

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	2.343.590,81	6,23%	685	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.707.054,02	4,53%	903	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.577.791,63	4,19%	794	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.278.341,63	6,05%	89	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	103.467,96	0,27%	370	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	4.089.516,12	10,86%	94	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.813.512,74	12,79%	239	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.176.500,64	3,13%	873	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.864.313,99	4,95%	933	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.020.540,37	5,37%	247	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.464.664,96	3,89%	40	0,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	723.857,28	1,92%	65	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	203.224,18	0,54%	121	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	99.955,72	0,27%	55.068	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.097.148,80	10,88%	149	0,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.252.648,12	3,33%	404	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.730.967,43	4,60%	426	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	55.362,58	0,15%	426	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.006.945,06	5,33%	78	0,43%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	525.843,22	1,40%	568	0,16%	Artigo 8º, Inciso I

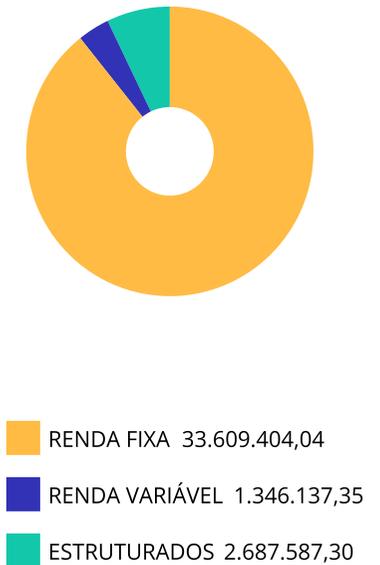


Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRANCO H IBOVESPA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC A...	D+5	Não há	47.408,29	0,13%	9	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	458.881,48	1,22%	1.003	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	314.004,36	0,83%	35	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.951.693,35	5,18%	178	0,59%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	735.893,95	1,95%	2.895	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			37.643.128,69				

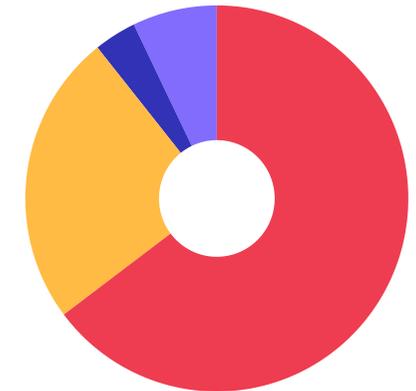
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2023)

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%	0,00%	0,00%	50,00%	18.821.564,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	24.366.376,33	64,73%	0,00%	67,00%	100,00%	13.276.752,36
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	50,00%	18.821.564,35
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.882.156,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	9.243.027,71	24,55%	0,00%	27,00%	60,00%	13.342.849,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	22.585.877,21
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	7.528.625,74
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.882.156,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.882.156,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.882.156,43
Total Renda Fixa	100,00%	33.609.404,04	89,28%	0,00%	94,00%	360,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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%	1.346.137,35	3,58%	0,00%	1,50%	30,00%	9.946.801,26
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	7.528.625,74
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.687.587,30	7,14%	0,00%	4,50%	10,00%	1.076.725,57
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.882.156,43
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.882.156,43
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.882.156,43
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	4.033.724,65	10,72%	0,00%	6,00%	75,00%	



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%	3.764.312,87
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.764.312,87
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.764.312,87
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	

■ 7º I b
 ■ 7º III a
 ■ 8º I
 ■ 10º I



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.300.234,07	37,99	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.587.738,34	28,13	-
CAIXA DTVM	8.042.460,44	21,37	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.730.802,34	7,25	-
ITAÚ UNIBANCO	1.464.664,96	3,89	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	314.004,36	0,83	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	203.224,18	0,54	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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)



