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	10,57%	5,95%
CAIXA	IMA-B5	CAIXA BRASIL 2027 TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	10,08%	5,95%
BNP	ACÇÕES LIVRES	BNP PARIBAS ACTION FIC ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	9,60%	5,95%
RIOBRAVO	IMA-B	RIO BRAVO ESTRATEGICO IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	9,46%	4,95%
BB	ACÇÕES EXTERIOR	BB ACÇÕES GLOBAIS FIC ACÇÕES BDR NIVEL I	Artigo 9º, Inciso III	RENDA VARIÁVEL	9,43%	5,95%
BB	DURATION	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	9,37%	5,95%
TRIGONO	ACÇÕES SMALL MID CAPS	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	8,41%	5,95%
RIOBRAVO	MULTIMERCADO EXTERIOR	RIO BRAVO PROTECAO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	8,33%	5,95%
TARPON	ACÇÕES LIVRES	TARPON INTERSECTION I FIC ACÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	8,20%	0,53%
CAIXA	CREDITO PRIVADO	CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	RENDA FIXA	8,03%	5,95%

43	Fundos acima da Meta atuarial	
6	Fundos abaixo da Meta Atuarial	
2	Fundos com rendimento Negativo	
51	Total Fundos Investidos	

84,31%	Fundos da carteira acima da meta atuarial no ano		
11,76%	Fundos da carteira abaixo da meta atuarial no ano		
3,92%	Fundos da carteira com rendimento negativo no ano		

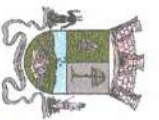


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

BB	IMA-B5	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	7,97%	5,95%
DAYCOVAL	DURATION	DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINAMICA FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' I	RENDA FIXA	7,93%	5,95%
CAIXA	DURATION	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	7,91%	5,95%
CAIXA	DURATION	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' I	RENDA FIXA	7,64%	5,95%
BB	MULTIMERCADO MODERADO	BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	7,64%	5,95%
BB	IDKA IPCA 2A	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	7,42%	5,95%
DAYCOVAL	TÍTULOS PRIVADOS	LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDA FIXA	7,41%	5,95%
CAIXA	MULTIMERCADO OUTROS	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	7,35%	5,95%
DAYCOVAL	TÍTULOS PRIVADOS	LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDA FIXA	7,28%	5,95%
CAIXA	IRF-M1	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	7,28%	5,95%
CAIXA	IMA-B5	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	6,87%	5,95%
CAIXA	IDKA IPCA 2A	RENTA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	6,85%	5,95%
BB	IMA-B5	BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	6,67%	5,95%
CAIXA	CDI	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' I	RENDA FIXA	6,59%	5,95%
BB	CDI	BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' I	RENDA FIXA	6,50%	5,95%
DAYCOVAL	AÇÕES INDICE ATIVO	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	6,25%	5,95%
DAYCOVAL	CREDITO PRIVADO	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	6,21%	5,95%
BB	IMA-B5	BB TÍTULOS PÚBLICOS VERTICE 2028 RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	2,79%	1,53%
BB	CDI	BB TÍTULOS PÚBLICOS VERTICE 2024 RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	2,04%	1,53%
CAIXA	IMA GERAL	CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' I	RENDA FIXA	1,79%	0,86%
QUELUZ	AÇÕES LIVRES	QLZ MOS FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	1,08%	0,53%
BB	CDI	BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' I	RENDA FIXA	5,80%	5,95%
SCHRODER	AÇÕES EXTERIOR MULTIMERCADO	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVEST. EXTERIOR	Artigo 9º, Inciso II	RENDA VARIÁVEL	4,72%	5,95%
RIOBRAVO	MULTIMERCADO MODERADO	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	2,11%	5,95%

TAXA ADMINISTRATIVA

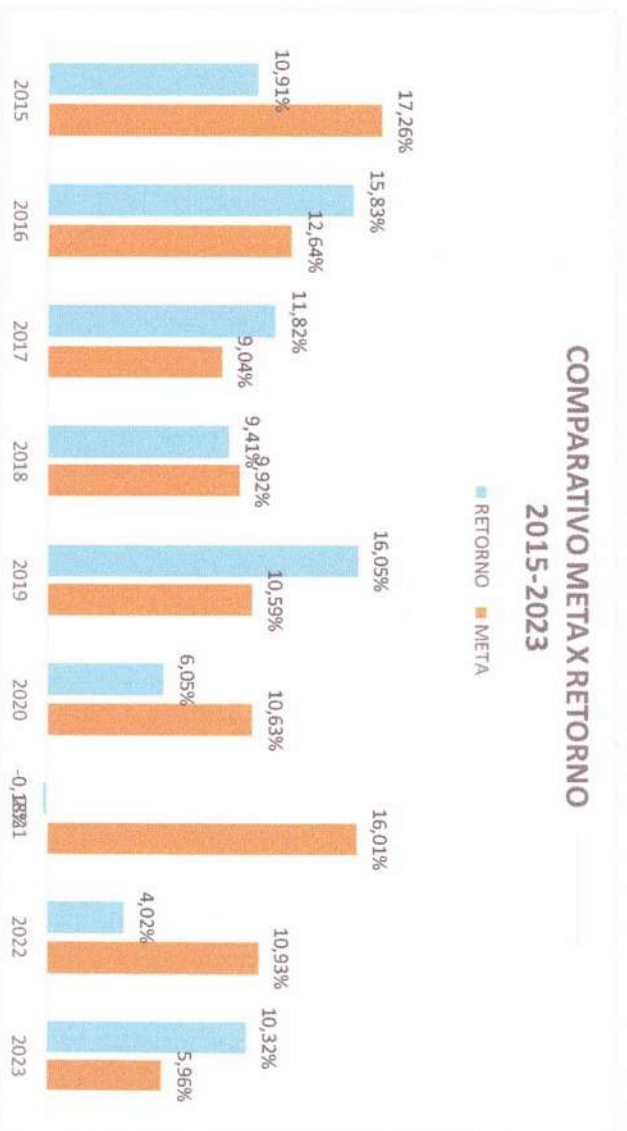
TAXA ADMINISTRATIVA

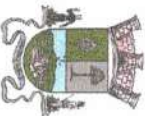


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPÁ DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

CAIXA	CDI	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,99%	5,95%
SANTANDER	TÍTULOS PRIVADOS	LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA 6,25%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDA FIXA	1,48%	1,53%
SANTANDER	TÍTULOS PRIVADOS	LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA 5,93%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDA FIXA	1,33%	1,53%
BNP	AÇÕES EXTERIOR	BNP PARIBAS ACCESS WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	Artigo 9º, Inciso II	RENDA VARIÁVEL	-2,05%	5,95%
ZION	FUNDO IMOBILIÁRIO	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Artigo 11º	RENDA VARIÁVEL	-29,43%	5,95%

Retorno acumulado 2015 a 2023





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

5) ENQUADRAMENTO

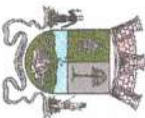
Em atendimento a Resolução Nº 4963/2021 em substituição a resolução Nº 3922/2010 e suas alterações, e em atendimento aos limites previsto na política de investimentos vigente, a carteira de investimentos do Instituto de Previdência do Município de Itapererica da Serra, atende aos limites pré-estabelecidos.

