

# **CARTEIRA DE INVESTIMENTOS**

## **RELATÓRIO MENSAL**

Julho/2023

## **1. INTRODUÇÃO**

A Divisão de Investimentos e Financeiro do IPREMB apresenta o relatório mensal da carteira de investimentos dos recursos deste RPPS correspondente ao posicionamento das aplicações no mês de julho/2023.

Em consonância com as legislações vigentes que regem as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, o presente relatório demonstra o resultado detalhado e a adequação das aplicações financeiras do IPREMB às essas normas, quais sejam:

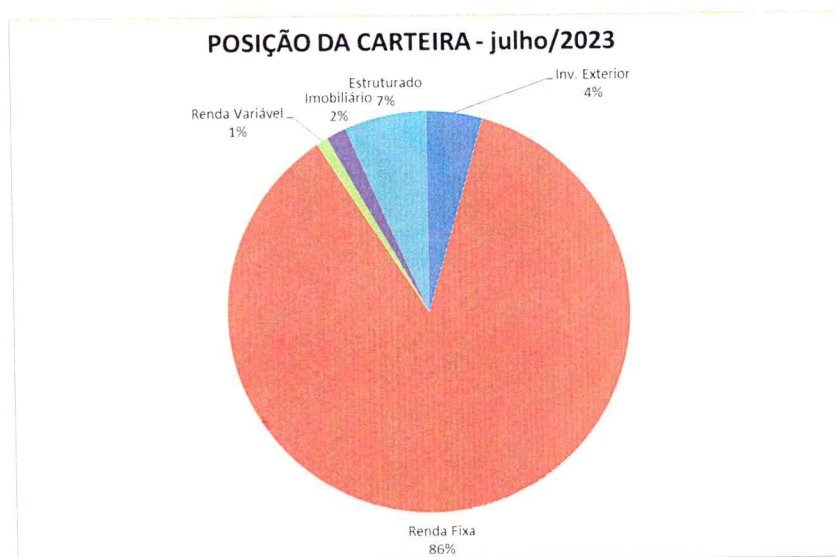
- Resolução do Conselho Monetário Nacional - CMN nº 4.963/2021.
- Portaria da Secretaria de Previdência Social nº 1.467/2022.
- Política de Investimento do IPREMB.

## 2. POSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

| JULHO 2023     |                             |
|----------------|-----------------------------|
| VALOR APLICADO | R\$ 1.517.142.966,14        |
| VALOR EM CONTA | R\$ 42.803,52               |
| <b>TOTAL:</b>  | <b>R\$ 1.517.185.769,66</b> |

### 2.1 POR TIPO DE INVESTIMENTO

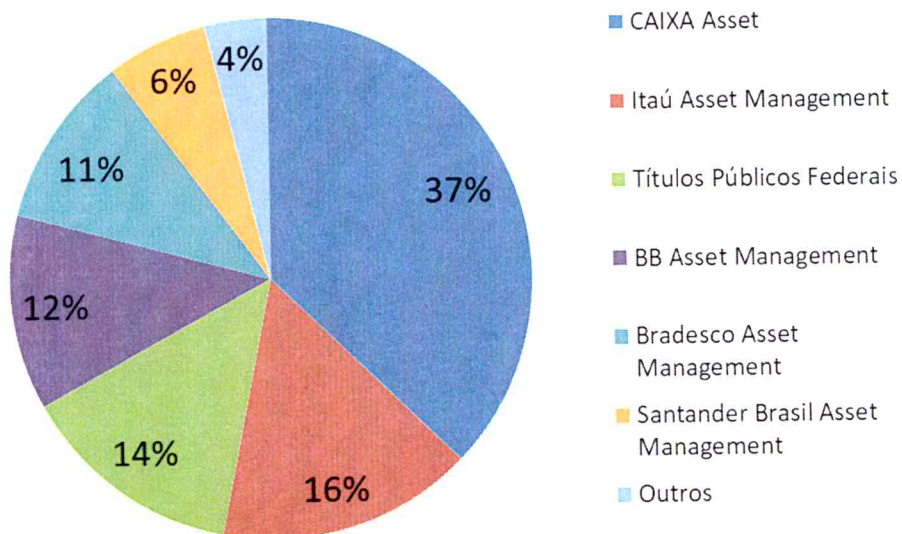
| Investimento       | Valor                   | %              |
|--------------------|-------------------------|----------------|
| Inv. Exterior      | 68.539.540,06           | 4,52%          |
| Renda Fixa         | 1.309.808.761,11        | 86,33%         |
| Renda Variável     | 13.639.152,07           | 0,90%          |
| Imobiliário        | 25.214.554,42           | 1,66%          |
| Estruturado        | 99.940.958,47           | 6,59%          |
| <b>Total Geral</b> | <b>1.517.142.966,14</b> | <b>100,00%</b> |



## 2.2 POSIÇÃO POR INSTITUIÇÕES

| Gestor                            | Valor                   | %              |
|-----------------------------------|-------------------------|----------------|
| CAIXA Asset                       | 565.759.830,61          | 37,29%         |
| Itaú Asset Management             | 241.691.163,39          | 15,93%         |
| Títulos Públicos Federais         | 210.201.380,42          | 13,86%         |
| BB Asset Management               | 183.532.619,81          | 12,10%         |
| Bradesco Asset Management         | 162.713.606,83          | 10,73%         |
| Santander Brasil Asset Management | 95.339.257,19           | 6,28%          |
| Outros                            | 57.905.107,89           | 3,82%          |
| <b>Total Geral</b>                | <b>1.517.142.966,14</b> | <b>100,00%</b> |