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 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%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	0,23%	8,74%	1,95%	4,17%	11,27%	20,66%	0,84%	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)	-0,15%	12,82%	1,26%	8,24%	14,06%	22,31%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,18%	12,55%	1,18%	8,11%	13,58%	21,42%	1,57%	0,05%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,20%	12,46%	1,16%	8,08%	13,47%	21,49%	1,58%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	9,91%	3,13%	6,40%	13,31%	24,18%	0,06%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,90%	9,93%	3,16%	6,40%	13,35%	24,28%	0,06%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,11%	8,75%	1,65%	4,25%	11,41%	21,41%	0,99%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	8,79%	1,67%	4,28%	11,46%	21,66%	0,98%	0,02%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,10%	8,69%	1,63%	4,20%	11,31%	21,09%	0,99%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,97%	10,54%	-0,60%	6,39%	10,71%	18,31%	2,53%	0,05%



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
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,26%	10,64%	-0,98%	6,42%	10,10%	16,54%	2,73%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,97%	9,79%	3,17%	6,38%	13,28%	25,59%	0,01%	0,00%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,31%	3,54%	6,88%	13,98%	27,19%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	10,15%	3,42%	6,85%	13,67%	26,52%	0,02%	0,00%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	2,43%	10,33%	5,47%	7,26%	13,60%	-	1,21%	0,02%
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%
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%

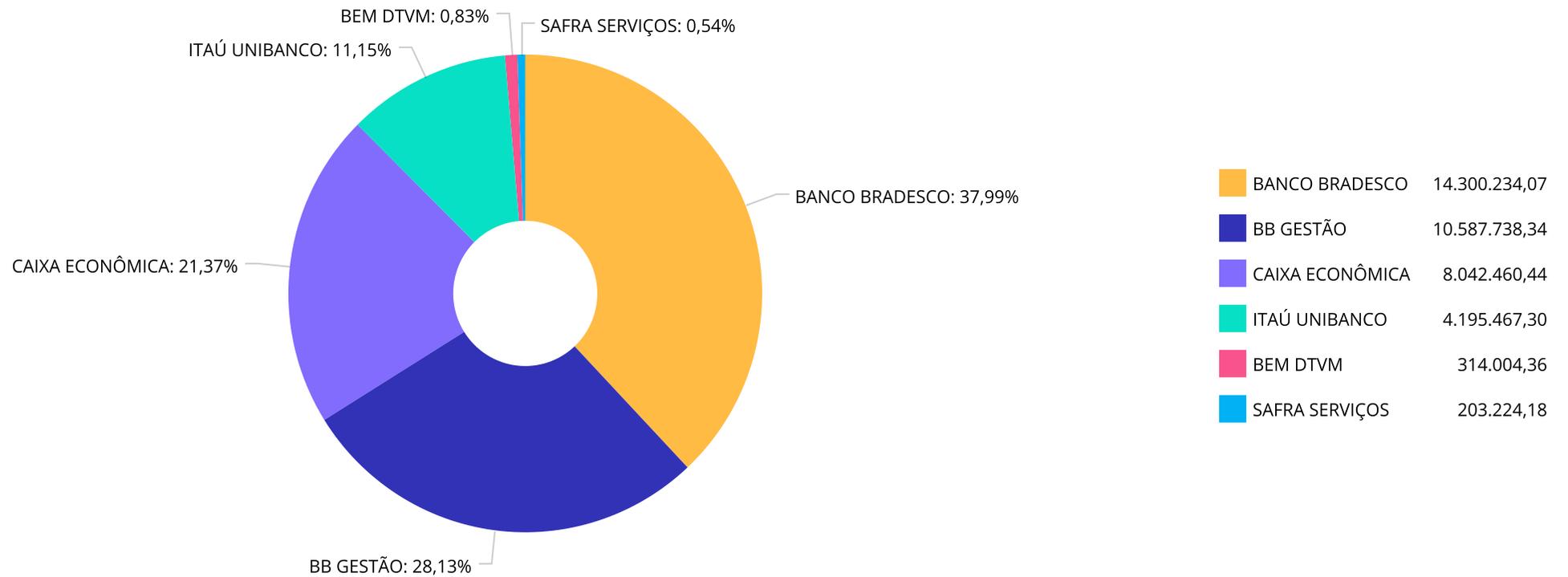


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,86%	9,52%	2,78%	6,24%	12,70%	26,54%	0,12%	0,00%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	9,25%	2,52%	5,77%	12,29%	24,46%	0,54%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,71%	6,76%	0,19%	14,05%	4,84%	4,66%	7,65%	0,19%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01%	6,08%	-1,83%	14,99%	1,58%	-6,60%	7,55%	0,20%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	-1,13%	4,09%	-3,27%	11,56%	1,22%	10,10%	7,28%	0,20%
BRADESCO H IBOVESPA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC AÇÕES	-0,76%	3,00%	-3,79%	14,52%	-3,65%	-13,44%	7,83%	0,22%

