

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

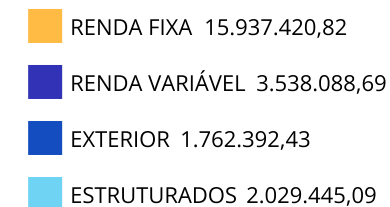
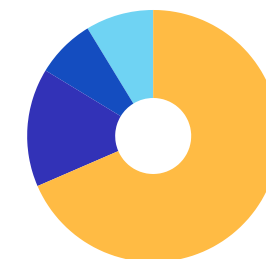
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.006.508,93	4,33%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	341.107,94	1,47%	931	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	324.260,31	1,39%	786	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	899.249,95	3,86%	589	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	604.046,97	2,60%	91	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	648.327,54	2,79%	1.132	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	709.980,02	3,05%	552	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.139.569,25	4,90%	292	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	851.652,41	3,66%	191	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	343.084,25	1,47%	120	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.818.553,73	7,82%	370	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.871.597,26	8,04%	1.903	1,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	687.449,96	2,95%	42	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	957.065,70	4,11%	57.010	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	60.236,14	0,26%	980	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	255.085,20	1,10%	225	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	198.052,09	0,85%	1.126	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	901.447,71	3,87%	235	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.155.164,93	4,96%	105	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0		401.390,66	1,73%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	763.589,87	3,28%	42.080	0,06%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	177.604,51	0,76%	20.876	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	738.774,38	3,18%	1.475	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	528.410,32	2,27%	6.694	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	790.392,97	3,40%	20.881	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	630.062,67	2,71%	436	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	43.420,50	0,19%	203	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	489.571,50	2,10%	72	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	139.851,84	0,60%	10.301	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	957.013,19	4,11%	150	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	403.005,14	1,73%	17.282	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	402.374,10	1,73%	1.989	0,41%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	153.171,46	0,66%	95	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	495.399,22	2,13%	183	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.071.776,72	4,61%	48.530	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	309.097,69	1,33%	645	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			23.267.347,03				

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

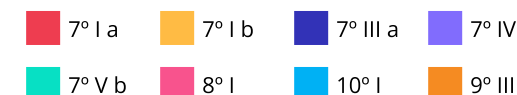
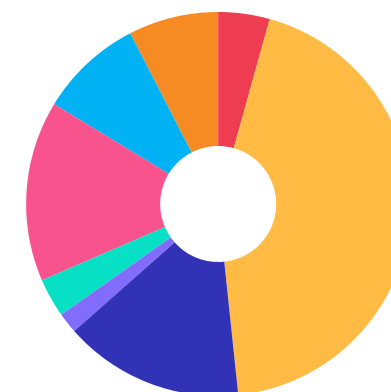
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	1.006.508,93	4,33%	0,00%	22,95%	81,95%	18.061.081,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	10.238.879,59	44,01%	20,48%	27,30%	81,95%	8.828.711,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	3.527.051,77	15,16%	12,00%	12,30%	60,00%	10.433.356,45
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	401.390,66	1,73%	0,00%	0,00%	20,00%	4.252.078,75
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	763.589,87	3,28%	0,00%	5,00%	5,00%	399.777,48
Total Renda Fixa	100,00%	15.937.420,82	68,50%	32,48%	67,55%	248,90%	



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%	3.538.088,69	15,21%	12,75%	18,25%	20,00%	1.115.380,72
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.029.445,09	8,72%	5,75%	8,20%	10,00%	297.289,61
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	5.567.533,78	23,93%	18,50%	26,45%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.762.392,43	7,57%	0,00%	5,00%	10,00%	564.342,27
Total Exterior	10,00%	1.762.392,43	7,57%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.465.819,41	62,17	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	3.265.249,80	14,03	0,03
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.833.361,46	12,18	-
ITAÚ UNIBANCO	1.295.016,77	5,57	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	1.006.508,93	4,33	-