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	-	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	128.420.202,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	142.087.451,68	44,26%	15,00%	30,00%	90,00%	146.858.004,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	23.998.048,42	7,47%	2,00%	5,00%	50,00%	136.527.205,18
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	36.482.282,31	11,36%	0,00%	18,00%	20,00%	27.727.819,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	9.928.486,23	3,09%	0,00%	3,00%	5,00%	6.124.039,13
Total Renda Fixa	100,00%	212.496.268,64	66,19%	17,00%	66,00%	205,00%	

Artigos - Renda Variável Estruturado - Fundo Imobiliário	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	70.994.610,33	22,11%	10,00%	20,00%	30,00%	25.320.541,83
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	16.952.707,78	5,28%	1,00%	5,50%	10,00%	15.152.342,94
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	9.631.515,22
Artigo 11º	5,00%	464.348,59	0,14%	0,00%	0,50%	3,00%	9.167.166,63
Total Renda Variável / Estruturado / Fundo Imobiliário	30,00%	88.411.666,70	27,54%	11,00%	26,00%	46,00%	

Artigos Exterior	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.799.596,41	0,87%	0,00%	3,00%	10,00%	29.305.454,31
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	17.342.975,45	5,40%	1,00%	5,00%	10,00%	14.762.075,27
Total Exterior	10,00%	20.142.571,86	6,27%	1,00%	8,00%	20,00%	

6) DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA ESTADO DE SÃO PAULO

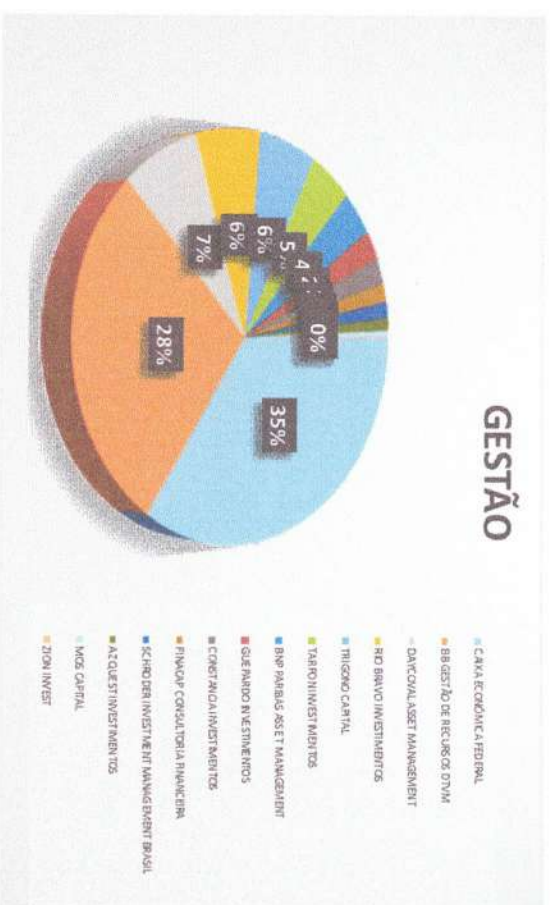
Os recursos financeiros do Instituto de Previdência do Município de Itapeçerica da Serra, apresenta a seguinte distribuição quanto a gestores, administradores e Subsegimento de aplicações:

Gestores

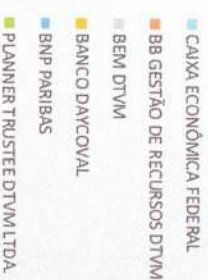
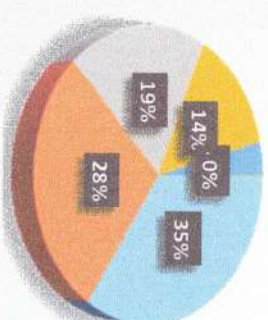
Gestão	Valor	% s/ Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	99.358.942,17	30,95%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	78.525.150,47	24,46%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	21.029.521,64	6,55%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	18.409.118,79	5,73%
TRIGONO CAPITAL	16.871.004,98	5,25%
TARPON INVESTIMENTOS	13.031.820,79	4,06%
BNP PARIBAS ASSE T MANAGEMENT	11.155.721,15	3,47%
GUERPARDO INVESTIMENTOS	6.538.071,43	2,04%
CONSTANCIA INVESTIMENTOS	6.509.371,37	2,03%
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	4.305.390,87	1,34%
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL	3.939.186,18	1,23%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.037.123,69	0,95%
MOS CAPITAL	1.393.452,77	0,43%
ZION INVEST	464.348,59	0,14%

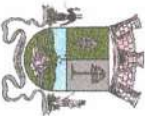
Administradores

Administrador	Valor	% s/ Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	99.358.942,17	30,95%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	78.525.150,47	24,46%
BEM DTVM	54.464.648,65	16,96%
BANCO DAYCOVAL	40.599.413,86	12,65%
BNP PARIBAS	11.155.721,15	3,47%
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	464.348,59	0,14%



ADMINISTRAÇÃO

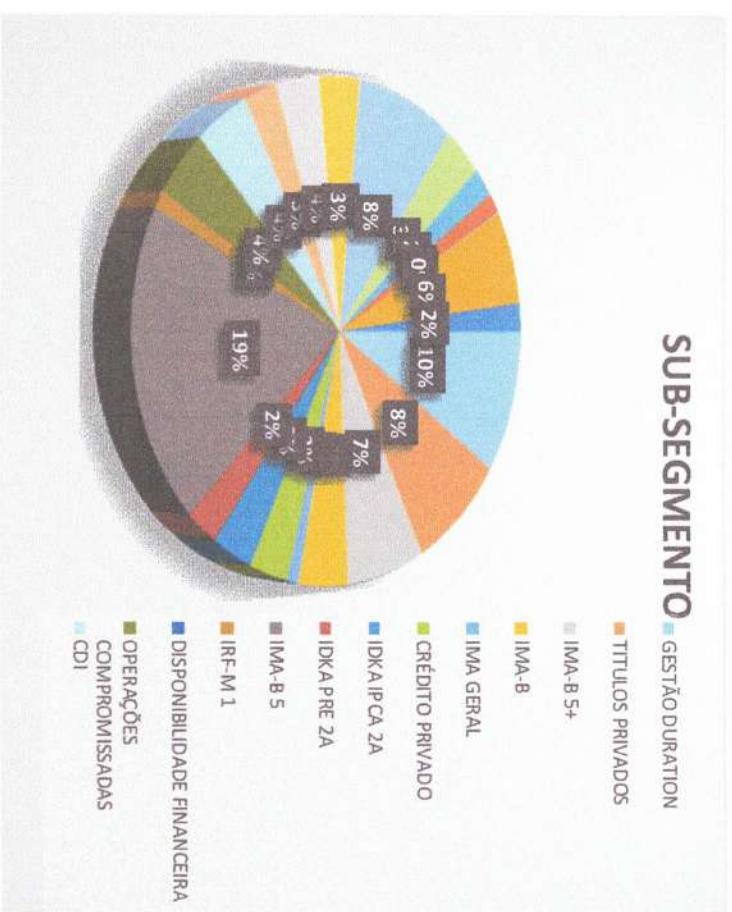




Subsegmento das Aplicações

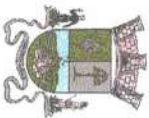
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA ESTADO DE SÃO PAULO

Sub-Segmento	Valor	% s/Carteira	
GESTÃO DURATION	30.911.150,60	9,63%	GESTÃO DURATION
TÍTULOS PRIVADOS	26.335.062,90	8,20%	TÍTULOS PRIVADOS
IMA-B-5+	21.185.139,35	6,60%	LONGÍSSIMO PRAZO
IMA-B	12.809.218,49	3,99%	
IMA GERAL	3.053.390,47	0,95%	LONGO PRAZO
CRÉDITO PRIVADO	9.928.486,23	3,09%	
IDKA IPCA 2A	10.293.447,09	3,21%	
IDKA PRE 2A	7.872.798,42	2,45%	MEDIO PRAZO
IMA-B-5	62.754.959,24	19,55%	
IRF-M 1	3.670.920,87	1,14%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.853,74	0,01%	
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	13.534.475,57	4,22%	CURTO PRAZO
CDI	13.534.475,57	4,22%	
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	8.529.100,19	2,66%	
AÇÕES - DIVIDENDOS	11.379.028,48	3,54%	
AÇÕES - VALOR	10.843.462,30	3,38%	AÇÕES
AÇÕES - LIVRES	26.535.744,23	8,27%	
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11.209.005,97	3,49%	
MULTIMERCADO - MODERADO	6.353.896,62	1,98%	MULTIMERCADO
MULTIMERCADO OUTROS	4.303.309,84	1,34%	
FUNDO IMOBILIÁRIO	464.348,59	0,14%	FUNDO IMOBILIÁRIO
MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.142.571,86	6,27%	
AÇÕES - EXTERIOR	6.294.501,32	1,96%	EXTERIOR



7) RISCO

Value at Risk (VaR) é um método para avaliar o risco em operações financeiras. O VaR resume, em um número, o risco de um produto financeiro ou o risco de uma carteira de investimentos, de um montante financeiro. Esse número representa a pior perda esperada em um dado horizonte de tempo e é associado a um intervalo de confiança. Existem várias técnicas de avaliação do risco de operações financeiras, tais como Back Test, Stress Test, Expected



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

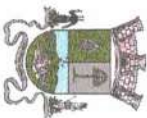
Shortfall, além do Value at Risk. Essas técnicas visam quantificar o risco de mercado, ou seja, do risco de perdas monetárias decorrentes da variação de preços, de taxas de juros ou de taxas de câmbio.