**Distribuição da carteira por gestor**



### 3. RENTABILIDADE TOTAL POR GESTOR

| GESTOR                                   | TOTAL POR GESTOR            | RENTABILIDADE            | RENTABILIDADE (%) |
|------------------------------------------|-----------------------------|--------------------------|-------------------|
| <b>CAIXA Asset</b>                       | <b>R\$ 565.759.830,61</b>   | <b>R\$ 7.492.125,09</b>  | <b>1,32%</b>      |
| Inv. Exterior                            | R\$ 45.306.749,38           | R\$ 938.728,43           | 2,07%             |
| Renda Fixa                               | R\$ 434.125.298,03          | R\$ 5.793.740,93         | 1,33%             |
| Renda Variável                           | R\$ 9.261.466,13            | -R\$ 266.297,37          | -2,88%            |
| Imobiliário                              | R\$ 6.406.400,00            | R\$ 112.000,00           | 1,75%             |
| Estruturado                              | R\$ 70.659.917,07           | R\$ 913.953,10           | 1,29%             |
| <b>Itaú Asset Management</b>             | <b>R\$ 241.691.163,39</b>   | <b>R\$ 2.294.833,74</b>  | <b>0,95%</b>      |
| Renda Fixa                               | R\$ 240.154.959,65          | R\$ 2.255.719,83         | 0,94%             |
| Renda Variável                           | R\$ 1.536.203,74            | R\$ 39.113,90            | 2,55%             |
| <b>Títulos Públicos Federais</b>         | <b>R\$ 210.201.380,42</b>   | <b>R\$ 664.837,32</b>    | <b>0,32%</b>      |
| Renda Fixa                               | R\$ 210.201.380,42          | R\$ 664.837,32           | 0,32%             |
| <b>BB Asset Management</b>               | <b>R\$ 183.532.619,81</b>   | <b>R\$ 1.958.578,90</b>  | <b>1,07%</b>      |
| Inv. Exterior                            | R\$ 23.232.790,68           | R\$ 565.143,44           | 2,43%             |
| Renda Fixa                               | R\$ 160.299.829,13          | R\$ 1.393.435,47         | 0,87%             |
| <b>Bradesco Asset Management</b>         | <b>R\$ 162.713.606,83</b>   | <b>R\$ 1.790.054,85</b>  | <b>1,10%</b>      |
| Renda Fixa                               | R\$ 159.139.364,91          | R\$ 1.685.191,36         | 1,06%             |
| Renda Variável                           | R\$ 2.135.901,63            | R\$ 54.902,38            | 2,57%             |
| Estruturado                              | R\$ 1.438.340,29            | R\$ 49.961,11            | 3,47%             |
| <b>Santander Brasil Asset Management</b> | <b>R\$ 95.339.257,19</b>    | <b>R\$ 934.770,41</b>    | <b>0,98%</b>      |
| Renda Fixa                               | R\$ 94.633.676,63           | R\$ 911.945,52           | 0,96%             |
| Renda Variável                           | R\$ 705.580,57              | R\$ 22.824,89            | 3,23%             |
| <b>Queluz Asset Management</b>           | <b>R\$ 38.690.964,01</b>    | <b>-R\$ 50.619,19</b>    | <b>-0,13%</b>     |
| Imobiliário                              | R\$ 8.749.466,49            | -R\$ 13.573,11           | -0,16%            |
| Estruturado                              | R\$ 29.941.497,52           | -R\$ 37.046,08           | -0,12%            |
| <b>Graphen Investimentos</b>             | <b>R\$ 11.247.419,00</b>    | <b>-R\$ 2.943,68</b>     | <b>-0,03%</b>     |
| Renda Fixa                               | R\$ 11.247.419,00           | -R\$ 2.943,68            | -0,03%            |
| <b>Macam Asset</b>                       | <b>R\$ 6.784.680,77</b>     | <b>-R\$ 7.418,19</b>     | <b>-0,11%</b>     |
| Imobiliário                              | R\$ 6.784.680,77            | -R\$ 7.418,19            | -0,11%            |
| <b>Veritas Capital Management</b>        | <b>R\$ 2.641.159,17</b>     | <b>-R\$ 4.007,16</b>     | <b>-0,15%</b>     |
| Imobiliário                              | R\$ 2.641.159,17            | -R\$ 4.007,16            | -0,15%            |
| <b>RB Capital Asset Management</b>       | <b>R\$ 632.848,00</b>       | <b>-R\$ 51.140,96</b>    | <b>-8,08%</b>     |
| Imobiliário                              | R\$ 632.848,00              | -R\$ 51.140,96           | -8,08%            |
| <b>BTG Pactual Gestora de Recursos</b>   | <b>R\$ 159.769,69</b>       | <b>-R\$ 3.681,52</b>     | <b>-2,30%</b>     |
| Estruturado                              | R\$ 159.769,69              | -R\$ 3.681,52            | -2,30%            |
| <b>Genial Banco</b>                      | <b>R\$ 6.833,35</b>         | <b>R\$ 3.184,88</b>      | <b>46,61%</b>     |
| Renda Fixa                               | R\$ 6.833,35                | R\$ 3.184,88             | 46,61%            |
| <b>Arena Capital</b>                     | <b>-R\$ 2.258.566,09</b>    | <b>-R\$ 2.933,36</b>     | <b>0,13%</b>      |
| Estruturado                              | -R\$ 2.258.566,09           | -R\$ 2.933,36            | 0,13%             |
| <b>Total Geral</b>                       | <b>R\$ 1.517.142.966,14</b> | <b>R\$ 15.375.298,64</b> | <b>1,02%</b>      |

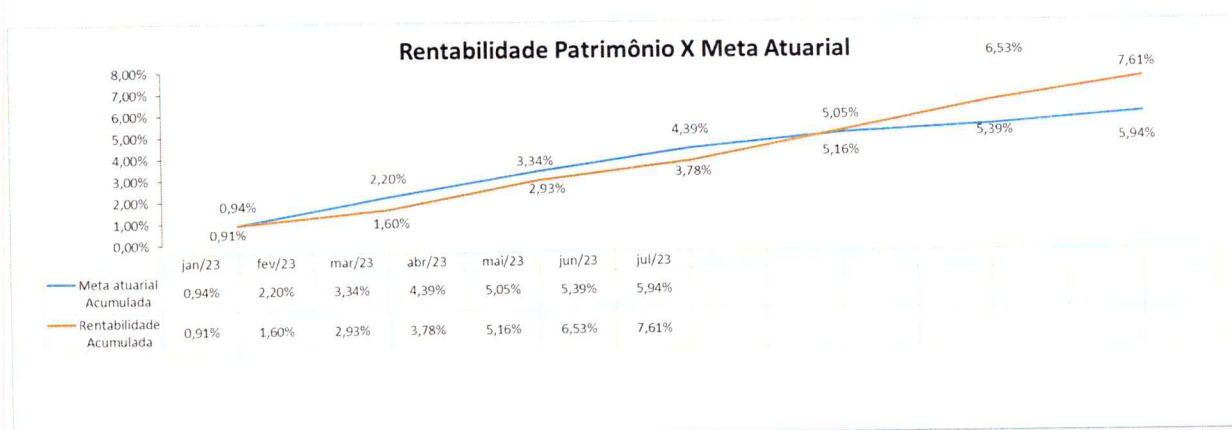
#### 4. ENQUADRAMENTO DAS APLICAÇÕES: POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023