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	1.006.508,93	4,33	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	10.238.879,59	44,01	20,48	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	3.527.051,77	15,16	12,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	763.589,87	3,28	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.538.088,69	15,21	12,75	20,00
Artigo 9º, Inciso III	1.762.392,43	7,57	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.029.445,09	8,72	5,75	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,98%	7,84%	2,26%	6,31%	10,55%	21,73%	-	-
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%
IMA Geral (Benchmark)	0,98%	9,70%	4,55%	8,94%	14,59%	21,41%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,79%	12,10%	5,76%	12,12%	15,18%	18,67%	1,58%	0,05%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	9,65%	4,52%	8,87%	14,78%	21,19%	0,72%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,07%	7,81%	3,44%	6,64%	13,84%	23,07%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,62%	3,38%	6,50%	13,50%	22,42%	0,16%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,08%	2,62%	6,60%	11,29%	22,46%	-	-
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%
IMA-B (Benchmark)	0,81%	12,27%	5,83%	12,27%	15,46%	19,21%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	12,17%	5,90%	12,22%	15,20%	18,65%	1,58%	0,05%
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%
IRF-M (Benchmark)	0,89%	10,59%	5,29%	9,67%	16,44%	20,41%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	10,30%	5,13%	9,40%	15,98%	19,65%	1,06%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	1,07%	7,64%	3,30%	6,44%	13,58%	24,25%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	7,57%	3,35%	6,37%	13,57%	24,57%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,98%	7,02%	3,06%	5,93%	12,47%	21,74%	0,01%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,07%	7,85%	3,61%	6,68%	13,59%	28,69%	0,28%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,99%	8,16%	3,83%	7,05%	13,23%	26,01%	0,43%	0,01%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,17%	5,83%	2,24%	4,67%	11,31%	-	0,98%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,12%	2,99%	0,27%	2,45%	3,99%	14,46%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	-	-	-	-	-	0,42%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	12,57%	5,83%	12,25%	15,21%	-	1,57%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	10,10%	3,35%	8,80%	12,42%	-	1,11%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	6,67%	1,99%	5,21%	9,90%	-	0,42%	0,02%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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
SMLL (Benchmark)	3,12%	16,80%	26,65%	13,48%	17,47%	-20,79%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	2,76%	14,26%	22,06%	11,70%	14,98%	-14,65%	7,39%	0,23%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,11%	19,52%	10,06%	12,57%	11,11%	4,41%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3,64%	24,44%	12,13%	16,86%	20,80%	22,13%	3,74%	0,19%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,28%	20,19%	10,09%	13,47%	15,98%	14,96%	3,57%	0,18%
IDIV (Benchmark)	2,84%	12,41%	12,81%	6,16%	18,72%	18,15%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,89%	13,01%	16,71%	8,22%	19,90%	14,12%	6,91%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	3,27%	11,13%	16,77%	7,50%	18,20%	0,12%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,82%	8,04%	15,36%	4,55%	9,45%	-2,72%	7,64%	0,21%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3,47%	10,34%	17,34%	6,52%	16,68%	-3,02%	8,18%	0,21%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2,74%	6,25%	14,98%	2,34%	14,80%	-9,21%	7,87%	0,21%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	4,49%	7,85%	18,30%	3,61%	1,72%	-	7,60%	0,23%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3,27%	8,61%	15,99%	3,98%	11,69%	-1,78%	7,98%	0,21%
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 MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,99%	6,30%	2,85%	5,18%	10,55%	18,69%	0,87%	0,02%



