

Relatório Analítico dos Investimentos

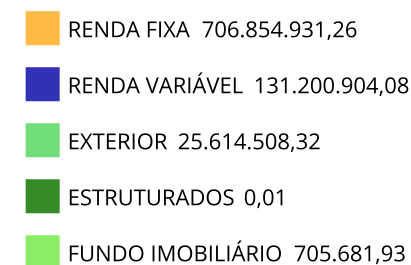
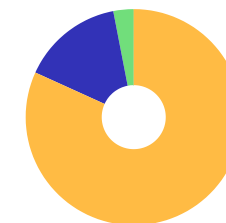
em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.053.981,48	0,47%	13.446	2,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.205.902,15	0,83%	2.755	1,45%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	22.239.316,86	2,57%	27.768	2,68%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	14.042.383,68	1,62%	19.831	1,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	10.001.030,03	1,16%	83	1,56%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.627.070,99	1,46%	6.362	10,66%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.364.350,41	1,43%	5.718	1,86%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	27.675.652,48	3,20%	2.466	4,30%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	9.186.432,99	1,06%	32	3,56%	Artigo 8º, Inciso I
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	10.197.745,88	1,18%	8.273	1,61%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	8.869.876,14	1,03%	4.394	1,47%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	6.546.886,30	0,76%	197	2,27%	Artigo 9º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	705.681,93	0,08%		0,49%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			864.376.025,60				

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%	15,00%	40,00%	345.750.410,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	473.629.553,14	54,79%	15,00%	50,00%	75,00%	174.652.466,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	156.262.704,40	18,08%	4,00%	7,00%	60,00%	362.362.910,96
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	41.662.994,17	4,82%	0,00%	1,00%	20,00%	131.212.210,95
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	80.646,00	0,01%	0,00%	0,10%	0,50%	4.241.234,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	35.219.033,55	4,07%	0,00%	1,50%	5,00%	7.999.767,73
Total Renda Fixa	100,00%	706.854.931,26	81,78%	19,00%	74,60%	200,50%	



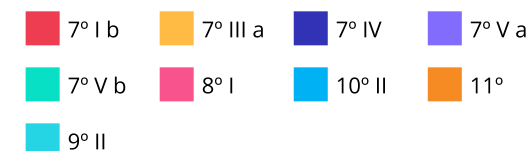
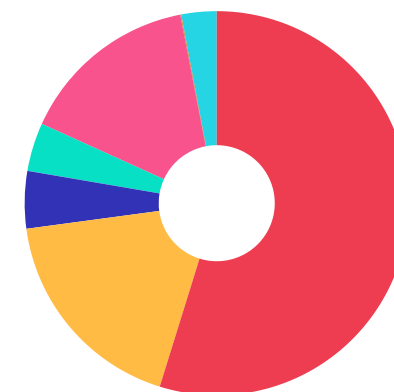
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	131.200.904,08	15,18%	10,00%	18,00%	35,00%	171.330.704,88
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	10,00%	86.437.602,56
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,10%	3,00%	25.931.280,76
Artigo 11º	5,00%	705.681,93	0,08%	0,00%	0,10%	1,00%	7.938.078,33
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	131.906.586,02	15,26%	10,00%	22,20%	49,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	25.614.508,32	2,96%	0,50%	2,90%	10,00%	60.823.094,24
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,30%	10,00%	86.437.602,56
Total Exterior	10,00%	25.614.508,32	2,96%	0,50%	3,20%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	288.597.045,95	33,39	-
CAIXA DTVM	226.323.035,97	26,18	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	175.025.455,38	20,25	-
SICREDI	43.081.273,18	4,98	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	42.225.996,13	4,89	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	32.111.823,38	3,72	-
ICATU VANGUARDA	27.675.652,48	3,20	-
XP ASSET MANAGEMENT	10.197.745,88	1,18	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.749.324,02	0,78	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	6.546.886,30	0,76	-
ARX INVESTIMENTOS	5.055.458,99	0,58	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	705.681,93	0,08	-
VILA RICA CAPITAL	80.645,99	0,01	-
PLURAL	0,02	0,00	-