| Lig.                           | Descrição                                                        | Limite Resolução CMN | Limite Política de Investimento | Posição carteira do IPREMB em julho/2023 |
|--------------------------------|------------------------------------------------------------------|----------------------|---------------------------------|------------------------------------------|
| <b>Renda fixa</b>              |                                                                  | <b>100%</b>          | <b>100%</b>                     | <b>86,33%</b>                            |
| 7º I A                         | Títulos Públicos - Art. 7º, I, a                                 | 100%                 | 100%                            | 13,86%                                   |
| 7º I B                         | FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b                               | 100%                 | 100%                            | 31,55%                                   |
| 7º I C                         | Fundos de índices carteira 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c | 100%                 | 100%                            | -                                        |
| 7º II                          | Operações compromissadas - Art. 7º, II                           | 5%                   | 5%                              | -                                        |
| 7º III A                       | Fundos referenciados em indicadores RF* - Art. 7º, III, a        | 60%                  | 60%                             | 38,37%                                   |
| 7º III B                       | Fundos de índices (ETF) em indicadores títulos - Art. 7º, III, b | 60%                  | 60%                             | -                                        |
| 7º III A                       | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a                           | 60%                  | 60%                             | 38,37%                                   |
| 7º III B                       | FI Renda Fixa (ETF) - quaisquer indicadores - Art. 7º, IV, b     | 60%                  | 60%                             | -                                        |
| 7º IV                          | Letra Imobiliária Garantida - LIIG - Art. 7º, V, b               | 20%                  | 20%                             | -                                        |
| 7º IV                          | CDB nos limites garantidos pelo FGC - Art. 7º, VI, a             | 15%                  | 15%                             | -                                        |
| 26                             | Poupança nos limites garantidos pelo FGC - Art. 7º, VI, b        | 15%                  | 15%                             | -                                        |
| 7º V A                         | FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a       | 5%                   | 5%                              | 0,74%                                    |
| 7º V B                         | FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, b                | 5%                   | 5%                              | 1,82%                                    |
| 7º V C                         | FI Renda Fixa de debêntures de infraestrutura - Art. 7º, VII, c  | 5%                   | 5%                              | -                                        |
| <b>Renda variável</b>          |                                                                  | <b>30%</b>           | <b>30%</b>                      | <b>0,90%</b>                             |
| 8º I                           | FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, a      | 30%                  | 30%                             | 0,90%                                    |
| 8º II                          | ETF de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, b     | 30%                  | 30%                             | -                                        |
| 8º I                           | FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a                             | 30%                  | 30%                             | 0,90%                                    |
| 8º II                          | ETF de Ações - Geral - Art. 8º, II, b                            | 30%                  | 30%                             | -                                        |
| <b>Estruturado</b>             |                                                                  | <b>10%</b>           | <b>10%</b>                      | <b>6,59%</b>                             |
| 10 I                           | FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III                          | 10%                  | 10%                             | 6,22%                                    |
| 10 II                          | FI em Participações - Art. 8º, IV, a                             | 5%                   | 5%                              | 0,37%                                    |
| 10 III                         | FI Ações - Mercado de Acesso                                     | 5%                   | 5%                              | -                                        |
| <b>Imobiliário</b>             |                                                                  | <b>30%</b>           | <b>30%</b>                      | <b>1,66%</b>                             |
| 11                             | FI Imobiliários - Art. 8º, IV, b                                 | 5%                   | 5%                              | 1,18%                                    |
| <b>Inv. exterior</b>           |                                                                  | <b>10%</b>           | <b>10%</b>                      | <b>4,52%</b>                             |
| 9º I                           | FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa                       | 10%                  | 10%                             | -                                        |
| 9º II                          | FIC - Aberto - Investimento no Exterior                          | 10%                  | 10%                             | -                                        |
| 9º III                         | Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III                      | 10%                  | 10%                             | 4,52%                                    |
| <b>Empréstimos Consignados</b> |                                                                  | <b>5%</b>            | <b>10%</b>                      | <b>0,00%</b>                             |
| 12 I                           | Empréstimos Consignados - Art. 12, I                             | 5%                   | 5%                              | -                                        |
| 12 II                          | Empréstimos Consignados - Art. 12, II                            | 10%                  | -                               | -                                        |

100,00%

## 5. QUADRO COMPARATIVO: META ATUARIAL

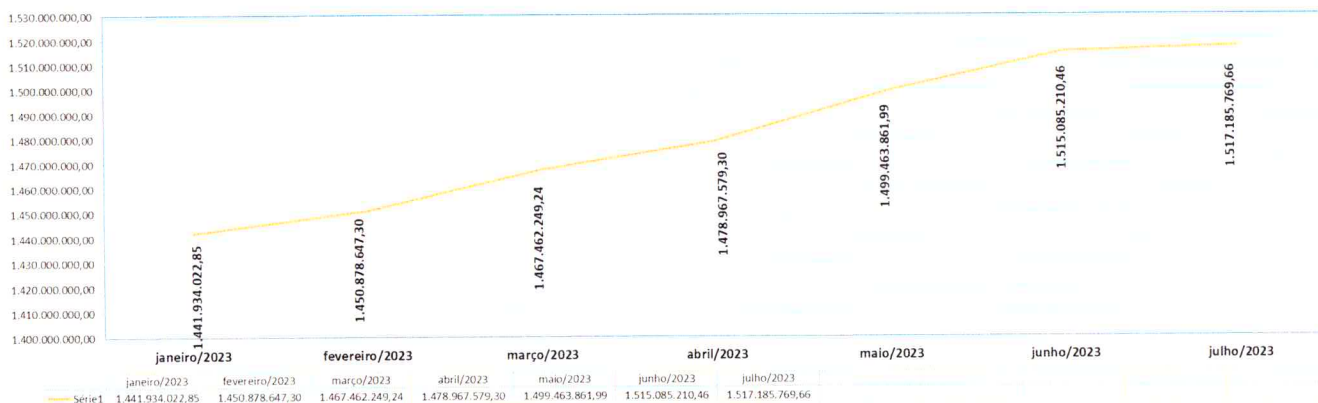
|        | IPCA (%) | Meta atuarial (%) | Rentabilidade média da carteira (%) | % atingido da meta | Meta atuarial Acumulada | Rentabilidade Acumulada | Patrimônio Líquido (R\$) | Evolução Patrimonial (%) |
|--------|----------|-------------------|-------------------------------------|--------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
| jan/23 | 0,53%    | 0,94%             | 0,91%                               | -3,08%             | 0,94%                   | 0,91%                   | R\$ 1.441.934.022,85     | 0,00%                    |
| fev/23 | 0,84%    | 1,25%             | 0,69%                               | -44,95%            | 2,20%                   | 1,60%                   | R\$ 1.450.878.647,30     | 0,62%                    |
| mar/23 | 0,71%    | 1,12%             | 1,31%                               | 17,49%             | 3,34%                   | 2,93%                   | R\$ 1.467.462.249,24     | 1,77%                    |
| abr/23 | 0,61%    | 1,02%             | 0,82%                               | -19,35%            | 4,39%                   | 3,78%                   | R\$ 1.478.967.579,30     | 2,57%                    |
| mai/23 | 0,23%    | 0,64%             | 1,33%                               | 109,80%            | 5,05%                   | 5,16%                   | R\$ 1.499.463.861,99     | 3,99%                    |
| jun/23 | -0,08%   | 0,32%             | 1,30%                               | 301,36%            | 5,39%                   | 6,53%                   | R\$ 1.515.085.210,46     | 5,07%                    |
| jul/23 | 0,12%    | 0,52%             | 1,02%                               | 94,20%             | 5,94%                   | 7,61%                   | R\$ 1.517.185.769,66     | 5,22%                    |



