

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

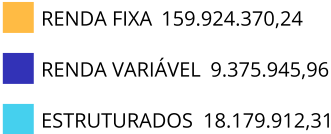
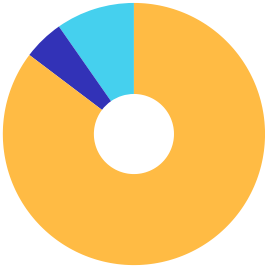
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	12.297.319,49	6,56%	685	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	10.038.598,37	5,35%	903	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	2.098.998,50	1,12%	370	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.917.509,12	1,56%	85	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.144.376,11	0,61%	303	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.737.523,07	4,66%	873	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.306.914,66	3,90%	1.185	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	35.641.967,79	19,01%	721	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	628.411,16	0,34%	213	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.519.846,62	0,81%	999	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.753.327,71	2,54%	246	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.518.887,42	2,94%	157	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	35.249.035,46	18,80%	1.116	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	7.691.756,48	4,10%	152	1,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	22.512.292,15	12,01%	226	0,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	618.601,44	0,33%	71	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.249.004,69	0,67%	114	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	1.417.073,38	0,76%	20.043	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.510.716,80	4,01%	1.399	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	448.155,78	0,24%	17	0,30%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.367.888,24	4,46%	5.373	0,55%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.812.024,07	5,23%	5.458	1,72%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			187.480.228,51				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Setembro / 2023)

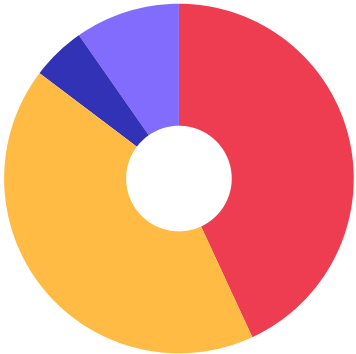
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	19,72%	26,29%	81,95%	153.640.047,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	80.811.618,27	43,10%	20,48%	27,30%	81,95%	72.828.428,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	79.112.751,97	42,20%	20,92%	27,90%	60,00%	33.375.385,14
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	37.496.045,70
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	3,75%	5,00%	5,00%	9.374.011,43
Total Renda Fixa	100,00%	159.924.370,24	85,30%	64,87%	86,49%	248,90%	



Enquadramento e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	9.375.945,96	5,00%	1,89%	2,51%	20,00%	28.120.099,74
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	9.374.011,43
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	18.179.912,31	9,70%	3,75%	4,00%	10,00%	568.110,54
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	27.555.858,27	14,70%	5,64%	7,51%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,75%	5,00%	10,00%	18.748.022,85
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	3,75%	5,00%	10,00%	



7º I b 7º III a 8º I 10º I

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	93.522.986,09	49,88	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	80.403.803,75	42,89	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	10.609.265,60	5,66	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.867.606,13	1,00	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	628.411,16	0,34	-
ITAÚ DTVM	448.155,78	0,24	-

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	19,72	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	80.811.618,27	43,10	20,48	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	79.112.751,97	42,20	20,92	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	3,75	5,00
Artigo 8º, Inciso I	9.375.945,96	5,00	1,89	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	18.179.912,31	9,70	3,75	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,75	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,11%	12,17%	1,95%	7,48%	13,59%	21,87%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,03%	11,76%	1,79%	7,27%	12,92%	20,66%	1,32%	0,04%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	8,97%	2,05%	4,08%	11,42%	21,35%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	8,59%	1,91%	4,04%	11,22%	20,92%	0,85%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	8,79%	2,06%	4,24%	11,36%	20,79%	0,74%	0,02%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	9,92%	3,12%	6,37%	13,31%	24,16%	0,07%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	0,11%	8,63%	1,64%	4,15%	11,28%	21,03%	0,99%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,94%	0,43%	1,87%	5,73%	8,35%	0,33%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,58%	-0,66%	6,49%	10,77%	18,43%	2,54%	0,05%

CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	11,72%	2,73%	7,91%	13,59%	23,82%	0,14%	0,02%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,00%	9,45%	3,30%	6,60%	12,99%	25,78%	0,03%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	9,87%	3,22%	6,49%	13,40%	26,08%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,12%	2,96%	5,95%	12,33%	23,32%	0,01%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,96%	9,74%	3,16%	6,34%	13,18%	25,23%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	9,91%	3,16%	6,49%	13,34%	25,92%	0,03%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,82%	3,09%	4,58%	11,76%	-	0,33%	0,02%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,19%	9,05%	1,21%	5,61%	11,22%	21,04%	0,85%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,30%	11,35%	0,97%	6,94%	10,76%	22,65%	1,61%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,14%	11,18%	1,58%	7,35%	12,82%	22,74%	0,98%	0,03%

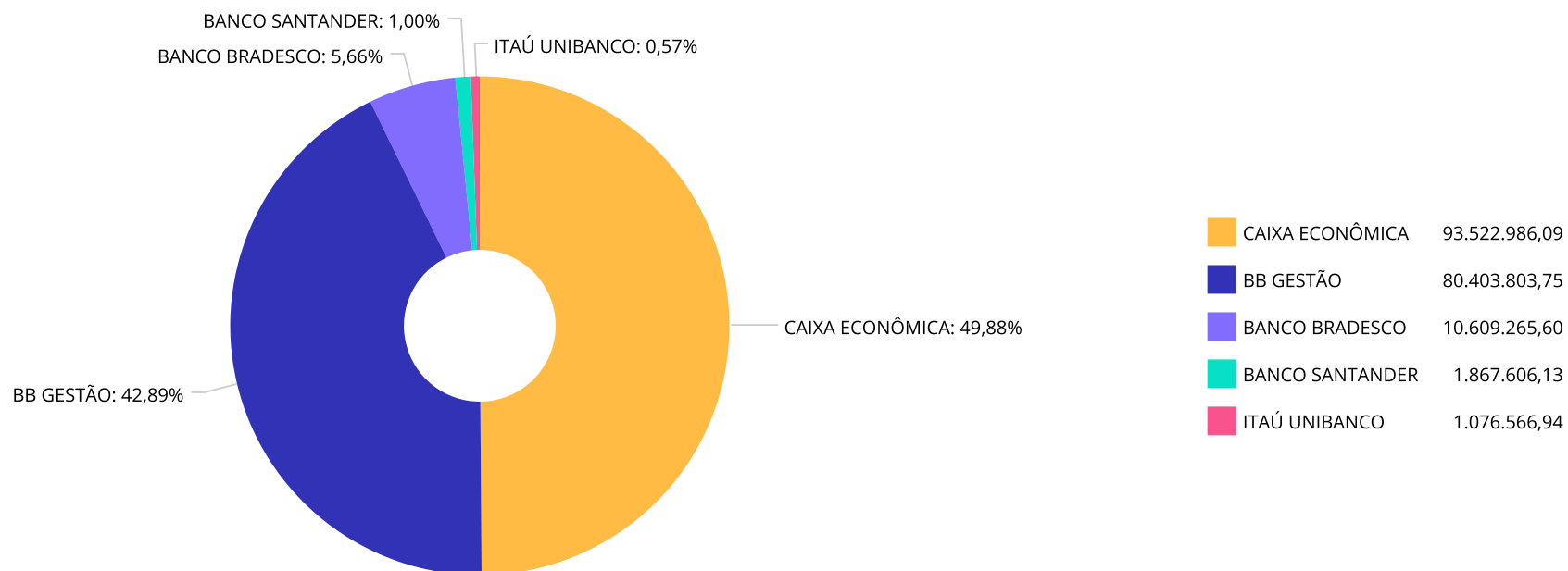
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	8,36%	1,59%	6,08%	10,18%	21,24%	1,92%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,90%	8,06%	1,93%	7,76%	9,73%	20,93%	2,15%	0,06%

