

# 2023

## Relatório Mensal

# Julho

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

| Ativo   | Saldo Atual   | % Carteira | PL R\$            | % PL   | Lei      |
|---|---------------|------------|-------------------|--------|----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 5.021.548,92  | 1,68%      | 6.277.767.899,83  | 0,08%  | 7º I b   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 32.597.479,48 | 10,94%     | 4.905.523.474,02  | 0,66%  | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 573.925,23    | 0,19%      | 190.221.835,84    | 0,30%  | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.214.734,50  | 2,76%      | 2.407.366.882,67  | 0,34%  | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 4.941.234,82  | 1,66%      | 22.080.982,67     | 22,38% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | 24.309.947,57 | 8,16%      | 3.548.133.366,37  | 0,69%  | 7º I b   |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA  | 34.150.887,08 | 11,46%     | 537.765.715,15    | 6,35%  | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 3.882.037,49  | 1,30%      | 5.655.699.960,16  | 0,07%  | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 7.967.239,20  | 2,67%      | 8.226.261.315,96  | 0,10%  | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 41.064.474,15 | 13,78%     | 4.916.698.620,80  | 0,84%  | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 299.183,18    | 0,10%      | 7.409.323.495,01  | 0,00%  | 7º I b   |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP                     | 5.558.994,74  | 1,87%      | 400.119.784,91    | 1,39%  | 7º I b   |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP    | 25.446.391,96 | 8,54%      | 14.673.774.494,53 | 0,17%  | 7º III a |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                   | 7.217.306,39  | 2,42%      | 405.456.482,06    | 1,78%  | 7º III a |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                | 12.261.911,93 | 4,11%      | 8.447.360.930,23  | 0,15%  | 7º III a |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | 11.321.455,34 | 3,80%      | 14.867.599.167,79 | 0,08%  | 7º III a |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP        | 14.646.851,34 | 4,91%      | 1.359.618.949,84  | 1,08%  | 7º III a |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES                             | 1.367.259,43  | 0,46%      | 1.363.728.101,58  | 0,10%  | 8º I     |
| BB GOVERNANÇAS FIAÇÕES  | 8.002.875,12  | 2,69%      | 815.496.559,66    | 0,98%  | 8º I     |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                                    | 10.544.277,88 | 3,54%      | 877.152.038,75    | 1,20%  | 8º I     |
| BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                                  | 16.577.715,21 | 5,56%      | 616.247.506,61    | 2,69%  | 8º I     |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FIAÇÕES                                   | 4.185.372,42  | 1,40%      | 674.022.303,80    | 0,62%  | 8º I     |
| SANTANDER PIBB FIAÇÕES  | 1.251.341,49  | 0,42%      | 49.446.957,27     | 2,53%  | 8º I     |
| SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES                          | 3.426.596,42  | 1,15%      | 237.732.806,48    | 1,44%  | 8º I     |
| BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I                             | 7.542.056,84  | 2,53%      | 463.666.119,49    | 1,63%  | 9º III   |
| BRADERCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                   | 2.610.902,64  | 0,88%      | 114.759.833,18    | 2,28%  | 9º III   |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                      | 2.735.741,33  | 0,92%      | 2.066.727.306,72  | 0,13%  | 9º III   |

Investimentos

\$ 298.027.434,10

Disponibilidades Financeiras

\$ 62.303,81

Total Carteira

\$ 298.089.737,91

Governança (Pró Gestão)

572

| Ativo                             | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$         | % PL  | Lei |
|-----------------------------------|-------------|------------|----------------|-------|-----|
| BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11 | 307.692,00  | 0,10%      | 174.725.100,00 | 0,18% | 11° |

Investimentos  
\$ 298.027.434,10

Disponibilidades Financeiras  
\$ 62.303,81

Total Carteira  
\$ 298.089.737,91

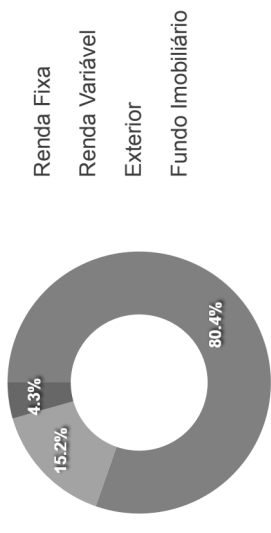
Governança (Pró Gestão)  
572

| Artigos                        | Limite (%) | Utilizado      | Livre          |
|--------------------------------|------------|----------------|----------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN    | 100,00%    | 168.581.686,36 | 129.508.051,55 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00%     | 70.893.916,96  | 107.959.925,79 |
| 8º I - Fundos de Ações         | 30,00%     | 45.355.437,97  | 44.071.483,40  |
| 9º III - Ações - BDR Nível I   | 10,00%     | 12.888.700,81  | 16.920.272,98  |
| 11º - Fundos Imobiliários      | 5,00%      | 307.692,00     | 14.596.794,90  |

