

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

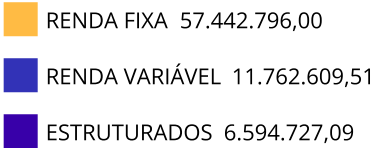
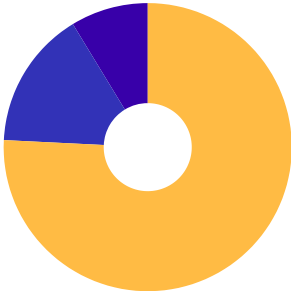
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	48.534,72	0,06%	849	0,00%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	617.489,14	0,81%	627	0,01%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.212.122,31	4,24%	76	1,06%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	72.816,86	0,10%	621	0,00%	7º I b
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	15/08/2030	862.080,87	1,14%	23	0,36%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	4.945.139,66	6,52%	747	0,10%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	2.248.055,64	2,97%	813	0,05%	7º I b
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	5.842.683,50	7,71%	902	0,08%	7º I b
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	43.987,99	0,06%	267	0,00%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.203.167,53	2,91%	739	0,06%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	2.418.532,22	3,19%	1.152	0,03%	7º I b
10.577.519/0001-90	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	1.667.349,03	2,20%	232	0,18%	7º I b
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	335.619,66	0,44%	414	0,02%	7º I b
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	939.134,25	1,24%	731	0,01%	7º I b
50.236.636/0001-05	ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	564.169,61	0,74%	30	0,24%	7º I b
32.922.086/0001-04	ITAÚ IDKA 2 IPCA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	4.626.061,14	6,10%	37	3,08%	7º I b
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	2.332.343,61	3,08%	60	0,88%	7º I b
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	3.152.222,63	4,16%	203	0,16%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	2.556.349,74	3,37%	105	0,16%	7º I b
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	12.245.011,74	16,15%	2.790	0,41%	7º I b

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	366.529,53	0,48%	1.029	0,01%	7º III a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	674.335,71	0,89%	1.167	0,00%	7º III a
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC RE...	D+0	Não há	642.207,01	0,85%	217	0,06%	7º III a
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 RESP LIMITADA FIF ...	D+1	Não há	2.478.462,18	3,27%	438	0,28%	7º III a
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M RESP LIMITADA FIF RE...	D+1	Não há	2.348.389,72	3,10%	552	0,38%	7º III a
29.258.294/0001-38	BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+33	Não há	1.621.912,97	2,14%	1.153	0,22%	8º I
35.495.250/0001-24	ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+23	Não há	2.265.312,54	2,99%	42	1,07%	8º I
02.887.290/0001-62	ITAÚ DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	859.869,76	1,13%	179	0,36%	8º I
24.571.992/0001-75	ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24	Não há	1.713.426,17	2,26%	11.470	0,13%	8º I
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.886.272,49	2,49%	33	0,49%	8º I
42.318.981/0001-60	ITAÚ MOMENTO 30 II RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+23 du	Não há	2.692.493,08	3,55%	51	2,28%	8º I
06.051.151/0001-55	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	D+4	Não há	723.322,50	0,95%	3.929	0,35%	8º I
08.070.841/0001-87	CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTI...	D+4	Não há	4.662.764,64	6,15%	4.293	0,37%	10º I
03.737.188/0001-43	CAIXA RV 30 RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.931.962,45	2,55%	4.568	0,41%	10º I
Total para cálculo dos limites da Resolução			75.800.132,60					

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	25,00%	18.950.033,15
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	50.932.871,85	67,19%	20,00%	35,00%	80,00%	9.707.234,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	6.509.924,15	8,59%	8,00%	15,00%	40,00%	23.810.128,89
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	15.160.026,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.790.006,63
Total Renda Fixa	100,00%	57.442.796,00	75,78%	28,00%	70,00%	170,00%	

