

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			5.405.268,41	10,75%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	407.075,43	0,81%	903	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.824.657,59	3,63%	1.132	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	673.567,76	1,34%	794	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.608.919,31	9,17%	873	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.948.258,68	7,86%	933	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	80.472,08	0,16%	782	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.310.697,36	8,58%	49	1,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.343,43	0,01%	999	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.896.730,92	5,76%	152	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.359.293,76	4,69%	404	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	938.160,00	1,87%	226	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	3.957.171,85	7,87%	362	0,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '
LETRA FINANCEIRA GENIAL	S/Info	Não se aplica	2.147.904,77	4,27%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.781.399,01	5,53%	33	2,21%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	968.259,17	1,93%	38	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	769.459,29	1,53%	1.399	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	511.341,41	1,02%	2.755	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.467.563,18	4,91%	139	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	611.048,10	1,22%	201	0,08%	Artigo 8º, Inciso I



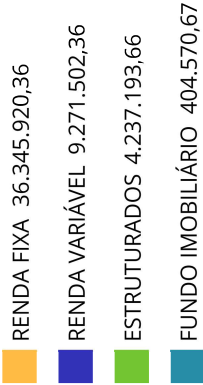
Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.973.752,16	3,93%	71	0,59%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	648.361,15	1,29%	65	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	690.427,47	1,37%	22	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	631.290,43	1,26%	31	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.514.245,15	3,01%	178	0,46%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.516.433,51	3,02%	19	1,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.206.515,00	2,40%	114	0,19%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	404.570,67	0,80%		0,14%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			50.259.187,05				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.588,95				Artigo 6º
		PL Total	50.260.776,00				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	5.405.268,41	10,75%	0,00%	15,00%	81,95%	35.782.135,38
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	15.853.648,21	31,54%	19,45%	21,85%	81,95%	25.333.755,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	65,00%	10.157.699,96	20,21%	19,86%	25,65%	65,00%	22.510.771,62
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	2.147.904,77	4,27%	0,00%	2,50%	20,00%	7.903.932,64
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	5,00%	2.781.399,01	5,53%	0,00%	0,00%	5,00%	-268.439,66
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.512.959,35
Total Renda Fixa	100,00%	36.345.920,36	72,32%	39,31%	65,00%	258,90%	

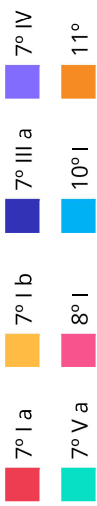
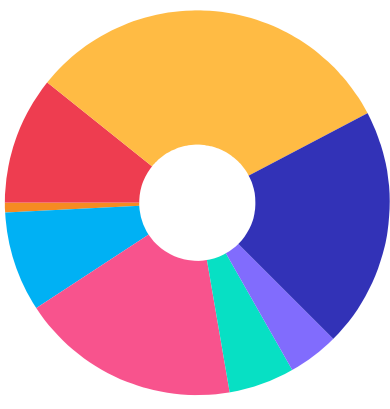


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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%	9.271.502,36	18,45%	1,89%	20,88%	35,00%	8.319.213,11
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.237.193,66	8,43%	3,75%	5,00%	10,00%	788.725,05
Artigo 11º	5,00%	404.570,67	0,80%	1,59%	2,12%	5,00%	2.108.388,68
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário		13.913.266,69	27,68%	7,23%	28,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	5.025.918,71
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	5.025.918,71
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	16.024.112,78	31,88	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.240.021,37	18,38	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	6.932.810,67	13,79	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	5.405.268,41	10,75	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.033.122,30	10,01	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.781.399,01	5,53	-
GENIAL INVESTIMENTOS	2.147.904,77	4,27	-
TRÍGONO CAPITAL	1.321.717,90	2,63	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	968.259,17	1,93	-
ZION INVEST	404.570,67	0,80	-

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 '	5.405.268,41	10,75	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	15.853.648,21	31,54	19,45	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	10.157.699,96	20,21	19,86	65,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	2.781.399,01	5,53	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	9.271.502,36	18,45	1,89	35,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	4.237.193,66	8,43	3,75	10,00
Artigo 11º	404.570,67	0,80	1,59	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00