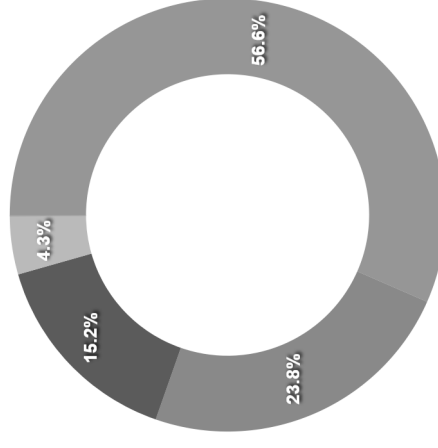
Governança (Pró Gestão)

51 Não possui

Segmentos



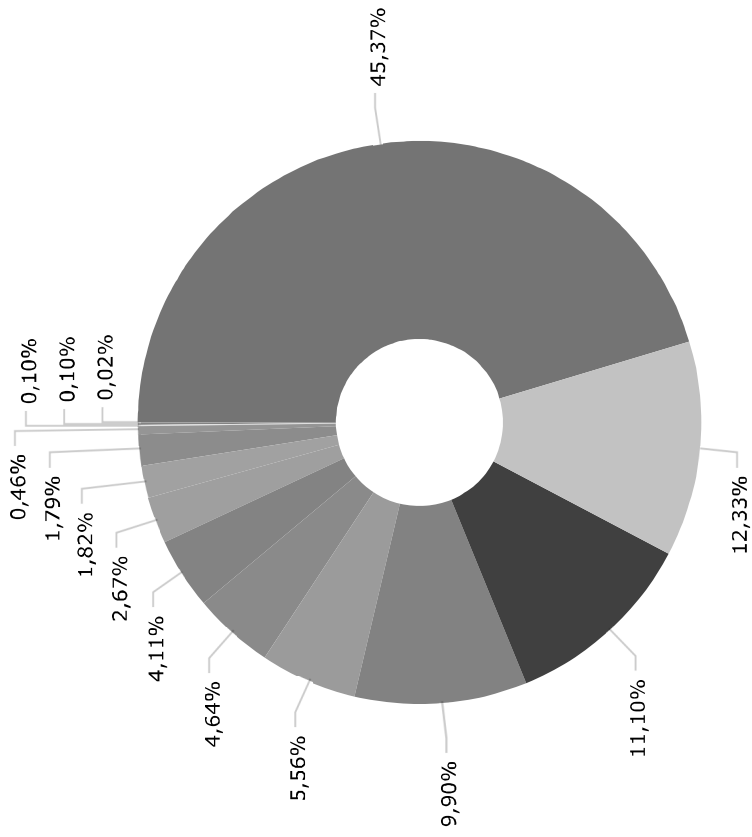
Artigos



| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior   | Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior  |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|----------------|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC         | 0,00%  | 0,00%    | 5,00%  | 100,00%  | 298.089.737,91 | 8º I - Fundos de Ações            | 15,22% | 0,00%    | 16,00% | 30,00%   | 44.071.483,40 |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN       | 56,55% | 0,00%    | 19,00% | 100,00%  | 129.508.051,55 | 8º II - ETF de Ações              | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 30,00%   | 89.426.921,37 |
| 7º I c - ETF 100% Títulos TN      | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 100,00%  | 298.089.737,91 | 9º I - Renda Fixa - Dívida Ext... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 29.808.973,79 |
| 7º II - Operações Compromissad... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 14.904.486,90  | 9º II - Constituídos no Brasil    | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 29.808.973,79 |
| 7º III a - FI Referenciados RF    | 23,78% | 0,00%    | 50,00% | 60,00%   | 107.959.925,79 | 9º III - Ações - BDR Nivel I      | 4,32%  | 0,00%    | 4,00%  | 10,00%   | 16.920.272,98 |
| 7º III b - FI de Índices Refer... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 60,00%   | 178.853.842,75 | 10º I - Fundos Multimercados      | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 10,00%   | 29.808.973,79 |
| 7º IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 20,00%   | 59.617.947,58  | 10º II - Fundos em Participaçõ... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 14.904.486,90 |
| 7º V a - FIDC Cota Sênior         | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 14.904.486,90  | 10º III - Fundos de Ações - Me... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 14.904.486,90 |
| 7º V b - Fundos de RF - Crédi...  | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 14.904.486,90  | 11º - Fundos Imobiliários         | 0,10%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 14.596.794,90 |
| 7º V c - Fundos de Debentures ... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 14.904.486,90  | 12º - Empréstimos Consignados     | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 14.904.486,90 |

