

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

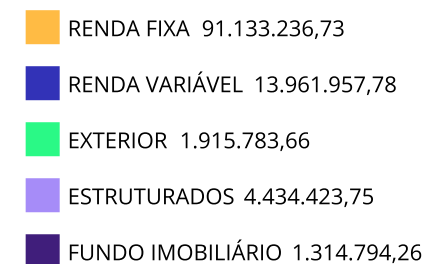
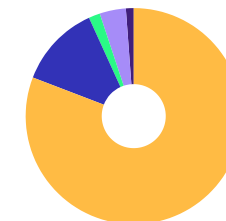
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	15.245.410,23	13,52%	903	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	805.670,79	0,71%	1.132	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	3.969.621,03	3,52%	42	2,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	3.971.521,24	3,52%	121	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	7.308.568,49	6,48%	303	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	5.456.996,69	4,84%	83	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.549.865,09	4,92%	794	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.846.345,65	9,62%	873	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.744.481,93	6,87%	1.185	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.738.695,81	5,98%	721	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.974.384,74	2,64%	1.710	1,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	363.327,85	0,32%	999	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.282.597,61	1,14%	1.116	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	2.300.190,68	2,04%	362	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.175.272,96	2,82%	426	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDIT...	D+0	Não há	2.077.271,48	1,84%	1.146	1,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	166.344,77	0,15%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	154.226,80	0,14%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	8.220.270,21	7,29%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	Não pos...	Não há	1.110.229,77	0,98%	8	5,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	937.604,83	0,83%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	734.338,08	0,65%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	360.619,65	0,32%	568	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.760.709,75	1,56%	201	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	1.992.959,70	1,77%	288	0,59%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.038.647,88	5,36%	22	0,76%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.809.020,80	3,38%	31	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	945.859,47	0,84%	10.797	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	969.924,19	0,86%	477	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.311.601,25	1,16%	5.373	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	16.127,61	0,01%	12	1,16%	Artigo 10º, Inciso I
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	880.929,22	0,78%	14	0,62%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.225.765,67	1,97%	28	1,81%	Artigo 10º, Inciso II
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	182.708,25	0,16%		0,06%	Artigo 11º
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.132.086,01	1,00%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			112.760.196,18				

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

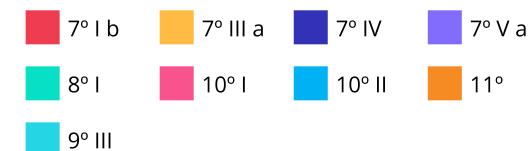
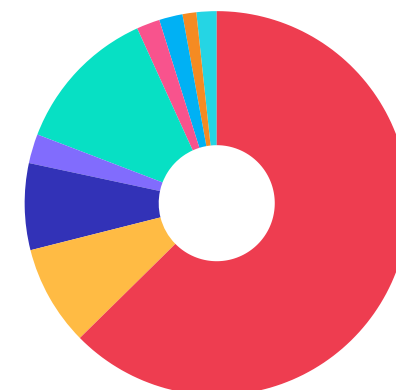
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	22.552.039,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	70.611.561,69	62,62%	15,00%	69,00%	90,00%	30.872.614,87
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	11.276.019,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	60,00%	9.519.232,15	8,44%	4,00%	7,00%	60,00%	58.136.885,56
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	8.220.270,21	7,29%	0,00%	1,00%	20,00%	14.331.769,03
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	5,00%	2.782.172,68	2,47%	0,00%	3,00%	5,00%	2.855.837,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	5.638.009,81
Total Renda Fixa	100,00%	91.133.236,73	80,82%	19,00%	82,50%	210,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	13.961.957,78	12,38%	0,00%	9,00%	30,00%	19.866.101,07
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.208.658,08	1,96%	0,00%	3,00%	10,00%	9.067.361,54
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	2.225.765,67	1,97%	0,00%	2,50%	5,00%	3.412.244,14
Artigo 11º	5,00%	1.314.794,26	1,17%	0,00%	1,50%	5,00%	4.323.215,55
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	19.711.175,79	17,48%	0,00%	16,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.915.783,66	1,70%	0,00%	1,50%	10,00%	9.360.235,96
Total Exterior	10,00%	1.915.783,66	1,70%	0,00%	1,50%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	53.162.652,49	47,15	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.944.627,87	23,90	-
TRÍGONO CAPITAL	9.847.668,68	8,73	-
BANCO DAYCOVAL	8.220.270,21	7,29	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	5.051.656,22	4,48	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.930.386,30	3,49	-
KPTL	2.225.765,67	1,97	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	1.992.959,70	1,77	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	880.929,22	0,78	-
ZION INVEST	182.708,25	0,16	-
RJI CORRETORA DE VALORES	166.344,77	0,15	-
PLURAL	154.226,80	0,14	-

