

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)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.063.859.575,51	39,77%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	3.614.245,07	0,14%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	11.416.201,22	0,43%	92	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	94.388.179,68	3,53%	813	2,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	513.574.521,79	19,20%	1.167	2,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	197.856.402,84	7,40%	412	3,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	57.857.537,43	2,16%	21.327	4,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	37.553.034,47	1,40%	22.326	5,28%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	37.029.536,89	1,38%	16.231	3,26%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	28.209.117,31	1,05%	47	12,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	35.390.261,38	1,32%	853	6,43%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	42.385.150,37	1,58%	200	5,60%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	60.943.038,51	2,28%	11.470	4,59%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	48.070.165,48	1,80%	33	12,55%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	8.691.466,82	0,32%	16	7,23%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.038.982,31	0,04%	2.899	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.779.242,45	0,07%	111	1,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	45.060.410,02	1,68%	110	2,82%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	36.576.839,30	1,37%	40	10,64%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	6.895.190,33	0,26%	59	10,01%	Artigo 9º, Inciso II

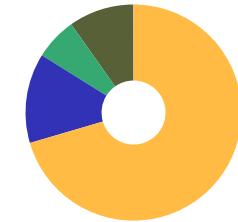
Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO	D+8	Não há	39.221.694,48	1,47%	4.078	5,70%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	34.506.490,89	1,29%	448	1,27%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.214.596,86	0,27%	331	0,95%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	128.287.541,85	4,80%	7.906	6,66%	Artigo 10º, Inciso I
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	131.213.196,11	4,91%	604	9,79%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.363.400,00	0,09%		1,69%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução				2.674.996.019,37			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				68.080,40			Artigo 6º
				PL Total	2.675.064.099,77		



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	1.063.859.575,51	39,77%	10,00%	60,00%	100,00%	1.611.136.443,86
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	109.418.625,97	4,09%	0,00%	3,00%	90,00%	2.298.077.791,46
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.407.496.417,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	711.430.924,63	26,60%	2,00%	3,00%	65,00%	1.027.316.487,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.738.747.412,59
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	133.749.800,97
Total Renda Fixa	100,00%	1.884.709.126,11	70,46%	12,00%	66,00%	415,00%	



- █ RENDA FIXA 1.884.709.126,11
- █ RENDA VARIÁVEL 358.947.533,42
- █ EXTERIOR 169.475.221,88
- █ ESTRUTURADOS 259.500.737,96
- █ FUNDO IMOBILIÁRIO 2.363.400,00

ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!





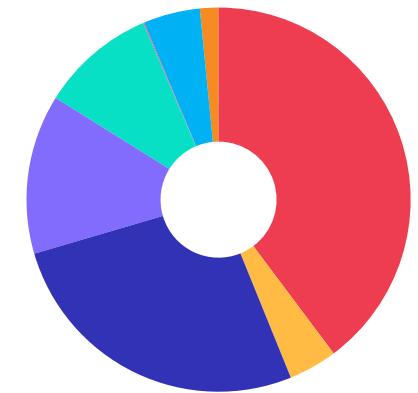
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/07/2024

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	358.947.533,42	13,42%	0,00%	18,20%	35,00%	577.301.073,36
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	936.248.606,78
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	259.500.737,96	9,70%	0,00%	9,50%	10,00%	7.998.863,98
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	133.749.800,97
Artigo 11º	5,00%	2.363.400,00	0,09%	0,00%	0,30%	5,00%	131.386.400,97
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	620.811.671,38	23,21%	0,00%	28,00%	90,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	127.754.134,13	4,78%	0,00%	4,30%	10,00%	139.745.467,81
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	41.721.087,75	1,56%	0,00%	1,70%	10,00%	225.778.514,19
Total Exterior	10,00%	169.475.221,88	6,34%	0,00%	6,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	267.499.601,94