## 6. PATRIMÔNIO LÍQUIDO

| Patrimônio líquido - 2023 |                  | Evolução Patrimonial |
|---------------------------|------------------|----------------------|
| janeiro/2023              | 1.441.934.022,85 | 0,0000%              |
| fevereiro/2023            | 1.450.878.647,30 | 0,6203%              |
| março/2023                | 1.467.462.249,24 | 1,7704%              |
| abril/2023                | 1.478.967.579,30 | 2,5683%              |
| maio/2023                 | 1.499.463.861,99 | 3,9898%              |
| junho/2023                | 1.515.085.210,46 | 5,0731%              |
| julho/2023                | 1.517.185.769,66 | 5,2188%              |

Patrimônio Líquido - IPREMB - JUNHO/2023



## 7. RANKING DOS FUNDOS

### RANKING DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - julho/2023

META ATUARIAL NO MÊS: 0,52%

META ATUARIAL NO ANO: 5,94%

| Gestão                            | Fundo                                                                | % Mês  | % Meta    | Fundo        |
|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------------|--------|-----------|--------------|
| Genial Banco                      | MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1                              | 87,29% | 16636,53% | 3.184,88     |
| CAIXA Asset                       | CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                      | 3,64%  | 693,76%   | 17.670,01    |
| Bradesco Asset Management         | BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO                                      | 3,60%  | 685,81%   | 49.961,11    |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES                      | 3,34%  | 637,12%   | 22.824,89    |
| BB Asset Management               | BB AÇÕES BOLSA GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I               | 2,95%  | 562,87%   | 301.475,64   |
| Bradesco Asset Management         | BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES                                         | 2,64%  | 502,81%   | 54.902,38    |
| Itaú Asset Management             | ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                               | 2,61%  | 497,93%   | 39.113,90    |
| CAIXA Asset                       | CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP               | 2,30%  | 439,21%   | 366.991,35   |
| BB Asset Management               | BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                               | 2,12%  | 403,29%   | 263.667,79   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                             | 2,12%  | 403,23%   | 938.728,43   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11                         | 1,78%  | 339,11%   | 112.000,00   |
| Bradesco Asset Management         | BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                       | 1,18%  | 225,51%   | 968.927,32   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                    | 1,15%  | 218,57%   | 3.150.976,67 |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                    | 1,15%  | 218,57%   | 3.150.976,67 |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                    | 1,15%  | 218,57%   | 3.150.976,67 |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                        | 1,14%  | 217,48%   | 788.015,14   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                        | 1,14%  | 217,48%   | 1.301,02     |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                        | 1,14%  | 217,48%   | 101.411,27   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO                  | 1,14%  | 216,77%   | 95.436,92    |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI       | 1,13%  | 216,28%   | 239.796,58   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 1,07%  | 204,18%   | 145.831,36   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 1,07%  | 204,18%   | 145.831,36   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 1,07%  | 204,18%   | 145.831,36   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 1,07%  | 204,18%   | 145.831,36   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                   | 1,05%  | 201,01%   | 343.466,20   |
| BB Asset Management               | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO            | 1,05%  | 200,88%   | 149.718,08   |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA                              | 1,05%  | 200,28%   | 61.593,55    |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI    | 1,05%  | 200,10%   | 164.707,16   |
| BB Asset Management               | BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                 | 1,05%  | 199,91%   | 173.338,17   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP                             | 0,99%  | 189,13%   | 106.086,06   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP                             | 0,99%  | 189,13%   | 106.086,06   |
| Itaú Asset Management             | ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP                 | 0,99%  | 188,08%   | 907.627,12   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES                 | 0,99%  | 187,98%   | 0,00         |
| BB Asset Management               | BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                       | 0,98%  | 187,40%   | 172.407,38   |
| BB Asset Management               | BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO             | 0,98%  | 186,71%   | 140.547,96   |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA                             | 0,95%  | 181,75%   | 44.998,48    |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP               | 0,95%  | 181,36%   | 227.593,91   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP               | 0,95%  | 181,36%   | 227.593,91   |
| Bradesco Asset Management         | BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA                        | 0,95%  | 180,64%   | 716.264,03   |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP                               | 0,95%  | 180,26%   | 129.217,81   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 0,92%  | 174,61%   | 291.949,42   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 0,92%  | 174,61%   | 291.949,42   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 0,92%  | 174,61%   | 291.949,42   |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 0,91%  | 174,06%   | 41.750,28    |
| Itaú Asset Management             | ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                  | 0,90%  | 171,16%   | 412.471,14   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                       | 0,89%  | 170,20%   | 1.977,10     |
| Itaú Asset Management             | ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA                                  | 0,89%  | 168,71%   | 885.212,85   |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                       | 0,88%  | 167,28%   | 74.380,83    |
| Itaú Asset Management             | ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                                 | 0,80%  | 153,31%   | 50.408,72    |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 | 0,80%  | 152,75%   | 7.652,69     |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP                            | 0,80%  | 152,18%   | 65.708,54    |
| Santander Brasil Asset Management | SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                                       | 0,79%  | 150,26%   | 89.792,31    |
| BB Asset Management               | BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 0,79%  | 149,91%   | 757.423,87   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 | 0,66%  | 125,12%   | 7.643,32     |
| Arena Capital                     | CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11                            | 0,13%  | 24,78%    | (2.933,36)   |
| Graphen Investimentos             | GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1                                            | 0,01%  | 2,64%     | 1.428,36     |
| Queluz Asset Management           | BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP                                 | -0,03% | -6,00%    | (2.411,96)   |
| Veritas Capital Management        | SÃO DOMINGOS FII - FID11                                             | -0,07% | -13,52%   | (1.524,57)   |
| Macam Asset                       | MACAM SHOPPING FII                                                   | -0,11% | -20,81%   | (7.418,19)   |
| Queluz Asset Management           | AQUILA FII - AQLL11                                                  | -0,15% | -29,52%   | (13.573,11)  |
| Queluz Asset Management           | SCULPTOR FII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                            | -0,16% | -29,57%   | (34.634,12)  |
| Graphen Investimentos             | PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                                                | -0,47% | -89,66%   | (4.372,04)   |
| Veritas Capital Management        | CAM THRONE FII                                                       | -0,50% | -95,33%   | (2.482,59)   |
| BTG Pactual Gestora de Recursos   | BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA                                 | -2,25% | -429,26%  | (3.681,52)   |
| CAIXA Asset                       | CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES                                            | -2,79% | -532,67%  | (266.297,37) |
| RB Capital Asset Management       | RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11                                     | -7,48% | -1424,95% | (51.140,96)  |