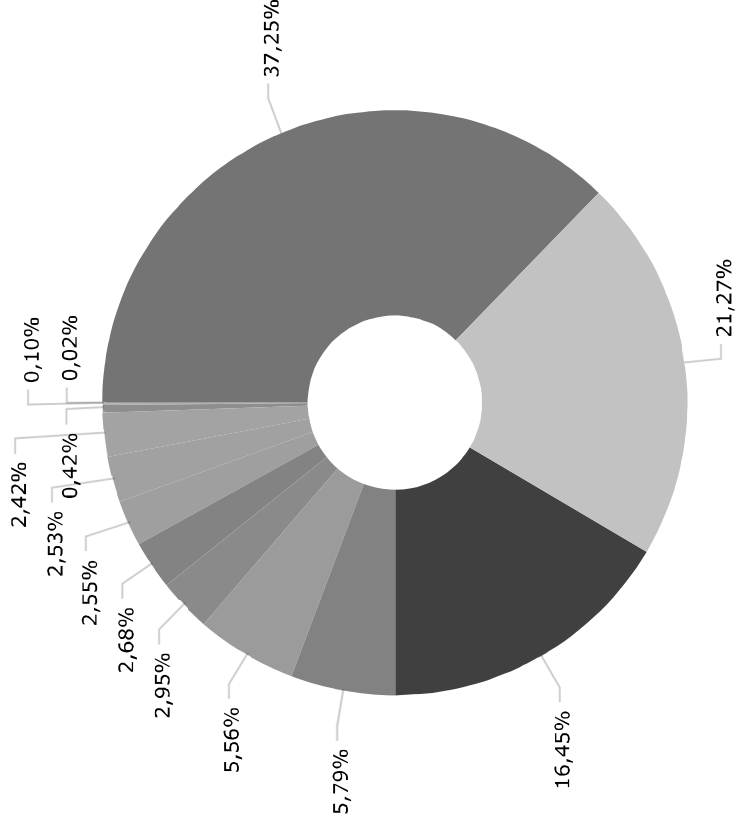
|  | Mês         | Ano          | 3M           | 6M           | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>CDI - BENCHMARK</b>                                     | <b>1,07</b> | <b>7,64</b>  | <b>3,30</b>  | <b>6,44</b>  | <b>13,58</b> | <b>24,25</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP              | 1,14        | 7,64         | 3,48         | 6,47         | 13,70        | 24,83        | 0,03      | 0,06               |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 1,06        | 7,57         | 3,34         | 6,37         | 13,57        | 24,57        | 0,01      | 0,02               |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                             | <b>2,13</b> | <b>17,59</b> | <b>8,68</b>  | <b>12,66</b> | <b>8,57</b>  | <b>-3,00</b> |           |                    |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                   | 2,12        | 16,95        | 8,55         | 12,11        | 7,35         | -4,52        | 5,49      | 11,57              |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                | 1,35        | 7,86         | 4,76         | 5,97         | 1,54         | -5,87        | 4,75      | 10,01              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                | <b>3,27</b> | <b>11,13</b> | <b>16,77</b> | <b>7,50</b>  | <b>18,20</b> | <b>0,12</b>  |           |                    |
| BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I                         | 2,44        | 31,58        | 20,31        | 22,26        | 20,43        | -22,82       | 6,52      | 13,74              |
| SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES                       | 2,67        | 10,96        | 15,51        | 7,19         | 17,49        | 3,31         | 7,98      | 16,81              |
| BB GOVERNANÇAS FI AÇÕES                                    | 3,45        | 10,18        | 17,22        | 6,33         | 15,96        | -4,59        | 7,97      | 16,79              |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                                 | 4,53        | 7,41         | 14,49        | 0,67         | 6,35         | -22,27       | 7,87      | 16,57              |
| <b>IBX - BENCHMARK</b>                                     | <b>3,32</b> | <b>10,13</b> | <b>16,52</b> | <b>6,40</b>  | <b>16,39</b> | <b>-2,60</b> |           |                    |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES                          | 4,12        | 14,11        | 18,63        | 11,16        | 14,05        | -13,05       | 8,72      | 18,37              |
| <b>IBX-50 - BENCHMARK</b>                                  | <b>3,70</b> | <b>8,84</b>  | <b>16,09</b> | <b>5,28</b>  | <b>16,73</b> | <b>-1,88</b> |           |                    |
| SANTANDER PIBB FI AÇÕES                                    | 3,48        | 8,06         | 15,79        | 4,70         | 15,25        | -4,32        | 8,19      | 17,26              |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                               | 3,47        | 9,13         | 15,56        | 4,14         | 14,81        | -6,18        | 7,77      | 16,36              |
| <b>IDIV - BENCHMARK</b>                                    | <b>2,84</b> | <b>12,41</b> | <b>12,81</b> | <b>6,16</b>  | <b>18,72</b> | <b>18,15</b> |           |                    |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                               | 3,31        | 10,34        | 15,54        | 7,13         | 15,83        | 9,69         | 7,37      | 15,52              |
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                        | <b>0,98</b> | <b>7,84</b>  | <b>2,26</b>  | <b>6,31</b>  | <b>10,55</b> | <b>21,73</b> |           |                    |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 1,04        | 7,47         | 3,23         | 6,30         | 13,35        | 26,90        | 0,00      | 0,00               |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 0,94        | 7,57         | 2,37         | 6,04         | 10,71        | 21,24        | 0,66      | 1,39               |

