

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023



Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

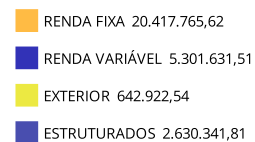
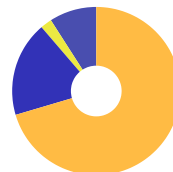
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.040.357,11	3,59%	903	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	728.350,70	2,51%	794	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.502,42	0,03%	1.132	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	150.892,11	0,52%	303	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	844.130,14	2,91%	370	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.214.639,07	4,19%	303	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.094.395,63	7,22%	794	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.294.921,25	4,47%	873	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	921.122,82	3,18%	933	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.712.859,13	5,91%	782	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.432.499,70	4,94%	1.185	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	100.733,37	0,35%	30	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	154.092,78	0,53%	3.070	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	284.385,87	0,98%	999	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	153.562,35	0,53%	152	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	21.420,58	0,07%	226	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASILATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.412.798,47	8,32%	119	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	469.077,14	1,62%	362	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	918.509,56	3,17%	273	0,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.134.646,21	10,81%	235	0,11%	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
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.046.660,64	3,61%	71	0,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	280.208,57	0,97%	710	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	149.457,67	0,52%	2.755	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	401.207,07	1,38%	19.831	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	897.016,21	3,09%	259	2,52%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.364.235,34	4,71%	1.003	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.245.771,02	4,30%	201	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	858.425,45	2,96%	2.194	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	385.518,75	1,33%	2.619	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	145.376,39	0,50%	10.797	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	73.522,31	0,25%	69	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	424.023,84	1,46%	477	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	D+0	Não há	682.437,89	2,35%	11	0,39%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	55.083,69	0,19%	533	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	248.217,19	0,86%	5.373	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	405.386,33	1,40%	853	0,49%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	728.635,43	2,51%	2.895	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	510.581,28	1,76%	35	0,60%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			28.992.661,48				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	20,00%	80,97%	23.475.358,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.696.496,23	40,34%	20,24%	22,85%	80,97%	11.778.861,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	8.441.060,82	29,11%	27,02%	33,15%	60,00%	8.954.536,07
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	280.208,57	0,97%	1,00%	2,00%	5,00%	1.169.424,50
Total Renda Fixa	100,00%	20.417.765,62	70,42%	48,26%	78,00%	226,94%	

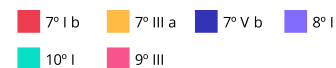
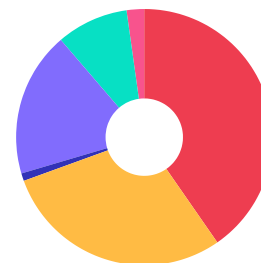


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	5.301.631,51	18,29%	1,89%	14,00%	20,00%	496.900,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.630.341,81	9,07%	2,00%	5,00%	10,00%	268.924,34
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	7.931.973,32	27,36%	3,89%	19,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	642.922,54	2,22%	1,00%	3,00%	10,00%	2.256.343,61
Total Exterior	10,00%	642.922,54	2,22%	1,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	17.766.937,95	61,28	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.751.659,48	12,94	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.389.472,36	11,69	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.861.622,45	6,42	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.046.660,64	3,61	-
ITAÚ UNIBANCO	510.581,28	1,76	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	385.518,75	1,33	-
SOMMA INVESTIMENTOS	280.208,57	0,97	-

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 %		

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%	-	-
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%
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%	-	-
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%	-	-
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%
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%	-	-
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%

CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,26%	7,99%	4,19%	7,48%	11,80%	25,42%	0,09%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,42%	9,32%	2,07%	5,81%	12,22%	24,91%	0,59%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	8,77%	2,96%	5,82%	11,77%	22,06%	0,01%	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 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%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,98%	9,89%	3,21%	6,45%	13,38%	25,76%	0,01%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,10%	8,46%	1,64%	4,16%	11,04%	21,06%	0,99%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	-	3,12%	-	-	-	0,33%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,82%	3,09%	4,58%	11,76%	-	0,33%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,45%	10,01%	2,08%	6,48%	12,18%	23,72%	0,54%	0,01%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,14%	11,18%	1,58%	7,35%	12,82%	22,74%	0,98%	0,03%
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)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1,10%	-	0,12%	-	-	-	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
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	1,32%	9,78%	4,21%	4,59%	13,97%	24,61%	1,40%	0,04%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	8,36%	1,59%	6,08%	10,18%	21,24%	1,92%	0,04%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,86%	9,52%	2,78%	6,24%	12,70%	26,54%	0,12%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,90%	10,07%	3,12%	6,75%	13,36%	26,19%	0,08%	0,00%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	0,93%	9,98%	3,12%	6,66%	13,28%	25,35%	0,13%	0,00%

Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,41%	7,63%	1,13%	4,47%	11,45%	-8,94%	4,69%	0,20%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,58%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	0,22%

Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,00%	6,85%	-4,46%	12,85%	1,02%	4,21%	7,67%	0,18%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,47%	4,43%	-0,70%	13,47%	1,94%	0,42%	7,60%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,12%	11,80%	-1,69%	17,93%	10,85%	13,29%	8,45%	0,19%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01%	6,08%	-1,83%	14,99%	1,58%	-6,60%	7,55%	0,20%

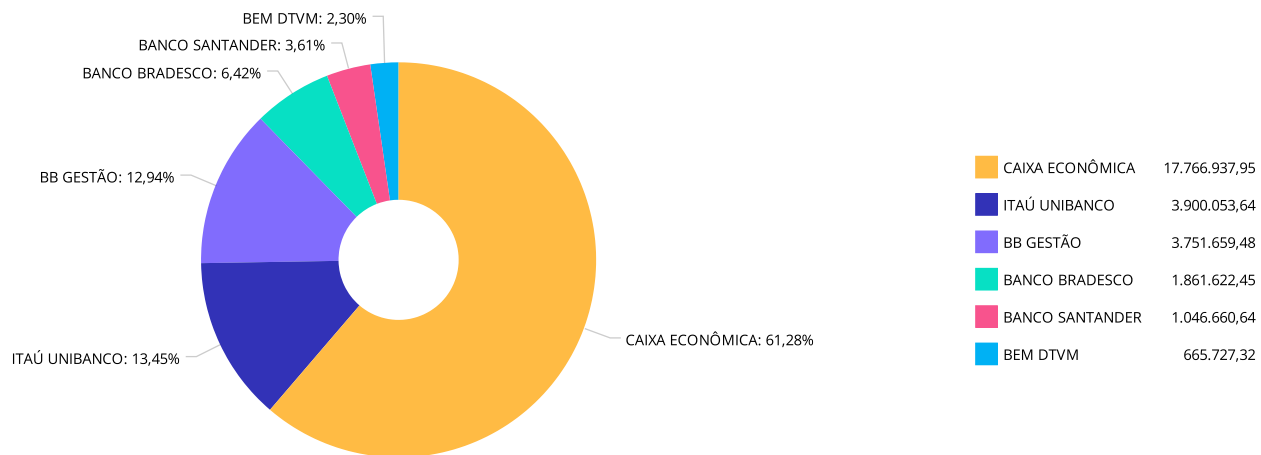
IDIV (Benchmark)	1,32%	10,67%	1,25%	15,38%	14,16%	22,39%	-	-
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,23%	9,93%	0,98%	14,95%	13,15%	20,09%	6,26%	0,18%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,29%	14,58%	-4,52%	17,03%	11,80%	8,54%	6,89%	0,19%

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

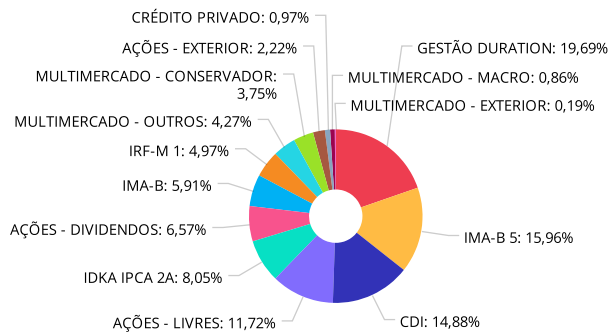
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,25%	9,55%	1,01%	14,44%	12,73%	19,59%	6,11%	0,18%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,68%	-12,05%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	0,20%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-4,87%	11,68%	-3,65%	4,35%	19,59%	-0,45%	-	-
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	-4,54%	13,82%	-2,15%	4,83%	24,64%	12,01%	5,03%	0,17%

