

# Relatório Analítico dos Investimentos

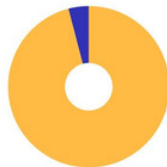
em agosto de 2023

## Carteira consolidada de investimentos - base (Ago / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	160.444.299,91	21,28%	686	2,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	20.153.304,43	2,67%	623	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	99.708.153,22	13,22%	1.128	1,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	20.180.981,36	2,68%	577	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	40.025.975,09	5,31%	300	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.448.075,40	1,25%	110	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	71.113.201,12	9,43%	793	1,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	100.185.446,96	13,29%	1.188	1,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	13.076.547,92	1,73%	409	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	46.490.193,32	6,17%	996	1,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	89.922.061,79	11,92%	1.116	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	4.125.974,11	0,55%	360	0,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	41.899.599,20	5,56%	989	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.567.891,62	0,21%	213	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	D+3 ou ...	90 dias	975.573,01	0,13%	19	19,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	Não se ...	27 meses	4.078.354,01	0,54%	13	12,10%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	30.688.322,77	4,07%	5.567	1,98%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>754.083.955,24</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>47.433,82</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>754.131.389,06</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	754.083.955,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	534.335.985,41	70,86%	20,00%	26,00%	100,00%	219.747.969,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	184.981.293,05	24,53%	10,00%	35,00%	60,00%	267.469.080,09
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	4.078.354,01	0,54%	1,00%	1,00%	5,00%	33.625.843,75
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	37.704.197,76
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>723.395.632,47</b>	<b>95,93%</b>	<b>31,00%</b>	<b>72,00%</b>	<b>270,00%</b>	



■ RENDA FIXA 723.395.632,47

■ ESTRUTURADOS 30.688.322,77

## Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	150.816.791,05
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	30.688.322,77	4,07%	0,00%	10,00%	10,00%	44.720.072,75
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	37.704.197,76
Artigo 11*	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	37.704.197,76
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>30.688.322,77</b>	<b>4,07%</b>	<b>0,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>40,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	75.408.395,52
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	75.408.395,52
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	75.408.395,52
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



■ 7º I b  
 ■ 7º III a  
 ■ 7º V a  
 ■ 10º I

## Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	476.924.969,12	63,25	-
CAIXA DTVM	270.537.167,48	35,88	-
GENIAL GESTÃO LTDA	4.078.354,01	0,54	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.567.891,62	0,21	-
BRZ INVESTIMENTOS	975.573,01	0,13	-

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

## Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	1,15%	9,05%	3,44%	6,81%	13,74%	24,03%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	8,92%	3,38%	6,69%	13,51%	23,50%	0,18%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	8,82%	3,37%	6,66%	13,40%	23,37%	0,18%	0,00%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,38%	11,84%	2,83%	10,43%	13,76%	20,07%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,74%	6,14%	0,10%	7,79%	7,55%	7,05%	4,30%	0,07%
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	-3,32%	-51,61%	-3,77%	-50,53%	-54,28%	-58,00%	3,64%	0,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	11,65%	2,71%	10,26%	13,45%	19,42%	1,74%	0,05%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,76%	11,43%	3,81%	9,56%	14,96%	22,06%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	11,33%	3,76%	9,45%	14,84%	21,77%	1,04%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	11,10%	3,63%	9,30%	14,47%	21,30%	1,05%	0,03%

<b>CDI (Benchmark)</b>	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05%	8,15%	3,07%	6,14%	12,44%	22,66%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,24%	8,97%	3,54%	6,94%	13,76%	25,76%	0,03%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	10,75%	3,67%	8,97%	14,02%	22,87%	0,10%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,05%	7,80%	3,06%	5,94%	11,81%	21,38%	0,00%	0,00%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	-0,31%	-2,53%	-0,94%	-1,95%	20,87%	13,30%	0,01%	0,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,16%	8,81%	3,35%	6,69%	13,54%	25,45%	0,02%	0,00%

## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - RENDA FIXA

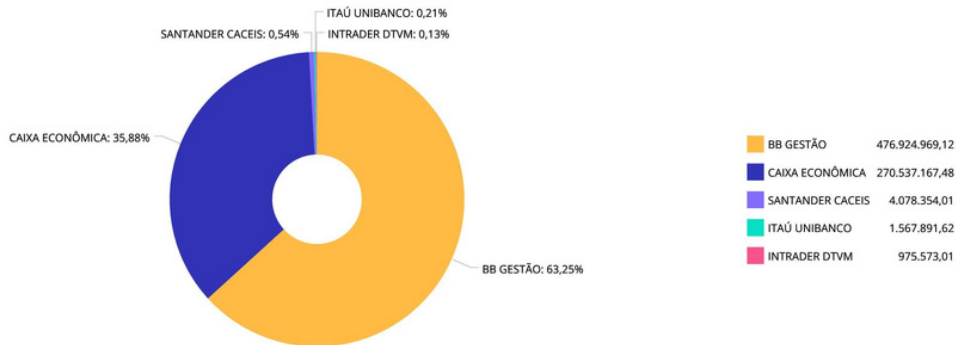
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,23%	3,23%	0,27%	1,83%	4,61%	13,74%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-	2,95%	-	-	-	0,62%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,63%	9,92%	3,67%	7,75%	13,76%	23,41%	0,58%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,37%	11,68%	3,52%	9,87%	12,79%	24,05%	1,25%	0,04%

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

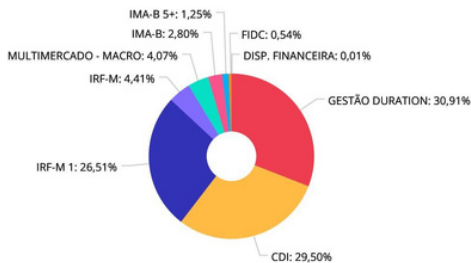
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,39%	7,82%	2,92%	6,69%	11,19%	19,74%	1,49%	0,04%



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



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

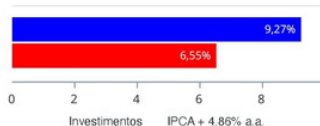


■ GESTÃO DURATION	233.125.392,65	■ CDI	222.463.803,51	■ IRF-M 1	199.893.600,18	■ IRF-M	33.257.529,28
■ MULTIMERCADO - MACRO	30.688.322,77	■ IMA-B	21.128.877,44	■ IMA-B 5+	9.448.075,40	■ FIDC	4.078.354,01
■ DISP. FINANCEIRA	47.433,82						

## Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

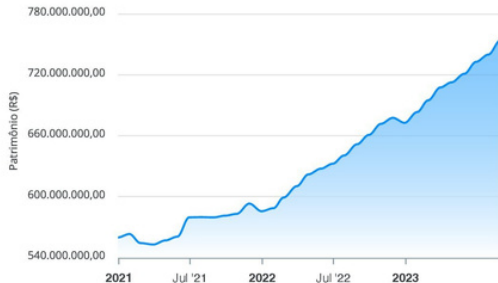
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	672.505.866,17	13.549.307,27	9.281.407,84	683.149.352,19	6.375.586,59	6.375.586,59	0,94%	0,94%	0,95%	0,95%	99,44%	0,78%
Fevereiro	683.149.352,19	26.366.792,04	20.929.406,19	694.673.038,37	6.086.300,33	12.461.886,92	0,88%	1,83%	1,18%	2,14%	85,67%	0,72%
Março	694.673.038,37	23.749.131,46	21.086.147,90	707.203.889,05	9.867.867,12	22.329.754,04	1,42%	3,28%	1,15%	3,31%	98,87%	0,47%
Abril	707.203.889,05	18.371.680,35	19.480.875,28	712.159.806,51	6.065.112,39	28.394.866,43	0,86%	4,16%	0,95%	4,30%	96,86%	0,55%
Mai	712.159.806,51	92.141.406,52	94.153.067,66	720.620.011,56	10.471.866,19	38.866.732,62	1,47%	5,69%	0,65%	4,97%	114,55%	0,41%
Junho	720.620.011,56	20.426.580,99	18.710.227,03	732.956.710,41	10.620.344,89	49.487.077,51	1,47%	7,25%	0,32%	5,30%	136,69%	0,53%
Julho	732.956.710,41	16.846.202,57	16.944.398,70	740.051.360,28	7.192.846,00	56.679.923,51	0,98%	8,30%	0,52%	5,85%	141,98%	0,45%
Agosto	740.051.360,28	33.088.955,32	25.787.566,82	754.083.955,24	6.731.206,46	63.411.129,97	0,90%	9,27%	0,67%	6,55%	141,61%	0,38%

## Investimentos x Meta de Rentabilidade



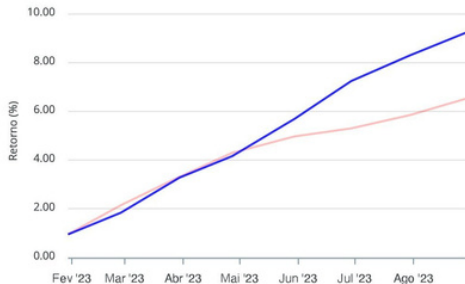
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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