## 8. RETORNO X RISCO

### a. Renda Fixa

| Fundo                                                                |            | CNPJ               | Retorno | Volatilidade | Beta  |                         |
|----------------------------------------------------------------------|------------|--------------------|---------|--------------|-------|-------------------------|
| NTN-B 760199 20240815                                                |            | 2110               |         | 0,37%        | 0,95% | (2.808.088.297.731,38)  |
| NTN-B 760199 20240815                                                |            | 3055               |         | 0,37%        | 0,95% | (2.808.088.297.731,38)  |
| NTN-B 760199 20240815                                                |            | 3405               |         | 0,37%        | 0,95% | (2.808.088.297.731,38)  |
| NTN-B 760199 20240815                                                |            | 7612 - XP          |         | 0,53%        | 0,95% | (2.808.088.297.731,38)  |
| NTN-B 760199 20240815                                                |            | 750 - XP           |         | 0,54%        | 0,95% | (2.808.088.297.731,38)  |
| NTN-B 760199 20250515                                                |            | 7423 - XP          |         | 0,49%        | 1,36% | (5.246.949.101.446,90)  |
| NTN-B 760199 20250515                                                |            | 504 - XP           |         | 0,50%        | 1,36% | (5.246.949.101.446,90)  |
| NTN-B 760199 20280815                                                |            | 7457 - XP          |         | 0,47%        | 2,69% | (9.903.212.245.235,17)  |
| NTN-B 760199 20250515                                                |            | 3339 - XP          |         | 0,05%        | 1,36% | (5.246.949.101.446,90)  |
| NTN-B 760199 20260515                                                |            | 6840 - XP          | # N/D   | 0,05%        | #N/D  | #N/D                    |
| NTN-B 760199 20280815                                                |            | 6950 - XP          |         | 0,05%        | 2,69% | (9.903.212.245.235,17)  |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                 |            | 19.523.305/0001-06 |         | 1,05%        | 0,00% | (957.117.890,03)        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO            |            | 19.303.795/0001-35 |         | 1,05%        | 0,88% | (2.805.726.227.815,36)  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 82-5       | 10.740.670/0001-06 |         | 1,07%        | 0,33% | (1.144.930.992.143,67)  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  |            | 10.740.670/0001-06 |         | 1,07%        | 0,33% | (1.144.930.992.143,67)  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | Sede       | 10.740.670/0001-06 |         | 1,07%        | 0,33% | (1.144.930.992.143,67)  |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 |            | 10.740.658/0001-93 |         | 0,80%        | 3,27% | (11.160.866.558.056,80) |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP               |            | 11.060.913/0001-10 |         | 0,95%        | 1,55% | (5.991.928.359.743,08)  |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                       |            | 23.215.097/0001-55 |         | 0,89%        | 2,18% | (6.853.103.934.817,26)  |
| CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                   |            | 19.768.682/0001-05 |         | 1,05%        | 0,88% | (2.820.635.792.780,95)  |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA                             |            | 13.455.117/0001-01 |         | 0,95%        | 1,56% | (6.018.692.247.505,86)  |
| SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP                               |            | 18.599.673/0001-75 |         | 0,95%        | 1,56% | (6.029.284.982.979,78)  |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP                            |            | 14.504.578/0001-90 |         | 0,80%        | 3,32% | (11.344.490.261.716,60) |
| SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                       |            | 13.455.197/0001-03 |         | 0,88%        | 2,27% | (7.067.465.034.513,87)  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          |            | 14.386.926/0001-71 |         | 0,92%        | 1,49% | (5.743.135.839.507,61)  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 82-5       | 14.386.926/0001-71 |         | 0,92%        | 1,49% | (5.743.135.839.507,61)  |
| SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA                              |            | 10.979.025/0001-32 |         | 1,05%        | 0,33% | (1.061.454.154.457,10)  |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                  |            | 21.838.150/0001-49 |         | 0,90%        | 2,43% | (8.955.535.131.731,96)  |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        |            | 35.292.588/0001-89 |         | 0,79%        | 1,02% | (3.047.996.658.398,54)  |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI    |            | 09.577.447/0001-00 |         | 1,05%        | 0,02% | (45.050.247.502,11)     |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                                       |            | 26.507.132/0001-06 |         | 0,79%        | 2,25% | (7.507.298.864.824,20)  |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES                 |            | 14.508.643/0001-55 |         | 0,99%        | 0,00% | (5.510.284.614,62)      |
| ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA                                  |            | 50.302.776/0001-34 |         | 0,89%        | 2,35% | (8.635.175.799.712,05)  |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                                 |            | 06.175.696/0001-73 |         | 0,80%        | 0,02% | (43.825.653.237,98)     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP               | 711098 - F | 11.060.913/0001-10 |         | 0,95%        | 1,55% | (5.991.928.359.743,08)  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 711098 - F | 14.386.926/0001-71 |         | 0,92%        | 1,49% | (5.743.135.839.507,61)  |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 | 711098 - F | 14.508.605/0001-00 |         | 0,66%        | 2,27% | (7.072.512.211.373,69)  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 711098 - R | 10.740.670/0001-06 |         | 1,07%        | 0,33% | (1.144.930.992.143,67)  |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                       |            | 13.077.415/0001-05 |         | 0,98%        | 0,02% | (38.292.788.579,33)     |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                        | 85-0       | 03.737.206/0001-97 |         | 1,14%        | 0,06% | 32.405.605.833,80       |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                        | 29-9       | 03.737.206/0001-97 |         | 1,14%        | 0,06% | 32.405.605.833,80       |
| BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA                          |            | 20.216.216/0001-04 |         | 0,95%        | 1,62% | (6.215.857.362.679,43)  |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP                 |            | 32.972.942/0001-28 |         | 0,99%        | 0,90% | (2.120.990.790.753,86)  |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI       |            | 02.224.354/0001-45 |         | 1,13%        | 0,04% | (30.979.553.803,09)     |
| BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                         |            | 03.399.411/0001-90 |         | 1,18%        | 0,13% | 15.131.802.913,87       |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                    | 29-9       | 23.215.008/0001-70 |         | 1,15%        | 0,08% | (61.748.564.541,98)     |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                    | 82-5       | 23.215.008/0001-70 |         | 1,15%        | 0,08% | (61.748.564.541,98)     |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                    | 711098 - F | 23.215.008/0001-70 |         | 1,15%        | 0,08% | (61.748.564.541,98)     |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                        | 711098 - R | 03.737.206/0001-97 |         | 1,14%        | 0,06% | 32.405.605.833,80       |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1                                            |            | 17.013.985/0001-92 |         | 0,01%        | 0,82% | (3.527.812.890.098,73)  |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1                              |            | 12.138.813/0001-21 |         | 87,29%       |       |                         |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                                                |            | 06.018.364/0001-85 |         | -0,47%       | 0,12% | 145.907.885.901,65      |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO             |            | 14.091.645/0001-91 |         | 0,98%        | 1,12% | (4.334.786.196.799,18)  |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO                  |            | 21.918.896/0001-62 |         | 1,14%        | 1,74% | (5.855.282.787.949,84)  |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP |            | 17.138.474/0001-05 |         | 0,91%        | 0,82% | 2.324.195.358.384,71    |