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%
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,41%	7,63%	1,13%	4,47%	11,45%	-8,94%	4,69%	20,026%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,57%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	22,223%



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

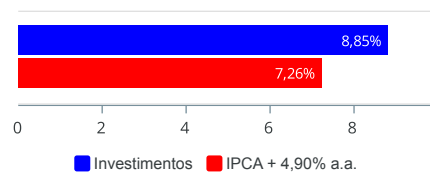


■ GESTÃO DURATION	5.707.417,09	■ IMA-B 5	4.626.752,29	■ CDI	4.315.248,06
■ AÇÕES - LIVRES	3.396.732,18	■ IDKA IPCA 2A	2.335.278,36	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.904.899,33
■ IMA-B	1.712.859,13	■ IRF-M 1	1.440.002,12	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.239.216,71
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.087.824,22	■ AÇÕES - EXTERIOR	642.922,54	■ CRÉDITO PRIVADO	280.208,57
■ MULTIMERCADO - MACRO	248.217,19	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	55.083,69		

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	24.056.086,72	202.334,54	10.807,71	24.648.586,85	400.973,30	400.973,30	1,65%	1,65%	0,95%	0,95%	173,94%	2,83%
Fevereiro	24.648.586,85	3.594.115,74	3.362.649,31	24.797.315,58	-82.737,70	318.235,60	-0,33%	1,32%	1,19%	2,15%	61,27%	2,64%
Março	24.797.315,58	2.112.414,44	1.588.621,53	25.476.851,82	155.743,33	473.978,93	0,62%	1,94%	1,15%	3,32%	58,35%	1,99%
Abril	25.476.851,82	962.543,58	618.935,75	26.097.785,46	277.325,81	751.304,74	1,07%	3,03%	0,95%	4,31%	70,41%	1,92%
Mai	26.097.785,46	557.334,89	117.450,09	26.968.773,61	431.103,35	1.182.408,09	1,62%	4,71%	0,65%	4,99%	94,41%	1,76%
Junho	26.968.773,61	1.346.451,71	1.530.795,30	27.448.644,49	664.214,47	1.846.622,56	2,46%	7,29%	0,32%	5,32%	136,93%	1,97%
Julho	27.448.644,49	967.109,56	571.841,92	28.199.680,16	355.768,03	2.202.390,59	1,28%	8,66%	0,52%	5,87%	147,51%	1,89%
Agosto	28.199.680,16	898.649,66	383.336,44	28.683.233,23	-31.760,15	2.170.630,44	-0,11%	8,54%	0,67%	6,58%	129,81%	1,98%
Setembro	28.683.233,23	860.307,70	633.371,77	28.992.661,48	82.492,32	2.253.122,76	0,29%	8,85%	0,64%	7,26%	121,85%	2,02%