Normalmente o VaR é calculado com 95%, 97,5% ou 99% de confiança. Este nível de confiança nos indica que é esperada perda maior que a calculada pelo VaR. Assim, ao utilizar 99% de confiança, espera-se que a cada 100 observações do VaR, em pelo menos 1 vez a perda do investimento financeiro seja superior à perda estimada no cálculo do VaR. Assim, com o auxílio da amostra e distribuição dos retornos do ativo que está em análise e o seu desvio padrão, o VaR calcula qual a probabilidade de perda máxima que se pode ter investindo naquele ativo com um intervalo de confiança. Por exemplo, o VaR calculado de um investimento é de 5% com um intervalo de confiança de 99%. Isso nos diz que a perda máxima que esse investimento pode sofrer é de 5%. Vale destacar que em casos como crise financeira, pandemias e eventos “fora da curva”, as perdas não podem ser mensuradas pelo VaR.

Retorno dos investimentos e benchmark JULHO/2023

Renda Fixa

IPCA + 6,00% ao ano												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	1,14%	8,14%	2,77%	6,70%	11,88%	20,95%	0,20%	0,83%	2,17%			
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,61%	6,51%	1,74%	5,48%	10,23%	28,61%	-	-	-			
IRF-M 1												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1,07%	7,73%	3,39%	6,53%	13,63%	22,57%	0,20%	0,16%	0,36%			
IRF-M 1 (Benchmark)	1,07%	7,81%	3,44%	6,64%	13,84%	23,07%	-	-	-			



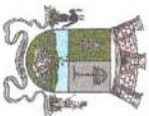
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

IPCA												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-			
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-			
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDE...	1,06%	6,67%	1,99%	5,21%	9,90%	-	0,20%	0,42%	2,24%			
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIX...	1,07%	-	-	-	-	-	0,20%	0,42%	-			
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,00%	8,84%	4,42%	7,78%	14,17%	21,28%	0,40%	0,61%	1,61%			
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIX...	0,81%	-	-	-	-	-	0,15%	1,27%	-			
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIX...	0,89%	9,23%	4,88%	8,11%	14,71%	20,86%	0,20%	1,04%	1,45%			
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-			
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-			
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-	-			

IMA-B 5												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,92%	7,92%	2,66%	6,54%	11,08%	21,09%	0,50%	0,75%	2,30%			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,95%	8,01%	2,61%	6,54%	11,10%	21,88%	0,20%	0,74%	2,34%			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,95%	8,02%	2,64%	6,56%	11,20%	22,15%	0,20%	0,73%	2,32%			
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	0,82%	6,89%	0,35%	5,64%	6,24%	-	0,20%	1,11%	5,96%			
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-	-			

IMA-B												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,71%	9,12%	5,84%	8,82%	6,82%	6,36%	0,20%	1,57%	8,28%			
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	0,73%	12,10%	5,78%	12,11%	15,14%	18,55%	0,20%	1,54%	5,15%			
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-	-			

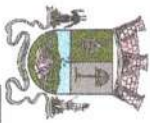
IMA Geral												
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	0,93%	9,73%	4,58%	8,98%	14,73%	21,19%	0,20%	0,72%	2,47%			
IMA Geral (Benchmark)	0,98%	9,70%	4,55%	8,94%	14,59%	21,41%	-	-	-			



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Renda Variável

SMLL										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,12%	14,11%	18,63%	11,16%	14,05%	-13,05%	2,00%	8,72	18,84%	
SMLL (Benchmark)	3,12%	16,80%	26,65%	13,48%	17,47%	-20,79%	-	-	-	
MSCI USA Extended ESG Focus										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses	
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	9,42%	6,67%	7,40%	3,63%	-5,70%	1,00%	5,15	21,52%	
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,71%	8,12%	4,44%	4,01%	0,56%	-7,12%	-	-	-	
MSCI ACWI										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses	
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO ...	3,64%	24,55%	12,24%	16,92%	20,80%	22,16%	1,20%	3,74	18,83%	
MSCI ACWI (Benchmark)	1,88%	6,14%	2,36%	1,41%	1,33%	-9,61%	-	-	-	
IPCA										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses	
SQI FIC AÇÕES	17,15%	63,15%	55,38%	39,44%	-	-	0,00%	23,91	-	
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-	-	
IFIX										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses	
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES F...	-3,40%	-29,43%	5,29%	-21,65%	-56,64%	158,44%	1,60%	8,52	34,06%	
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES F...	-3,40%	-29,43%	5,29%	-21,65%	-56,64%	23,76%	1,60%	8,52	34,06%	
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-	-	



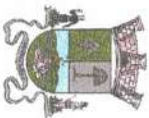
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Ibovespa										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses	
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,84%	2,11%	0,45%	1,89%	5,61%	-	1,20%	1,54	6,97%	
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	3,31%	11,17%	16,14%	6,86%	17,72%	5,83%	1,50%	7,86	21,23%	
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2,56%	9,60%	14,12%	5,00%	11,10%	-5,36%	2,00%	7,19	21,40%	
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,29%	28,12%	28,23%	29,31%	36,99%	32,25%	1,90%	8,94	22,56%	
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,45%	13,46%	16,34%	9,27%	13,40%	2,04%	2,00%	6,37	18,58%	
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1,08%	11,94%	19,85%	6,38%	24,18%	21,15%	2,50%	5,97	21,70%	
FINACAP MAURITSTAD FI AÇÕES	2,56%	15,01%	20,21%	11,22%	17,68%	11,73%	2,00%	6,40	17,97%	
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC...	2,51%	8,41%	21,72%	4,87%	17,68%	2,54%	2,00%	6,90	20,11%	
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5,91%	32,21%	32,12%	29,17%	43,47%	42,26%	2,00%	8,17	21,89%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2,74%	6,25%	14,98%	2,34%	14,80%	-9,21%	2,50%	7,87	20,86%	
QLZ MOS FI AÇÕES	3,01%	-	35,08%	30,20%	-	-	2,00%	7,88	-	
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-	-	

Global BDRX										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses	
Não há dados para a tabela!										
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-	-	

CDI										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses	
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1,25%	6,22%	3,79%	5,70%	12,60%	25,48%	0,35%	0,10	0,53%	
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,00%	7,63%	2,95%	6,34%	12,86%	20,60%	0,85%	0,61	1,37%	
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,99%	7,62%	3,61%	6,45%	13,69%	25,44%	0,70%	0,10	0,46%	
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-	-	

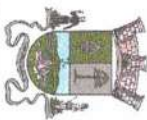
Não definido										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIME...	0,89%	8,32%	4,19%	7,45%	-	-	1,20%	0,59	-	
Não definido (Benchmark)										



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Investimento no Exterior

MSCI WORLD												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VarR Mês	Volatilidade - 12 meses			
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMEN...	0,68%	-2,05%	-2,59%	-3,40%	-3,81%	-12,19%	0,70%	3,99	17,82%			
MSCI WORLD (Benchmark)	1,62%	6,99%	2,45%	2,31%	1,97%	-7,57%	-	-	-			
MSCI USA Extended ESG Focus												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VarR Mês	Volatilidade - 12 meses			
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	9,42%	6,67%	7,40%	3,63%	-5,70%	1,00%	5,15	21,52%			
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,71%	8,12%	4,44%	4,01%	0,56%	-7,12%	-	-	-			
MSCI ACWI												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VarR Mês	Volatilidade - 12 meses			
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVE...	1,81%	4,72%	1,78%	2,93%	4,05%	-10,02%	0,85%	6,18	23,32%			
MSCI ACWI (Benchmark)	1,88%	6,14%	2,36%	1,41%	1,33%	-9,61%	-	-	-			
Global BDRX												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VarR Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	0,70%	5,49	23,13%			
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-	-			



8) DELIBERAÇÕES

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA **ESTADO DE SÃO PAULO**

Deliberações do comitê de investimentos:

APLICAÇÃO

CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA FIC RENDA FIXA – Aplicação de R\$ 1.000.000,00 para diversificação da carteira em ativos enquadrados como gestão Duration. Os recursos serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

APLICAÇÃO

CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP - Aplicação de R\$ 2.000.000,00 para diversificação da carteira em ativos enquadrados como gestão Duration. Os recursos serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

RESGATE

QUELUZ VALOR FI AÇÕES – Resgate total para reequacionamento do ativo conforme fato relevante do administrador. Os recursos do fundo serão incorporados ao ativo QLZ MOS FI AÇÕES.