## b. Renda Variável

| Fundo                                                   |      | CNPJ               | Retomo | Volatilidade | Beta                    |
|---------------------------------------------------------|------|--------------------|--------|--------------|-------------------------|
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES         |      | 01.699.688/0001-02 | 3,34%  | 16,53%       | (58.297.386.559.247,00) |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES                            |      | 03.660.879/0001-96 | 2,64%  | 15,50%       | (58.733.113.986.921,30) |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                  |      | 24.571.992/0001-75 | 2,61%  | 15,48%       | (39.945.278.385.511,90) |
| CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES                               |      | 45.443.475/0001-90 | -2,79% | 26,12%       | (64.477.325.656.613,40) |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I |      | 39.255.695/0001-98 | 2,95%  | 14,27%       | 15.484.470.445.863,80   |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                |      | 17.502.937/0001-68 | 2,12%  | 11,57%       | 3.239.811.443.631,64    |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                  |      | 22.632.237/0001-28 | 2,12%  | 10,86%       | 4.276.383.412.015,34    |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                |      | 14.655.180/0001-54 | -0,16% | 0,20%        | 80.320.550.202,03       |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP         |      | 30.036.235/0001-02 | 3,64%  | 7,89%        | 4.008.684.498.811,79    |
| BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO                         |      | 18.959.094/0001-96 | 3,60%  | 7,91%        | 3.990.706.370.902,72    |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP  |      | 42.229.068/0001-97 | 2,30%  | 5,86%        | (13.400.135.952.384,60) |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP                | 29-9 | 14.120.520/0001-42 | 0,99%  | 0,22%        | (251.315.560.723,85)    |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP                | 82-5 | 14.120.520/0001-42 | 0,99%  | 0,22%        | (251.315.560.723,85)    |
| BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP                    |      | 12.312.767/0001-35 | -0,03% |              |                         |
| BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA                    |      | 14.584.094/0001-06 | -2,25% | 0,23%        | (76.190.495.430,70)     |
| CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11               |      | 10.625.626/0001-47 | 0,13%  |              |                         |
| MACAM SHOPPING FII                                      |      | 16.685.929/0001-31 | -0,11% |              |                         |
| CAM THRONE FII                                          |      | 21.862.783/0001-92 | -0,50% |              |                         |
| SÃO DOMINGOS FII - FID11                                |      | 16.543.270/0001-89 | -0,07% | 0,00%        | -                       |
| RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11                        |      | 09.006.914/0001-34 | -7,48% | 25,27%       | (46.653.195.302.250,10) |
| ÁQUILA FII - AQL11                                      |      | 13.555.918/0001-49 | -0,15% | 0,00%        | -                       |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11            |      | 17.098.794/0001-70 | 1,78%  | 18,84%       | (4.524.351.101.286,86)  |

## 9. EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS JULHO 2023

| Tipos de Aplicação                    | Valor mensal Julho 2023 |
|---------------------------------------|-------------------------|
| Aplicações Gerais                     | R\$ 1.516.786.744,28    |
| Consignados - Fundo Garantidor        | R\$ 12.218,62           |
| Consignados - Fundo Oscilação Riscos  | R\$ 8.147,58            |
| Consignados - Rendimentos Consignados | R\$ 115.312,87          |

| Resumo dos empréstimos consignados até 31/07/2023 |                   |
|---------------------------------------------------|-------------------|
| Valor Total Emprestado                            | R\$ 10.839.438,59 |
| Consignados - Rendimentos Consignados             | R\$ 323.188,01    |