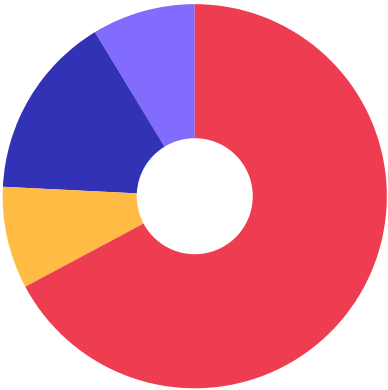


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	11.762.609,51	15,52%	10,00%	19,00%	30,00%	10.977.430,27
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.740.039,78
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	6.594.727,09	8,70%	3,00%	5,00%	10,00%	985.286,17
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.790.006,63
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	18.357.336,60	24,22%	13,00%	24,00%	75,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	7.580.013,26
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.790.006,63



7º I b 7º III a 8º I 10º I

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	0,00	0,00	0,00	25,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	47.780.649,22	63,04	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	6.509.924,15	8,59	8,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	11.762.609,51	15,52	10,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	6.594.727,09	8,70	3,00	10,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	28.742.684,45	37,92	0,15
SICREDI	17.071.863,64	22,52	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	16.164.592,13	21,33	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.613.741,24	8,73	-
ITAÚ UNIBANCO	4.597.656,15	6,07	0,00
ITAÚ DTVM	1.886.272,49	2,49	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	723.322,50	0,95	0,01

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,75%	3,98%	2,01%	3,15%	8,12%	19,52%	-	-
ITAÚ IDKA 2 IPCA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,71%	3,69%	1,95%	2,97%	7,74%	19,20%	1,01%	1,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,73%	3,70%	1,96%	2,95%	7,87%	19,26%	1,03%	1,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,76%	3,90%	2,08%	3,17%	7,92%	19,47%	0,94%	1,75%

IRF-M 1+ (Benchmark)	1,55%	1,77%	1,44%	1,17%	7,38%	27,10%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	1,54%	1,62%	1,37%	1,03%	7,10%	26,22%	1,99%	3,60%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,51%	1,43%	1,31%	0,86%	6,85%	25,86%	2,00%	3,62%

IMA-B 5+ (Benchmark)	3,24%	-1,97%	2,52%	-0,51%	1,03%	20,60%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	3,20%	-2,04%	2,45%	-0,60%	1,00%	20,02%	3,38%	6,12%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,94%	5,49%	2,37%	4,62%	10,81%	26,14%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,90%	5,51%	2,26%	4,53%	10,89%	26,34%	0,34%	0,45%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,93%	5,46%	2,32%	4,50%	10,64%	25,71%	0,28%	0,38%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,91%	4,27%	2,37%	3,56%	8,16%	20,37%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,90%	4,15%	2,32%	3,47%	7,96%	19,94%	0,83%	1,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,89%	4,13%	2,31%	3,45%	7,93%	20,02%	0,84%	1,73%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)	2,09%	0,97%	2,45%	1,43%	4,38%	20,51%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,99%	-0,47%	2,20%	0,09%	2,23%	17,23%	2,10%	4,28%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	2,08%	0,75%	2,29%	1,25%	4,14%	19,96%	2,25%	4,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	2,07%	0,82%	2,37%	1,30%	4,17%	20,10%	2,12%	3,91%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	1,76%	-1,83%	2,43%	-1,48%	-1,62%	7,12%	2,35%	5,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	2,07%	0,82%	2,39%	1,31%	4,13%	19,89%	2,11%	3,92%
IRF-M (Benchmark)	1,34%	2,87%	1,71%	2,19%	8,37%	26,19%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	1,18%	2,53%	1,43%	1,79%	7,94%	25,62%	1,42%	2,69%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	1,33%	2,71%	1,64%	2,03%	8,10%	25,75%	1,41%	2,57%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,32%	2,70%	1,64%	2,03%	8,07%	25,34%	1,41%	2,57%
CDI (Benchmark)	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,92%	6,19%	2,55%	5,17%	11,51%	26,61%	0,01%	0,06%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,98%	3,70%	3,06%	2,56%	4,97%	-	0,25%	4,14%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,92%	5,96%	2,50%	4,96%	11,19%	26,26%	0,03%	0,10%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,97%	6,26%	2,62%	5,25%	11,61%	26,75%	0,04%	0,06%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	5,57%	2,29%	4,64%	10,41%	24,18%	0,00%	0,06%
IPCA (Benchmark)	0,38%	2,87%	1,05%	2,44%	4,50%	8,67%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,88%	2,80%	1,43%	2,32%	7,03%	21,01%	0,56%	2,62%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,96%	3,35%	1,85%	2,67%	7,47%	23,28%	0,64%	1,34%