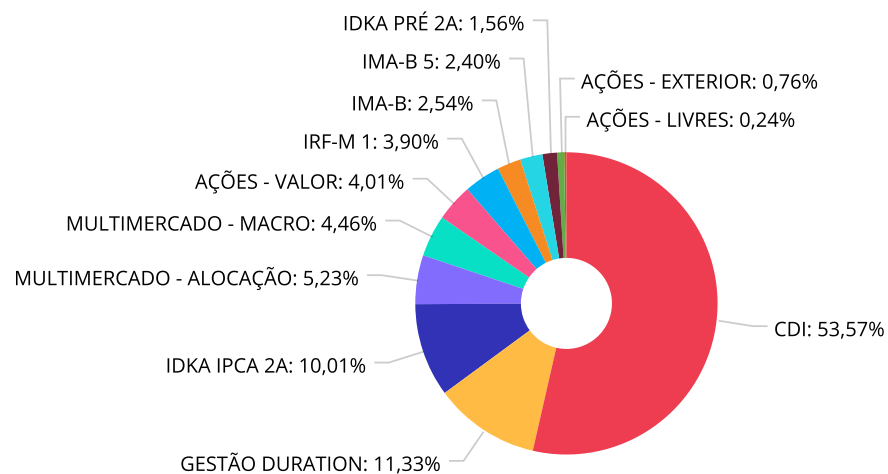
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-0,74%	3,84%	-3,36%	12,23%	-0,73%	-12,46%	7,60%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26%	2,02%	-1,96%	10,30%	-0,01%	-4,02%	7,72%	0,20%

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-4,87%	11,68%	-3,65%	4,35%	19,59%	-0,45%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-4,67%	13,72%	-2,27%	5,40%	23,45%	10,63%	4,87%	0,16%

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



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

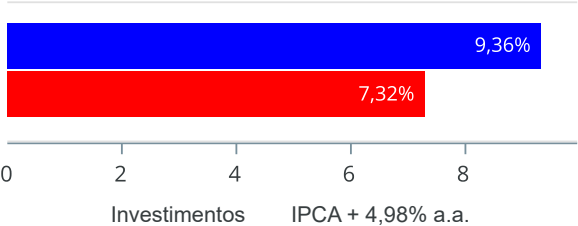


CDI	100.442.029,44	GESTÃO DURATION	21.236.088,57	IDKA IPCA 2A	18.776.121,44	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	9.812.024,07
MULTIMERCADO - MACRO	8.367.888,24	AÇÕES - VALOR	7.510.716,80	IRF-M 1	7.306.914,66	IMA-B	4.753.327,71
IMA-B 5	4.492.379,30	IDKA PRÉ 2A	2.917.509,12	AÇÕES - EXTERIOR	1.417.073,38	AÇÕES - LIVRES	448.155,78

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

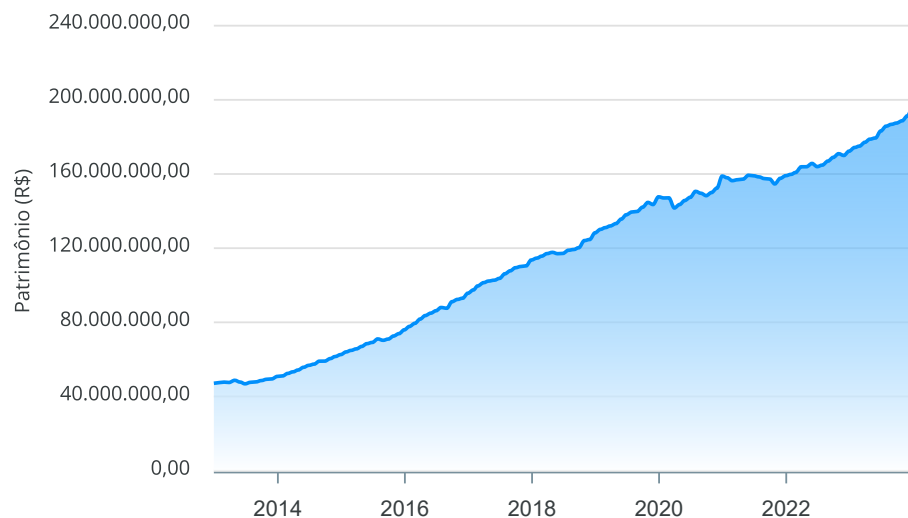
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	172.310.671,63	27.191.826,50	27.088.784,08	174.304.483,26	1.890.769,21	1.890.769,21	1,10%	1,10%	0,96%	0,96%	114,54%	1,45%
Fevereiro	174.304.483,26	1.631.294,00	1.571.334,60	175.050.314,98	685.872,32	2.576.641,53	0,39%	1,49%	1,19%	2,16%	69,20%	1,32%
Março	175.050.314,98	22.645.926,89	22.650.727,65	177.098.808,11	2.053.293,89	4.629.935,42	1,17%	2,68%	1,16%	3,34%	80,33%	0,90%
Abril	177.098.808,11	1.548.842,84	1.541.125,04	178.771.813,69	1.665.287,78	6.295.223,20	0,94%	3,65%	0,96%	4,33%	84,22%	0,89%
Maiο	178.771.813,69	120.034,81	1.868.408,38	179.429.545,98	2.406.105,86	8.701.329,06	1,35%	5,05%	0,66%	5,02%	100,53%	0,78%
Junho	179.429.545,98	1.736.175,37	1.002.589,64	183.174.001,52	3.010.869,81	11.712.198,87	1,67%	6,80%	0,33%	5,36%	126,87%	0,84%
Julho	183.174.001,52	2.111.518,45	1.673.843,86	185.799.952,97	2.188.276,86	13.900.475,73	1,19%	8,07%	0,53%	5,92%	136,49%	0,80%
Agosto	185.799.952,97	1.822.154,64	1.783.702,89	186.797.666,46	959.261,74	14.859.737,47	0,52%	8,63%	0,68%	6,63%	130,18%	0,74%
Setembro	186.797.666,46	1.035.968,01	1.614.383,05	187.480.228,51	1.260.977,09	16.120.714,56	0,68%	9,36%	0,65%	7,32%	127,92%	0,81%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