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	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	473.629.553,14	54,79	15,00	75,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	156.262.704,40	18,08	4,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	80.646,00	0,01	0,00	0,50
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	35.219.033,55	4,07	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	131.200.904,08	15,18	10,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	25.614.508,32	2,96	0,50	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,01	0,00	0,00	3,00
Artigo 11º	705.681,93	0,08	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,25%	12,79%	4,11%	8,31%	17,41%	34,76%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	11,76%	14,62%	13,22%	13,75%	-1,65%	-46,14%	-	-
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%	-	-
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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,11%	8,70%	1,67%	4,20%	11,40%	21,46%	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%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,23%	3,54%	6,91%	13,89%	27,22%	0,03%	0,00%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,07%	10,32%	3,60%	7,00%	14,15%	27,79%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	8,77%	2,96%	5,82%	11,77%	22,06%	0,01%	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%

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
TRENBANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	900,00%	0,00%	0,00%	0,00%	900,00%	-	-
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,99%	9,95%	3,25%	6,51%	13,43%	25,82%	0,02%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,79%	3,08%	4,56%	11,72%	22,22%	0,33%	0,02%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,56%	9,22%	2,39%	4,80%	11,96%	22,25%	0,58%	0,02%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
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
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,47%	4,43%	-0,70%	13,47%	1,94%	0,42%	7,60%	0,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,87%	3,35%	0,58%	10,91%	-3,14%	-16,56%	8,29%	0,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-3,33%	28,98%	-6,35%	27,17%	5,30%	11,14%	12,60%	0,32%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,19%	5,18%	-0,56%	13,91%	1,79%	-5,36%	8,34%	0,19%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,09%	0,17%	-2,47%	11,72%	-1,97%	-5,38%	7,36%	0,20%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,27%	6,05%	-1,69%	14,56%	4,93%	3,07%	7,93%	0,20%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-4,08%	-5,73%	-12,21%	8,36%	-18,78%	-42,13%	8,98%	0,27%
IBX-50 (Benchmark)	1,21%	4,92%	-0,03%	13,75%	5,32%	5,93%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,94%	3,70%	-1,68%	10,78%	2,36%	0,19%	7,84%	0,20%
IDIV (Benchmark)	1,32%	10,67%	1,25%	15,38%	14,16%	22,39%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,29%	14,58%	-4,52%	17,03%	11,80%	8,54%	6,89%	0,19%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,59%	3,98%	-0,29%	11,66%	4,41%	0,60%	7,51%	0,18%
IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
SMLL (Benchmark)	-2,84%	5,06%	-7,25%	16,09%	-2,94%	-20,83%	-	-

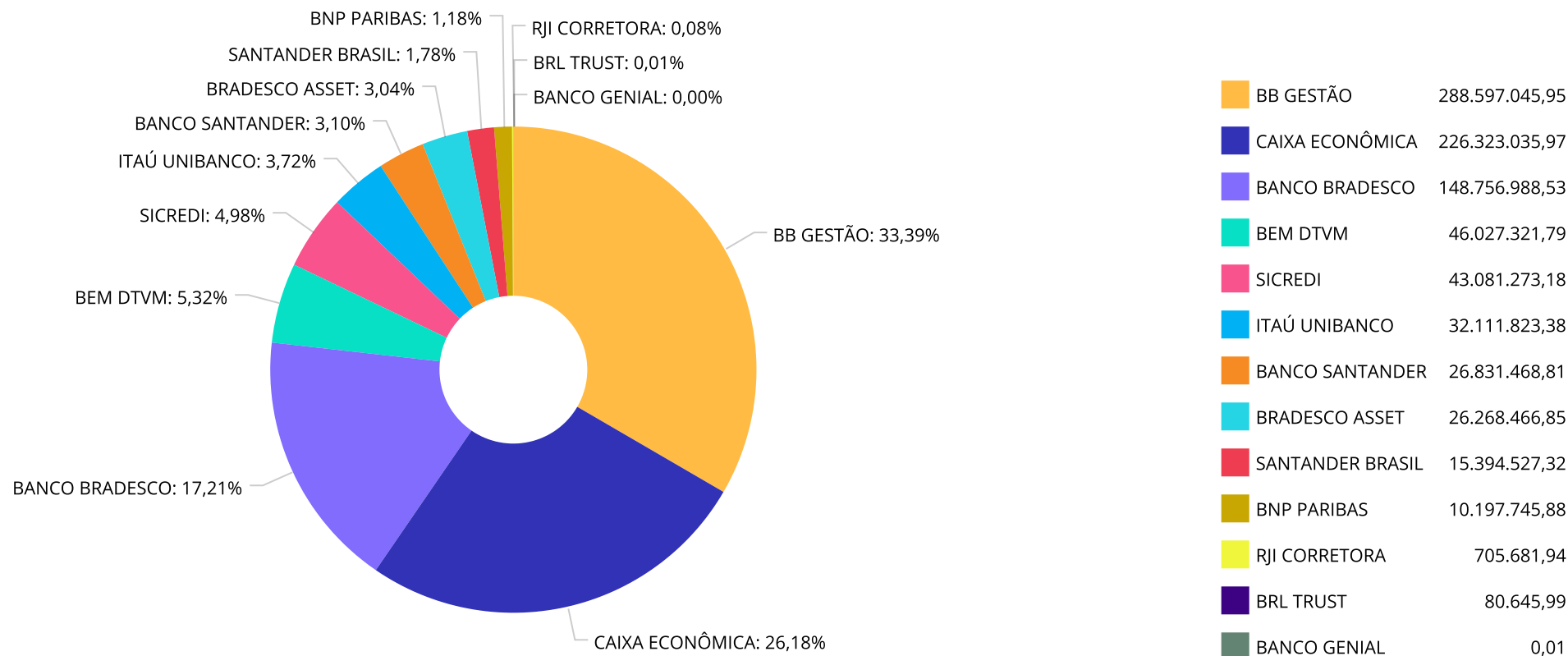
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-2,87%	4,86%	-7,24%	15,55%	-3,23%	-21,52%	9,40%	0,25%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,06%	11,50%	3,15%	6,57%	16,23%	37,64%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-