|   | Mês         | Ano          | 3M           | 6M           | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| 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      | 1,49               |
| <b>IMA-B - BENCHMARK</b>                                      | <b>0,81</b> | <b>12,27</b> | <b>5,83</b>  | <b>12,27</b> | <b>15,46</b> | <b>19,21</b> |           |                    |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                   | 0,80        | 12,35        | 5,93         | 12,34        | 15,34        | 18,39        | 1,62      | 3,42               |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 0,80        | 12,14        | 5,79         | 12,17        | 15,29        | 18,72        | 1,55      | 3,27               |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP        | 0,82        | 12,21        | 5,87         | 12,31        | 15,19        | 18,61        | 1,58      | 3,33               |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP                     | 0,80        | 12,11        | 5,78         | 12,15        | 15,17        | 18,63        | 1,58      | 3,32               |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 0,73        | 12,10        | 5,78         | 12,11        | 15,14        | 18,55        | 1,54      | 3,25               |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA  | 0,78        | 12,08        | 5,75         | 12,10        | 15,11        | 18,43        | 1,58      | 3,33               |
| <b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>                                    | <b>0,97</b> | <b>8,08</b>  | <b>2,62</b>  | <b>6,60</b>  | <b>11,29</b> | <b>22,46</b> |           |                    |
| 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      | 1,55               |
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                       | <b>0,23</b> | <b>3,11</b>  | <b>0,38</b>  | <b>2,56</b>  | <b>4,11</b>  | <b>14,59</b> |           |                    |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | 1,06        | 6,67         | 1,99         | 5,21         | 9,90         |              | 0,42      | 0,88               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 1,05        | 6,65         | 1,99         | 5,20         | 9,87         | 22,03        | 0,42      | 0,88               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,07        |              |              |              |              |              | 0,42      | 0,88               |
| <b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>                                    | <b>1,07</b> | <b>7,81</b>  | <b>3,44</b>  | <b>6,64</b>  | <b>13,84</b> | <b>23,07</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 1,07        | 7,73         | 3,39         | 6,53         | 13,63        | 22,57        | 0,16      | 0,33               |
| <b>SELIC - BENCHMARK</b>                                      | <b>1,07</b> | <b>7,64</b>  | <b>3,30</b>  | <b>6,44</b>  | <b>13,58</b> | <b>24,25</b> |           |                    |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                | 1,18        | 7,79         | 3,52         | 6,59         | 13,99        | 25,52        | 0,06      | 0,13               |
| <b>IFIX - BENCHMARK</b>                                       | <b>1,33</b> | <b>11,51</b> | <b>11,86</b> | <b>13,33</b> | <b>13,61</b> | <b>13,21</b> |           |                    |
| BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11                             | 4,68        | 9,90         | 16,57        | 15,06        | 11,03        | -2,91        | 7,31      | 15,40              |