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

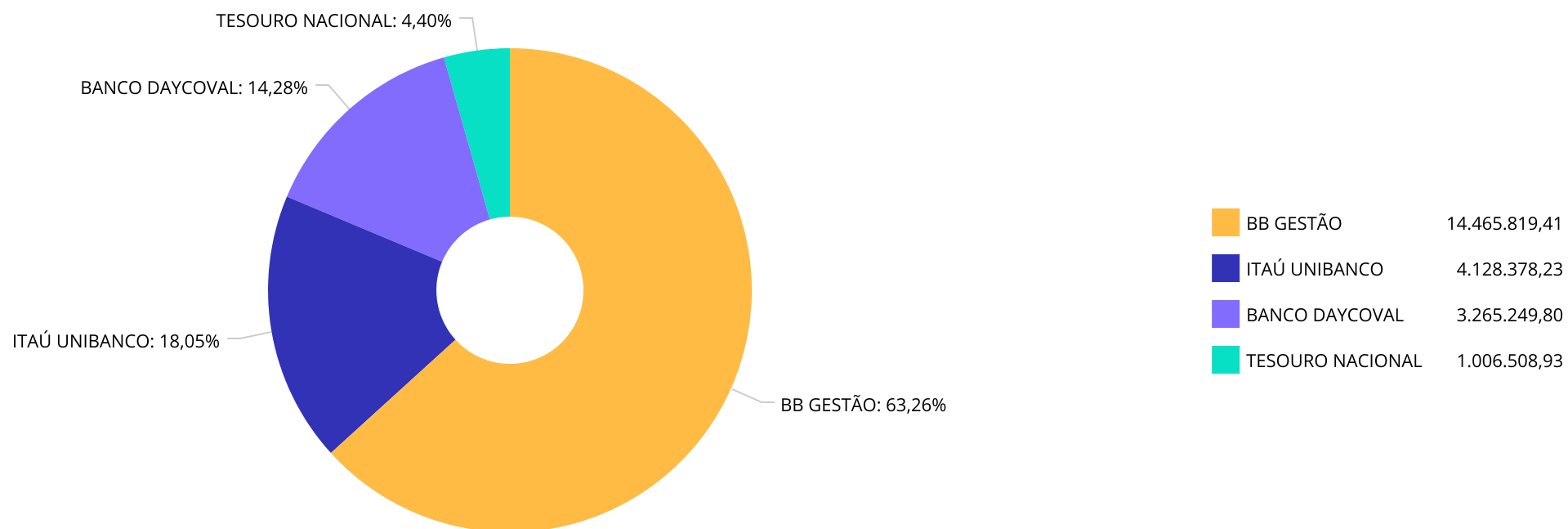
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,00%	7,63%	2,95%	6,34%	12,86%	20,60%	0,61%	0,01%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,01%	7,64%	3,27%	6,40%	13,65%	22,93%	0,44%	0,01%



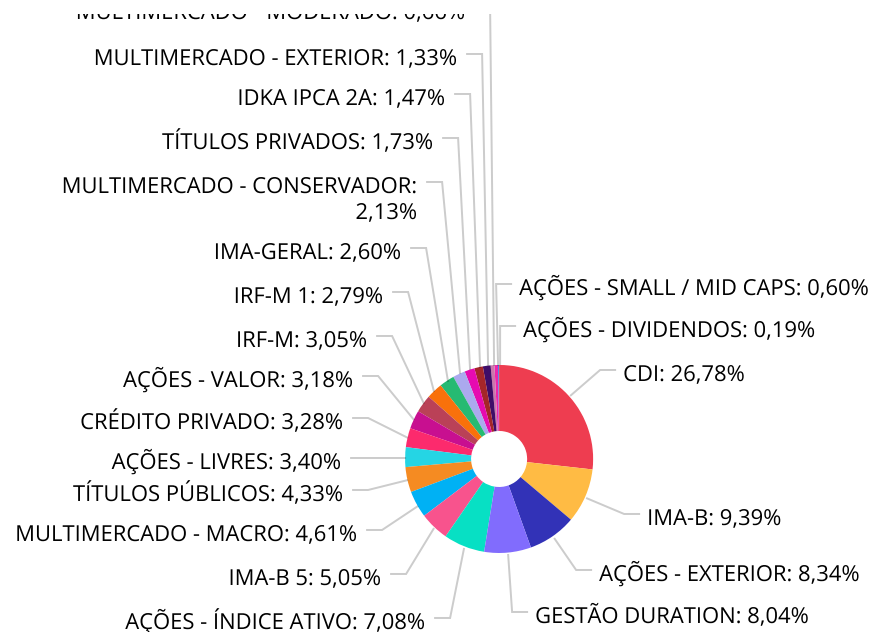
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,13%	17,59%	8,68%	12,66%	8,57%	-3,00%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,81%	1,12%	2,23%	1,06%	-2,12%	-3,21%	4,45%	20,073%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,44%	31,58%	20,31%	22,26%	20,43%	-22,82%	6,52%	19,388%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,20%	10,06%	6,95%	7,93%	4,67%	-3,79%	5,15%	21,523%