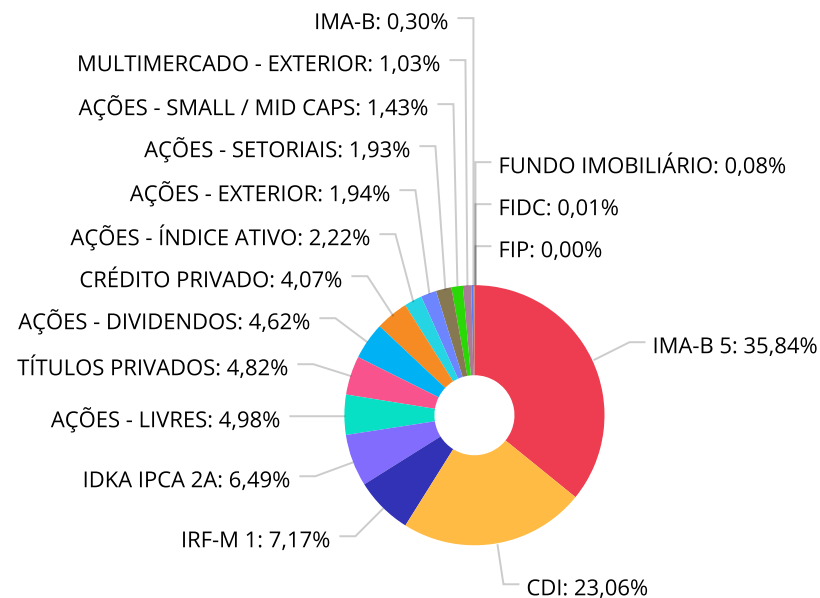
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,78%	5,21%	-0,07%	0,75%	11,10%	-12,63%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-2,79%	2,04%	1,01%	1,13%	10,84%	-19,00%	3,43%	17,904%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-3,77%	22,95%	1,01%	6,67%	25,17%	-31,61%	7,97%	28,975%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,61%	4,13%	-0,05%	0,10%	9,93%	-14,78%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,96%	2,95%	0,08%	-0,04%	13,53%	-14,54%	5,59%	22,121%

