

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

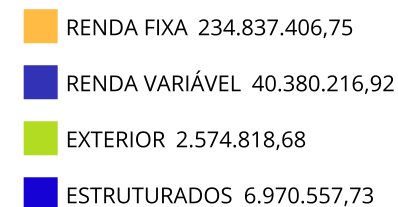
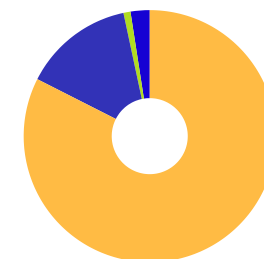
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			8.123.712,71	2,85%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	17.333.655,09	6,09%	685	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	23.701.506,09	8,32%	903	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.098.198,56	0,39%	638	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	13.423.376,20	4,71%	1.132	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	49444	14.099.285,01	4,95%	44	2,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	9.210.763,58	3,23%	370	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.862.211,78	0,65%	239	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.797.768,66	3,44%	303	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	5.048.334,55	1,77%	201	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	15.263.431,86	5,36%	794	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.795.786,41	3,44%	933	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	11.576.434,19	4,07%	782	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.454.740,07	5,78%	1.185	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	27.129.329,84	9,53%	426	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.359.406,96	1,53%	721	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIX...	D+0	Não há	272.142,23	0,10%	724	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	15.473.571,33	5,43%	1.116	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.823.338,47	0,64%	164	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.025.767,72	3,17%	404	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	1.611.797,81	0,57%	362	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.375.902,07	1,54%	229	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.464.143,34	1,92%	71	1,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	5.854.552,79	2,06%	467	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info	Não se aplica	2.658.249,43	0,93%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.412.760,45	0,85%	1.399	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	8.720.837,62	3,06%	19.831	0,65%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.856.278,74	3,11%	2.194	3,79%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	20.390.340,11	7,16%	123	3,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.574.818,68	0,90%	10.797	0,41%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	6.970.557,73	2,45%	6.682	0,45%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			284.763.000,08				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			86.194,12				Artigo 6º
PL Total			284.849.194,20				

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

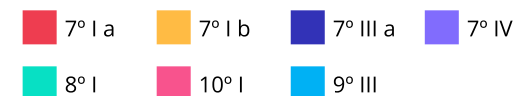
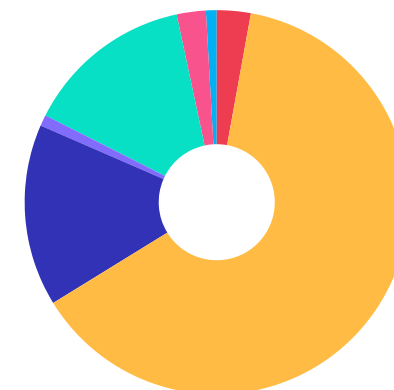
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	8.123.712,71	2,85%	2,75%	3,20%	85,12%	234.266.552,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	180.426.371,08	63,36%	40,00%	58,05%	85,12%	61.963.894,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	43.629.073,53	15,32%	14,75%	17,40%	60,00%	127.228.726,52
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	2.658.249,43	0,93%	0,00%	0,00%	20,00%	54.294.350,59
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	1,85%	5,00%	14.238.150,00
Total Renda Fixa	100,00%	234.837.406,75	82,47%	58,50%	80,50%	255,24%	



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%	40.380.216,92	14,18%	14,00%	16,35%	20,00%	16.572.383,10
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	6.970.557,73	2,45%	1,75%	2,40%	10,00%	21.505.742,28
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	47.350.774,65	16,63%	15,75%	18,75%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.574.818,68	0,90%	0,50%	0,75%	10,00%	25.901.481,33
Total Exterior	10,00%	2.574.818,68	0,90%	0,50%	0,75%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	141.630.109,00	49,74	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	108.048.772,61	37,94	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	14.249.087,79	5,00	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	12.711.317,97	4,46	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	8.123.712,71	2,85	-

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 '	8.123.712,71	2,85	2,75	85,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	180.426.371,08	63,36	40,00	85,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	43.629.073,53	15,32	14,75	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	1,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	40.380.216,92	14,18	14,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	2.574.818,68	0,90	0,50	10,00
Artigo 10º, Inciso I	6.970.557,73	2,45	1,75	10,00