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'	1.063.859.575,51	39,77	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	109.418.625,97	4,09	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	711.430.924,63	26,60	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	358.947.533,42	13,42	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	127.754.134,13	4,78	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	41.721.087,75	1,56	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	259.500.737,96	9,70	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.363.400,00	0,09	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	1.063.859.575,51	39,77	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	742.682.326,19	27,76	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	396.907.827,79	14,84	-
CAIXA DTVM	337.321.024,17	12,61	-
ITAÚ DTVM	56.761.632,30	2,12	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	39.221.694,48	1,47	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	28.209.117,31	1,05	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE INVESTIMENTOS	10.032.821,62	0,38	-

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%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	3,70%	1,96%	2,95%	7,87%	19,26%	1,03%	1,77%
CDI (Benchmark)	0,91%	6,18%	2,55%	5,16%	11,51%	26,66%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	6,26%	2,62%	5,25%	11,61%	26,75%	0,04%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	6,49%	2,66%	5,43%	12,31%	27,86%	0,03%	0,10%
IPCA (Benchmark)	0,38%	2,87%	1,05%	2,44%	4,50%	8,67%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	6,73%	3,04%	5,57%	11,21%	22,14%	0,25%	0,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	6,72%	3,03%	5,55%	11,20%	22,18%	0,25%	0,84%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,29%	41,47%	21,39%	35,02%	51,99%	65,02%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,51%	40,23%	20,99%	34,11%	49,78%	60,78%	10,12%	14,93%

Ibovespa (Benchmark)	3,02%	-4,87%	1,37%	-0,08%	4,68%	23,74%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	3,36%	-9,71%	1,35%	-4,78%	-1,57%	4,69%	4,74%	13,85%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2,47%	-8,91%	1,38%	-2,62%	-0,25%	11,41%	5,03%	13,01%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2,99%	-4,98%	1,36%	-0,16%	4,66%	23,81%	4,74%	13,17%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3,90%	-6,83%	-1,13%	-3,13%	-0,49%	16,35%	6,77%	15,44%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3,28%	-7,24%	0,42%	-2,90%	-0,40%	16,66%	4,78%	13,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	4,18%	-6,34%	1,32%	-2,46%	-2,12%	10,58%	5,46%	14,34%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,70%	-6,21%	-1,74%	-3,58%	3,53%	22,46%	7,34%	15,77%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	3,69%	-5,51%	-0,26%	-1,79%	1,51%	14,71%	5,42%	14,33%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2,85%	-6,80%	1,03%	-2,77%	-1,94%	10,98%	5,67%	13,93%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,13%	4,28%	3,86%	6,72%	15,06%	26,25%	5,45%	12,63%

IFIX (Benchmark)	0,52%	1,61%	-0,50%	0,94%	5,24%	19,57%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-3,93%	-1,65%	-0,48%	-6,55%	-1,62%	25,05%	12,37%	39,20%

MSCI ACWI (Benchmark)	3,40%	30,98%	17,81%	27,34%	37,49%	39,32%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,38%	18,31%	10,67%	16,35%	26,55%	52,86%	6,44%	11,50%