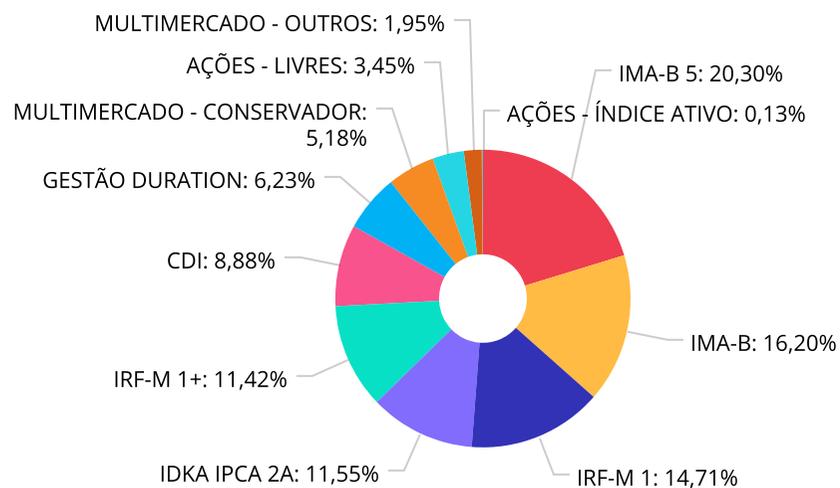


Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2023)





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

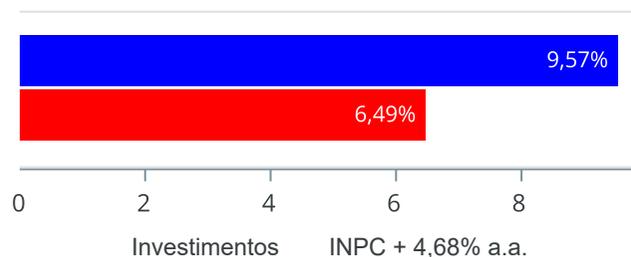


IMA-B 5	7.642.722,38	IMA-B	6.096.461,18	IRF-M 1	5.537.370,02
IDKA IPCA 2A	4.348.219,62	IRF-M 1+	4.298.882,00	CDI	3.342.158,03
GESTÃO DURATION	2.343.590,81	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.951.693,35	AÇÕES - LIVRES	1.298.729,06
MULTIMERCADO - OUTROS	735.893,95	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	47.408,29		

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	37.053.175,51	760.208,24	1.138.626,77	37.031.619,18	356.862,20	356.862,20	0,96%	0,96%	0,86%	0,86%	111,74%	1,43%
Fevereiro	37.031.619,18	944.140,34	1.130.205,36	37.226.681,04	381.126,88	737.989,08	1,03%	2,00%	1,10%	1,97%	101,57%	1,27%
Março	37.226.681,04	981.944,28	1.245.723,88	37.542.509,28	579.607,84	1.317.596,92	1,56%	3,59%	1,06%	3,05%	117,60%	0,96%
Abril	37.542.509,28	1.380.668,60	1.631.523,28	37.673.657,97	382.003,37	1.699.600,29	1,02%	4,64%	0,86%	3,94%	117,93%	0,86%
Mai	37.673.657,97	909.292,30	1.161.321,22	37.924.775,24	503.146,19	2.202.746,48	1,34%	6,04%	0,76%	4,73%	127,74%	0,88%
Junho	37.924.775,24	1.114.389,42	1.359.641,12	38.308.257,99	628.734,45	2.831.480,93	1,66%	7,80%	0,28%	5,02%	155,24%	1,11%
Julho	38.308.257,99	965.598,06	1.243.420,65	38.419.136,79	388.701,39	3.220.182,32	1,01%	8,89%	0,29%	5,33%	166,84%	1,01%
Agosto	38.419.136,79	941.555,34	1.176.616,58	38.351.957,39	167.881,84	3.388.064,16	0,44%	9,37%	0,62%	5,98%	156,61%	1,04%
Setembro	38.351.957,39	407.166,06	1.187.263,12	37.643.128,69	71.268,36	3.459.332,52	0,19%	9,57%	0,47%	6,49%	147,61%	1,22%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