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	70.611.561,69	62,62	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	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
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,87%	9,62%	2,57%	5,35%	13,60%	31,48%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	-0,25%	-3,09%	-0,97%	-2,07%	-4,13%	14,79%	-	-

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

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,80%	8,86%	2,33%	4,86%	12,55%	29,06%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,45%	-2,18%	-1,14%	-2,12%	-1,76%	1,94%	0,14%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,26%	-2,42%	0,21%	0,47%	-2,67%	-15,94%	0,07%	0,01%

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%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,45%	-10,21%	-12,53%	-11,41%	-8,69%	-7,02%	0,02%	0,16%
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 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,40%	6,89%	0,82%	1,68%	5,19%	-	1,47%	0,06%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,26%	-6,23%	-0,70%	-1,34%	-5,84%	-25,03%	0,18%	0,04%

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
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,97%	10,69%	-0,70%	6,72%	10,51%	18,48%	2,49%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	8,77%	2,96%	5,82%	11,77%	22,06%	0,01%	0,00%
MAG PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,01%	9,81%	3,17%	6,38%	13,31%	-	0,05%	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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	10,15%	3,42%	6,85%	13,67%	26,52%	0,02%	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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,12%	2,96%	5,95%	12,33%	23,32%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,75%	-	0,05%	-	-	-	1,90%	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,22%	10,88%	-0,79%	6,21%	11,04%	-	2,73%	0,05%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	8,36%	1,59%	6,08%	10,18%	21,24%	1,92%	0,04%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,36%	-3,22%	-1,09%	-2,18%	-6,36%	-11,42%	0,00%	0,02%

Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
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%	-	-
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,02%	14,38%	8,16%	23,03%	17,39%	13,25%	9,80%	0,20%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,25%	20,50%	8,81%	25,22%	26,65%	33,62%	9,54%	0,22%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,04%	9,55%	-2,31%	16,88%	7,47%	13,87%	7,48%	0,17%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,12%	11,80%	-1,69%	17,93%	10,85%	13,29%	8,45%	0,19%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,71%	6,76%	0,19%	14,05%	4,84%	4,66%	7,65%	0,19%

IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
HAZ FII - ATCR11	9.673.071.328,38%	10.177.306.020,44%	9.653.007.209,93%	10.181.110.770,04%	10.180.697.836,98%	10.492.002.791,83%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-6,84%	-37,23%	-14,06%	-21,33%	-55,64%	-44,69%	17,30%	0,34%

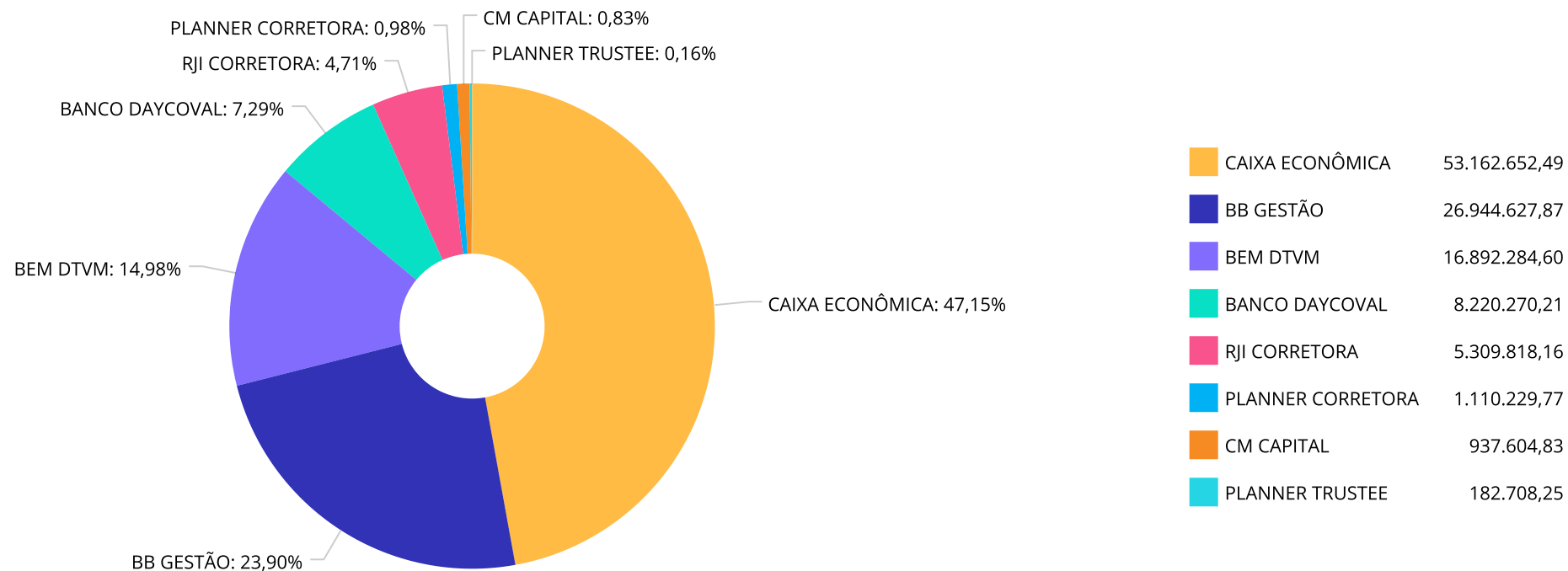
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,06%	11,50%	3,15%	6,57%	16,23%	37,64%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,14%	-1,31%	-0,45%	-0,87%	-	-10,20%	-	-