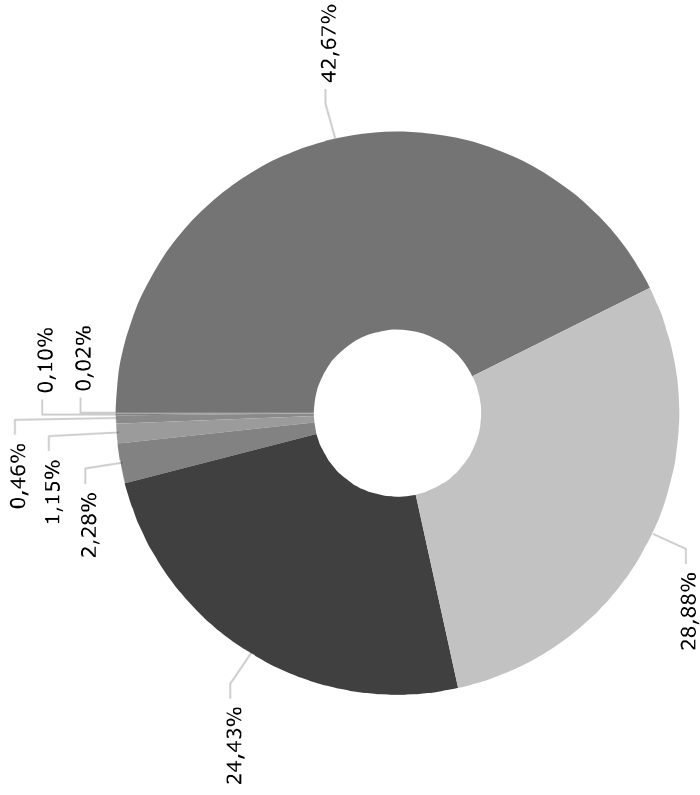


|                              |                |
|------------------------------|----------------|
| IMA-B                        | 135.235.993,18 |
| CDI                          | 36.767.847,30  |
| IPCA                         | 33.098.607,30  |
| Ibovespa                     | 29.515.806,26  |
| IDIV                         | 16.577.715,21  |
| IDKA IPCA 2 Anos             | 13.844.821,23  |
| Selic                        | 12.261.911,93  |
| IMA-B 5                      | 7.967.239,20   |
| IBX-50                       | 5.436.713,91   |
| Global BDRX                  | 5.346.643,97   |
| IBX                          | 1.367.259,43   |
| IFIX                         | 307.692,00     |
| IRF-M 1                      | 299.183,18     |
| Disponibilidades Financeiras | 62.303,81      |

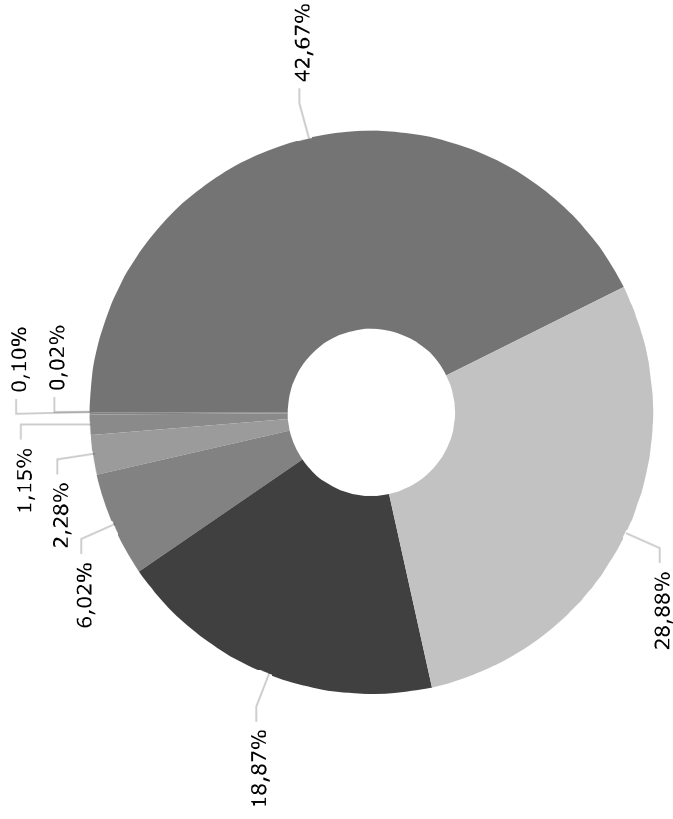




|   |                |
|---|----------------|
| Renda Fixa Indexados                          | 111.037.808,50 |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano             | 63.402.069,47  |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 49.029.759,23  |
| Ações Livres                                  | 17.258.181,28  |
| Ações Dividendos                              | 16.577.715,21  |
| Não classificado                              | 8.788.659,73   |
| Ações Sustentabilidade/Governança             | 8.002.875,12   |
| Ações Índice Ativo                            | 7.611.968,84   |
| Ações Setoriais                               | 7.542.056,84   |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento  | 7.217.306,39   |
| Ações Indexados                               | 1.251.341,49   |
| FII Renda Gestão Passiva                      | 307.692,00     |
| Disponibilidades Financeiras                  | 62.303,81      |



|   |                                   |                |
|---|-----------------------------------|----------------|
| ■ | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 127.194.472,32 |
| ■ | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 86.102.354,45  |
| ■ | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME... | 72.818.723,25  |
| ■ | SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC... | 6.810.336,23   |
| ■ | SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT... | 3.426.596,42   |
| ■ | AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA       | 1.367.259,43   |
| ■ | VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT... | 307.692,00     |
| ■ | DISPONIBILIDADE FINANCEIRA        | 62.303,81      |