CRÉDITO
& MERCADO

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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,80%	8,86%	2,33%	4,86%	12,55%	29,06%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,26%	-2,42%	0,21%	0,47%	-2,67%	-15,94%	0,07%	0,01%
IMA Geral (Benchmark)	0,18%	10,59%	1,80%	6,72%	12,50%	22,90%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,96%	10,59%	-0,57%	6,42%	10,78%	18,56%	2,53%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
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 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%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-



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
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,31%	3,54%	6,88%	13,98%	27,19%	0,03%	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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	8,77%	2,96%	5,82%	11,77%	22,06%	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%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,14%	11,18%	1,58%	7,35%	12,82%	22,74%	0,98%	0,03%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%



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%	-	-
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,86%	9,48%	2,63%	6,14%	12,99%	24,41%	0,35%	0,00%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,85%	7,39%	1,94%	6,31%	9,60%	23,26%	1,95%	0,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	9,25%	2,52%	5,77%	12,29%	24,46%	0,54%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,25%	20,50%	8,81%	25,22%	26,65%	33,62%	9,54%	0,22%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,02%	14,38%	8,16%	23,03%	17,39%	13,25%	9,80%	0,20%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-0,96%	0,53%	-4,77%	8,93%	-0,40%	-1,54%	8,76%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,53%	-1,58%	-5,28%	9,42%	-11,12%	-23,18%	9,63%	0,22%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-0,56%	-2,40%	-5,44%	9,05%	-12,44%	-	9,55%	0,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26%	2,02%	-1,96%	10,30%	-0,01%	-4,02%	7,72%	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%
IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-6,84%	-37,23%	-14,08%	-21,33%	-55,64%	-44,69%	17,30%	0,34%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-6,84%	-37,23%	-14,08%	-21,33%	-55,64%	10,83%	17,30%	0,34%

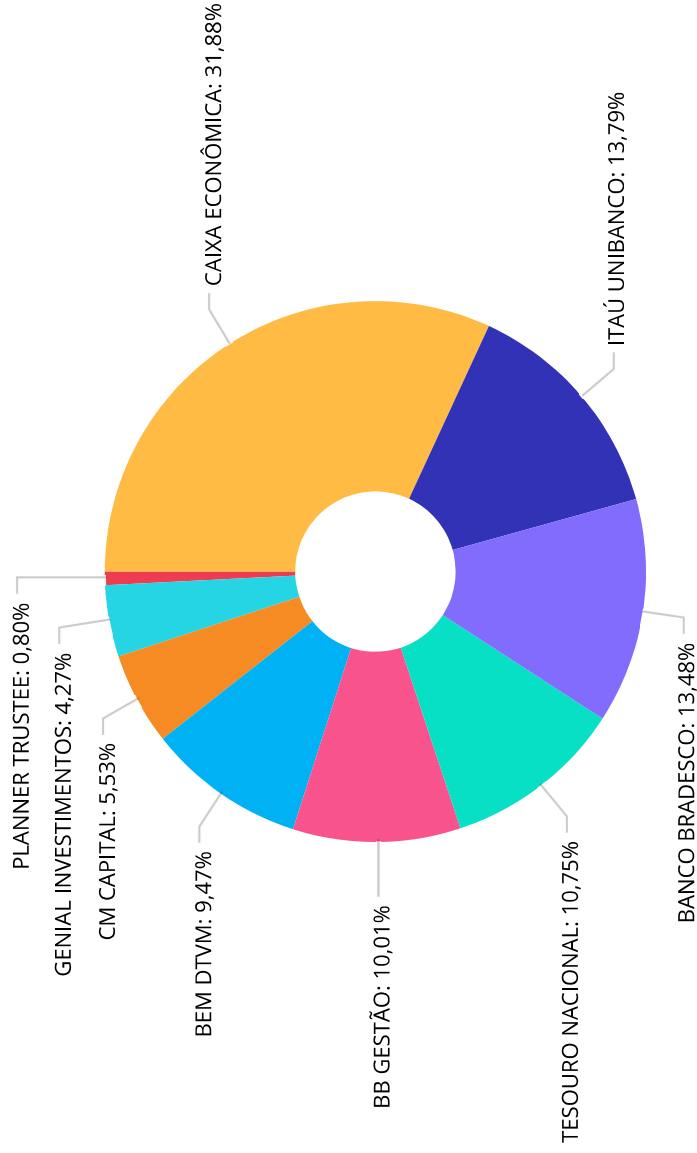


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-2,84%	5,06%	-7,25%	16,09%	-2,94%	-20,83%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,06%	5,63%	-3,40%	11,76%	1,84%	-10,92%	8,99%	0,18%