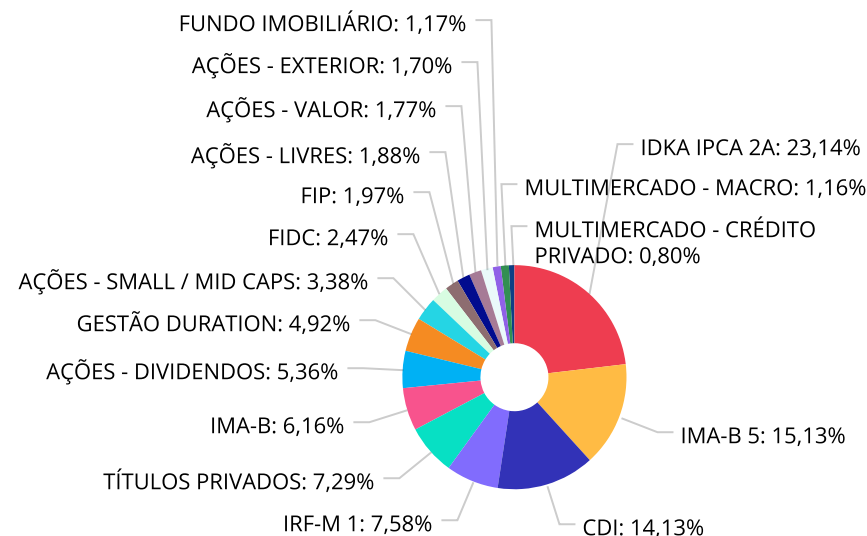
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
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 Administradores - base (Setembro / 2023)



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

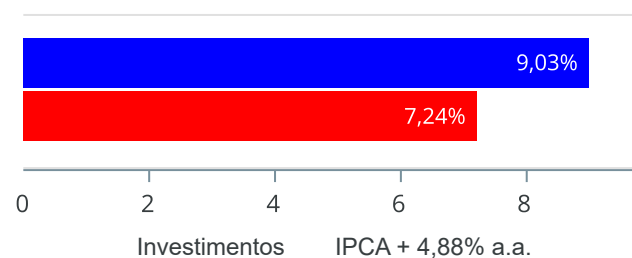


IDKA IPCA 2A	26.091.755,88	IMA-B 5	17.055.757,78	CDI	15.937.356,39
IRF-M 1	8.550.152,72	TÍTULOS PRIVADOS	8.220.270,21	IMA-B	6.945.905,98
AÇÕES - DIVIDENDOS	6.038.647,88	GESTÃO DURATION	5.549.865,09	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	3.809.020,80
FIDC	2.782.172,68	FIP	2.225.765,67	AÇÕES - LIVRES	2.121.329,40
AÇÕES - VALOR	1.992.959,70	AÇÕES - EXTERIOR	1.915.783,66	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.314.794,26
MULTIMERCADO - MACRO	1.311.601,25	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	897.056,83		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