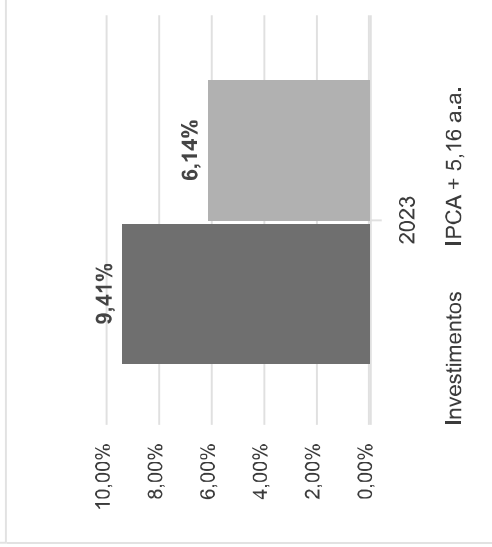
|                                   |                |
|-----------------------------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 127.194.472,32 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 86.102.354,45  |
| BANCO BRADESCO S.A.               | 56.241.008,04  |
| BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 17.944.974,64  |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.     | 6.810.336,23   |
| BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.    | 3.426.596,42   |
| VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT... | 307.692,00     |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA        | 62.303,81      |

| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$    | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro   | 268.794.272,86 | 2.200.000,00  | 1.752.772,00  | 273.542.753,59 | 4.301.252,73  | 4.301.252,73         | 1,60% ▲   | 1,60%               | 0,97%  | 0,97%            | 164,95%                    | 2,57%       |
| Fevereiro | 273.542.753,59 | 3.170.000,00  | 2.569.743,75  | 273.137.944,13 | -1.005.065,71 | 3.296.187,02         | -0,37% ▼  | 1,23%               | 1,20%  | 2,19%            | 56,16%                     | 2,23%       |
| Março     | 273.137.944,13 | 2.740.000,00  | 2.160.000,00  | 276.146.046,38 | 2.428.102,25  | 5.724.289,27         | 0,89% ▲   | 2,12%               | 1,17%  | 3,39%            | 62,54%                     | 1,91%       |
| Abril     | 276.146.046,38 | 2.800.000,00  | 2.170.000,00  | 279.837.694,10 | 3.061.647,72  | 8.785.936,99         | 1,11% ▲   | 3,25%               | 0,97%  | 4,39%            | 74,03%                     | 2,00%       |
| Mai       | 279.837.694,10 | 10.784.237,45 | 9.946.359,81  | 285.857.819,82 | 5.182.248,08  | 13.968.185,07        | 1,85% ▲   | 5,16%               | 0,67%  | 5,09%            | 101,38%                    | 1,93%       |
| Junho     | 285.857.819,82 | 76.182.559,80 | 75.843.475,21 | 293.709.583,12 | 7.512.678,71  | 21.480.863,78        | 2,63% ▲   | 7,92%               | 0,34%  | 5,45%            | 145,32%                    | 2,47%       |
| Julho     | 293.709.583,12 | 2.741.876,98  | 2.475.000,00  | 298.027.434,10 | 4.050.974,00  | 25.531.837,78        | 1,38% ▲   | 9,41%               | 0,65%  | 6,14%            | 153,26%                    | 2,24%       |

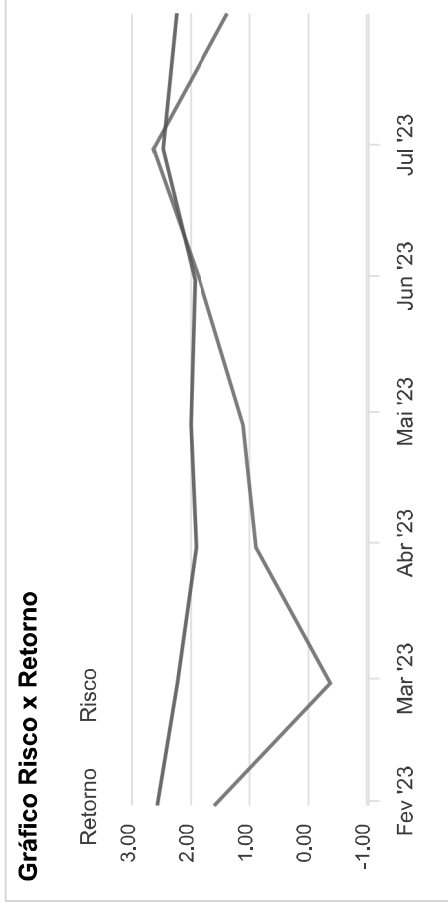
Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$    | Retorno % | Meta % |
|---------|---------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 5.724.289,27  | 2,12%     | 3,39%  |
| 2º Trim | 15.756.574,51 | 5,68%     | 2,00%  |
| 1º Sem  | 21.480.863,78 | 7,92%     | 5,45%  |