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

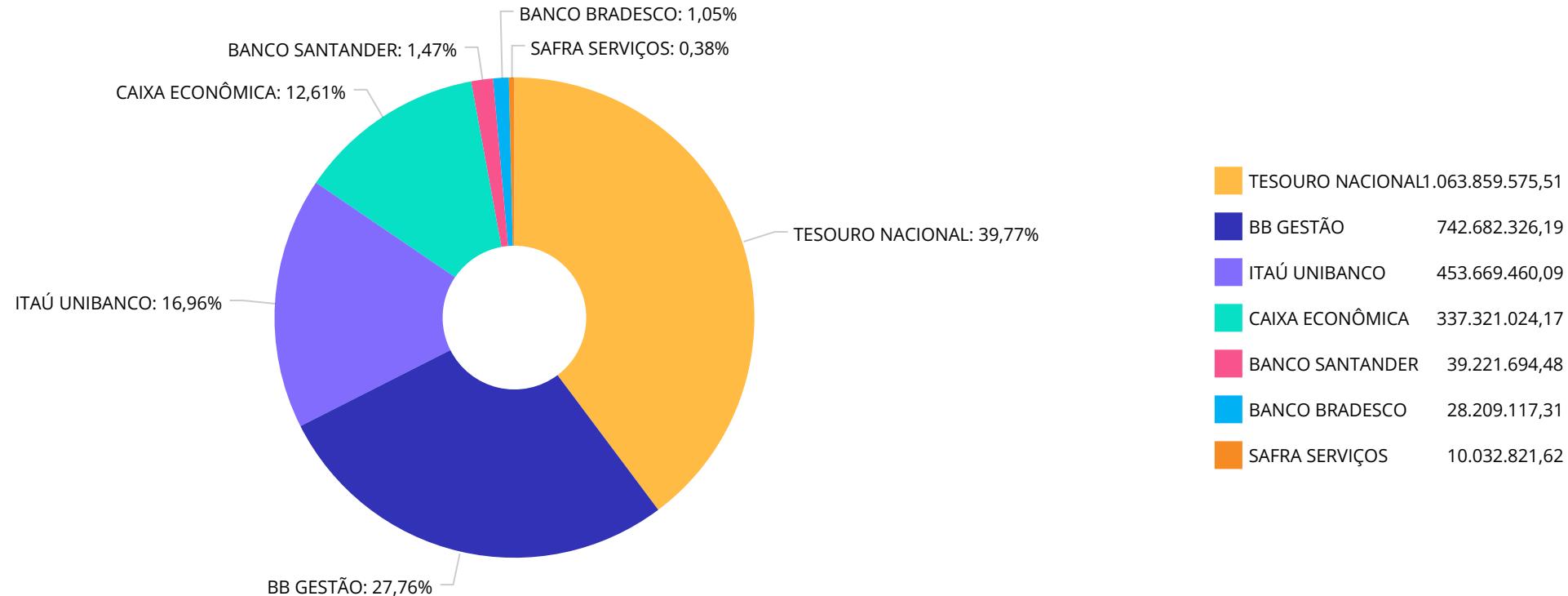
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,13%	15,78%	9,66%	13,96%	20,34%	33,70%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1,46%	17,93%	10,77%	15,99%	25,13%	45,13%	6,42%	11,49%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1,38%	18,36%	10,74%	16,42%	26,57%	52,91%	6,44%	11,49%



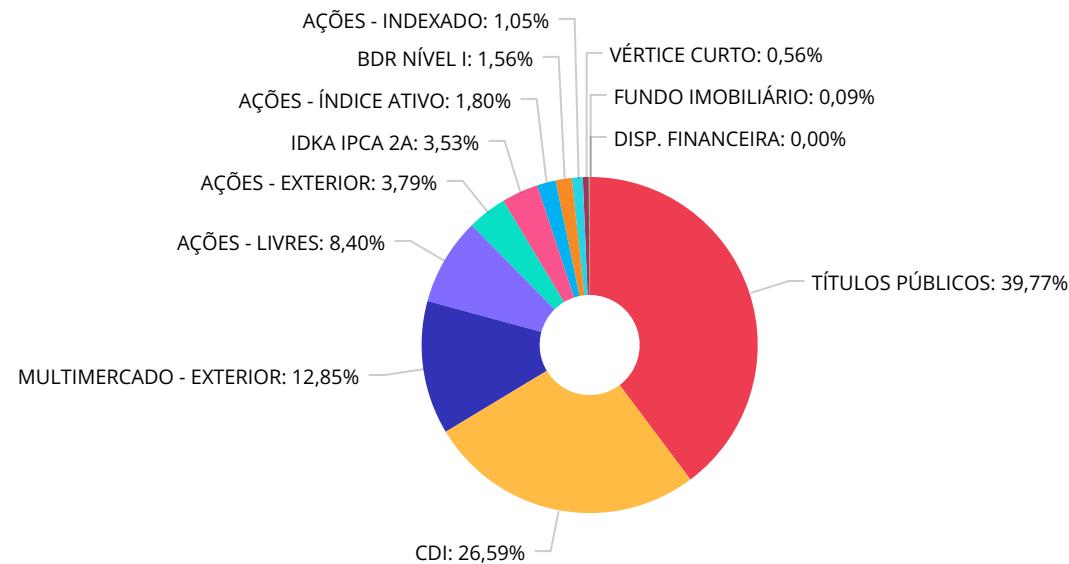
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,29%	41,47%	21,39%	35,02%	51,99%	65,02%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,62%	28,86%	17,65%	25,43%	38,64%	39,96%	7,44%	12,916%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,51%	40,23%	20,99%	34,11%	49,78%	60,78%	10,12%	14,934%
MSCI WORLD (Benchmark)	3,59%	31,80%	18,30%	27,37%	39,18%	41,92%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2,36%	29,69%	16,19%	25,80%	37,95%	41,00%	6,09%	10,886%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1,81%	26,00%	14,79%	28,03%	27,93%	28,50%	6,35%	12,792%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	2,25%	24,94%	13,31%	25,88%	28,14%	24,36%	7,07%	13,680%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-0,02%	31,45%	15,31%	26,17%	43,29%	53,48%	6,69%	13,188%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	1.063.859.575,51	■ CDI	711.430.924,63	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	343.782.842,46	■ AÇÕES - LIVRES	224.810.713,20
■ AÇÕES - EXTERIOR	101.329.567,06	■ IDKA IPCA 2A	94.388.179,68	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	48.070.165,48	■ BDR NÍVEL I	41.721.087,75
■ AÇÕES - INDEXADO	28.209.117,31	■ VÉRTICE CURTO	15.030.446,29	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.363.400,00	■ DISP. FINANCEIRA	68.080,40



Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/06/2022	9.875	3.971,848591	4.422,835128	39.222.004,84	43.675.496,88	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	29/08/2022	7.642	3925,476529	4.421,512946	29.998.491,63	33.789.201,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	3.761	3988,237004	4.421,383743	14.999.759,37	16.628.824,25	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	1.254	3.988,237004	4.421,383743	5.001.249,20	5.544.415,21	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	2.515	3977,260022	4.420,841088	10.002.808,96	11.118.415,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	3.771	3.977,260022	4.420,841088	14.998.247,54	16.670.991,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/05/2023	9.712	4.118,503984	4.420,14339	39.998.910,69	42.928.432,60	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3.855,205568	4.442,181185	39.843.549,55	45.909.942,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4089,215327	4.431,707095	40.000.704,33	43.350.958,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4062,955171	4.405,414201	30.000.860,98	32.529.578,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4004,964372	4.452,887841	39.997.579,18	44.470.990,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.451,983417	39.997.709,63	44.729.077,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.438,511808	58.915.192,29	66.977.143,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4047,135758	4.398,41999	1.197.952,18	1.301.932,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.358,806225	1.984.874,49	2.170.685,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.515,646244	39.862.509,79	45.960.247,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.493,724732	39.994.357,14	45.948.335,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.458,960401	15.078.262,63	17.345.355,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.478,431355	58.961.325,11	67.243.646,79	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.447,767079	9.639.666,59	10.674.640,98	Curva



Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2024)

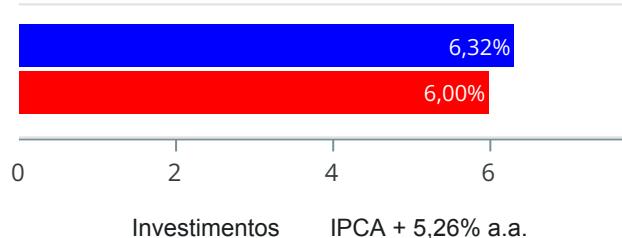
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/05/2022	4.840	4131,678715	4.452,857693	19.997.324,98	21.551.831,23	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4113,158402	4.427,490757	9.501.395,91	10.227.503,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4039,820802	4.402,334853	900.880,04	981.720,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.402,334853	2.086.995,07	2.289.214,12	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.487,406685	19.725.991,27	22.167.789,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.470,610242	39.229.327,99	43.767.274,26	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/02/2023	10.000	3.785,199052	4.179,291007	37.851.990,52	41.792.910,07	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3816,987204	4.179,291007	39.998.208,91	43.794.790,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.305,264332	19.846.240,66	21.741.584,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3851,268116	4.087,608268	39.999.270,65	42.453.899,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.414,260328	19.568.465,57	21.784.374,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.323,602602	19.536.375,31	21.721.779,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.305,854361	40.000.529,76	43.975.690,58	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	4.151,576876	38.836.282,35	42.873.334,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3792,196447	4.151,576876	40.003.880,32	43.794.984,46	Curva