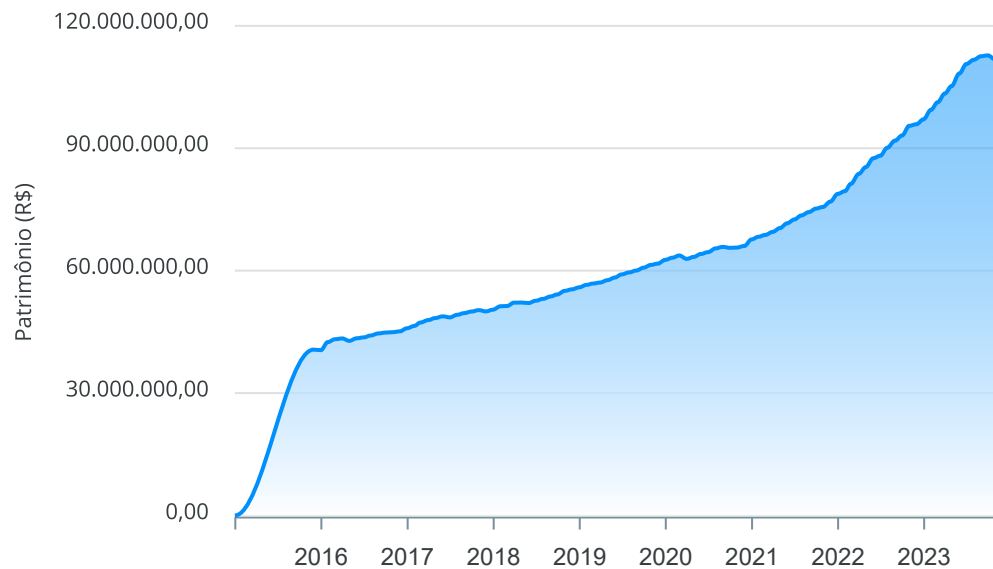
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	97.086.530,51	2.605.686,61	1.434.352,47	99.418.761,12	1.160.896,47	1.160.896,47	1,18%	1,18%	0,95%	0,95%	124,49%	1,83%
Fevereiro	99.418.761,12	1.868.013,19	677.044,41	101.258.624,52	648.894,62	1.809.791,09	0,64%	1,83%	1,18%	2,14%	85,54%	1,88%
Março	101.258.624,52	1.746.003,57	472.085,39	103.421.420,80	888.878,10	2.698.669,19	0,87%	2,72%	1,15%	3,32%	81,89%	1,51%
Abril	103.421.420,80	4.118.113,96	2.858.616,80	105.226.833,23	545.915,27	3.244.584,46	0,52%	3,25%	0,95%	4,30%	75,60%	1,25%
Mai	105.226.833,23	44.619.542,35	45.192.036,87	106.307.852,41	1.653.513,70	4.898.098,16	1,57%	4,88%	0,65%	4,98%	97,93%	2,29%
Junho	106.307.852,41	3.026.252,70	489.897,37	110.641.947,78	1.797.740,04	6.695.838,20	1,65%	6,61%	0,32%	5,31%	124,40%	1,58%
Julho	110.641.947,78	505.483,39	511.453,93	111.673.291,33	1.037.314,09	7.733.152,29	0,94%	7,61%	0,52%	5,86%	129,87%	1,38%
Agosto	111.673.291,33	935.711,05	919.504,89	112.546.347,43	856.849,94	8.590.002,23	0,77%	8,43%	0,67%	6,56%	128,48%	2,14%
Setembro	112.546.347,43	10.069.823,16	10.480.939,83	112.760.196,18	624.965,42	9.214.967,65	0,56%	9,03%	0,64%	7,24%	124,70%	2,05%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