APLICAÇÃO

QLZ MOS FI AÇÕES – Conforme fato relevante do administrador o fundo incorporou os ativos e cotistas do fundo QUELUZ VALOR FI AÇÕES.

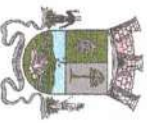
RESGATE

TARPON INTERSECTION FIC AÇÕES – Conforme fato relevante do administrador o fundo TARPON WAHOO FI AÇÕES, passou a se denominar TARPON INTERSECTION FIC AÇÕES e ocorreu a segregação de cotistas. Cotistas institucionais foram transferidos para o fundo TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES.

APLICAÇÃO

TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES – Conforme fato relevante, o ativo recebeu os cotistas do extinto TARPON WAHOO FIC AÇÕES, mantidas as mesmas regras de aplicação e resgates das cotas do fundo extinto.

Repassse das contribuições dos entes - Estima-se o recebimento de aproximadamente R\$ 4.800.000,00 (Quatro milhões e oitocentos mil reais) que serão utilizados aproximadamente R\$ 1.500.000,00 (Um milhão e quinhentos reais) para pagamento de benefícios e custeio do RPPS. O Saldo restante ficará aplicado no fundo CX BR DISPONIBILIDADE para futura diversificação da carteira.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

9) Análises Técnicas

- A carteira do RPPS atende as especificações e enquadramentos e limites da Resolução n. 4963/2021.
- Segundo consta em recente estudo de ALM realizado no ITAPREV, a carteira de investimentos do RPPS possui aproximadamente 90% de liquidez em D+30, permitindo a manutenção do portfólio em casos de mudanças no cenário econômico.
- Não há desequilíbrio ou ativos em liquidação na carteira do RPPS.
- No fechamento do mês, a carteira de investimentos encontra-se com rentabilidade acima da meta atuarial acumulada projetada.

10) Credenciamento

Distribuidores

Distribuidores com credenciamento válidos

Gestores

MOS GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA
4 UM GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA

Administradores

Administradores com credenciamento válido.

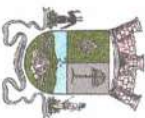
11) Assuntos Gerais:

Julho foi mais um mês de ótimos retornos no ano de 2023, com o arcabouço fiscal em tramitação o cenário para renda variável foi favorável. Adicionalmente a isso, atendendo as expectativas do mercado nos primeiros dias de agosto ocorreu o primeiro corte da taxa SELIC de 0,50% depois de mais de um ano em 13,75%.

A inflação nos mercados desenvolvidos e dados abaixo do esperado na China, trouxeram volatilidade no cenário internacional que ainda depois de um ano acompanha o conflito entre Rússia e Ucrânia que ainda não sinaliza um acordo.

O comitê de investimentos no mês de julho participou de uma live da asset Tarpon onde foram apresentados os resultados da estratégia de investimentos, o fundo possuía uma estratégia de três anos, em julho, ocorreu a venda da empresa SInquia para a estrangeira Evertec, com isso a estratégia do fundo foi alcançada em menos de 12 meses e os resultados da operação serão entregues aos cotistas até dezembro/2023.

Também em fato relevante divulgado, o fundo TARPON WAHOO FIA teve seus cotistas divididos em dois outros novos fundos com a mesma estratégia, fundos de pensão e RPPS foram enquadrados no fundo TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES CNPJ: 50.190.969/0001-40, mantidas as mesmas condições de taxas e resgates do fundo TARPON WAHOO FIA, mudando as regras para novas aplicações. Em caso de novas aplicações no fundo, a operação será o pagamento de 25% do



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

resgate solicitado a cada 90 dias. Como a exposição do RPPS é pequena no ativo, este Comitê de Investimentos deliberou pelo resgate das cotas deste para aplicação dos recursos no fundo TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES, que o RPPS já é cotista, da mesma gestora e, possui estratégia semelhante e que vem apresentando rentabilidade superior.

Mantendo a rotina de conversa com gestores, distribuidores e participantes do mercado o comitê de investimentos participou de reuniões com:

CALL DE RESULTADO SINGUA/TARPON
PRIVATIZA AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS
ATINA AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS

Com o início da queda da taxa Selic, o cenário começou a ficar favorável para os ativos SMALL CAPS, em visita a ATINA AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS foi apresentado ao comitê o fundo 4UM SMALL CAPS FI AÇÕES CNPJ: 09.550.197/0001-07, fundo com histórico desde junho de 2008, acumulando retorno de 400%. A gestora existe desde 1968 e possui atualmente mais de 6 bilhões em ativos sob gestão. Vê-se que o fundo possui bons retornos em comparativo a seus pares de mercado.

Após análise da consultoria de investimentos e parecer favorável da consultoria de investimentos, o comitê de investimentos aguardará apenas a manifestação do conselho administrativo, conforme estabelecido no item 4.1.2. da Política de Investimentos em curso, para aprovação do credenciamento da gestora 4UM e a aplicação de R\$ 5.000.000,00 no fundo com possível aumento de exposição no ativo. Serão utilizados na aplicação os recursos das transferências das contribuições recebidas no mês de julho que estarão aplicados no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

Em análise para discussão do comitê para diversificação da carteira ainda em 2023 estão os fundos:

DAYCOVAL CLASSIC TITULOS BANCARIOS FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIARIO DI LP
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA
DOURADA FIC AÇÕES
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOV. CICLICO I FIC MULTIMERCADO
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES

Para aplicação no fundo DAYCOVAL CLASSIC TITULOS BANCARIOS FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO deverá ocorrer o resgate total do ativo da mesma gestora DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES, o fundo possui estratégia ativa de superar o IBOVESPA, o que não ocorre em comparação a ativos de mesma estratégia no mesmo período.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

A aplicação no fundo BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA poderá ocorrer com recurso das transferências de contribuições adicionalmente ao resgate do fundo BNP PARIBAS ACCESS EQUITY WORLD que atualmente é direcionado somente a investidores qualificados, mas que devido as rentabilidades negativas do período de pandemia pode ser mantido na carteira até a recuperação do capital investido.

Quanto aos fundos apresentados pelos distribuidores OC AGENTE AUTONOMO, GRID AGENTES AUTONOMOS, TORRES INVEST, BAYES CAPITAL, o comitê optou por não fazer alocações no ano de 2023.

Atualmente, a carteira do RPPS já possui uma exposição que consideramos atualizada com o cenário atual. Os ativos propostos por esses participantes do mercado serão reavaliados no ano de 2024.