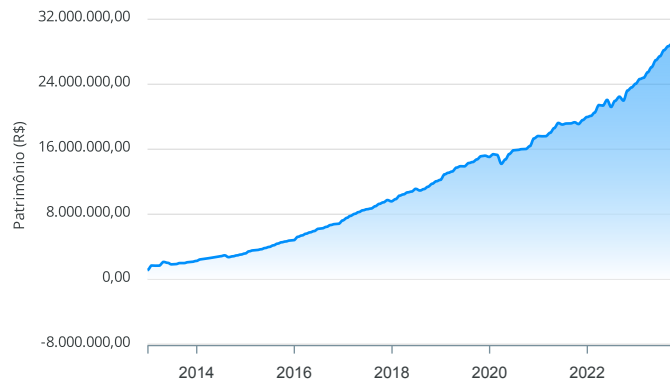
Investimentos x Meta de Rentabilidade



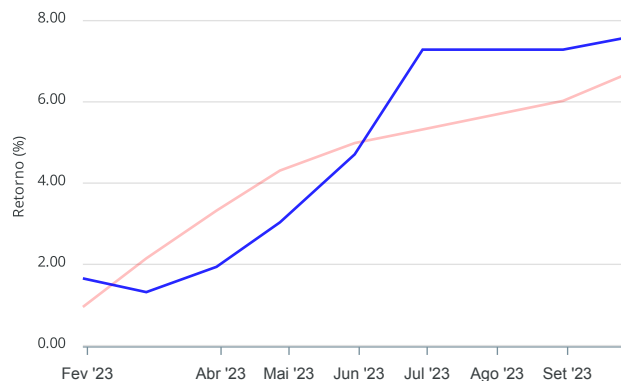
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	276.731,14	0,00	0,00	280.208,57	3.477,43	1,26%	1,26%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	149.240,64	0,00	0,00	150.892,11	1.651,47	1,11%	1,11%	0,33%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	99.636,44	0,00	0,00	100.733,37	1.096,93	1,10%	1,10%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	834.959,52	0,00	0,00	844.130,14	9.170,62	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.201.445,87	0,00	0,00	1.214.639,07	13.193,20	1,10%	1,10%	0,33%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	161.900,99	0,00	9.386,71	154.092,78	1.578,50	0,97%	0,97%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	21.217,69	0,00	0,00	21.420,58	202,89	0,96%	0,96%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.419.592,52	0,00	0,00	1.432.499,70	12.907,18	0,91%	0,91%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.435,19	0,00	0,00	7.502,42	67,23	0,90%	0,90%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	188.865,17	93.203,58	0,00	284.385,87	2.317,12	0,82%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	611.000,85	0,00	146.301,80	469.077,14	4.378,09	0,72%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.401.935,43	0,00	0,00	2.412.798,47	10.863,04	0,45%	0,45%	0,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.121.597,52	0,00	0,00	3.134.646,21	13.048,69	0,42%	0,42%	0,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.085.971,87	0,00	0,00	2.094.395,63	8.423,76	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.290.329,45	0,00	0,00	1.294.921,25	4.591,80	0,36%	0,36%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.038.159,32	0,00	0,00	1.040.357,11	2.197,79	0,21%	0,21%	0,85%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.044.711,36	0,00	0,00	1.046.660,64	1.949,28	0,19%	0,19%	0,85%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	153.350,94	0,00	0,00	153.562,35	211,41	0,14%	0,14%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	920.093,13	0,00	0,00	921.122,82	1.029,69	0,11%	0,11%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	727.542,02	0,00	0,00	728.350,70	808,68	0,11%	0,11%	0,99%

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 PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	917.636,52	0,00	0,00	918.509,56	873,04	0,10%	0,10%	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.589.866,04	139.420,86	0,00	1.712.859,13	-16.427,77	-0,95%	-0,96%	2,51%
Total Renda Fixa	20.263.219,62	232.624,44	155.688,51	20.417.765,62	77.610,07	0,38%		0,74%

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 HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	400.090,83	0,00	0,00	405.386,33	5.295,50	1,32%	1,32%	1,40%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	886.105,53	0,00	0,00	897.016,21	10.910,68	1,23%	1,23%	6,26%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	472.021,75	0,00	477.683,26	0,00	5.661,51	1,20%	-0,20%	5,34%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	676.175,56	0,00	0,00	682.437,89	6.262,33	0,93%	0,93%	0,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	506.021,22	0,00	0,00	510.581,28	4.560,06	0,90%	0,90%	0,08%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	722.452,77	0,00	0,00	728.635,43	6.182,66	0,86%	0,86%	0,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	246.984,53	0,00	0,00	248.217,19	1.232,66	0,50%	0,50%	1,92%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	399.328,65	0,00	0,00	401.207,07	1.878,42	0,47%	0,47%	7,60%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.364.329,50	0,00	0,00	1.364.235,34	-94,16	-0,01%	-0,01%	7,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.247.281,29	0,00	0,00	1.245.771,02	-1.510,27	-0,12%	-0,12%	8,45%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	150.000,00	0,00	149.457,67	-542,33	-0,36%	-0,29%	6,89%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	385.796,69	477.683,26	0,00	858.425,45	-5.054,50	-0,59%	1,25%	6,11%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	389.424,30	0,00	0,00	385.518,75	-3.905,55	-1,00%	-1,00%	7,67%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	57.705,66	0,00	0,00	55.083,69	-2.621,97	-4,54%	-4,54%	5,03%
Total Renda Variável	7.753.718,28	627.683,26	477.683,26	7.931.973,32	28.255,04	0,36%		5,08%