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 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%
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%
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,81%	3,11%	6,35%	13,19%	24,03%	0,06%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
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%
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%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	10,65%	-0,53%	6,49%	10,76%	18,68%	2,51%	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-1,00%	10,71%	-0,52%	6,60%	10,65%	18,53%	2,59%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,56%	-0,64%	6,42%	10,75%	18,44%	2,52%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,17%	11,62%	1,83%	7,45%	13,57%	22,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	11,49%	1,77%	7,33%	13,46%	22,40%	1,12%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,97%	9,84%	3,19%	6,42%	13,31%	25,63%	0,01%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02%	10,12%	3,52%	6,89%	13,72%	26,84%	0,01%	0,00%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,93%	9,43%	3,07%	6,17%	12,75%	24,47%	0,02%	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%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,31%	3,54%	6,88%	13,98%	27,19%	0,03%	0,00%
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	8,77%	2,96%	5,82%	11,77%	22,06%	0,01%	0,00%
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%

IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,58%	-	-1,90%	-	-	-	3,59%	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	-	0,21%	-	-	-	0,33%	-

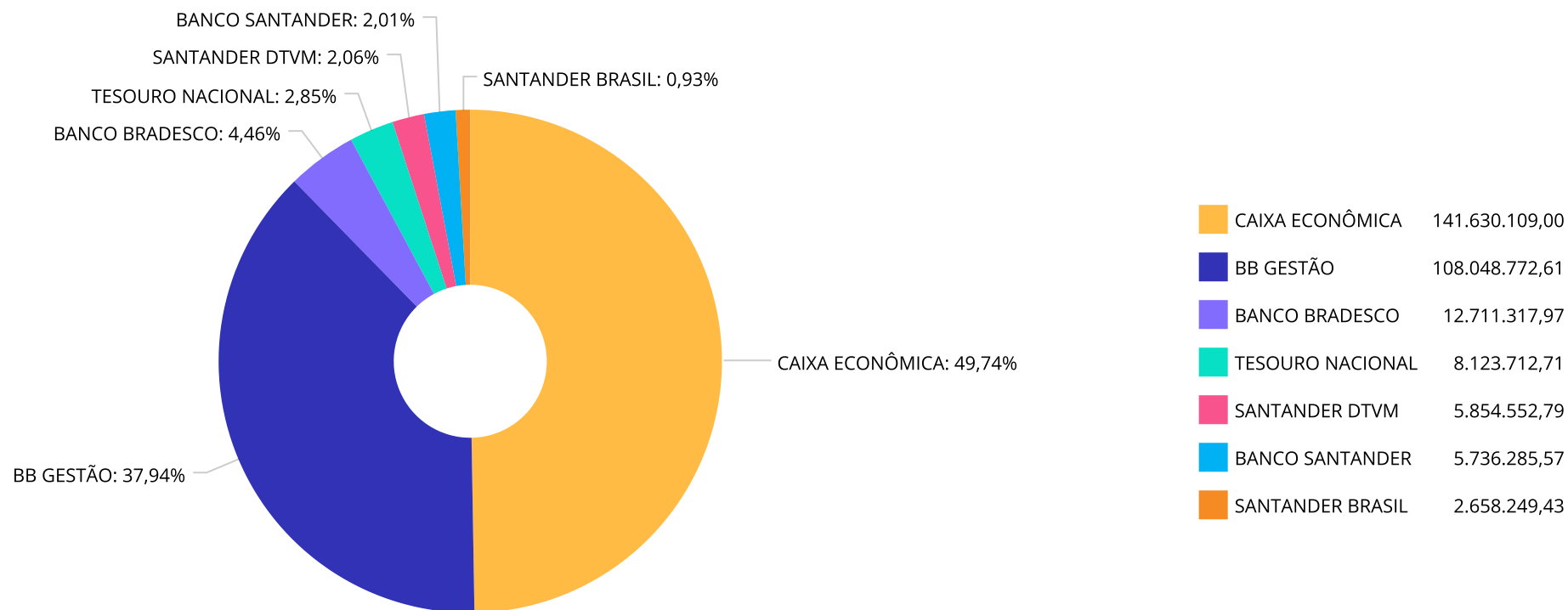
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26%	2,02%	-1,96%	10,30%	-0,01%	-4,02%	7,72%	0,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,47%	4,43%	-0,70%	13,47%	1,94%	0,42%	7,60%	0,20%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,08%	5,49%	-1,77%	13,76%	1,07%	3,72%	7,85%	0,21%
IDIV (Benchmark)	1,32%	10,67%	1,25%	15,38%	14,16%	22,39%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,25%	9,55%	1,01%	14,44%	12,73%	19,59%	6,11%	0,18%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,61%	4,13%	-0,05%	0,10%	9,93%	-14,78%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,46%	17,90%	-1,89%	8,34%	29,34%	17,35%	5,00%	0,17%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,68%	-12,05%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	0,20%