Embora o comitê de investimentos reconheça a possibilidade de errar em um custo de oportunidade ao adiar o início dessas parcerias para o próximo ano, não se sente confiante com as apresentações realizadas. Portanto, optamos por não dar continuidade ao processo de análise e credenciamento neste momento



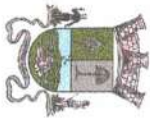
José Roberto dos Santos
Membro Comitê de Investimento
CPA-10/CGRPPS



Alex Domingues de Castro Santos
Membro Comitê de Investimento
CPA-10/CGRPPS



Rafael de Jesus Freitas
Membro Comitê de Investimento
CPA-10



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

APPROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL

O Conselho Fiscal, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, aprovou o relatório de investimentos, conforme registro na ata de reunião em anexo



Conselho Fiscal do ITAPREV

REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO FISCAL

Aos dias 12 de setembro de dois mil e vinte três, às 14h00 **102ª (centésima segunda reunião)**, do Conselho Fiscal do ITAPREV, reunião ordinária com os senhores membros do Conselho Fiscal, realizada na Sala de Reuniões do Bloco B do Complexo Administrativo da Prefeitura, com Ana Maria Bondezan, Conceição Aparecida Borges Kusuki e o Conselheiro Evandro Ferreira Domingues. Conforme análise do Balancete de Receitas e Despesas do mês de julho de dois mil e vinte três, saldo de fechamento R\$ 321.055.360,94 (trezentos e vinte e um cinquenta e cinco mil trezentos e sessenta reais e noventa e quatro centavos). Analisado também o Relatório da Comissão de Investimentos de julho de 2023, apesar da instabilidade econômica mundial, os investimentos se encontram coerente para o atual momento. Foi encerrada esta reunião a qual lavro a ata e assinamos abaixo, ficando a próxima reunião a critério dos novos Conselheiros eleitos.



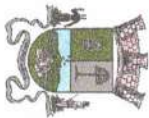
Ana Maria Bondezan
Presidente do Conselho Fiscal



Conceição Aparecida Borges Kusuki
Secretária do Conselho Fiscal



Conselheiro Evandro Ferreira Domingues
Conselho Fiscal



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO



**CRÉDITO
& MERCADO**

**Relatório Analítico dos Investimentos
em julho de 2023**



Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 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	10.404.330,28	3,24%	675	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	30.565,23	0,01%	65.590	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.723.364,98	1,16%	931	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	9.277.825,36	2,89%	786	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.863.054,00	0,58%	589	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	5.101.976,32	1,59%	292	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	16.422.130,98	5,12%	40	8,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	16.162.686,37	5,03%	370	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	15.908.336,30	4,96%	83	3,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	21.185.139,35	6,60%	110	2,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.159.440,24	1,61%	777	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.570.082,11	2,05%	892	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.872.798,42	2,45%	47	3,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.983.980,23	1,55%	925	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	3.053.390,47	0,95%	147	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.670.920,87	1,14%	1.184	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	10.697.430,17	3,33%	1.903	9,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.067.430,61	1,58%	980	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.649.949,91	1,45%	119	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	845.880,06	0,26%	355	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'



Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.488.623,35	0,78%	998	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	10.946.164,49	3,41%	14	7,92%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	D+0		8.095.969,90	2,52%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	D+0		8.106.669,42	2,53%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	D+0		10.132.423,58	3,16%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	D+0		10.147.219,41	3,16%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	6.609.458,27	2,06%	115	2,88%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	3.319.027,96	1,03%	42.080	0,27%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.037.123,69	0,95%	3.004	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.789.627,86	3,05%	2.432	4,58%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	D+15	Não há	6.509.371,37	2,03%	2.744	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	7.013.063,51	2,18%	436	4,76%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSDAD FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.305.390,87	1,34%	271	1,31%	Artigo 8º, Inciso I
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.538.071,43	2,04%	48	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
QLZ MOS FIC AÇÕES	D+10	Não há	1.393.452,77	0,43%	57	2,02%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.505.683,06	0,78%	30	1,95%	Artigo 8º, Inciso I
SQI FIC AÇÕES	D+0	Não há	4.195.942,46	1,31%	6	3,91%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.337.609,17	1,97%	53	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	D+4 du	Não há	2.498.269,16	0,78%	148	1,36%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	11.379.028,48	3,54%	22	1,94%	Artigo 8º, Inciso I



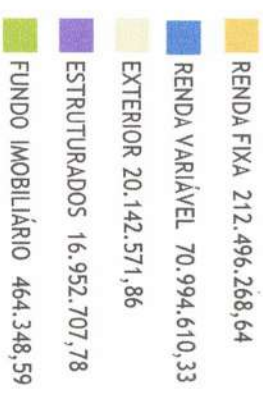
Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	5.491.976,50	1,71%	30	0,60%	Artigo 8º, Inciso I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO ...	D+5 du	Não há	1.366.093,29	0,43%	44	7,16%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	1.433.503,12	0,45%	206	0,49%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.315.872,97	2,59%	11.374	1,27%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	9.027.102,48	2,81%	488	0,44%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.155.913,37	0,67%	95	1,65%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	3.029.530,27	0,94%	6.942	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	4.304.309,84	1,34%	3.034	0,26%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	3.264.971,05	1,02%	21	1,46%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	4.197.983,25	1,31%	20	2,55%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI ...	Não se ...	Não se aplica	464.348,59	0,14%		0,16%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			321.050.507,20				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.853,74				Artigo 6º
			321.055.360,94				



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 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%	10,00%	40,00%	128.420.202,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	142.087.451,68	44,26%	15,00%	30,00%	90,00%	146.858.004,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	23.998.048,42	7,47%	2,00%	5,00%	50,00%	136.527.205,18
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	36.482.282,31	11,36%	0,00%	18,00%	20,00%	27.727.819,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	9.928.486,23	3,09%	0,00%	3,00%	5,00%	6.124.039,13
Total Renda Fixa	100,00%	212.496.268,64	66,19%	17,00%	66,00%	205,00%	

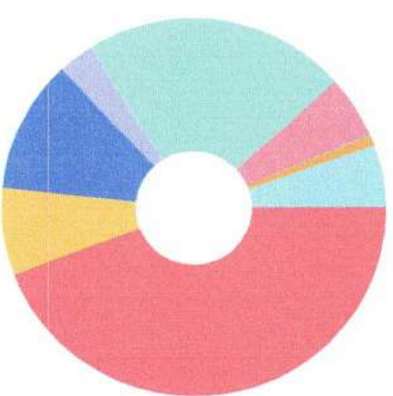




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	70.994.610,33	22,11%	10,00%	20,00%	30,00%	25.320.541,83
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	16.952.707,78	5,28%	1,00%	5,50%	10,00%	15.152.342,94
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	9.631.515,22
Artigo 11º	5,00%	464.348,59	0,14%	0,00%	0,50%	3,00%	9.167.166,63
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	88.411.666,70	27,54%	11,00%	26,00%	46,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.799.596,41	0,87%	0,00%	3,00%	10,00%	29.305.454,31
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	17.342.975,45	5,40%	1,00%	5,00%	10,00%	14.762.075,27
Total Exterior	10,00%	20.142.571,86	6,27%	1,00%	8,00%	20,00%	



- 7º I b
- 7º III a
- 7º IV
- 7º V b
- 8º I
- 10º I
- 11º
- 9º II
- 9º III



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão	Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
					Carteira \$	Carteira %		
CAIXA DTVM	99.358.942,17	30,95	-					
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	78.525.150,47	24,46	-	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	40,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	21.029.521,64	6,55	0,19	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	142.087.451,68	44,26	15,00	90,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	18.409.118,79	5,73	0,19	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	23.998.048,42	7,47	2,00	50,00
TRIANGONO CAPITAL	16.871.004,98	5,25	0,34	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	9.928.486,23	3,09	0,00	5,00
TARPON INVESTIMENTOS	13.031.820,79	4,06	0,15	Artigo 8º, Inciso I	70.994.610,33	22,11	10,00	30,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	11.155.721,15	3,47	0,02	Artigo 9º, Inciso II	2.799.596,41	0,87	0,00	10,00
GUEPARDO INVESTIMENTOS	6.538.071,43	2,04	0,13	Artigo 9º, Inciso III	17.342.975,45	5,40	1,00	10,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	6.509.371,37	2,03	0,32	Artigo 10º, Inciso I	16.952.707,78	5,28	1,00	10,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	4.305.390,87	1,34	-	Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	3,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.939.186,18	1,23	0,05	Artigo 11º	464.348,59	0,14	0,00	3,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.037.123,69	0,95	0,01					
MOS CAPITAL	1.393.452,77	0,43	-					
ZION INVEST	464.348,59	0,14	-					