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	2.567.523.344,80	45.095.927,70	48.822.037,76	2.569.922.536,57	6.125.301,83	6.125.301,83	0,23%	0,23%	0,87%	0,87%	26,94%	3,19%
Fevereiro	2.569.922.536,57	58.312.581,69	62.621.601,41	2.610.448.028,88	44.834.512,03	50.959.813,86	1,71%	1,94%	1,22%	2,10%	92,52%	3,53%
Março	2.610.448.028,88	33.594.187,36	44.184.187,36	2.629.918.510,18	30.060.481,30	81.020.295,16	1,14%	3,10%	0,57%	2,68%	115,72%	2,91%
Abril	2.629.918.510,18	40.962.954,53	48.037.406,87	2.608.903.681,39	-13.940.376,45	67.079.918,71	-0,52%	2,57%	0,83%	3,53%	72,58%	3,59%
Maio	2.608.903.681,39	36.565.347,44	51.724.247,54	2.617.357.295,49	23.612.514,20	90.692.432,91	0,89%	3,48%	0,89%	4,46%	78,11%	2,76%
Junho	2.617.357.295,49	155.426.054,88	169.999.186,01	2.646.377.469,80	43.593.305,44	134.285.738,35	1,57%	5,11%	0,62%	5,10%	100,11%	2,52%
Julho	2.646.377.469,80	108.635.700,00	119.435.955,52	2.667.369.140,94	31.791.926,66	166.077.665,01	1,15%	6,32%	0,85%	6,00%	105,41%	3,15%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