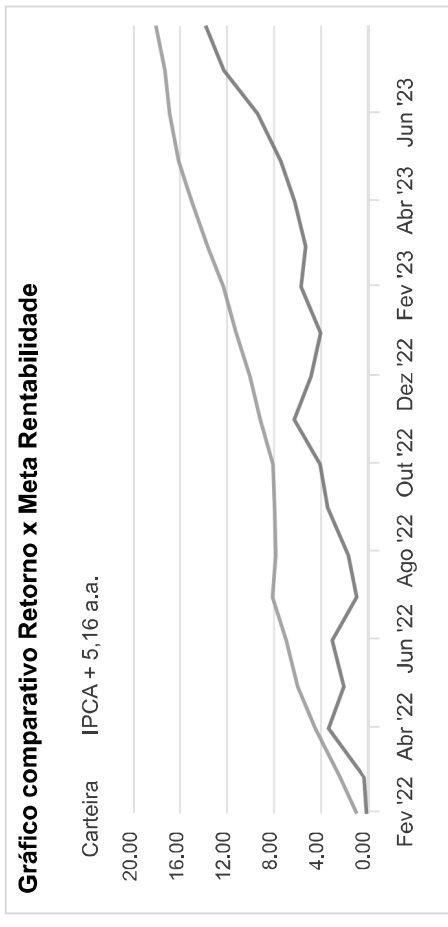
Gráfico Retorno e Meta Acumulado



### Gráfico Risco x Retorno

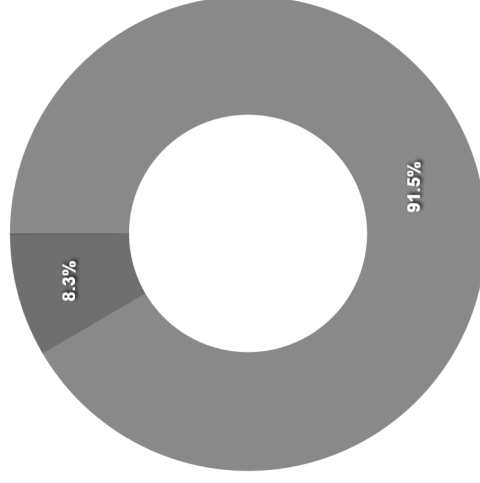


### Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



### Liquidez - 31/07/2023

| Disponibilidade | Valor          | %     |
|-----------------|----------------|-------|
| Até D+30        | 272.898.173,11 | 91,57 |
| Até D+180       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+360       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+720       | 24.883.872,80  | 8,35  |
| Até D+1800      | 0,00           | 0,00  |
| Até D+3600      | 0,00           | 0,00  |
| Acima D+3600    | 0,00           | 0,00  |
| Indeterminado   | 307.692,00     | 0,10  |