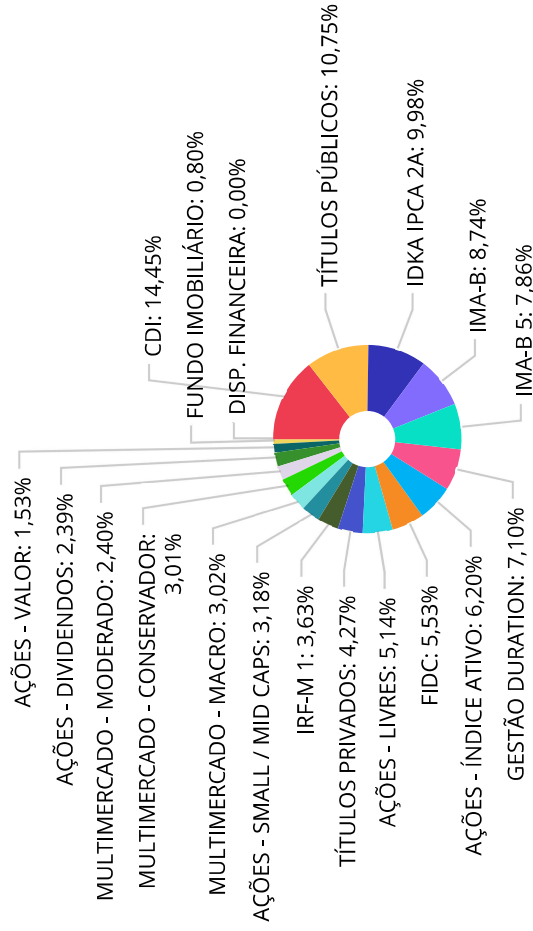
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2023)



CAIXA ECONÔMICA	16.024.112,78
ITAÚ UNIBANCO	6.932.810,67
BANCO BRADESCO	6.772.458,19
TESOURO NACIONAL	5.405.268,41
BB GESTÃO	5.033.122,30
BEM DTVM	4.757.540,25
CM CAPITAL	2.781.399,01
GENIAL INVESTIMENTOS	2.147.904,77
PLANNER TRUSTEE	404.570,67



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



CDI	7.260.969,04	TÍTULOS PÚBLICOS	5.405.268,41	IDKA IPCA 2A	5.015.994,74
IMA-B	4.391.169,44	IMA-B 5	3.948.258,68	GESTÃO DURATION	3.570.298,68
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.115.924,33	FIDC	2.781.399,01	AÇÕES - LIVRES	2.584.800,26
TÍTULOS PRIVADOS	2.147.904,77	IRF-M 1	1.824.657,59	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.599.549,60
MULTIMERCADO - MACRO	1.516.433,51	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.514.245,15	MULTIMERCADO - MODERADO	1.206.515,00
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.201.768,88	AÇÕES - VALOR	769.459,29	FUNDO IMOBILIÁRIO	404.570,67
DISP. FINANCEIRA	1.588,95				



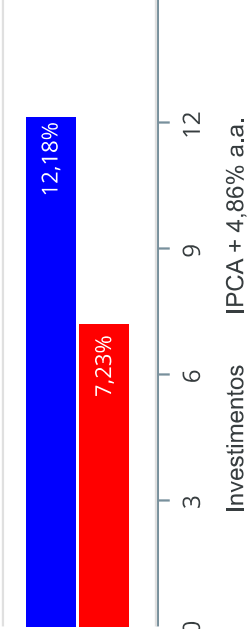
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2023)