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	150.435,29	0,00	0,00	145.376,39	-5.058,90	-3,36%	-3,36%	5,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	76.115,84	0,00	0,00	73.522,31	-2.593,53	-3,41%	-3,41%	4,69%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	439.744,20	0,00	0,00	424.023,84	-15.720,36	-3,57%	-3,57%	4,97%
Total Exterior	666.295,33	0,00	0,00	642.922,54	-23.372,79	-3,51%		5,08%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.070.993,89	0,00	0,00	3.134.646,21	63.652,32	2,07%	2,07%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.363.573,84	0,00	0,00	2.412.798,47	49.224,63	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.389.116,78	0,00	0,00	1.432.499,70	43.382,92	3,12%	3,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.054.550,11	0,00	0,00	2.094.395,63	39.845,52	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.209.489,20	0,00	31.789,95	1.214.639,07	36.939,82	3,05%	0,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.268.789,19	0,00	0,00	1.294.921,25	26.132,06	2,06%	2,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	841.808,09	0,00	23.359,96	844.130,14	25.682,01	3,05%	3,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.020.910,94	0,00	0,00	1.040.357,11	19.446,17	1,90%	1,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	906.010,43	0,00	0,00	921.122,82	15.112,39	1,67%	1,67%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	903.727,60	0,00	0,00	918.509,56	14.781,96	1,64%	1,64%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	405.880,04	435.021,17	385.281,18	469.077,14	13.457,11	1,60%	2,96%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	601.190,94	432.436,61	0,00	1.046.660,64	13.033,09	1,26%	1,21%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	686.326,74	30.705,27	0,00	728.350,70	11.318,69	1,58%	1,65%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	268.953,53	0,00	0,00	280.208,57	11.255,04	4,18%	4,18%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	186.241,69	0,00	37.546,84	154.092,78	5.397,93	2,90%	3,21%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	279.622,25	0,00	284.385,87	4.763,62	1,70%	2,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	150.654,73	0,00	4.394,36	150.892,11	4.631,74	3,07%	3,12%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	151.177,29	0,00	0,00	153.562,35	2.385,06	1,58%	1,58%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	20.764,58	0,00	0,00	21.420,58	656,00	3,16%	3,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.276,13	0,00	0,00	7.502,42	226,29	3,11%	3,11%

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
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	100.609,46	0,00	0,00	100.733,37	123,91	0,12%	0,12%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA ...	432.370,93	0,00	432.436,61	0,00	65,68	0,02%	3,82%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.551.765,81	171.210,81	0,00	1.712.859,13	-10.117,49	-0,59%	-0,53%
Total Renda Fixa	19.592.181,94	1.348.996,11	914.808,90	20.417.765,62	391.396,47	1,95%	

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
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	661.814,03	0,00	0,00	682.437,89	20.623,86	3,12%	3,12%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	708.957,84	0,00	0,00	728.635,43	19.677,59	2,78%	2,78%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	389.004,16	0,00	0,00	405.386,33	16.382,17	4,21%	4,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	495.125,47	0,00	0,00	510.581,28	15.455,81	3,12%	3,12%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	888.326,43	0,00	0,00	897.016,21	8.689,78	0,98%	0,98%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	244.333,43	0,00	0,00	248.217,19	3.883,76	1,59%	1,59%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	150.000,00	0,00	149.457,67	-542,33	-0,36%	-4,52%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	56.293,27	0,00	0,00	55.083,69	-1.209,58	-2,15%	-2,15%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	404.040,27	0,00	0,00	401.207,07	-2.833,20	-0,70%	-0,70%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	386.736,15	477.683,26	0,00	858.425,45	-5.993,96	-0,69%	1,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	483.945,23	0,00	477.683,26	0,00	-6.261,97	-1,29%	-2,66%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	313.359,08	90.000,00	0,00	385.518,75	-17.840,33	-4,42%	-4,46%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	804.268,17	463.329,58	0,00	1.245.771,02	-21.826,73	-1,72%	-1,69%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.389.710,86	0,00	0,00	1.364.235,34	-25.475,52	-1,83%	-1,83%
Total Renda Variável	7.225.914,39	1.181.012,84	477.683,26	7.931.973,32	2.729,35	0,03%	

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	189.676,81	0,00	196.057,97	0,00	6.381,16	3,36%	3,43%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	224.770,45	196.057,97	0,00	424.023,84	3.195,42	0,76%	1,32%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	143.400,33	0,00	0,00	145.376,39	1.976,06	1,38%	1,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	72.700,57	0,00	0,00	73.522,31	821,74	1,13%	1,13%
Total Exterior	630.548,16	196.057,97	196.057,97	642.922,54	12.374,38	1,50%	

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.