| RENDA FIXA  | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual    | Retorno \$   | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|--------------|----------------|--------------|-----------|-------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 4.974.623,17   | 0,00         | 0,00         | 5.021.548,92   | 46.925,75    | 0,94% ▲   | 0,66%       |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 32.360.177,28  | 0,00         | 0,00         | 32.597.479,48  | 237.302,20   | 0,73% ▲   | 1,54%       |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP    | 25.178.360,16  | 0,00         | 0,00         | 25.446.391,96  | 268.031,80   | 1,06% ▲   | 0,01%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 567.939,03     | 0,00         | 0,00         | 573.925,23     | 5.986,20     | 1,05% ▲   | 0,42%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.128.103,31   | 0,00         | 0,00         | 8.214.734,50   | 86.631,19    | 1,07% ▲   | 0,42%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 4.890.179,67   | 0,00         | 0,00         | 4.941.234,82   | 51.055,15    | 1,04% ▲   | 0,00%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | 24.055.601,36  | 0,00         | 0,00         | 24.309.947,57  | 254.346,21   | 1,06% ▲   | 0,42%       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                   | 7.160.343,15   | 0,00         | 0,00         | 7.217.306,39   | 56.963,24    | 0,80% ▲   | 1,62%       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA  | 32.350.763,21  | 1.525.000,00 | 0,00         | 34.150.887,08  | 275.123,87   | 0,81% ▲   | 1,58%       |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                | 14.571.341,98  | 0,00         | 2.475.000,00 | 12.261.911,93  | 165.569,95   | 1,14% ▲   | 0,06%       |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | 11.193.721,17  | 0,00         | 0,00         | 11.321.455,34  | 127.734,17   | 1,14% ▲   | 0,03%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 3.846.793,91   | 0,00         | 0,00         | 3.882.037,49   | 35.243,58    | 0,92% ▲   | 0,71%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 7.892.138,08   | 0,00         | 0,00         | 7.967.239,20   | 75.101,12    | 0,95% ▲   | 0,73%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 40.737.959,49  | 0,00         | 0,00         | 41.064.474,15  | 326.514,66   | 0,80% ▲   | 1,55%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 296.011,90     | 0,00         | 0,00         | 299.183,18     | 3.171,28     | 1,07% ▲   | 0,16%       |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP        | 13.302.895,49  | 1.216.876,98 | 0,00         | 14.646.851,34  | 127.078,87   | 0,88% ▲   | 1,58%       |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP                     | 5.514.957,86   | 0,00         | 0,00         | 5.558.994,74   | 44.036,88    | 0,80% ▲   | 1,58%       |
|   | 237.021.910,22 | 2.741.876,98 | 2.475.000,00 | 239.475.603,32 | 2.186.816,12 | 0,92%     | 1,00%       |

| RENDA VARIÁVEL                        | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$   | Retorno % | Risco - VaR |
|---------------------------------------|----------------|------------|----------|---------------|--------------|-----------|-------------|
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES     | 1.313.156,57   | 0,00       | 0,00     | 1.367.259,43  | 54.102,86    | 4,12% ▲   | 8,72%       |
| BB GOVERNANÇA IS FIC AÇÕES            | 7.736.291,30   | 0,00       | 0,00     | 8.002.875,12  | 266.583,82   | 3,45% ▲   | 7,97%       |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES            | 10.087.189,58  | 0,00       | 0,00     | 10.544.277,88 | 457.088,30   | 4,53% ▲   | 7,87%       |
| BRADESCO DIVIDENDOS FIC AÇÕES         | 16.047.344,99  | 0,00       | 0,00     | 16.577.715,21 | 530.370,22   | 3,31% ▲   | 7,37%       |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FIC AÇÕES         | 4.045.076,76   | 0,00       | 0,00     | 4.185.372,42  | 140.295,66   | 3,47% ▲   | 7,77%       |
| SANTANDER PIBB FIC AÇÕES              | 1.209.229,04   | 0,00       | 0,00     | 1.251.341,49  | 42.112,45    | 3,48% ▲   | 8,19%       |
| SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FIC AÇÕES | 3.337.553,26   | 0,00       | 0,00     | 3.426.596,42  | 89.043,16    | 2,67% ▲   | 7,98%       |
| -                                     | 43.775.841,50  | 0,00       | 0,00     | 45.355.437,97 | 1.579.596,47 | 3,61%     | 7,74%       |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS               | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|-----------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| BB RENDA CORPORATIVA FIL - BBRC11 | 293.944,00     | 0,00       | 0,00     | 307.692,00  | 13.748,00  | 4,68% ▲   | 7,31%       |
| -                                 | 293.944,00     | 0,00       | 0,00     | 307.692,00  | 13.748,00  | 4,68%     | 7,31%       |



| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I          | 7.362.742,09   | 0,00       | 0,00     | 7.542.056,84  | 179.314,75 | 2,44% ▲   | 6,52%       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.576.086,88   | 0,00       | 0,00     | 2.610.902,64  | 34.815,76  | 1,35% ▲   | 4,75%       |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I    | 2.679.058,43   | 0,00       | 0,00     | 2.735.741,33  | 56.682,90  | 2,12% ▲   | 5,49%       |
|   | 12.617.887,40  | 0,00       | 0,00     | 12.888.700,81 | 270.813,41 | 2,15%     | 4,78%       |

**Parecer do Comitê de Investimento**

O Comitê de Investimentos do **GUAIRAPREV FDO MUN PREV GUAÍRA - SP** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Julho/2023**, atestando os dados relativos 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.

#### Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **GUAIRAPREV FDO MUN PREV GUAÍRA - SP** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Julho/2023** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **GUAIRAPREV FDO MUN PREV GUAÍRA - SP** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