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



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

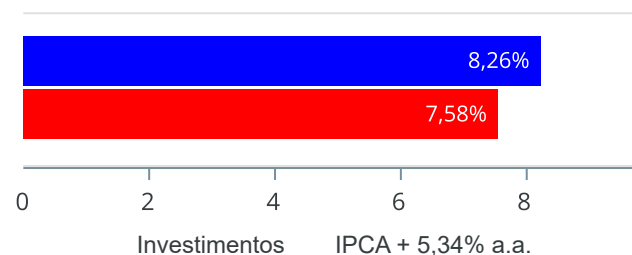


■ IMA-B 5	309.829.822,78	■ CDI	199.343.977,58	■ IRF-M 1	62.004.138,14	■ IDKA IPCA 2A	56.101.731,03
■ AÇÕES - LIVRES	43.031.024,56	■ TÍTULOS PRIVADOS	41.662.994,17	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	39.937.013,62	■ CRÉDITO PRIVADO	35.219.033,55
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	19.187.463,02	■ AÇÕES - EXTERIOR	16.744.632,18	■ AÇÕES - SETORIAIS	16.681.052,47	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	12.364.350,41
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	8.869.876,14	■ IMA-B	2.612.588,01	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	705.681,93	■ FIDC	80.646,00
■ FIP	0,01						

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	768.654.569,51	161.791.775,86	149.214.177,15	797.848.378,51	16.616.210,29	16.616.210,29	2,13%	2,13%	0,99%	0,99%	214,84%	3,05%
Fevereiro	797.848.378,51	37.116.816,98	32.138.780,94	795.008.960,59	-7.817.453,96	8.798.756,33	-0,97%	1,13%	1,21%	2,21%	51,20%	3,33%
Março	795.008.960,59	51.245.660,01	49.214.196,74	801.979.266,84	4.938.842,98	13.737.599,31	0,62%	1,76%	1,18%	3,42%	51,47%	2,42%
Abril	801.979.266,84	98.657.989,10	97.706.659,15	809.484.781,92	6.554.185,13	20.291.784,44	0,82%	2,59%	0,98%	4,43%	58,44%	2,03%
Mai	809.484.781,92	191.375.909,92	189.222.083,07	823.245.381,65	11.606.772,88	31.898.557,32	1,43%	4,06%	0,69%	5,15%	78,80%	1,94%
Junho	823.245.381,65	41.486.128,35	39.757.692,87	842.351.395,55	17.377.578,42	49.276.135,74	2,11%	6,25%	0,35%	5,52%	113,19%	1,90%
Julho	842.351.395,55	30.036.797,55	28.020.547,77	856.616.600,22	12.248.954,89	61.525.090,63	1,45%	7,79%	0,55%	6,11%	127,58%	1,79%
Agosto	856.616.600,22	42.156.593,57	40.202.796,98	857.764.166,31	-806.230,50	60.718.860,13	-0,09%	7,69%	0,71%	6,86%	112,14%	2,32%
Setembro	857.764.166,31	30.578.404,51	28.545.668,75	864.376.025,60	4.579.123,53	65.297.983,66	0,53%	8,26%	0,67%	7,58%	109,04%	1,77%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