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	12/05/2023	574	4.136,33335730	4.166,006524	2.374.255,47	2.391.287,74	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/05/2023	242	4.123,050181	4.124,158362	997.778,14	998.046,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	30/01/2023	486	4.115,226337	4.219,305511	2.000.000,00	2.050.582,48	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	45.217.257,78	1.515.056,25	3.233.034,28	46.125.000,41	2.625.720,66	2.625.720,66	5,81%	5,81%	0,95%	0,95%	612,96%	2,89%
Fevereiro	46.125.000,41	3.995.378,21	2.487.982,92	47.236.647,99	-395.747,71	2.229.972,95	-0,83%	4,93%	1,18%	2,14%	230,17%	2,80%
Março	47.236.647,99	1.554.282,52	2.646.531,45	46.285.799,35	141.400,29	2.371.373,24	0,30%	5,24%	1,15%	3,31%	158,24%	2,48%
Abril	46.285.799,35	1.711.855,53	249.003,78	48.059.891,67	311.240,57	2.682.613,81	0,65%	5,93%	0,95%	4,30%	137,99%	2,25%
Mai	48.059.891,67	7.802.289,26	8.206.595,44	48.924.628,89	1.269.043,40	3.951.657,21	2,64%	8,72%	0,65%	4,97%	175,56%	2,34%
Junho	48.924.628,89	1.800.708,08	1.571.117,88	50.283.504,17	1.129.285,08	5.080.942,29	2,30%	11,22%	0,32%	5,30%	211,70%	2,23%
Julho	50.283.504,17	5.740.124,48	6.470.988,05	50.191.284,59	638.643,99	5.719.586,28	1,27%	12,64%	0,52%	5,85%	216,16%	2,25%
Agosto	50.191.284,59	2.044.429,99	1.889.748,23	50.031.728,03	-314.238,32	5.405.347,96	-0,62%	11,93%	0,67%	6,55%	182,19%	2,27%
Setembro	50.031.728,03	2.518.115,57	2.401.801,28	50.259.187,05	111.144,73	5.516.492,69	0,22%	12,18%	0,64%	7,23%	168,48%	2,72%