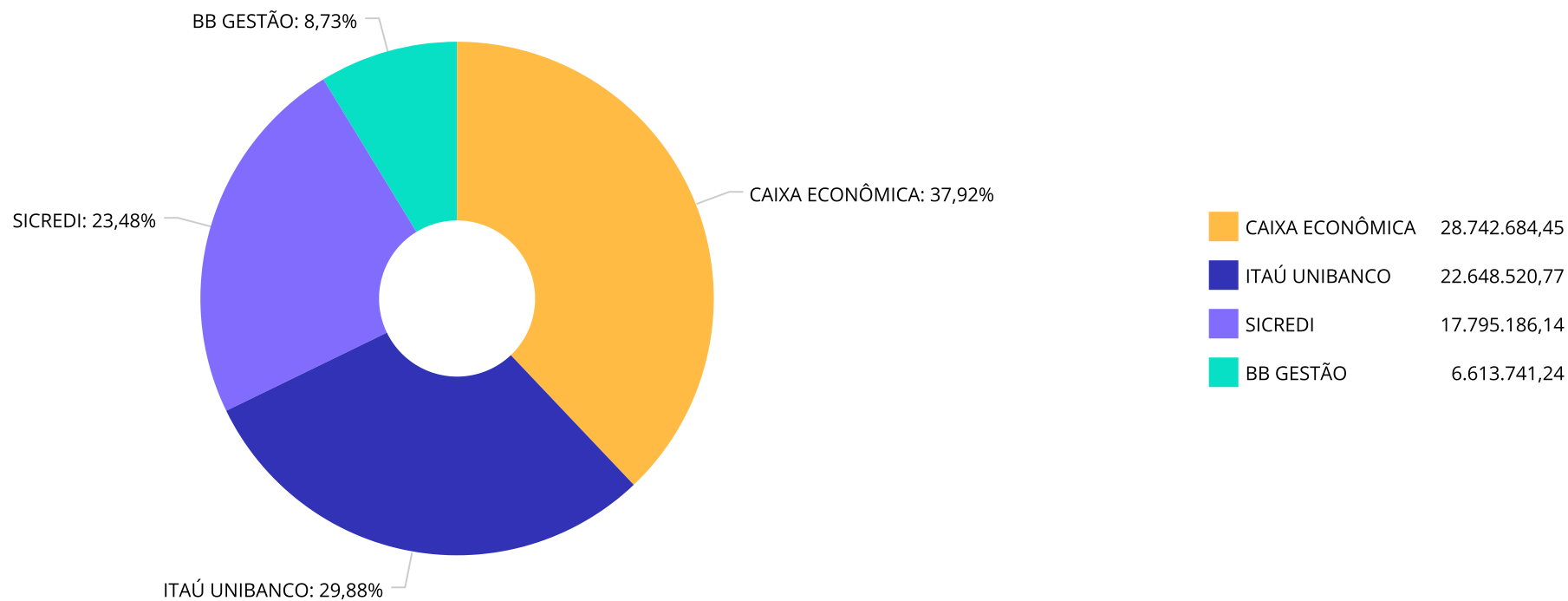
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
CAIXA RV 30 RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	1,62%	-0,33%	0,85%	0,36%	5,91%	21,77%	2,77%	4,97%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	1,34%	3,26%	1,85%	2,74%	8,42%	23,70%	1,70%	3,21%