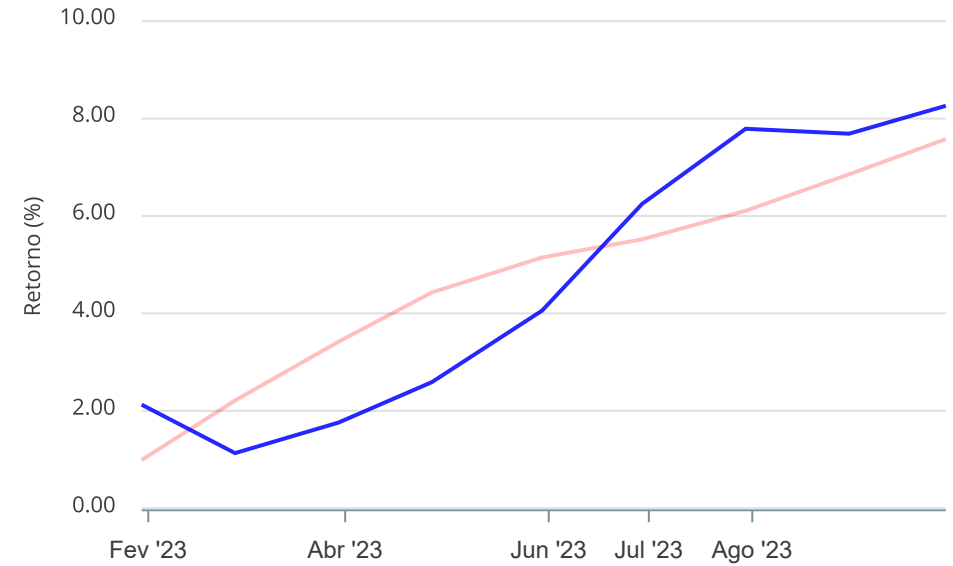
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	72.157,38	0,00	0,00	80.645,99	8.488,61	11,76%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	70.401.124,24	0,00	0,00	71.174.362,14	773.237,90	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	141.205.589,59	0,00	0,00	142.756.181,61	1.550.592,02	1,10%	1,10%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.584.300,75	0,00	0,00	2.612.588,01	28.287,26	1,09%	1,09%	0,33%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	24.440.437,45	0,00	0,00	24.700.922,39	260.484,94	1,07%	1,07%	0,03%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	146.628.487,99	12.462.875,52	11.931.211,41	148.756.988,53	1.596.836,43	1,00%	1,05%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.413.889,74	923.698,82	0,00	7.410.900,99	73.312,43	1,00%	1,05%	0,03%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	42.658.287,23	0,00	0,00	43.081.273,18	422.985,95	0,99%	0,99%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	47.998.046,05	93.980,27	48.656,27	48.479.588,05	436.218,00	0,91%	0,91%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	13.560.701,87	0,00	158.306,02	13.524.550,09	122.154,24	0,90%	0,90%	0,06%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	26.075.165,60	0,00	0,00	26.268.466,85	193.301,25	0,74%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	15.288.327,81	0,00	0,00	15.394.527,32	106.199,51	0,69%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.459.524,64	0,00	0,00	10.518.111,16	58.586,52	0,56%	0,56%	0,58%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	94.120,54	14.110.223,79	14.140.307,15	94.814,88	30.777,70	0,22%	0,90%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	55.983.213,96	0,00	0,00	56.101.731,03	118.517,07	0,21%	0,21%	0,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	87.027.387,04	0,00	0,00	87.124.119,35	96.732,31	0,11%	0,11%	0,99%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	8.045.068,32	721.444,73	0,00	8.775.159,68	8.646,63	0,10%	0,11%	0,98%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.266.181,38	2.267.187,90	0,00	1.006,52	0,04%	0,90%	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	698.935.830,21	30.578.404,51	28.545.668,75	706.854.931,26	5.886.365,29	0,84%		0,35%

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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.670.247,46	0,00	0,00	6.749.324,02	79.076,56	1,19%	1,19%	8,34%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9.908.219,18	0,00	0,00	10.001.030,03	92.810,85	0,94%	0,94%	7,84%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	22.047.715,09	0,00	0,00	22.239.316,86	191.601,77	0,87%	0,87%	8,29%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	27.514.771,39	0,00	0,00	27.675.652,48	160.881,09	0,58%	0,58%	7,51%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	13.976.638,02	0,00	0,00	14.042.383,68	65.745,66	0,47%	0,47%	7,60%
SANTANDER IBOVESPAATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9.161.369,84	0,00	0,00	9.186.432,99	25.063,15	0,27%	0,27%	7,93%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.060.092,30	0,00	0,00	5.055.458,99	-4.633,31	-0,09%	-0,09%	7,36%
ÁQUILLA FII - AQLL11	706.635,81	0,00	0,00	705.681,93	-953,88	-0,13%	0,00%	0,00%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	7.226.853,57	0,00	0,00	7.205.902,15	-20.951,42	-0,29%	-0,29%	6,89%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12.729.323,63	0,00	0,00	12.364.350,41	-364.973,22	-2,87%	-2,87%	9,40%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	4.193.781,53	0,00	0,00	4.053.981,48	-139.800,05	-3,33%	-3,33%	12,60%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	13.164.148,57	0,00	0,00	12.627.070,99	-537.077,58	-4,08%	-4,08%	8,98%
Total Renda Variável	132.359.796,40	0,00	0,00	131.906.586,02	-453.210,38	-0,34%		8,14%