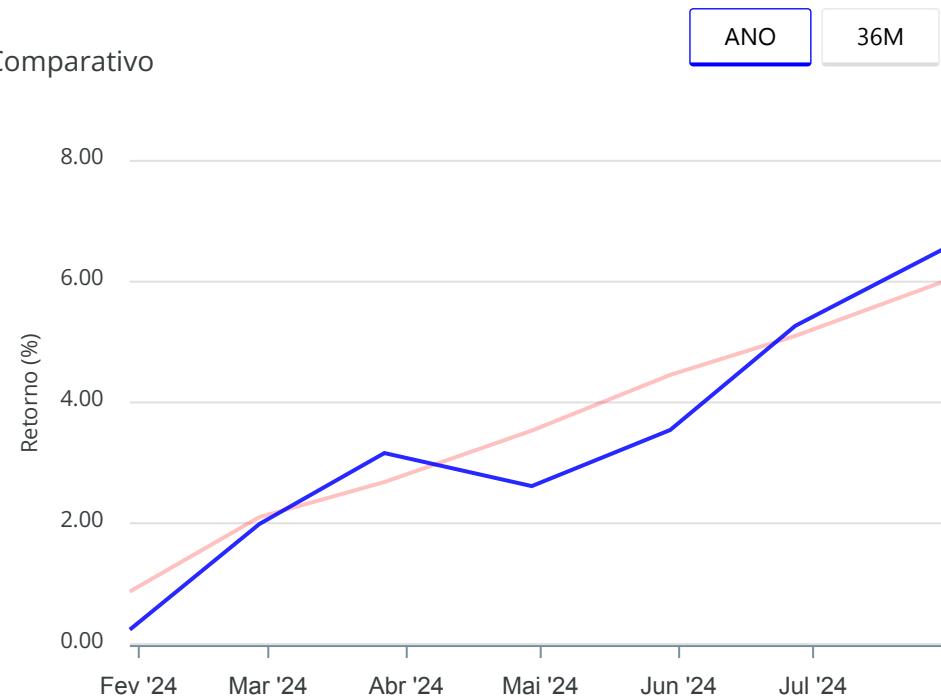
CRÉDITO
& MERCADO

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 SMILL IDIV



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.306.394,81	0,00	0,00	11.416.201,22	109.806,41	0,97%	0,97%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.579.879,90	0,00	0,00	3.614.245,07	34.365,17	0,96%	0,96%	0,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	126.060.190,68	70.000.000,00	0,00	197.856.402,84	1.796.212,16	0,92%	0,95%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	588.670.425,00	30.482.000,00	110.811.792,16	513.574.521,79	5.233.888,95	0,85%	0,97%	0,04%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.055.335.987,38	0,00	0,00	1.063.859.575,51	8.523.588,13	0,81%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	93.690.198,28	17.700,00	0,00	94.388.179,68	680.281,40	0,73%	0,73%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	237.628,23	8.965.000,00	9.206.463,36	0,00	3.835,13	0,04%	0,82%	0,00%
Total Renda Fixa	1.878.880.704,28	109.464.700,00	120.018.255,52	1.884.709.126,11	16.381.977,35	0,87%		0,15%



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 DUNAMIS FIC AÇÕES	57.967.105,08	0,00	0,00	60.943.038,51	2.975.933,43	5,13%	5,13%	5,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	8.343.103,88	0,00	0,00	8.691.466,82	348.362,94	4,18%	4,18%	5,46%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	999.990,40	0,00	0,00	1.038.982,31	38.991,91	3,90%	3,90%	6,77%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.715.996,40	0,00	0,00	1.779.242,45	63.246,05	3,69%	3,69%	5,42%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	36.331.135,44	0,00	0,00	37.553.034,47	1.221.899,03	3,36%	3,36%	4,74%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	46.542.765,52	0,00	0,00	48.070.165,48	1.527.399,96	3,28%	3,28%	4,78%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	27.389.829,80	0,00	0,00	28.209.117,31	819.287,51	2,99%	2,99%	4,74%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	34.411.175,31	0,00	0,00	35.390.261,38	979.086,07	2,85%	2,85%	5,67%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	36.137.773,12	0,00	0,00	37.029.536,89	891.763,77	2,47%	2,47%	5,03%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	57.027.274,25	0,00	0,00	57.857.537,43	830.263,18	1,46%	1,46%	6,42%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	129.427.737,36	0,00	0,00	131.213.196,11	1.785.458,75	1,38%	1,38%	6,44%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	126.542.461,93	0,00	0,00	128.287.541,85	1.745.079,92	1,38%	1,38%	6,44%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	42.090.333,41	0,00	0,00	42.385.150,37	294.816,96	0,70%	0,70%	7,34%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.460.000,00	0,00	17.700,00	2.363.400,00	-78.900,00	-3,21%	-3,21%	12,37%
Total Renda Variável	607.386.681,90	0,00	17.700,00	620.811.671,38	13.442.689,48	2,21%		5,97%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	38.316.762,89	0,00	0,00	39.221.694,48	904.931,59	2,36%	2,36%	6,09%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	35.773.708,26	0,00	0,00	36.576.839,30	803.131,04	2,25%	2,25%	7,07%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6.772.933,56	0,00	0,00	6.895.190,33	122.256,77	1,81%	1,81%	6,35%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.169.960,04	0,00	0,00	7.214.596,86	44.636,82	0,62%	0,62%	7,44%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	34.332.086,13	0,00	0,00	34.506.490,89	174.404,76	0,51%	0,51%	10,12%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	45.067.279,66	0,00	0,00	45.060.410,02	-6.869,64	-0,02%	-0,02%	6,69%
Total Exterior	167.432.730,54	0,00	0,00	169.475.221,88	2.042.491,34	1,22%		7,35%

Disclaimer

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

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