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/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR Mes	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)								
IDKA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,99%	11,11%	5,62%	10,25%	16,82%	19,48%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,95%	10,76%	5,52%	9,94%	-	-	1,09%	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)								
IDKA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98%	7,84%	2,26%	6,31%	10,55%	21,73%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	7,57%	2,34%	6,08%	10,55%	20,96%	0,71%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	7,57%	2,37%	6,04%	10,71%	21,24%	0,66%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)								
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,61%	6,51%	1,74%	5,48%	10,23%	28,61%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,14%	8,14%	2,77%	6,70%	11,88%	20,95%	0,83%	0,02%
IMA Geral (Benchmark)								
IMA Geral (Benchmark)	0,98%	9,70%	4,55%	8,94%	14,59%	21,41%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,93%	9,73%	4,58%	8,98%	14,73%	21,19%	0,72%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)								
IRF-M 1 (Benchmark)	1,07%	7,81%	3,44%	6,64%	13,84%	23,07%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,07%	7,73%	3,39%	6,53%	13,63%	22,57%	0,16%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)								
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,82%	6,89%	0,35%	5,64%	6,24%	-	1,11%	0,06%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,92%	7,92%	2,66%	6,54%	11,08%	21,09%	0,75%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,95%	8,01%	2,61%	6,54%	11,10%	21,88%	0,74%	0,02%

**Retorno dos Investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,02%	2,64%	6,56%	11,20%	22,15%	0,73%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	9,12%	5,84%	8,82%	6,82%	6,36%	1,57%	0,08%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	12,10%	5,78%	12,11%	15,14%	18,55%	1,54%	0,05%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,85%	6,03%	2,62%	5,10%	10,66%	-	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	9,61%	4,54%	8,91%	14,14%	21,06%	0,49%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	6,68%	2,97%	5,66%	11,77%	20,50%	0,00%	0,00%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,25%	6,22%	3,79%	5,70%	12,60%	25,48%	0,10%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,98%	7,02%	3,06%	5,93%	12,47%	21,74%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,14%	7,64%	3,48%	6,47%	13,70%	24,83%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	-	-	-	-	-	0,42%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	-	-	-	-	-	1,27%	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	-	-	-	-	-	-	-	-



Retorno dos Investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR Mes	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	6,67%	1,99%	5,21%	9,90%	-	0,42%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,00%	8,84%	4,42%	7,78%	14,17%	21,28%	0,61%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,89%	9,23%	4,88%	8,11%	14,71%	20,86%	1,04%	0,01%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	1,31%	-	4,89%	-	-	-	3,03%	-



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

	Mes	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR Mes	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	3,12%	16,80%	26,65%	13,48%	17,47%	-20,79%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,12%	14,11%	18,63%	11,16%	14,05%	-13,06%	8,72%	0,19%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,71%	8,12%	4,44%	4,01%	0,56%	-7,12%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	2,12%	9,42%	6,67%	7,40%	3,63%	-5,70%	5,15%	0,22%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,88%	6,14%	2,36%	1,41%	1,33%	-9,61%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,64%	24,55%	12,24%	16,92%	20,80%	22,16%	3,74%	0,19%
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
SQI FIC AÇÕES	17,15%	63,15%	55,38%	39,44%	-	-	23,91%	-
IFIX (Benchmark)	1,33%	11,51%	11,86%	13,33%	13,61%	13,21%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-3,40%	-29,43%	5,29%	-21,65%	-56,65%	158,44%	8,52%	0,34%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-3,40%	-29,43%	5,29%	-21,65%	-56,65%	23,76%	8,52%	0,34%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,84%	2,11%	0,45%	1,89%	5,61%	-	1,54%	0,07%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,51%	8,41%	21,72%	4,88%	17,68%	2,54%	6,90%	0,20%
QLZ MOS FIC AÇÕES	3,01%	-	35,08%	30,20%	-	-	7,88%	-



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR Mês	Volatilidade 12M
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2,56%	9,60%	14,12%	5,00%	11,10%	-5,36%	7,19%	0,21%
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	-	-	-	-	-	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	1,45%	13,46%	16,34%	9,27%	13,40%	2,04%	6,37%	0,19%
FINACAP MAURITSSAD FIC AÇÕES	2,56%	15,01%	20,21%	11,22%	21,28%	11,74%	6,40%	0,18%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,08%	11,94%	19,85%	6,38%	24,18%	21,15%	5,97%	0,22%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	2,74%	6,25%	14,98%	2,34%	14,80%	-9,21%	7,87%	0,21%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5,91%	32,21%	32,12%	29,17%	43,47%	42,26%	8,17%	0,22%
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	3,31%	11,17%	16,14%	6,86%	17,72%	5,83%	7,86%	0,21%
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,29%	28,12%	28,23%	29,31%	36,99%	32,25%	8,94%	0,23%
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	0,23%
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,25%	6,22%	3,79%	5,70%	12,60%	25,48%	0,10%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,00%	7,63%	2,95%	6,34%	12,86%	20,60%	0,61%	0,01%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,99%	7,62%	3,61%	6,45%	13,69%	25,44%	0,10%	0,00%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSAAMERICANA FI MULTIMERCADO	0,89%	8,32%	4,19%	7,45%	-	-	0,59%	-

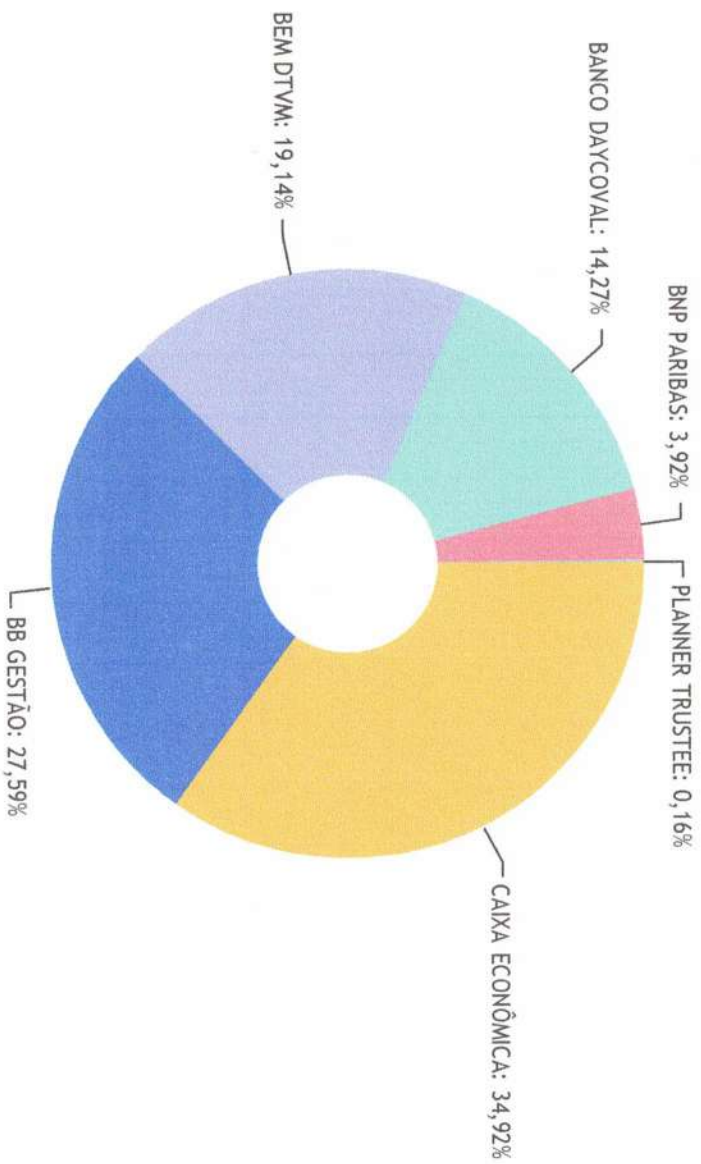


Retorno dos Investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - RENDA VARIÁVEL