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



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



■ CDI	6.230.089,55	■ IMA-B	2.184.869,36	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.939.996,94
■ GESTÃO DURATION	1.871.597,26	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.648.044,49	■ IMA-B 5	1.175.912,72
■ MULTIMERCADO - MACRO	1.071.776,72	■ TÍTULOS PÚBLICOS	1.006.508,93	■ AÇÕES - LIVRES	790.392,97
■ CRÉDITO PRIVADO	763.589,87	■ AÇÕES - VALOR	738.774,38	■ IRF-M	709.980,02
■ IRF-M 1	648.327,54	■ IMA-GERAL	604.046,97	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	495.399,22
■ TÍTULOS PRIVADOS	401.390,66	■ IDKA IPCA 2A	341.107,94	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	309.097,69
■ MULTIMERCADO - MODERADO	153.171,46	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	139.851,84	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	43.420,50



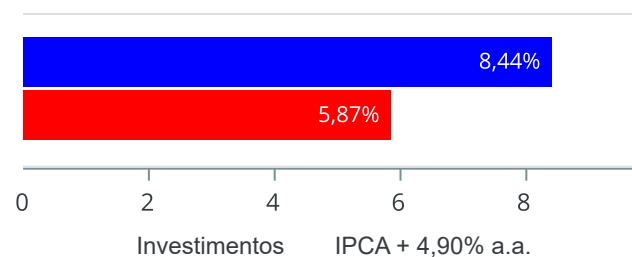
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2033	14/07/2023	115	4.382,736612	4.394,145562	504.014,71	505.326,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	14/07/2023	110	4.490,397247	4.502,309564	493.943,70	495.254,05	Curva

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	19.046.548,36	506.461,88	178.155,44	19.714.622,82	339.768,02	339.768,02	1,75%	1,75%	0,95%	0,95%	184,46%	3,15%
Fevereiro	19.714.622,82	2.126.544,03	1.726.103,29	20.002.081,67	-112.981,89	226.786,13	-0,56%	1,18%	1,19%	2,15%	55,06%	2,70%
Março	20.002.081,67	1.030.935,18	659.324,17	20.511.734,49	138.041,81	364.827,94	0,68%	1,87%	1,15%	3,32%	56,21%	2,54%
Abril	20.511.734,49	537.945,01	165.092,45	21.062.683,46	178.096,41	542.924,35	0,85%	2,74%	0,95%	4,31%	63,51%	2,46%
Mai	21.062.683,46	1.556.634,18	1.190.288,26	21.785.393,40	356.364,02	899.288,37	1,66%	4,44%	0,65%	4,99%	89,15%	2,33%
Junho	21.785.393,40	4.561.209,90	4.210.954,31	22.644.988,30	509.339,31	1.408.627,68	2,30%	6,85%	0,32%	5,32%	128,70%	2,27%
Julho	22.644.988,30	1.856.910,35	1.576.121,65	23.267.347,03	341.570,03	1.750.197,71	1,49%	8,44%	0,52%	5,87%	143,82%	2,25%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





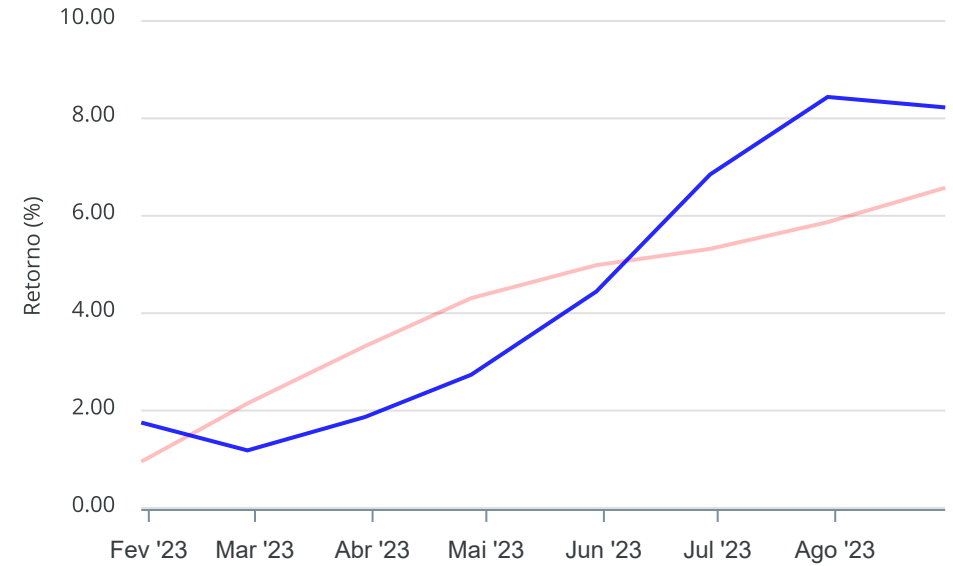
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1

IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	754.136,16	0,00	0,00	763.589,87	9.453,71	1,25%	1,25%	0,10%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	946.047,78	0,00	0,00	957.065,70	11.017,92	1,16%	1,16%	0,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.142.961,17	0,00	0,00	1.155.164,93	12.203,76	1,07%	1,07%	0,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.127.551,54	0,00	0,00	1.139.569,25	12.017,71	1,07%	1,07%	0,42%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	641.536,68	0,00	0,00	648.327,54	6.790,86	1,06%	1,06%	0,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.799.526,86	0,00	0,00	1.818.553,73	19.026,87	1,06%	1,06%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	892.638,66	0,00	0,00	901.447,71	8.809,05	0,99%	0,99%	0,43%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	321.208,37	0,00	0,00	324.260,31	3.051,94	0,95%	0,95%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	337.920,32	0,00	0,00	341.107,94	3.187,62	0,94%	0,94%	0,66%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	598.527,28	0,00	0,00	604.046,97	5.519,69	0,92%	0,92%	0,72%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.854.544,42	0,00	0,00	1.871.597,26	17.052,84	0,92%	0,92%	0,75%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	524.875,44	366.479,16	0,00	899.249,95	7.895,35	0,89%	0,73%	1,54%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	997.958,40	0,00	1.006.508,93	8.550,53	0,86%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	844.734,73	0,00	0,00	851.652,41	6.917,68	0,82%	0,82%	1,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	682.073,02	0,00	0,00	687.449,96	5.376,94	0,79%	0,79%	1,58%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	47.498,37	12.270,71	0,00	60.236,14	467,06	0,78%	0,98%	0,01%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	702.398,38	2.091,55	0,00	709.980,02	5.490,09	0,78%	0,78%	1,06%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	253.135,41	0,00	0,00	255.085,20	1.949,79	0,77%	0,77%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	340.652,48	0,00	0,00	343.084,25	2.431,77	0,71%	0,71%	1,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.755.472,11	8.660,72	1.576.121,65	198.052,09	10.040,91	0,57%	1,06%	0,01%



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
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	0,00	400.000,00	0,00	401.390,66	1.390,66	0,35%	-	-
Total Renda Fixa	15.567.439,18	1.787.460,54	1.576.121,65	15.937.420,82	158.642,75	1,01%		0,72%

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
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	468.548,23	0,00	0,00	489.571,50	21.023,27	4,49%	4,49%	7,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	711.561,33	0,00	0,00	738.774,38	27.213,05	3,82%	3,82%	7,64%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	298.248,67	0,00	0,00	309.097,69	10.849,02	3,64%	3,64%	3,74%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	510.681,85	0,00	0,00	528.410,32	17.728,47	3,47%	3,47%	8,18%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	171.957,23	0,00	0,00	177.604,51	5.647,28	3,28%	3,28%	3,57%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	765.338,49	0,00	0,00	790.392,97	25.054,48	3,27%	3,27%	7,98%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	42.199,05	0,00	0,00	43.420,50	1.221,45	2,89%	2,89%	6,91%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	136.101,36	0,00	0,00	139.851,84	3.750,48	2,76%	2,76%	7,39%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	613.258,05	0,00	0,00	630.062,67	16.804,62	2,74%	2,74%	7,87%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	490.458,33	0,00	0,00	495.399,22	4.940,89	1,01%	1,01%	0,44%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	151.655,27	0,00	0,00	153.171,46	1.516,19	1,00%	1,00%	0,61%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	992.516,98	69.449,81	0,00	1.071.776,72	9.809,93	0,92%	0,99%	0,87%
Total Renda Variável	5.352.524,84	69.449,81	0,00	5.567.533,78	145.559,13	2,68%		5,27%



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 TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	393.423,57	0,00	0,00	403.005,14	9.581,57	2,44%	2,44%	6,52%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	936.392,60	0,00	0,00	957.013,19	20.620,59	2,20%	2,20%	5,15%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	395.208,11	0,00	0,00	402.374,10	7.165,99	1,81%	1,81%	4,45%
Total Exterior	1.725.024,28	0,00	0,00	1.762.392,43	37.368,15	2,17%		5,31%

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.