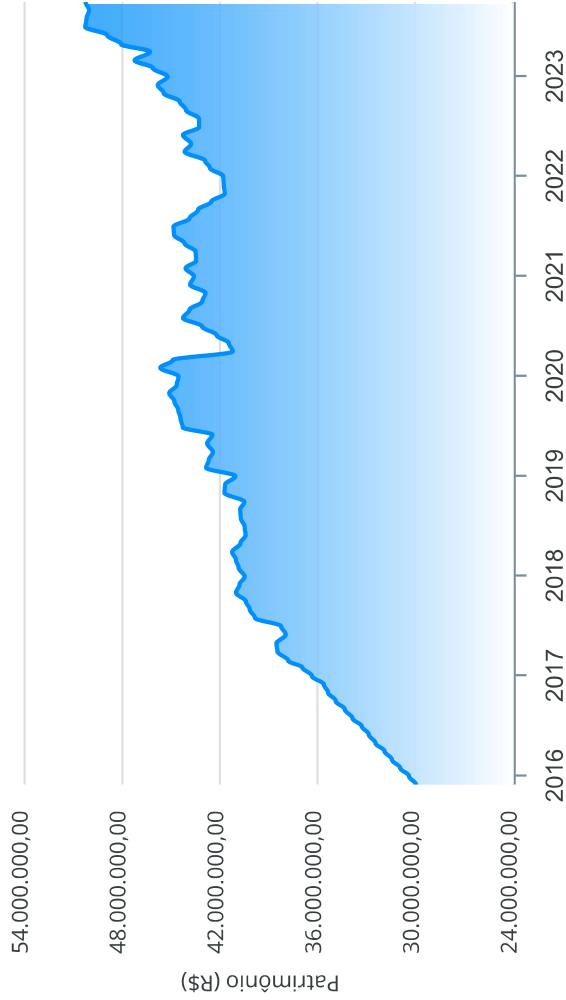
Investimentos x Meta de Rentabilidade



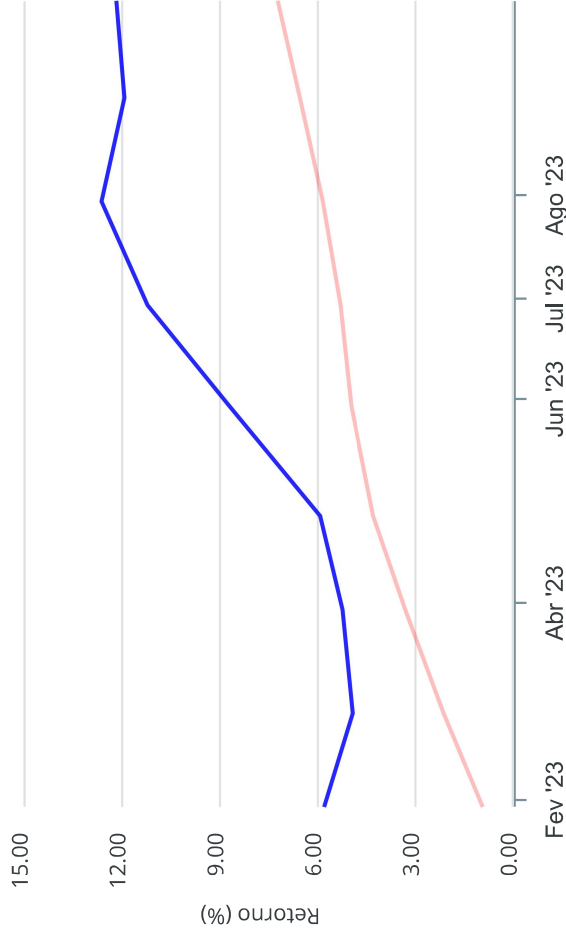


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 ☐ SMIL ☐ 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
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.334.792,53	0,00	0,00	2.359.293,76	24.501,23	1,05%	1,05%	0,03%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	929.274,09	0,00	0,00	938.160,00	8.885,91	0,96%	0,96%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.808.308,02	0,00	0,00	1.824.657,59	16.349,57	0,90%	0,90%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.287,09	0,00	0,00	6.343,43	56,34	0,90%	0,90%	0,01%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	2.130.914,92	0,00	0,00	2.147.904,77	16.989,85	0,80%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	5.377.224,71	0,00	0,00	5.405.268,41	28.043,70	0,52%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	3.814.708,68	1.819.563,97	1.703.249,68	3.957.171,85	26.148,88	0,46%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	670.858,63	0,00	0,00	673.567,76	2.709,13	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.592.576,01	0,00	0,00	4.608.919,31	16.343,30	0,36%	0,36%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	406.215,47	0,00	0,00	407.075,43	859,96	0,21%	0,21%	0,85%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.892.742,88	0,00	0,00	2.896.730,92	3.988,04	0,14%	0,14%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.943.845,03	0,00	0,00	3.948.258,68	4.413,65	0,11%	0,11%	0,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	698.969,73	0,00	698.551,60	0,00	-418,13	-0,06%	-0,30%	1,61%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.788.549,83	0,00	0,00	2.781.399,01	-7.150,82	-0,26%	-0,26%	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.652.176,43	698.551,60	0,00	4.310.697,36	-40.030,67	-0,92%	-0,96%	2,53%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	81.249,69	0,00	0,00	80.472,08	-777,61	-0,96%	-0,96%	2,51%
Total Renda Fixa	36.128.693,74	2.518.115,57	2.401.801,28	36.345.920,36	100.912,33	0,28%		0,78%

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	656.000,97	0,00	0,00	690.427,47	34.426,50	5,25%	5,25%	9,54%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	612.787,01	0,00	0,00	631.290,43	18.503,42	3,02%	3,02%	9,80%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.503.489,69	0,00	0,00	1.516.433,51	12.943,82	0,86%	0,86%	0,35%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.196.340,42	0,00	0,00	1.206.515,00	10.174,58	0,85%	0,85%	1,95%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.501.729,74	0,00	0,00	1.514.245,15	12.515,41	0,83%	0,83%	0,54%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	767.470,97	0,00	0,00	769.459,29	1.988,32	0,26%	0,26%	7,72%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	611.788,89	0,00	0,00	611.048,10	-740,79	-0,12%	-0,12%	8,45%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	512.828,16	0,00	0,00	511.341,41	-1.486,75	-0,29%	-0,29%	6,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.984.210,15	0,00	0,00	1.973.752,16	-10.457,99	-0,53%	-0,53%	9,63%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	652.006,62	0,00	0,00	648.361,15	-3.645,47	-0,56%	-0,56%	9,55%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.491.506,40	0,00	0,00	2.467.563,18	-23.943,22	-0,96%	-0,96%	8,76%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	978.590,37	0,00	0,00	968.259,17	-10.331,20	-1,06%	-1,06%	8,99%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	434.284,90	0,00	0,00	404.570,67	-29.714,23	-6,84%	-6,84%	17,30%
Total Renda Variável	13.903.034,29	0,00	0,00	13.913.266,69	10.232,40	0,07%		6,73%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de **Setembro / 2023**