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------



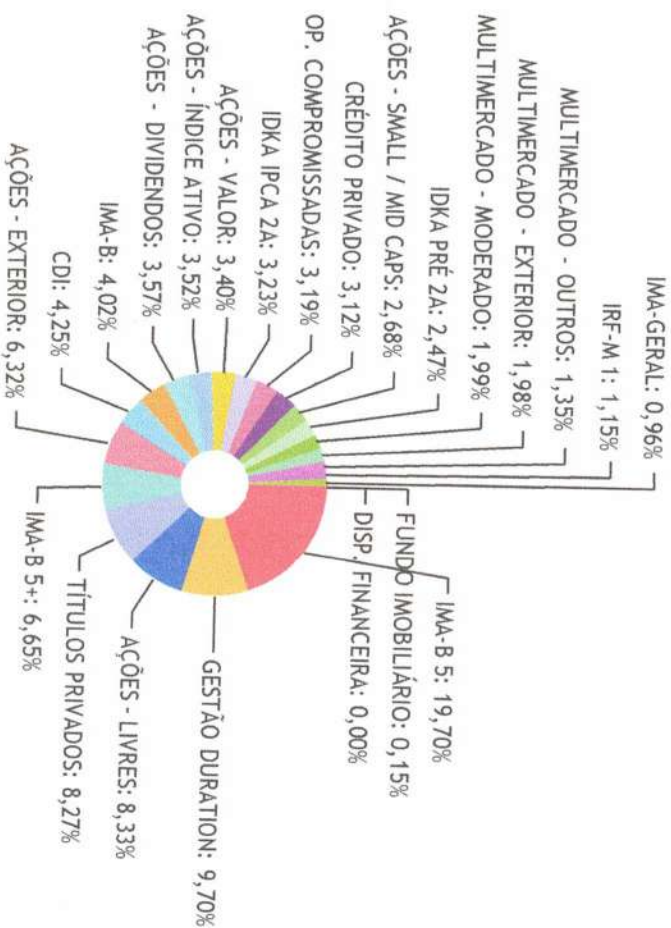
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,71%	8,12%	4,44%	4,01%	0,56%	-7,12%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	9,42%	6,67%	7,40%	3,63%	-5,70%	5,15%	21,524%
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12%	16,95%	8,55%	12,11%	7,35%	-4,52%	5,49%	23,133%
MSCI WORLD (Benchmark)	1,62%	6,99%	2,45%	2,31%	1,97%	-7,57%	-	-
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,68%	-2,05%	-2,59%	-3,40%	-3,81%	-12,19%	3,99%	17,820%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,88%	6,14%	2,36%	1,41%	1,33%	-9,61%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,81%	4,72%	1,78%	2,93%	4,05%	-10,02%	6,18%	23,316%



CAIXA ECONÔMICA	99.358.942,17
BB GESTÃO	78.525.150,47
BEM DTVM	54.464.648,65
BANCO DAYCOVAL	40.599.413,86
BNP PARIBAS	11.155.721,15
PLANNER TRUSTEE	464.348,59



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



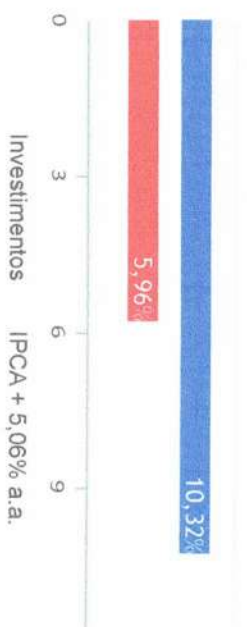
Sub-Segment	Value (R\$)	Sub-Segment	Value (R\$)	Sub-Segment	Value (R\$)
IMA-B 5	62.754.959,24	GESTÃO DURATION	30.911.150,60	ACÇÕES - LIVRES	26.535.744,23
IMA-B 5+	21.185.139,35	ACÇÕES - EXTERIOR	20.142.571,86	CDI	13.534.475,57
ACÇÕES - DIVIDENDOS	11.379.028,48	ACÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11.209.005,97	ACÇÕES - VALOR	10.843.462,30
OP. COMPROMISSADAS	10.147.219,41	CRÉDITO PRIVADO	9.928.486,23	ACÇÕES - SMALL / MID CAPS	8.529.100,19
MULTIMERCADO - MODERADO	6.353.896,62	MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.294.501,32	MULTIMERCADO - OUTROS	4.304.309,84
IMA-GERAL	3.053.390,47	FUNDO IMOBILIÁRIO	464.348,59	DISP. FINANCEIRA	4.853,74
				IRF-M 1	3.670.920,87



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

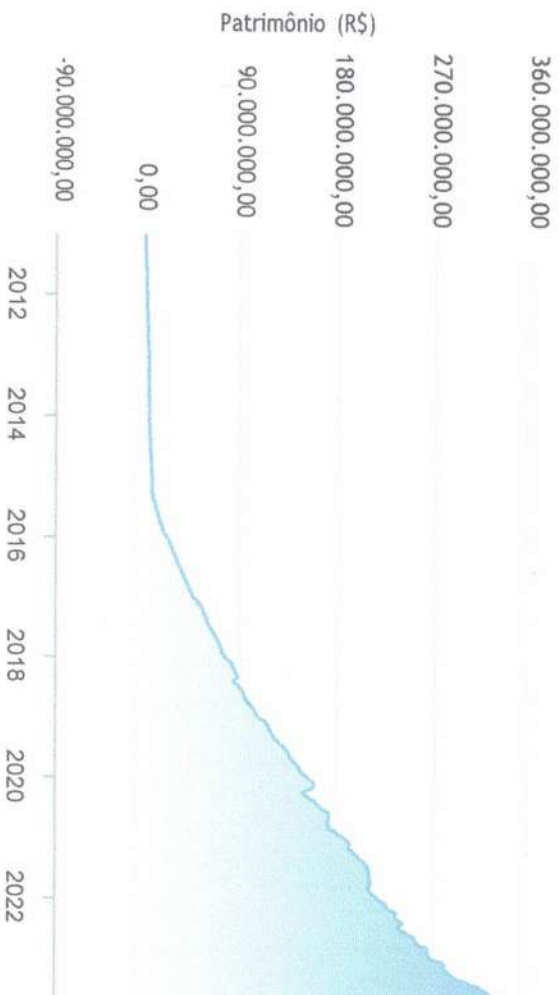
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	263.411.729,77	10.897.991,24	5.634.066,11	273.219.972,55	4.544.317,65	4.544.317,65	1,69%	1,69%	0,96%	0,96%	176,19%	3,54%
Fevereiro	273.219.972,55	32.905.272,17	31.766.834,85	273.027.916,94	-1.391.492,93	3.212.824,72	-0,49%	1,20%	1,20%	2,17%	55,26%	3,85%
Março	273.027.916,94	11.968.923,75	8.506.551,08	278.020.384,65	1.530.096,04	4.742.919,76	0,55%	1,76%	1,16%	3,36%	52,35%	3,72%
Abril	278.020.384,65	9.345.173,87	5.758.660,02	284.167.653,13	2.560.754,63	7.303.674,39	0,91%	2,68%	0,97%	4,36%	61,61%	3,46%
Mai	284.167.653,13	50.702.981,48	47.175.001,29	296.155.658,46	8.460.025,14	15.763.699,53	2,94%	5,70%	0,66%	5,05%	112,99%	3,80%
Junho	296.155.658,46	9.751.606,73	6.358.483,81	307.673.371,48	8.124.590,10	23.888.289,63	2,71%	8,57%	0,33%	5,40%	158,82%	3,31%
Julho	307.673.371,48	11.019.271,69	7.756.562,83	315.952.511,36	5.016.431,02	28.904.720,65	1,61%	10,32%	0,53%	5,96%	173,26%	3,10%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