## 10. ENQUADRAMENTO DAS APLICAÇÕES AOS LIMITES DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO - PL DOS FUNDOS

| FUNDO                                                               | CNPJ                | RUBRICA  | SALDO julho/2023 | PL - FUNDO julho/2023 | LIMITE DO PL - RESOLUÇÃO 4963 | % PL - FUNDO | SITUAÇÃO      |
|---------------------------------------------------------------------|---------------------|----------|------------------|-----------------------|-------------------------------|--------------|---------------|
| NTN-B 760199-20240815                                               |                     | 7º I A   | 8.817.627,83     |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20240815                                               |                     | 7º I A   | 12.766.754,99    |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20240815                                               |                     | 7º I A   | 14.229.394,68    |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20240815                                               |                     | 7º I A   | 32.115.613,58    |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20240815                                               |                     | 7º I A   | 3.161.055,10     |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20250515                                               |                     | 7º I A   | 31.050.135,21    |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20250515                                               |                     | 7º I A   | 2.100.464,52     |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20280815                                               |                     | 7º I A   | 31.927.301,92    |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20250515                                               |                     | 7º I A   | 14.005.064,80    |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20260515                                               | #N/D                | 7º I A   | 30.014.240,23    |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| NTN-B 760199-20280815                                               |                     | 7º I A   | 30.013.727,57    |                       | -                             | -            | ENQUADRADO    |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                | 19.523.305/0001-06  | 7º I B   | 16.698.504,54    | 48.676.878,46         | 100%                          | 34,30%       | ENQUADRADO    |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 19.303.735/0001-35  | 7º I B   | 19.303.735,00    | 190.221.835,84        | 100%                          | 7,55%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                 | 10.740.670/0001-06  | 7º I B   | 13.757.918,53    | 7.409.323.495,01      | 100%                          | 0,19%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                 | 10.740.670/0001-06  | 7º I B   | 16.552.637,48    | 7.409.323.495,01      | 100%                          | 0,23%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                 | 10.740.670/0001-06  | 7º I B   | 8.645.467,59     | 7.409.323.495,01      | 100%                          | 0,12%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                | 10.740.658/0001-93  | 7º I B   | 962.449,59       | 4.916.698.620,80      | 100%                          | 0,02%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP              | 11.060.913/0001-10  | 7º I B   | 24.482.535,38    | 8.226.261.315,96      | 100%                          | 0,30%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA                       | 23.215.097/0001-55  | 7º I B   | 223.366,18       | 5.462.057.088,14      | 100%                          | 0,00%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 19.768.682/0001-05  | 7º I B   | 32.907.938,40    | 190.114.095,97        | 100%                          | 17,31%       | ENQUADRADO    |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FI RENDA FIXA                             | 13.455.117/0001-01  | 7º I B   | 4.763.379,44     | 1.108.295.759,82      | 100%                          | 0,43%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP                              | 18.599.673/0001-75  | 7º I B   | 13.791.029,79    | 670.008.863,83        | 100%                          | 2,06%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FI RENDA FIXA LP                            | 14.504.578/0001-90  | 7º I B   | 8.294.714,26     | 400.119.784,91        | 100%                          | 2,07%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                      | 13.455.197/0001-03  | 7º I B   | 8.548.505,77     | 715.716.856,97        | 100%                          | 1,19%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IPCA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP         | 14.386.926/0001-71  | 7º I B   | 32.157.871,71    | 5.655.699.960,16      | 100%                          | 0,57%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IPCA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP         | 14.386.926/0001-71  | 7º I B   | 4.027.128,48     | 5.655.699.960,16      | 100%                          | 0,07%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA                             | 10.979.025/0001-32  | 7º I B   | 5.822.791,57     | 100.863.292,38        | 100%                          | 5,87%        | ENQUADRADO    |
| ITAUI INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA                 | 21.838.150/0001-49  | 7º I B   | 46.340.170,32    | 2.143.764.034,65      | 100%                          | 2,16%        | ENQUADRADO    |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 35.292.588/0001-89  | 7º I B   | 97.051.886,54    | 5.898.923.569,05      | 100%                          | 1,65%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 09.577.447/0001-00  | 7º I B   | 15.852.118,13    | 7.072.550.968,90      | 100%                          | 0,22%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER ATIVO FI RENDA FIXA                                       | 26.507.132/0001-06  | 7º I B   | 11.178.190,44    | 327.369.009,91        | 100%                          | 3,51%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA SIMPLES                 | 14.508.643/0001-55  | 7º I B   | 0,01             | 721.224.783,88        | 100%                          | 0,00%        | ENQUADRADO    |
| ITAUI ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA                                | 50.302.776/0001-34  | 7º I B   | 100.885.212,85   | 128.568.555,39        | 100%                          | 78,47%       | ENQUADRADO    |
| ITAUI SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES                                | 06.175.696/0001-73  | 7º I B   | 50.408,72        | 39.259.981.227,70     | 100%                          | 0,00%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP              | 11.060.913/0001-10  | 7º I B   | 8.147,58         | 8.226.261.315,96      | 100%                          | 0,00%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IPCA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP         | 14.386.926/0001-71  | 7º I B   | 12.218,62        | 5.655.699.960,16      | 100%                          | 0,00%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                | 14.508.605/0001-00  | 7º I B   | 639.515,76       | 1.825.912.846,83      | 100%                          | 0,04%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                 | 10.740.670/0001-06  | 7º I B   | 220.542,79       | 7.409.323.495,01      | 100%                          | 0,00%        | ENQUADRADO    |
| BB FLUXO FI RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                       | 13.077.417/0001-05  | 7º III A | 17.708.002,96    | 3.542.574.797,77      | 15%                           | 0,50%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                       | 03.737.206/0001-97  | 7º III A | 8.898.457,99     | 14.867.599.167,79     | 15%                           | 0,06%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                       | 03.737.206/0001-97  | 7º III A | 69.844.094,83    | 14.867.599.167,79     | 15%                           | 0,47%        | ENQUADRADO    |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA                        | 20.216.216/0001-04  | 7º III A | 76.285.059,61    | 946.252.745,21        | 15%                           | 8,06%        | ENQUADRADO    |
| ITAUI INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FI RENDA FIXA LP                | 32.972.942/0001-28  | 7º III A | 92.879.167,25    | 3.066.117.415,44      | 15%                           | 3,03%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 02.224.354/0001-45  | 7º III A | 21.369.906,35    | 2.886.944.335,56      | 15%                           | 0,74%        | ENQUADRADO    |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                   | 03.399.411/0001-90  | 7º III A | 82.854.305,31    | 8.447.360.930,23      | 15%                           | 0,98%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                   | 23.215.008/0001-70  | 7º III A | 192.742.394,67   | 5.833.199.134,59      | 15%                           | 3,30%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                   | 23.215.008/0001-70  | 7º III A | 19.330.047,77    | 5.833.199.134,59      | 15%                           | 0,33%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                                   | 23.215.008/0001-70  | 7º III A | 50.975,78        | 5.833.199.134,59      | 15%                           | 0,00%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                       | 03.737.206/0001-97  | 7º III A | 115.312,87       | 14.867.599.167,79     | 15%                           | 0,00%        | ENQUADRADO    |
| GGF PRIME FIDC SÊNIOR 1                                             | 17.013.985/0001-92  | 7º V A   | 10.322.508,71    | 125.549.744,30        | 5%                            | 8,22%        | DESENGUADRADO |
| MASTER III FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1                            | 12.138.813/0001-21  | 7º V A   | 6.833,35         | 365.272,94            | 5%                            | 1,87%        | ENQUADRADO    |
| Premium FIDC SÊNIOR 1                                               | 06.018.364/0001-85  | 7º V A   | 924.910,29       | 31.566.179,97         | 5%                            | 2,93%        | ENQUADRADO    |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO            | 14.087.645/0001-91  | 7º V B   | 14.487.156,60    | 312.755.409,33        | 5%                            | 4,63%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO                 | 21.918.806/0001-62  | 7º V B   | 4.486.276,01     | 229.261.530,04        | 5%                            | 3,70%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO   | 17.138.474/0001-05  | 7º V B   | 4.613.095,88     | 1.248.513.953,08      | 5%                            | 0,37%        | ENQUADRADO    |
| SANTANDER BLOQUEIO ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES                     | 01.699.688/0001-02  | 8º I     | 705.580,57       | 280.307.826,62        | 15%                           | 0,25%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA ELETOBRAS FI AÇÕES                                            | 02.660.879/0001-96  | 8º I     | 2.135.901,62     | 483.820.683,81        | 15%                           | 0,44%        | ENQUADRADO    |
| BR AÇÕES BOLSAIS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I             | 45.443.475/0001-90  | 8º I     | 1.536.203,74     | 1.516.010.022,90      | 15%                           | 0,10%        | ENQUADRADO    |
| ITAUI DUNAMIS FI AÇÕES                                              | 24.571.992/0001-75  | 8º I     | 9.261.466,13     | 315.632.000,78        | 15%                           | 2,93%        | ENQUADRADO    |
| BR AÇÕES BOLSAIS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I             | 39.255.625/0001-38  | 9º III   | 10.509.084,70    | 402.901.821,91        | 15%                           | 2,61%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                            | 17.502.937/0001-68  | 9º III   | 45.306.749,38    | 2.066.727.304,72      | 15%                           | 2,19%        | ENQUADRADO    |
| BR AÇÕES GLOBAIS FI AÇÕES BDR NÍVEL I                               | 27.632.237/0001-28  | 9º III   | 17.723.205,98    | 657.045.723,31        | 15%                           | 1,98%        | ENQUADRADO    |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                            | 14.655.180/0001-54  | 10 I     | 22.286.766,76    | 142.297.007,85        | 15%                           | 15,66%       | DESENGUADRADO |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                     | 30.026.235/0001-82  | 10 I     | 503.077,73       | 1.655.052.227,35      | 15%                           | 0,03%        | ENQUADRADO    |
| BRADESCO BOLSA FI MULTIMERCADO                                      | 18.359.094/0001-96  | 10 I     | 1.438.340,29     | 667.173.742,50        | 15%                           | 0,22%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FI MULTIMERCADO LP               | 229.028.069/0001-97 | 10 I     | 16.291.390,13    | 140.688.010,78        | 15%                           | 11,58%       | ENQUADRADO    |
| CAIXA JUBOS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP                             | 14.120.520/0001-42  | 10 I     | 10.796.263,84    | 1.628.550.372,57      | 15%                           | 0,66%        | ENQUADRADO    |
| BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGICA FIP                                | 12.217.767/0001-35  | 10 II    | 43.069.136,36    | 1.608.550.372,57      | 15%                           | 2,64%        | ENQUADRADO    |
| RIG PACTUAL III FIC FIP INFRAESTRUTURA                              | 14.584.094/0001-06  | 10 II    | 7.654.731,76     | 135.694.247,13        | 15%                           | 5,64%        | ENQUADRADO    |
| CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - ECCO11                           | 10.625.626/0001-47  | 10 II    | 159.769,69       | 24.208.300,99         | 15%                           | 0,66%        | ENQUADRADO    |
| MAGAM SHOPPING FII                                                  | 16.685.929/0001-31  | #N/D     | (2.258.566,09)   | (76.895.725,23)       | 15%                           | 2,94%        | ENQUADRADO    |
| CAM THRONE FII                                                      | 21.862.783/0001-92  | #N/D     | 5.784.680,77     | 314.625.445,47        | 15%                           | 1,86%        | ENQUADRADO    |
| SO DOMINGOS FII - FISP11                                            | 16.343.210/0001-89  | 11 I     | 493.854,90       | 2.734.231,80          | 15%                           | 18,06%       | DESENGUADRADO |
| BR CAPITAL RENDA II FII - BRBD11                                    | 09.206.914/0001-34  | 11 I     | 2.147.304,36     | 77.507.048,08         | 15%                           | 3,00%        | ENQUADRADO    |
| AQUILA FII - AQU11                                                  | 13.555.918/0001-49  | 11 I     | 632.848,00       | 127.601.610,47        | 15%                           | 0,52%        | ENQUADRADO    |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11                        | 17.098.794/0001-70  | 11 I     | 8.749.466,49     | 143.176.703,64        | 15%                           | 6,11%        | ENQUADRADO    |
|                                                                     |                     |          | 6.406.400,00     | 144.265.006,25        | 15%                           | 4,44%        | ENQUADRADO    |