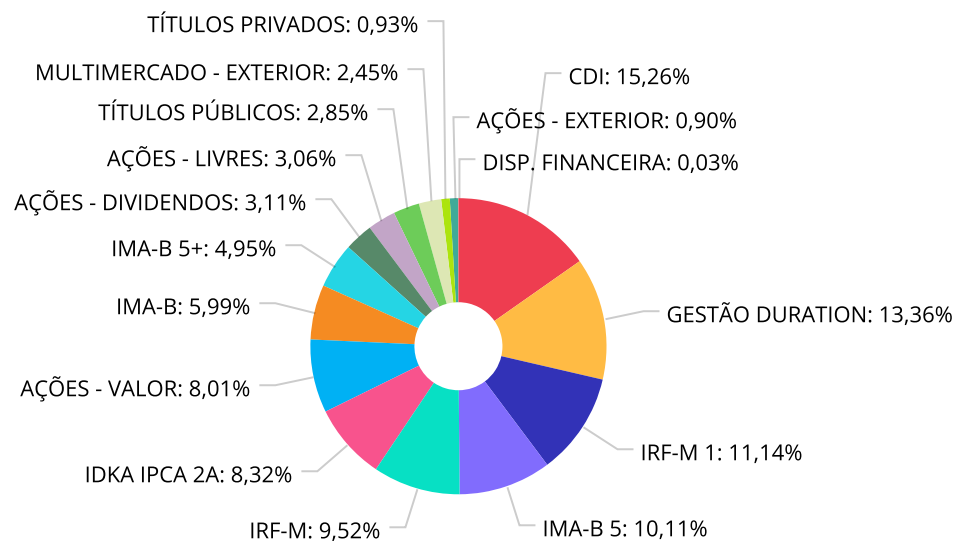
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,68%	-12,05%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	20,255%

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



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



■ CDI	43.468.911,86	■ GESTÃO DURATION	38.061.230,29	■ IRF-M 1	31.740.328,05	■ IMA-B 5	28.804.318,65
■ IRF-M	27.129.329,84	■ IDKA IPCA 2A	23.701.506,09	■ AÇÕES - VALOR	22.803.100,56	■ IMA-B	17.050.534,82
■ IMA-B 5+	14.099.285,01	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	8.856.278,74	■ AÇÕES - LIVRES	8.720.837,62	■ TÍTULOS PÚBLICOS	8.123.712,71
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.970.557,73	■ TÍTULOS PRIVADOS	2.658.249,43	■ AÇÕES - EXTERIOR	2.574.818,68	■ DISP. FINANCEIRA	86.194,12

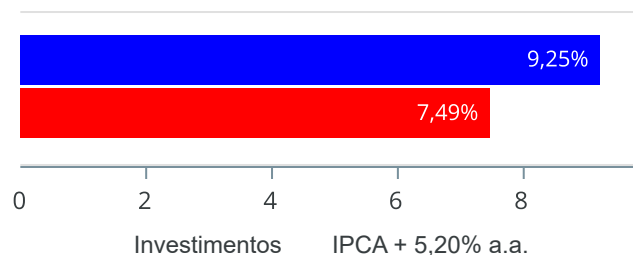
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	19/12/2003	500	1.320,355547	4.166,006524	660.177,77	2.083.003,26	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	09/09/2004	1.450	1.383,653728	4.166,006524	2.006.297,91	6.040.709,46	Mercado