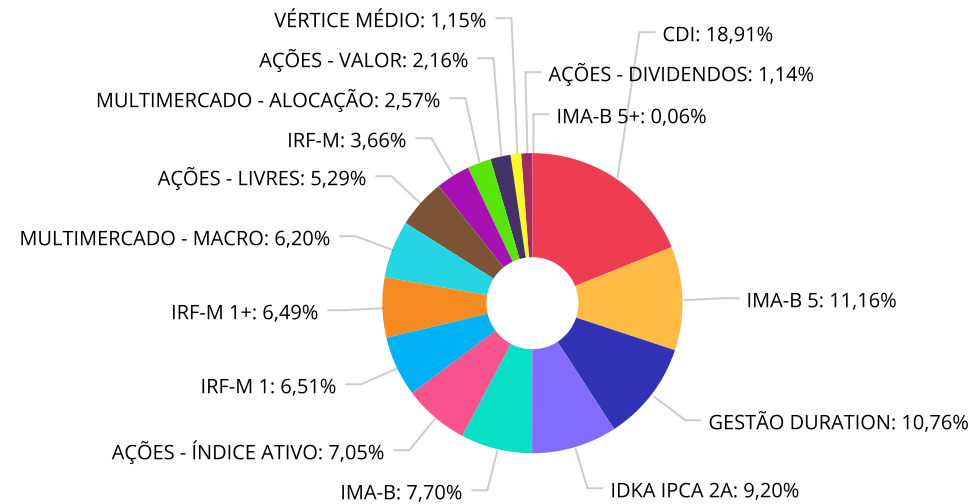
Ibovespa (Benchmark)	3,02%	-4,87%	1,37%	-0,08%	4,68%	23,74%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3,28%	-7,24%	0,42%	-2,90%	-0,40%	16,66%	4,78%	13,27%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	5,13%	4,28%	3,86%	6,72%	15,06%	26,25%	5,45%	12,63%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,77%	-2,42%	2,74%	2,39%	4,11%	31,77%	5,75%	13,15%
BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	2,74%	-5,07%	1,51%	-0,53%	2,52%	12,21%	4,62%	13,28%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	4,77%	-6,64%	1,47%	-1,98%	1,26%	18,97%	4,97%	13,24%
ITAÚ MOMENTO 30 II RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4,50%	-11,45%	0,34%	-5,56%	-12,66%	-11,16%	5,02%	16,95%

IDIV (Benchmark)	1,89%	-1,58%	2,90%	2,00%	11,06%	31,85%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	1,55%	-3,62%	1,23%	0,16%	7,04%	28,35%	4,71%	12,52%

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



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

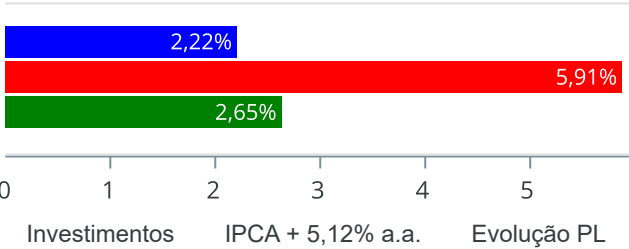


CDI	14.225.011,23	IMA-B 5	8.399.033,24	GESTÃO DURATION	8.097.362,29	IDKA IPCA 2A	6.922.651,50
IMA-B	5.795.207,29	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.302.088,07	IRF-M 1	4.896.994,40	IRF-M 1+	4.879.471,34
MULTIMERCADO - MACRO	4.662.764,64	AÇÕES - LIVRES	3.978.738,71	IRF-M	2.756.826,24	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.931.962,45
AÇÕES - VALOR	1.621.912,97	VÉRTICE MÉDIO	862.080,87	AÇÕES - DIVIDENDOS	859.869,76	IMA-B 5+	43.987,99