- ❖ Conforme Resolução 4.963/2021, em seu artigo 27 § 2º: "As aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento, previstos em seu regulamento, superiores ao previsto no caput, poderão ser mantidas em carteira, durante o respectivo prazo, desde que o regime próprio de previdência social demonstre a adoção de medidas de melhoria da governança e do controle de riscos na gestão das aplicações, conforme regulamentação estabelecida pela Secretaria de Previdência." (NR)



do setor agropecuário, as próximas leituras exibirão de forma mais clara os efeitos do aperto monetário sobre a atividade econômica do país. Projetamos crescimento de 2,1% do PIB de 2023.

O Banco Central americano (Fed) voltou a elevar a taxa de juros, levando-a para o intervalo entre 5,25% e 5,50%, conforme as expectativas. O comitê de política monetária (FOMC) reconheceu novamente a expansão moderada da atividade e o aperto do mercado de trabalho, além do nível elevado da inflação. O Comitê afirmou que a adoção de novos ajustes na taxa básica se dará mediante a análise dos novos indicadores, levando em conta o patamar já atingido e a defasagem com a qual a política monetária afeta a atividade econômica e a inflação.

PIB dos EUA teve avanço de 0,6% na margem, acima das expectativas do mercado de 0,4% e do avanço de 0,5% no trimestre anterior. Em termos de composição, destaque para o consumo das famílias, com alta de 0,4%, e para o investimento, que registrou crescimento de 1,4%, após queda de 3,1% no trimestre anterior. Em termos de inflação, o relatório de preços ao consumidor (PCE) indicou continuação do processo de desinflação no país em junho, embora o nível ainda se encontre distante da meta de 2%. O núcleo da inflação desacelerou na margem de maio para junho (de 0,3% para 0,2%) e na comparação interanual (de 4,6% para 4,1%). Já o índice do custo de emprego (ECI) teve avanço na margem de 1%, abaixo da expectativa (1,1%) e do avanço no trimestre anterior (1,2%). De modo geral, os dados mostram que a atividade segue resiliente, ao passo que a tendência de desinflação tem se consolidado.

Fonte: [economia@bram.bradesco.com.br](mailto:economia@bram.bradesco.com.br)

Em complemento à apresentação dos pontos mais importantes do cenário econômico mundial feito neste comentário, reproduzimos abaixo o Relatório FOCUS com base em pesquisa datada de 04 de Agosto de 2023, com as previsões do mercado para o final de 2023, final de 2024, final de 2025 e 2026, respectivamente:

## Focus

MEDIANAS DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

4 de agosto de 2023

|                                                                                                     | 2023             |                 |       |              | 2024             |                 |      |              | 2025             |                 |      |              | 2026             |                 |      |              |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------------|-------|--------------|------------------|-----------------|------|--------------|------------------|-----------------|------|--------------|------------------|-----------------|------|--------------|
|                                                                                                     | Set 23<br>última | Set 23<br>atual | Hoje  | Var. semanal | Set 23<br>última | Set 23<br>atual | Hoje | Var. semanal | Set 23<br>última | Set 23<br>atual | Hoje | Var. semanal | Set 23<br>última | Set 23<br>atual | Hoje | Var. semanal |
| IPCA (%)           | 4,95             | 4,84            | 4,84  | = (1)        | 3,92             | 3,89            | 3,88 | ▼ (3)        | 3,50             | = (2)           | 3,50 | = (5)        |                  |                 |      |              |
| PIB (var. %)       | 2,19             | 2,24            | 2,26  | ▲ (1)        | 1,28             | 1,30            | 1,30 | = (3)        | 1,90             | = (2)           | 2,00 | ▲ (1)        |                  |                 |      |              |
| CÂMBIO (R\$/US\$)  | 5,00             | 4,91            | 4,90  | ▼ (3)        | 5,06             | 5,00            | 5,00 | = (1)        | 5,08             | = (1)           | 5,10 | = (1)        |                  |                 |      |              |
| SELIC (% a.a.)    | 12,00            | 12,00           | 11,75 | ▼ (1)        | 9,50             | 9,25            | 9,00 | ▼ (2)        | 8,50             | ▼ (2)           | 8,50 | = (1)        |                  |                 |      |              |

\* comportamento dos indicadores desde o último Focus, os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade em relação ao Focus anterior

Matheus Henrique de Andrade  
Divisão de Investimentos e Financeiro

Bruno Ferreira Cypriano  
Presidente