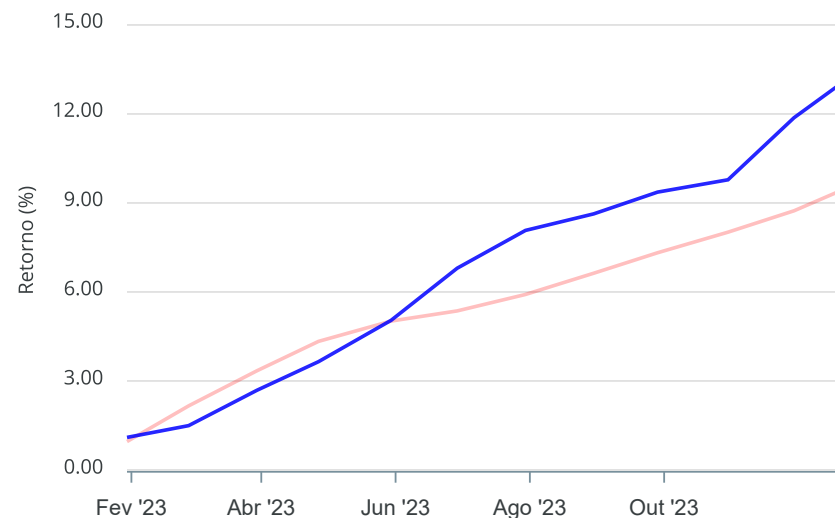
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.076.194,99	0,00	0,00	2.098.998,50	22.803,51	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.131.946,11	0,00	0,00	1.144.376,11	12.430,00	1,10%	1,10%	0,33%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	5.464.460,12	0,00	0,00	5.518.887,42	54.427,30	1,00%	1,00%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	34.910.410,75	0,00	0,00	35.249.035,46	338.624,71	0,97%	0,97%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	22.299.064,21	0,00	0,00	22.512.292,15	213.227,94	0,96%	0,96%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.305.306,44	0,00	0,00	35.641.967,79	336.661,35	0,95%	0,95%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.241.077,55	0,00	0,00	7.306.914,66	65.837,11	0,91%	0,91%	0,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	12.190.248,69	0,00	0,00	12.297.319,49	107.070,80	0,88%	0,88%	0,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.081.881,64	1.035.968,01	1.614.383,05	1.519.846,62	16.380,02	0,53%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.706.539,70	0,00	0,00	8.737.523,07	30.983,37	0,36%	0,36%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	10.017.391,44	0,00	0,00	10.038.598,37	21.206,93	0,21%	0,21%	0,85%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	617.449,37	0,00	0,00	618.601,44	1.152,07	0,19%	0,19%	0,85%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.681.166,94	0,00	0,00	7.691.756,48	10.589,54	0,14%	0,14%	0,98%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1.247.698,92	0,00	0,00	1.249.004,69	1.305,77	0,10%	0,10%	0,99%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.916.633,94	0,00	0,00	2.917.509,12	875,18	0,03%	0,03%	1,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	630.297,07	0,00	0,00	628.411,16	-1.885,91	-0,30%	-0,30%	1,61%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.800.060,06	0,00	0,00	4.753.327,71	-46.732,35	-0,97%	-0,97%	2,54%
Total Renda Fixa	159.317.827,94	1.035.968,01	1.614.383,05	159.924.370,24	1.184.957,34	0,74%		0,29%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	9.724.210,85	0,00	0,00	9.812.024,07	87.813,22	0,90%	0,90%	2,15%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.326.332,48	0,00	0,00	8.367.888,24	41.555,76	0,50%	0,50%	1,92%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7.491.308,78	0,00	0,00	7.510.716,80	19.408,02	0,26%	0,26%	7,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	451.487,80	0,00	0,00	448.155,78	-3.332,02	-0,74%	-0,74%	7,60%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.486.498,61	0,00	0,00	1.417.073,38	-69.425,23	-4,67%	-4,67%	4,87%