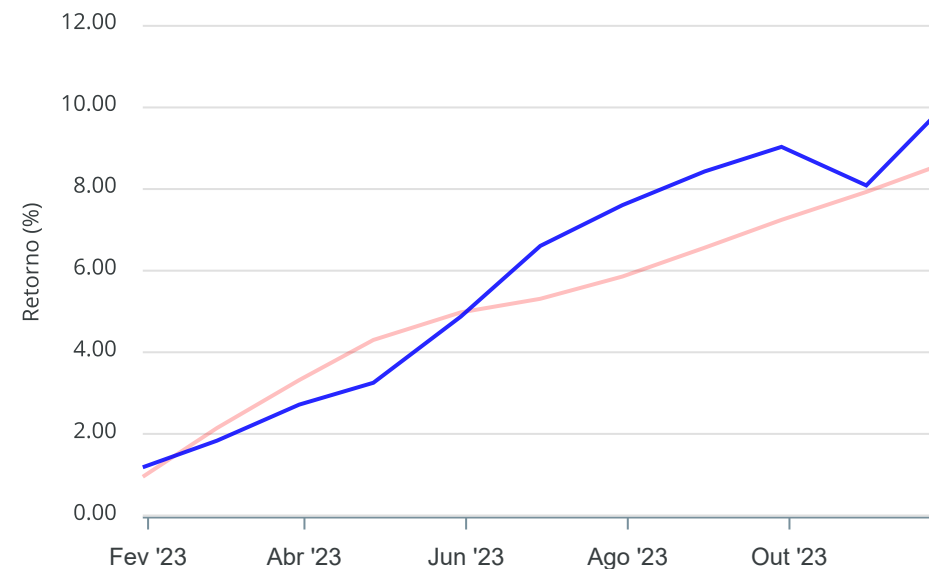
Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO

36M



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.229.184,12	0,00	0,00	7.308.568,49	79.384,37	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.143.259,11	0,00	0,00	3.175.272,96	32.013,85	1,02%	1,02%	0,02%
MAG PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO ...	2.056.611,37	0,00	0,00	2.077.271,48	20.660,11	1,00%	1,00%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.270.276,16	0,00	0,00	1.282.597,61	12.321,45	0,97%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.675.044,50	0,00	0,00	6.738.695,81	63.651,31	0,95%	0,95%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.674.702,26	0,00	0,00	7.744.481,93	69.779,67	0,91%	0,91%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	798.451,70	0,00	0,00	805.670,79	7.219,09	0,90%	0,90%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	355.714,04	4.396,92	0,00	363.327,85	3.216,89	0,89%	0,90%	0,01%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	8.162.045,00	0,00	0,00	8.220.270,21	58.225,21	0,71%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	165.594,65	0,00	0,00	166.344,77	750,12	0,45%	0,45%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.527.543,22	0,00	0,00	5.549.865,09	22.321,87	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.687.192,01	5.065.426,24	5.480.939,83	2.300.190,68	28.512,26	0,37%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.803.969,35	0,00	5.000.000,00	10.846.345,65	42.376,30	0,27%	0,36%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	15.213.203,71	0,00	0,00	15.245.410,23	32.206,52	0,21%	0,21%	0,85%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	1.113.027,65	0,00	0,00	1.110.229,77	-2.797,88	-0,25%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	940.015,35	0,00	0,00	937.604,83	-2.410,52	-0,26%	-0,26%	0,07%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	154.632,13	0,00	0,00	154.226,80	-405,33	-0,26%	-0,26%	0,18%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.479.064,04	0,00	0,00	5.456.996,69	-22.067,35	-0,40%	-0,40%	1,47%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	737.683,81	0,00	0,00	734.338,08	-3.345,73	-0,45%	-0,45%	0,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	3.999.464,27	0,00	0,00	3.969.621,03	-29.843,24	-0,75%	-0,75%	1,90%

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
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.974.384,74	-25.615,26	-0,85%	-0,96%	2,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	4.020.547,11	0,00	0,00	3.971.521,24	-49.025,87	-1,22%	-1,22%	2,73%
Total Renda Fixa	93.207.225,56	8.069.823,16	10.480.939,83	91.133.236,73	337.127,84	0,36%		0,75%

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
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.737.545,28	0,00	0,00	6.038.647,88	301.102,60	5,25%	5,25%	9,54%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	3.697.376,57	0,00	0,00	3.809.020,80	111.644,23	3,02%	3,02%	9,80%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	358.072,29	0,00	0,00	360.619,65	2.547,36	0,71%	0,71%	7,65%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.305.087,71	0,00	0,00	1.311.601,25	6.513,54	0,50%	0,50%	1,92%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.762.844,29	0,00	0,00	1.760.709,75	-2.134,54	-0,12%	-0,12%	8,45%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	882.000,90	0,00	0,00	880.929,22	-1.071,68	-0,12%	-0,12%	0,65%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.228.876,57	0,00	0,00	2.225.765,67	-3.110,90	-0,14%	-	-
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.992.959,70	-7.040,30	-0,35%	0,04%	7,48%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	16.185,29	0,00	0,00	16.127,61	-57,68	-0,36%	-0,36%	0,00%
HAZ FII - ATCR11	1.170.348,03	0,00	0,00	1.132.086,01	-38.262,02	-3,27%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	196.127,50	0,00	0,00	182.708,25	-13.419,25	-6,84%	-6,84%	17,30%
Total Renda Variável	17.354.464,43	2.000.000,00	0,00	19.711.175,79	356.711,36	1,84%		8,18%