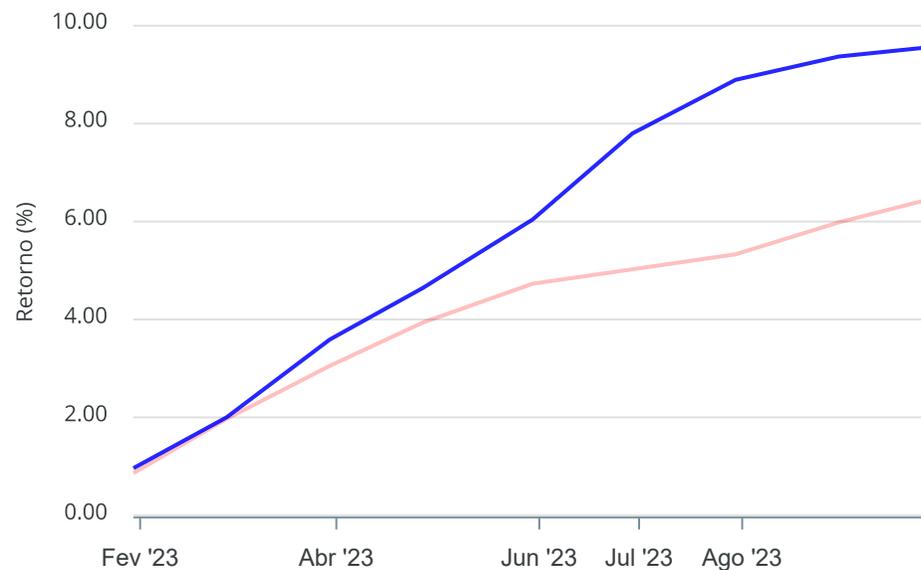
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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



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
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	76.056,87	0,00	0,00	1.730.967,43	1.654.910,56	2.175,89%	1,02%	0,02%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	97.582,05	0,00	0,00	99.955,72	2.373,67	2,43%	2,43%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	102.343,89	0,00	0,00	103.467,96	1.124,07	1,10%	1,10%	0,33%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.239.639,39	0,00	0,00	1.252.648,12	13.008,73	1,05%	1,05%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1.713.515,40	0,00	0,00	1.730.967,43	17.452,03	1,02%	1,02%	0,02%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	201.281,28	0,00	0,00	203.224,18	1.942,90	0,97%	0,97%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	717.005,91	0,00	0,00	723.857,28	6.851,37	0,96%	0,90%	0,06%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.769.882,02	0,00	0,00	4.813.512,74	43.630,72	0,91%	0,91%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.984.825,05	340.491,25	0,00	2.343.590,81	18.274,51	0,79%	0,88%	0,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.172.328,74	0,00	0,00	1.176.500,64	4.171,90	0,36%	0,36%	0,74%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	1.461.240,72	0,00	0,00	1.464.664,96	3.424,24	0,23%	0,23%	0,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.868.949,93	0,00	1.165.805,87	1.707.054,02	3.909,96	0,14%	0,21%	0,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.862.229,93	0,00	0,00	1.864.313,99	2.084,06	0,11%	0,11%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.576.039,84	0,00	0,00	1.577.791,63	1.751,79	0,11%	0,11%	0,99%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	4.093.037,63	0,00	0,00	4.097.148,80	4.111,17	0,10%	0,10%	0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.024.141,33	0,00	0,00	2.020.540,37	-3.600,96	-0,18%	-0,18%	1,57%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.282.840,30	0,00	0,00	2.278.341,63	-4.498,67	-0,20%	-0,20%	1,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	4.129.689,04	0,00	0,00	4.089.516,12	-40.172,92	-0,97%	-0,97%	2,53%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2.032.590,56	0,00	0,00	2.006.945,06	-25.645,50	-1,26%	-1,26%	2,73%
Total Renda Fixa	34.405.219,88	340.491,25	1.165.805,87	35.285.008,89	1.705.103,63	4,96%		0,98%