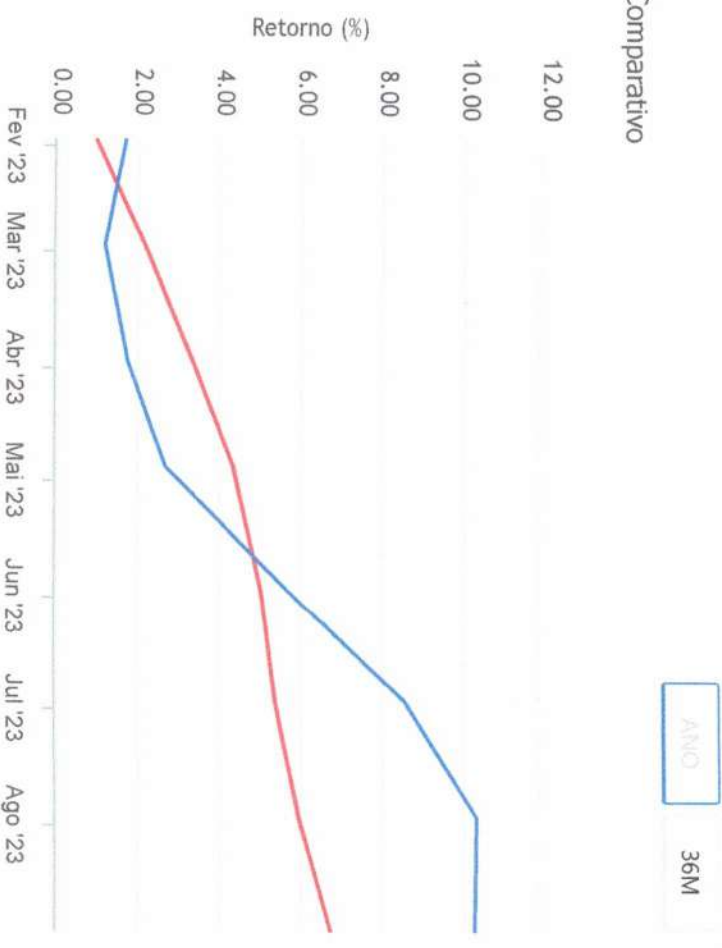




Evolução do Patrimônio



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 Julho/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	10.805.201,72	0,00	0,00	10.946.164,49	140.962,77	1,30%	1,30%	3,03%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3.277.936,40	0,00	0,00	3.319.027,96	41.091,56	1,25%	1,25%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.460.545,49	0,00	0,00	2.488.623,35	28.077,86	1,14%	1,14%	0,03%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	6.535.128,09	0,00	0,00	6.609.458,27	74.330,18	1,14%	1,14%	0,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.632.009,79	0,00	0,00	3.670.920,87	38.911,08	1,07%	1,07%	0,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	5.048.171,75	0,00	0,00	5.101.976,32	53.804,57	1,07%	1,07%	0,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIAR...	15.993.582,01	0,00	0,00	16.162.686,37	169.104,36	1,06%	1,06%	0,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.149.552,57	0,00	132.339,17	5.067.430,61	50.217,21	0,98%	0,98%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.937.000,04	0,00	0,00	4.983.980,23	46.980,19	0,95%	0,95%	0,73%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	7.798.699,28	0,00	0,00	7.872.798,42	74.099,14	0,95%	0,95%	1,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.190.502,47	0,00	0,00	9.277.825,36	87.322,89	0,95%	0,95%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.688.570,59	0,00	0,00	3.723.564,98	34.794,39	0,94%	0,94%	0,66%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	3.025.397,39	0,00	0,00	3.053.390,47	27.993,08	0,93%	0,93%	0,72%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	10.599.961,75	0,00	0,00	10.697.430,17	97.468,42	0,92%	0,92%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.510.434,75	0,00	0,00	6.570.082,11	59.647,36	0,92%	0,92%	0,71%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	30.308,19	0,00	0,00	30.565,23	257,04	0,85%	0,85%	0,01%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.779.182,72	0,00	0,00	15.908.336,30	129.153,58	0,82%	0,82%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	16.290.200,63	0,00	0,00	16.422.130,98	131.930,35	0,81%	0,81%	1,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.323.131,65	0,00	0,00	10.404.330,28	81.199,63	0,79%	0,79%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.121.048,35	1.000.000,00	0,00	5.159.440,24	38.391,89	0,75%	0,89%	1,04%



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

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...	1.849.491,39	0,00	0,00	1.863.054,00	13.562,61	0,73%	0,73%	1,54%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.035.109,95	0,00	0,00	21.185.139,35	150.029,40	0,71%	0,71%	1,57%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.617.877,11	2.000.000,00	0,00	4.648.949,91	32.072,80	0,69%	1,00%	0,61%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	8.059.710,90	0,00	0,00	8.108.669,42	46.958,52	0,58%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	8.050.513,75	0,00	0,00	8.095.969,90	45.456,15	0,56%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	10.104.164,34	0,00	0,00	10.147.219,41	43.055,07	0,43%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	563.349,82	4.331.914,42	4.069.205,56	845.880,06	19.821,38	0,40%	0,99%	0,00%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	10.091.967,75	0,00	0,00	10.132.423,58	40.455,83	0,40%	-	-
Total Renda Fixa	207.568.750,64	7.331.914,42	4.201.544,73	212.496.268,64	1.797.148,31	0,85%		0,98%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SOLIFICAÇÕES	3.581.710,94	0,00	0,00	4.195.942,46	614.231,52	17,15%	17,15%	23,91%
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	0,00	2.308.837,47	0,00	2.498.269,16	189.431,69	8,20%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.984.131,31	0,00	0,00	6.337.609,17	353.477,86	5,91%	5,91%	8,17%
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.209.385,75	0,00	0,00	6.538.071,43	328.685,68	5,29%	5,29%	8,94%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.916.943,81	0,00	0,00	3.037.123,69	120.179,88	4,12%	4,12%	8,72%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.923.121,62	0,00	0,00	3.029.530,27	106.408,65	3,64%	3,64%	3,74%
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	2.425.391,22	0,00	0,00	2.505.683,06	80.291,84	3,31%	3,31%	7,86%
DAYCOVAL IBOVSPAATIVO FIC AÇÕES	6.826.015,70	0,00	0,00	7.013.063,51	187.047,81	2,74%	2,74%	7,87%
FINACAP MAURITSTAD FIC AÇÕES	4.198.004,03	0,00	0,00	4.305.390,87	107.386,84	2,56%	2,56%	6,40%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9.545.469,42	0,00	0,00	9.789.627,86	244.158,44	2,56%	2,56%	7,19%
TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	5.357.448,36	0,00	0,00	5.491.976,50	134.528,14	2,51%	2,51%	6,90%
TARPON INTERSECTION FIC AÇÕES	2.257.444,46	0,00	2.308.837,47	0,00	51.393,01	2,28%	9,89%	11,29%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	6.416.583,29	0,00	0,00	6.509.371,37	92.788,08	1,45%	1,45%	6,37%
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	1.360.479,23	0,00	1.378.519,80	0,00	18.040,57	1,33%	-	-
QLZ MOS FIC AÇÕES	0,00	1.378.519,80	0,00	1.393.452,77	14.932,97	1,08%	3,01%	7,88%
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.257.268,04	0,00	0,00	11.379.028,48	121.760,44	1,08%	1,08%	5,97%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.134.572,78	0,00	0,00	2.155.913,37	21.340,59	1,00%	1,00%	0,51%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	4.262.014,91	0,00	0,00	4.304.309,84	42.294,93	0,99%	0,99%	0,10%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3.236.281,98	0,00	0,00	3.264.971,05	28.689,07	0,89%	0,89%	0,59%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	4.163.104,40	0,00	0,00	4.197.983,25	34.878,85	0,84%	0,84%	1,54%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	480.682,46	0,00	0,00	464.348,59	-16.333,87	-3,40%	-3,40%	8,52%
Total Renda Variável	85.536.053,71	3.687.357,27	3.687.357,27	88.411.666,70	2.875.612,99	3,22%		6,91%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	8.143.546,77	0,00	0,00	8.315.872,97	172.326,20	2,12%	2,12%	5,15%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	8.840.066,38	0,00	0,00	9.027.102,48	187.036,10	2,12%	2,12%	5,49%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.407.992,72	0,00	0,00	1.433.503,12	25.510,40	1,81%	1,81%	6,18%
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO...	1.356.822,02	0,00	0,00	1.366.093,29	9.271,27	0,68%	0,68%	3,99%
Total Exterior	19.748.427,89	0,00	0,00	20.142.571,86	394.143,97	2,00%		5,30%



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