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	978.774,08	0,00	0,00	945.859,47	-32.914,61	-3,36%	-3,36%	5,58%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.005.883,36	0,00	0,00	969.924,19	-35.959,17	-3,57%	-3,57%	4,97%
Total Exterior	1.984.657,44	0,00	0,00	1.915.783,66	-68.873,78	-3,47%		5,27%

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.540.144,11	0,00	5.000.000,00	10.846.345,65	306.201,54	1,97%	2,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.960.445,71	0,00	0,00	15.245.410,23	284.964,52	1,90%	1,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.509.942,15	0,00	0,00	7.744.481,93	234.539,78	3,12%	3,12%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.277.581,35	0,00	191.282,39	7.308.568,49	222.269,53	3,05%	0,43%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.532.280,37	0,00	0,00	6.738.695,81	206.415,44	3,16%	3,16%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	8.067.867,70	0,00	0,00	8.220.270,21	152.402,51	1,89%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.444.279,88	0,00	0,00	5.549.865,09	105.585,21	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.070.236,15	0,00	0,00	3.175.272,96	105.036,81	3,42%	3,42%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.402.340,69	6.280.699,54	6.462.879,46	2.300.190,68	80.029,91	0,92%	2,96%
MAG PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO ...	2.013.460,22	0,00	0,00	2.077.271,48	63.811,26	3,17%	3,17%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.412.902,04	0,00	0,00	5.456.996,69	44.094,65	0,81%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.242.543,69	0,00	0,00	1.282.597,61	40.053,92	3,22%	3,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	781.369,98	0,00	0,00	805.670,79	24.300,81	3,11%	3,11%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	190.179,83	0,00	32.046,05	166.344,77	8.210,99	4,32%	-12,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	125.977,31	230.318,06	0,00	363.327,85	7.032,48	1,97%	2,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	4.079.678,81	0,00	113.868,23	3.969.621,03	3.810,45	0,09%	0,05%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	935.676,93	0,00	0,00	937.604,83	1.927,90	0,21%	0,21%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	155.307,27	0,00	0,00	154.226,80	-1.080,47	-0,70%	-0,70%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	742.816,54	0,00	0,00	734.338,08	-8.478,46	-1,14%	-1,14%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	1.121.131,29	0,00	0,00	1.110.229,77	-10.901,52	-0,97%	-0,97%

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
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.974.384,74	-25.615,26	-0,85%	-0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	4.109.274,77	0,00	107.655,99	3.971.521,24	-30.097,54	-0,73%	-0,79%
Total Renda Fixa	91.715.436,79	9.511.017,60	11.907.732,12	91.133.236,73	1.814.514,46	1,79%	

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
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.549.823,76	0,00	0,00	6.038.647,88	488.824,12	8,81%	8,81%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	3.521.770,83	0,00	0,00	3.809.020,80	287.249,97	8,16%	8,16%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.291.079,11	0,00	0,00	1.311.601,25	20.522,14	1,59%	1,59%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	359.943,13	0,00	0,00	360.619,65	676,52	0,19%	0,19%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	16.304,59	0,00	0,00	16.127,61	-176,98	-1,09%	-1,09%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	885.246,03	0,00	0,00	880.929,22	-4.316,81	-0,49%	-0,49%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.992.959,70	-7.040,30	-0,35%	-2,31%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.235.720,99	0,00	0,00	2.225.765,67	-9.955,32	-0,45%	-0,45%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	212.643,50	0,00	0,00	182.708,25	-29.935,25	-14,08%	-14,08%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.790.949,27	0,00	0,00	1.760.709,75	-30.239,52	-1,69%	-1,69%
HAZ FII - ATR11	1.172.780,65	0,00	4.166,53	1.132.086,01	-36.528,11	-3,11%	9.653.007.209,92%
Total Renda Variável	17.036.261,86	2.000.000,00	4.166,53	19.711.175,79	679.080,46	3,57%	

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	933.002,72	0,00	0,00	945.859,47	12.856,75	1,38%	1,38%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	957.246,41	0,00	0,00	969.924,19	12.677,78	1,32%	1,32%
Total Exterior	1.890.249,13	0,00	0,00	1.915.783,66	25.534,53	1,35%	

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.