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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	729.649,69	0,00	0,00	735.893,95	6.244,26	0,86%	0,86%	0,12%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.935.562,37	0,00	0,00	1.951.693,35	16.130,98	0,83%	0,83%	0,54%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	476.316,16	47.115,36	0,00	525.843,22	2.411,70	0,46%	0,71%	7,65%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	439.847,56	19.559,45	0,00	458.881,48	-525,53	-0,11%	-0,01%	7,55%
BRADESCO H IBOVESPA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC AÇÕ...	47.769,95	0,00	0,00	47.408,29	-361,66	-0,76%	-0,76%	7,83%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	317.591,78	0,00	0,00	314.004,36	-3.587,42	-1,13%	-1,13%	7,28%
Total Renda Variável	3.946.737,51	66.674,81	0,00	4.033.724,65	20.312,33	0,51%		2,80%



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
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	125.558,19	0,00	73.541,49	1.730.967,43	1.678.950,73	1.337,19%	3,42%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.667.440,65	0,00	0,00	4.813.512,74	146.072,09	3,13%	3,13%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1.673.707,68	0,00	73.541,49	1.730.967,43	130.801,24	7,82%	3,42%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	4.031.276,06	0,00	0,00	4.097.148,80	65.872,74	1,63%	1,63%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.949.082,82	340.491,25	0,00	2.343.590,81	54.016,74	2,36%	2,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.406.815,88	0,00	2.283.122,47	1.176.500,64	52.807,23	1,55%	2,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.821.284,09	0,00	1.165.805,87	1.707.054,02	51.575,80	1,83%	1,90%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.209.814,09	0,00	0,00	1.252.648,12	42.834,03	3,54%	3,54%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	1.436.677,04	0,00	0,00	1.464.664,96	27.987,92	1,95%	1,95%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.252.278,85	0,00	0,00	2.278.341,63	26.062,78	1,16%	1,16%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.552.189,78	0,00	0,00	1.577.791,63	25.601,85	1,65%	1,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	701.857,63	0,00	0,00	723.857,28	21.999,65	3,13%	3,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.087.970,30	912.106,62	0,00	2.020.540,37	20.463,45	1,02%	1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.166.628,16	678.646,33	0,00	1.864.313,99	19.039,50	1,03%	1,67%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	94.772,24	0,00	0,00	99.955,72	5.183,48	5,47%	5,47%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	125.558,19	0,00	73.541,49	55.362,58	3.345,88	2,66%	3,42%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	0,00	200.000,00	0,00	203.224,18	3.224,18	1,61%	3,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	103.183,34	0,00	2.863,31	103.467,96	3.147,93	3,05%	3,09%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2.026.774,96	0,00	0,00	2.006.945,06	-19.829,90	-0,98%	-0,98%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	4.114.223,68	0,00	0,00	4.089.516,12	-24.707,56	-0,60%	-0,60%
Total Renda Fixa	34.547.093,69	2.131.244,20	3.672.416,12	35.340.371,47	2.334.449,76	6,76%	



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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.903.713,06	0,00	0,00	1.951.693,35	47.980,29	2,52%	2,52%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	797.653,23	0,00	81.967,21	735.893,95	20.207,93	2,53%	2,78%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	398.139,05	128.559,58	0,00	525.843,22	-855,41	-0,16%	0,19%
BRADERCO H IBOVESPA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC AÇÕ...	49.273,44	0,00	0,00	47.408,29	-1.865,15	-3,79%	-3,79%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	413.329,30	54.515,68	0,00	458.881,48	-8.963,50	-1,92%	-1,83%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	324.614,47	0,00	0,00	314.004,36	-10.610,11	-3,27%	-3,27%
Total Renda Variável	3.886.722,55	183.075,26	81.967,21	4.033.724,65	45.894,05	1,15%	

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 & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