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%



CRÉDITO
& MERCADO

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
	TÍTULOS PÚBLICOS	5.449.573,36	0,00	158.957,48	5.405.268,41	114.652,53	2,10%	-
	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.515.909,36	0,00	0,00	4.608.919,31	93.009,95	2,06%	2,06%
	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.278.618,23	0,00	0,00	2.359.293,76	80.675,53	3,54%	3,54%
	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	3.753.750,44	5.673.811,81	5.548.998,72	3.957.171,85	78.608,32	0,83%	2,96%
	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.883.481,61	0,00	0,00	3.948.258,68	64.777,07	1,67%	1,67%
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.769.621,88	0,00	0,00	1.824.657,59	55.035,71	3,11%	3,11%
	LETRA FINANCEIRA GENIAL	2.100.069,96	0,00	0,00	2.147.904,77	47.834,81	2,28%	-
	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.851.740,20	0,00	0,00	2.896.730,92	44.990,72	1,58%	1,58%
	CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.333.848,13	0,00	425.723,13	938.160,00	30.035,00	2,25%	3,16%
	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.093.922,94	0,00	3.117.380,61	0,00	23.457,67	0,76%	3,54%
	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	660.753,25	0,00	0,00	673.567,76	12.814,51	1,94%	1,94%
	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	690.192,53	0,00	698.551,60	0,00	8.359,07	1,21%	0,97%
	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	399.466,45	0,00	0,00	407.075,43	7.608,98	1,90%	1,90%
	GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.775.679,93	0,00	0,00	2.781.399,01	5.719,08	0,21%	0,21%
	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	510.005,10	0,00	512.926,02	0,00	2.920,92	0,57%	2,07%
	BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.160,97	0,00	0,00	6.343,43	182,46	2,96%	2,96%
	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	80.903,63	0,00	0,00	80.472,08	-431,55	-0,53%	-0,53%
	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	4.328.858,23	0,00	4.310.697,36	-18.160,87	-0,42%	-0,57%
	Total Renda Fixa	36.153.697,97	10.002.670,04	10.462.537,56	36.345.920,36	652.089,91	1,41%	



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	634.537,88	0,00	0,00	690.427,47	55.889,59	8,81%	8,81%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	583.682,88	0,00	0,00	631.290,43	47.607,55	8,16%	8,16%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.477.541,78	0,00	0,00	1.516.433,51	38.891,73	2,63%	2,63%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.477.019,06	0,00	0,00	1.514.245,15	37.226,09	2,52%	2,52%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.183.589,08	0,00	0,00	1.206.515,00	22.925,92	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	621.542,62	0,00	0,00	611.048,10	-10.494,52	-1,69%	-1,69%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	784.833,55	0,00	0,00	769.459,29	-15.374,26	-1,96%	-1,96%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	535.554,89	0,00	0,00	511.341,41	-24.213,48	-4,52%	-4,52%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	982.430,73	0,00	300.000,00	648.361,15	-34.069,58	-3,47%	-5,44%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.002.354,76	0,00	0,00	968.259,17	-34.095,59	-3,40%	-3,40%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	470.856,26	0,00	0,00	404.570,67	-66.285,59	-14,08%	-14,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.083.828,97	0,00	0,00	1.973.752,16	-110.076,81	-5,28%	-5,28%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.292.033,74	300.000,00	0,00	2.467.563,18	-124.470,56	-4,80%	-4,77%
Total Renda Variável	14.129.806,20	300.000,00	300.000,00	13.913.266,69	-216.539,51	-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 aliquotas 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.