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	9.124.378,16	0,00	0,00	8.869.876,14	-254.502,02	-2,79%	-2,79%	3,43%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	6.746.752,63	0,00	0,00	6.546.886,30	-199.866,33	-2,96%	-2,96%	5,59%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	10.597.408,91	0,00	0,00	10.197.745,88	-399.663,03	-3,77%	-3,77%	7,97%
Total Exterior	26.468.539,70	0,00	0,00	25.614.508,32	-854.031,38	-3,23%		5,79%

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
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	140.130.630,96	39.100.550,87	35.682.868,02	148.756.988,53	5.208.674,72	2,91%	3,54%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	142.150.918,66	0,00	3.736.264,21	142.756.181,61	4.341.527,16	3,05%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	70.978.574,51	0,00	1.969.637,34	71.174.362,14	2.165.424,97	3,05%	3,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	85.710.410,00	0,00	0,00	87.124.119,35	1.413.709,35	1,65%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	42.854.448,31	4.565.892,52	337.267,15	48.479.588,05	1.396.514,37	2,94%	3,12%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	41.727.084,17	0,00	0,00	43.081.273,18	1.354.189,01	3,25%	3,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	55.053.087,39	0,00	0,00	56.101.731,03	1.048.643,64	1,90%	1,90%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	23.842.497,11	0,00	0,00	24.700.922,39	858.425,28	3,60%	3,60%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	25.741.976,70	0,00	0,00	26.268.466,85	526.490,15	2,05%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	13.584.189,58	0,00	475.538,20	13.524.550,09	415.898,71	3,06%	3,11%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	15.127.536,79	0,00	0,00	15.394.527,32	266.990,53	1,76%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.272.860,29	0,00	0,00	10.518.111,16	245.250,87	2,39%	2,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.439.362,50	2.762.025,96	0,00	7.410.900,99	209.512,53	2,91%	3,54%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	6.727.926,96	1.930.025,65	0,00	8.775.159,68	117.207,07	1,35%	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.609.693,96	0,00	76.373,38	2.612.588,01	79.267,43	3,04%	3,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	101.610,88	45.624.507,65	45.698.044,79	94.814,88	66.741,14	0,15%	2,96%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	71.231,60	0,00	0,00	80.645,99	9.414,39	13,22%	13,22%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.788.792,98	8.792.821,47	0,00	4.028,49	0,05%	2,96%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	681.124.040,38	102.771.795,63	96.768.814,56	706.854.931,26	19.727.909,81	2,87%	

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 RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	22.110.662,50	0,00	0,00	22.239.316,86	128.654,36	0,58%	0,58%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	708.799,85	0,00	0,00	705.681,93	-3.117,92	-0,44%	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	15.928,08	0,00	198,94	0,00	-15.729,14	-98,75%	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.787.598,02	0,00	0,00	6.749.324,02	-38.274,00	-0,56%	-0,56%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	27.756.383,51	0,00	0,00	27.675.652,48	-80.731,03	-0,29%	-0,29%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	14.141.546,32	0,00	0,00	14.042.383,68	-99.162,64	-0,70%	-0,70%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.183.417,66	0,00	0,00	5.055.458,99	-127.958,67	-2,47%	-2,47%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9.344.154,96	0,00	0,00	9.186.432,99	-157.721,97	-1,69%	-1,69%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	10.171.742,60	0,00	0,00	10.001.030,03	-170.712,57	-1,68%	-1,68%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	4.328.788,40	0,00	0,00	4.053.981,48	-274.806,92	-6,35%	-6,35%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	7.547.122,24	0,00	0,00	7.205.902,15	-341.220,09	-4,52%	-4,52%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	13.328.836,72	0,00	0,00	12.364.350,41	-964.486,31	-7,24%	-7,24%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	14.383.601,13	0,00	0,00	12.627.070,99	-1.756.530,14	-12,21%	-12,21%
Total Renda Variável	135.808.582,00	0,00	198,94	131.906.586,02	-3.901.797,04	-2,87%	

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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	10.096.199,90	0,00	0,00	10.197.745,88	101.545,98	1,01%	1,01%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	8.781.157,20	0,00	0,00	8.869.876,14	88.718,94	1,01%	1,01%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	6.541.416,07	0,00	0,00	6.546.886,30	5.470,23	0,08%	0,08%
Total Exterior	25.418.773,17	0,00	0,00	25.614.508,32	195.735,15	0,77%	

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.