Total Renda Variável	27.479.838,52	0,00	0,00	27.555.858,27	76.019,75	0,28%		3,82%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Setembro / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2023**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	34.148.252,01	0,00	0,00	35.249.035,46	1.100.783,45	3,22%	3,22%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.550.205,69	0,00	0,00	35.641.967,79	1.091.762,10	3,16%	3,16%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	21.822.858,97	0,00	0,00	22.512.292,15	689.433,18	3,16%	3,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.970.729,75	0,00	0,00	12.297.319,49	326.589,74	2,73%	2,73%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.085.626,48	0,00	0,00	7.306.914,66	221.288,18	3,12%	3,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.850.958,66	0,00	0,00	10.038.598,37	187.639,71	1,90%	1,90%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	5.342.389,23	0,00	0,00	5.518.887,42	176.498,19	3,30%	3,30%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.561.196,15	0,00	0,00	8.737.523,07	176.326,92	2,06%	2,06%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.489.727,01	83.241,33	0,00	7.691.756,48	118.788,14	1,57%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.093.224,54	0,00	58.086,45	2.098.998,50	63.860,41	3,05%	3,09%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.866.141,89	0,00	0,00	2.917.509,12	51.367,23	1,79%	1,79%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.597.331,32	4.857.220,77	4.984.664,35	1.519.846,62	49.958,88	0,77%	2,96%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.110.151,94	29.179,00	29.179,00	1.144.376,11	34.224,17	3,00%	0,43%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1.228.907,02	0,00	0,00	1.249.004,69	20.097,67	1,64%	1,64%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	611.209,19	0,00	0,00	618.601,44	7.392,25	1,21%	1,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	622.382,22	0,00	0,00	628.411,16	6.028,94	0,97%	0,97%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.785.104,47	0,00	0,00	4.753.327,71	-31.776,76	-0,66%	-0,66%
Total Renda Fixa	155.736.396,54	4.969.641,10	5.071.929,80	159.924.370,24	4.290.262,40	2,67%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	9.626.089,61	0,00	0,00	9.812.024,07	185.934,46	1,93%	1,93%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.236.958,96	0,00	0,00	8.367.888,24	130.929,28	1,59%	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	463.733,85	0,00	0,00	448.155,78	-15.578,07	-3,36%	-3,36%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.450.037,07	0,00	0,00	1.417.073,38	-32.963,69	-2,27%	-2,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7.660.785,49	0,00	0,00	7.510.716,80	-150.068,69	-1,96%	-1,96%
Total Renda Variável	27.437.604,98	0,00	0,00	27.555.858,27	118.253,29	0,43%	

Disclaimer

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

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

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

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

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

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

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

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