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

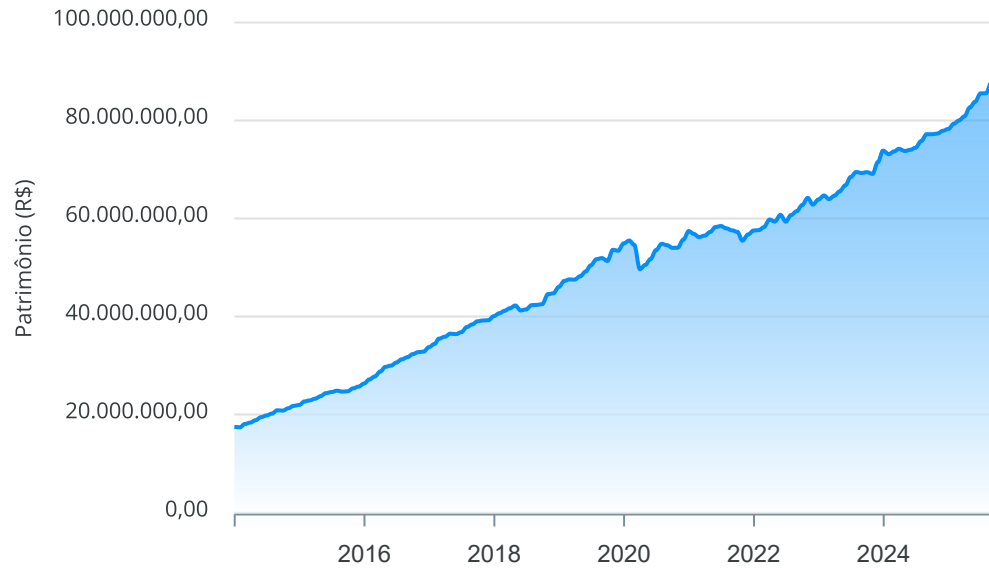
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	73.845.428,70	30.985,73	547.833,53	73.132.820,33	-195.760,57	-195.760,57	-0,27%	-0,27%	0,86%	0,86%	-30,87%	1,44%
Fevereiro	73.132.820,33	755.863,41	652.572,61	73.685.010,32	448.899,19	253.138,62	0,61%	0,35%	1,21%	2,08%	16,65%	1,57%
Março	73.685.010,32	4.449.340,25	4.348.649,30	74.219.748,46	434.047,19	687.185,81	0,59%	0,94%	0,56%	2,65%	35,36%	1,26%
Abril	74.219.748,46	785.374,71	686.455,36	73.782.283,89	-536.383,92	150.801,89	-0,72%	0,21%	0,82%	3,49%	5,96%	1,85%
Maio	73.782.283,89	813.737,53	637.492,96	74.023.427,82	64.899,36	215.701,25	0,09%	0,30%	0,88%	4,40%	6,73%	1,45%
Junho	74.023.427,82	2.846.882,12	2.667.121,74	74.424.451,55	221.263,35	436.964,60	0,30%	0,60%	0,61%	5,03%	11,82%	1,81%
Julho	74.424.451,55	859.980,56	688.040,00	75.800.132,60	1.203.740,49	1.640.705,09	1,61%	2,22%	0,84%	5,91%	37,51%	1,61%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL