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	253.978.503,41	2.168.241,45	1.611.000,00	258.681.437,20	4.145.692,34	4.145.692,34	1,63%	1,63%	0,98%	0,98%	166,90%	2,55%
Fevereiro	258.681.437,20	18.523.882,20	17.876.670,63	258.495.021,25	-833.627,52	3.312.064,82	-0,32%	1,30%	1,21%	2,19%	59,36%	2,35%
Março	258.495.021,25	2.255.934,64	1.818.600,00	261.145.280,34	2.212.924,45	5.524.989,27	0,85%	2,17%	1,18%	3,40%	63,83%	2,01%
Abril	261.145.280,34	5.321.971,39	4.375.440,17	265.160.070,20	3.068.258,64	8.593.247,91	1,17%	3,36%	0,97%	4,40%	76,38%	1,96%
Mai	265.160.070,20	21.270.754,61	20.509.166,26	269.797.431,54	3.875.772,99	12.469.020,90	1,46%	4,87%	0,67%	5,11%	95,34%	1,84%
Junho	269.797.431,54	7.473.598,73	7.578.657,20	276.753.050,62	7.060.677,55	19.529.698,45	2,62%	7,61%	0,34%	5,47%	139,23%	1,97%
Julho	276.753.050,62	2.508.559,98	1.794.924,57	281.224.679,39	3.757.993,36	23.287.691,81	1,35%	9,07%	0,54%	6,04%	150,14%	1,87%
Agosto	281.224.679,39	4.307.331,52	3.577.866,38	281.714.822,24	-239.322,29	23.048.369,52	-0,08%	8,98%	0,69%	6,78%	132,45%	1,92%
Setembro	281.714.822,24	2.525.287,17	1.790.500,00	283.155.538,70	705.929,29	23.754.298,81	0,25%	9,25%	0,66%	7,49%	123,55%	1,93%

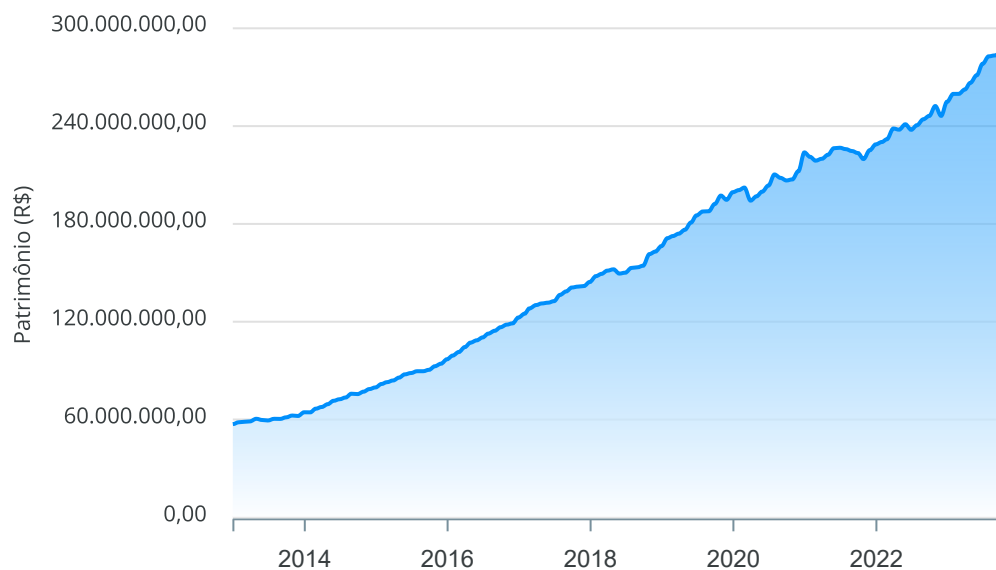
Investimentos x Meta de Rentabilidade



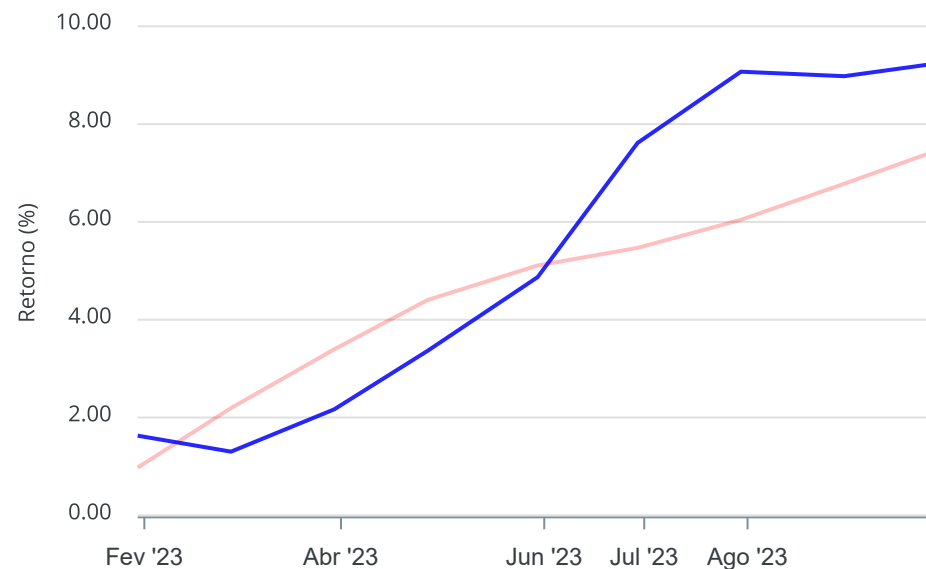
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	8.034.059,63	0,00	0,00	8.123.712,71	89.653,08	1,12%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.993.103,25	0,00	0,00	5.048.334,55	55.231,30	1,11%	1,11%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.110.697,89	0,00	0,00	9.210.763,58	100.065,69	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.691.347,06	0,00	0,00	9.797.768,66	106.421,60	1,10%	1,10%	0,33%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.932.035,26	0,00	0,00	9.025.767,72	93.732,46	1,05%	1,05%	0,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.795.441,92	0,00	0,00	5.854.552,79	59.110,87	1,02%	1,02%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	15.324.922,34	0,00	0,00	15.473.571,33	148.648,99	0,97%	0,97%	0,01%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	1.806.517,49	0,00	0,00	1.823.338,47	16.820,98	0,93%	0,93%	0,02%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	232.002,70	37.640,10	0,00	272.142,23	2.499,43	0,93%	0,97%	0,01%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.845.332,29	0,00	0,00	1.862.211,78	16.879,49	0,91%	0,91%	0,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.306.478,83	0,00	0,00	16.454.740,07	148.261,24	0,91%	0,91%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	13.303.098,06	0,00	0,00	13.423.376,20	120.278,14	0,90%	0,90%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.621.613,31	698.929,09	0,00	4.359.406,96	38.864,56	0,90%	0,95%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	17.182.733,73	0,00	0,00	17.333.655,09	150.921,36	0,88%	0,88%	0,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.448.737,01	150.000,00	0,00	1.611.797,81	13.060,80	0,82%	0,90%	0,01%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	2.640.089,37	0,00	0,00	2.658.249,43	18.160,06	0,69%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.202.041,47	0,00	0,00	15.263.431,86	61.390,39	0,40%	0,40%	0,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	23.651.435,74	0,00	0,00	23.701.506,09	50.070,35	0,21%	0,21%	0,85%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	5.453.967,03	0,00	0,00	5.464.143,34	10.176,31	0,19%	0,19%	0,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	27.089.770,84	0,00	0,00	27.129.329,84	39.559,00	0,15%	0,15%	1,12%

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.569.901,42	0,00	1.790.500,00	9.795.786,41	16.384,99	0,14%	0,11%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.900.603,57	1.788.717,98	0,00	11.576.434,19	-112.887,36	-0,97%	-0,96%	2,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.108.943,08	0,00	0,00	1.098.198,56	-10.744,52	-0,97%	-0,97%	2,52%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.419.879,95	0,00	0,00	4.375.902,07	-43.977,88	-1,00%	-1,00%	2,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	14.326.014,07	0,00	0,00	14.099.285,01	-226.729,06	-1,58%	-1,58%	3,59%
Total Renda Fixa	232.990.767,31	2.675.287,17	1.790.500,00	234.837.406,75	961.852,27	0,41%		0,81%