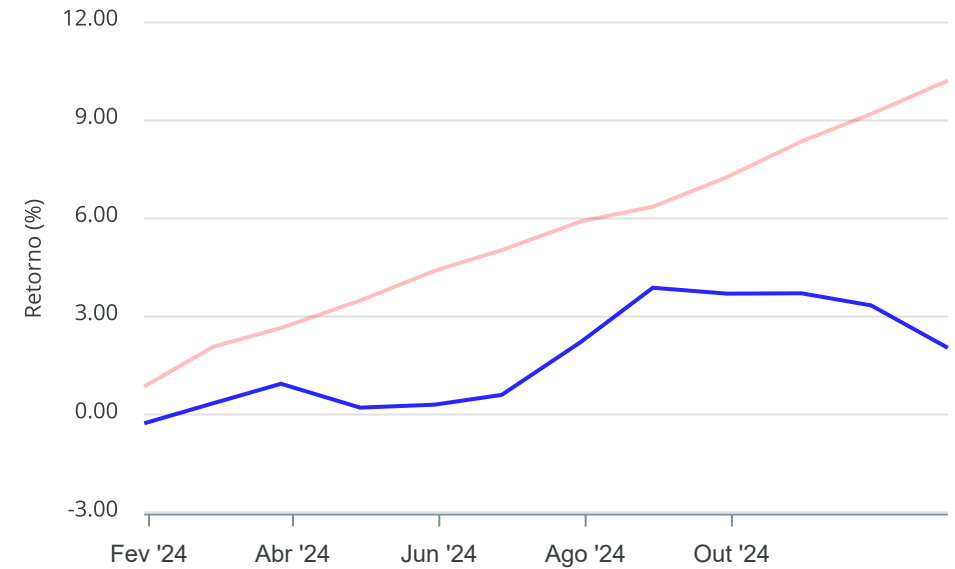
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	42.624,95	0,00	0,00	43.987,99	1.363,04	3,20%	3,20%	3,38%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC REND...	629.122,88	0,00	0,00	642.207,01	13.084,13	2,08%	2,08%	2,25%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	604.940,65	0,00	0,00	617.489,14	12.548,49	2,07%	2,07%	2,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.158.428,83	0,00	0,00	2.203.167,53	44.738,70	2,07%	2,07%	2,12%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	2.286.780,31	0,00	0,00	2.332.343,61	45.563,30	1,99%	1,99%	2,10%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	847.197,60	0,00	0,00	862.080,87	14.883,27	1,76%	1,76%	2,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.642.104,86	0,00	0,00	1.667.349,03	25.244,17	1,54%	1,54%	1,99%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	3.164.470,33	0,00	0,00	3.212.122,31	47.651,98	1,51%	1,51%	2,00%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	331.223,86	0,00	0,00	335.619,66	4.395,80	1,33%	1,33%	1,41%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	71.868,36	0,00	0,00	72.816,86	948,50	1,32%	1,32%	1,41%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M RESP LIMITADA FIF REND...	2.321.096,82	0,00	0,00	2.348.389,72	27.292,90	1,18%	1,18%	1,42%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	558.708,88	0,00	0,00	564.169,61	5.460,73	0,98%	0,98%	0,25%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	667.842,83	0,00	0,00	674.335,71	6.492,88	0,97%	0,97%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	4.699.812,87	213.212,08	15.430,98	4.945.139,66	47.545,69	0,97%	0,96%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	2.396.277,66	0,00	0,00	2.418.532,22	22.254,56	0,93%	0,93%	0,28%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RE...	930.621,06	0,00	0,00	939.134,25	8.513,19	0,91%	0,91%	0,03%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI RESP LIMITADA FIF ...	11.945.633,91	188.459,04	0,00	12.245.011,74	110.918,79	0,91%	0,91%	0,01%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 RESP LIMITADA FIF RE...	2.456.335,99	0,00	0,00	2.478.462,18	22.126,19	0,90%	0,90%	0,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	2.533.649,36	0,00	0,00	2.556.349,74	22.700,38	0,90%	0,90%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	5.790.979,55	0,00	0,00	5.842.683,50	51.703,95	0,89%	0,89%	0,84%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	3.416.442,35	354.355,31	650.339,98	3.152.222,63	31.764,95	0,84%	0,88%	0,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	48.166,91	0,00	0,00	48.534,72	367,81	0,76%	0,76%	0,94%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	2.231.850,21	0,00	0,00	2.248.055,64	16.205,43	0,73%	0,73%	1,03%
ITAÚ IDKA 2 IPCA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	4.593.410,20	0,00	0,00	4.626.061,14	32.650,94	0,71%	0,71%	1,01%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	282.230,22	103.954,13	22.269,04	366.529,53	2.614,22	0,68%	0,82%	0,00%
Total Renda Fixa	56.651.821,45	859.980,56	688.040,00	57.442.796,00	619.033,99	1,09%		0,85%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	2.121.734,55	0,00	0,00	2.265.312,54	143.577,99	6,77%	6,77%	5,75%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.629.757,18	0,00	0,00	1.713.426,17	83.668,99	5,13%	5,13%	5,45%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	690.416,48	0,00	0,00	723.322,50	32.906,02	4,77%	4,77%	4,97%
ITAÚ MOMENTO 30 II RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	2.576.593,51	0,00	0,00	2.692.493,08	115.899,57	4,50%	4,50%	5,02%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	1.826.337,35	0,00	0,00	1.886.272,49	59.935,14	3,28%	3,28%	4,78%
BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.578.693,13	0,00	0,00	1.621.912,97	43.219,84	2,74%	2,74%	4,62%
CAIXA RV 30 RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	1.901.201,92	0,00	0,00	1.931.962,45	30.760,53	1,62%	1,62%	2,77%
ITAÚ DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	846.744,62	0,00	0,00	859.869,76	13.125,14	1,55%	1,55%	4,71%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	4.601.151,36	0,00	0,00	4.662.764,64	61.613,28	1,34%	1,34%	1,70%
Total Renda Variável	17.772.630,10	0,00	0,00	18.357.336,60	584.706,50	3,29%		3,99%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

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.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

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.