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 DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.746.568,60	0,00	0,00	8.856.278,74	109.710,14	1,25%	1,25%	6,11%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8.680.007,14	0,00	0,00	8.720.837,62	40.830,48	0,47%	0,47%	7,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.406.525,77	0,00	0,00	2.412.760,45	6.234,68	0,26%	0,26%	7,72%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	20.375.122,63	0,00	0,00	20.390.340,11	15.217,48	0,07%	0,07%	7,85%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7.295.851,08	0,00	0,00	6.970.557,73	-325.293,35	-4,46%	-4,46%	5,00%
Total Renda Variável	47.504.075,22	0,00	0,00	47.350.774,65	-153.300,57	-0,32%		7,05%

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
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.664.418,84	0,00	0,00	2.574.818,68	-89.600,16	-3,36%	-3,36%	5,58%
Total Exterior	2.664.418,84	0,00	0,00	2.574.818,68	-89.600,16	-3,36%		5,58%

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.956.412,19	0,00	0,00	16.454.740,07	498.327,88	3,12%	3,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	18.548.075,73	0,00	1.700.000,00	17.333.655,09	485.579,36	2,62%	2,73%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	14.990.350,98	0,00	0,00	15.473.571,33	483.220,35	3,22%	3,22%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	26.657.672,21	0,00	0,00	27.129.329,84	471.657,63	1,77%	1,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	23.258.481,73	0,00	0,00	23.701.506,09	443.024,36	1,90%	1,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	13.018.497,49	0,00	0,00	13.423.376,20	404.878,71	3,11%	3,11%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.717.133,58	0,00	0,00	9.025.767,72	308.634,14	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.756.227,71	0,00	256.430,60	9.797.768,66	297.971,55	3,05%	0,43%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	14.973.047,74	0,00	0,00	15.263.431,86	290.384,12	1,94%	1,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.185.426,45	0,00	254.893,24	9.210.763,58	280.230,37	3,05%	3,09%
TÍTULOS PÚBLICOS	8.110.050,62	0,00	238.069,96	8.123.712,71	251.732,05	3,10%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.244.031,29	0,00	3.658.221,00	9.795.786,41	209.976,12	1,59%	1,67%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.655.369,51	0,00	0,00	5.854.552,79	199.183,28	3,52%	3,52%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.037.923,40	0,00	144.591,32	5.048.334,55	155.002,47	3,08%	0,21%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.162.800,25	2.091.376,49	0,00	4.359.406,96	105.230,22	2,47%	3,16%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	5.398.847,13	0,00	0,00	5.464.143,34	65.296,21	1,21%	1,21%
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.805.700,62	0,00	0,00	1.862.211,78	56.511,16	3,13%	3,13%
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	1.769.013,44	0,00	0,00	1.823.338,47	54.325,03	3,07%	3,07%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	2.612.710,38	0,00	0,00	2.658.249,43	45.539,05	1,74%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.290.829,10	1.186.985,12	911.084,83	1.611.797,81	45.068,42	1,82%	2,96%

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
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	156.143,97	109.095,29	0,00	272.142,23	6.902,97	2,60%	3,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.105.305,53	0,00	0,00	1.098.198,56	-7.106,97	-0,64%	-0,64%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3.509.197,77	893.985,12	0,00	4.375.902,07	-27.280,82	-0,62%	-0,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.320.690,58	5.352.736,65	0,00	11.576.434,19	-96.993,04	-0,83%	-0,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	14.371.974,93	0,00	0,00	14.099.285,01	-272.689,92	-1,90%	-1,90%
Total Renda Fixa	227.611.914,33	9.634.178,67	7.163.290,95	234.837.406,75	4.754.604,70	2,07%	

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 DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.767.867,43	0,00	0,00	8.856.278,74	88.411,31	1,01%	1,01%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.460.968,87	0,00	0,00	2.412.760,45	-48.208,42	-1,96%	-1,96%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	8.782.421,27	0,00	0,00	8.720.837,62	-61.583,65	-0,70%	-0,70%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7.104.728,67	0,00	0,00	6.970.557,73	-134.170,94	-1,89%	-1,89%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	20.758.672,11	0,00	0,00	20.390.340,11	-368.332,00	-1,77%	-1,77%
Total Renda Variável	47.874.658,35	0,00	0,00	47.350.774,65	-523.883,70	-1,09%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.539.820,04	0,00	0,00	2.574.818,68	34.998,64	1,38%	1,38%
Total Exterior	2.539.820,04	0,00	0,00	2.574.818,68	34.998,64	1,38%	

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.

