

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			407.164.653,82	43,39%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.994.262,23	0,21%	685	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	17.291.312,66	1,84%	794	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	77.700,93	0,01%	1.132	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	938.226,47	0,10%	140	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	5.949.228,76	0,63%	94	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	17.794.597,88	1,90%	794	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	31.811.244,33	3,39%	933	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	58.287.293,75	6,21%	782	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	99.914,19	0,01%	1.185	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	29.807.052,41	3,18%	426	1,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.444.242,44	0,90%	113	1,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.491,44	0,00%	18	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIX...	D+0	Não há	18.544.792,71	1,98%	724	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.394.854,38	0,68%	7.261	1,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.724.195,20	0,50%	246	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+3	Não há	2.399.373,72	0,26%	2.874	3,68%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	325.028,89	0,03%	213	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.889.155,88	0,41%	139	2,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ...	Não há	7.022.197,55	0,75%	4.676	2,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

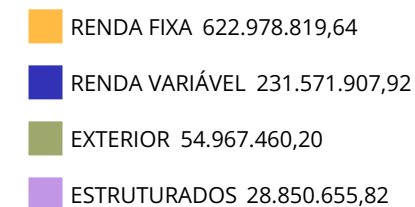
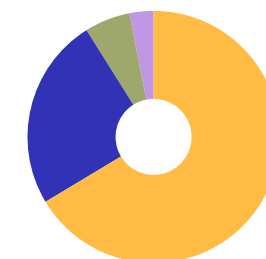
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	6.074.454,38	0,65%	106	8,77%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.222.349,10	0,24%	1.399	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.071.739,89	0,54%	19.831	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.352.035,11	1,00%	2.298	4,57%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	13.516.505,18	1,44%	6.672	5,23%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	7.868.615,82	0,84%	1.003	1,25%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	16.022.749,00	1,71%	151	1,71%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	10.645.553,08	1,13%	123	1,60%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	8.219.367,95	0,88%	2.619	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	17.650.894,57	1,88%	62	1,02%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	954.045,83	0,10%	2.466	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
INDIE FIC AÇÕES	D+32	Não há	11.091.855,63	1,18%	9.627	2,76%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.509.055,79	0,16%	1.263	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	807.137,36	0,09%	3.625	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	D+3 du	Não há	471.432,78	0,05%	98	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	842.557,56	0,09%	159	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	326.407,04	0,03%	1.053	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	5.010.982,32	0,53%	35	3,88%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	26.200.910,29	2,79%	56	1,39%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	D+7	Não há	10.645.513,28	1,13%	38	7,03%	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
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	1.421.689,71	0,15%	140	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	24.019.563,98	2,56%	1.277	9,32%	Artigo 8º, Inciso I
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	D+3	Não há	23.125.322,16	2,46%	147	0,48%	Artigo 8º, Inciso II
IT NOW S&P500® TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11	D+3	Não há	26.182.362,21	2,79%	48	4,33%	Artigo 8º, Inciso II
TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENT...	D+2 du	Não há	2.318.807,90	0,25%	20.529	7,01%	Artigo 8º, Inciso II
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	D+5 du	Não há	13.167.619,92	1,40%	68	7,38%	Artigo 9º, Inciso II
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	4.700.803,92	0,50%	2.697	2,14%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	3.668.036,77	0,39%	139	3,41%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	19.742.232,64	2,10%	8.273	3,11%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.254.705,08	0,45%	477	0,21%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.818.046,31	0,41%	377	0,55%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	5.616.015,56	0,60%	64.970	0,41%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	650.618,48	0,07%	19	0,43%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	13.299.556,68	1,42%	2.309	2,66%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	3.446.636,71	0,37%	4.179	1,84%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.453.843,95	1,22%	24.858	1,55%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			938.368.843,58				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.103.112,28				Artigo 6º
PL Total			939.471.955,86				

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

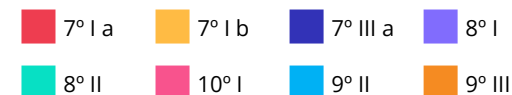
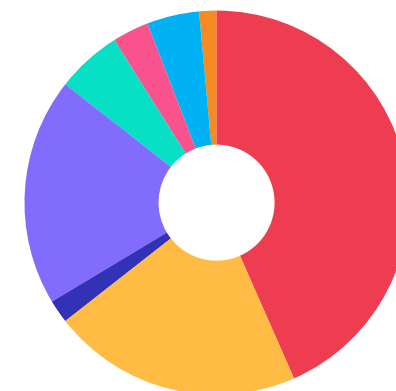
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	407.164.653,82	43,39%	0,00%	56,37%	100,00%	531.204.189,76
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	197.454.214,58	21,04%	0,00%	6,22%	100,00%	740.914.629,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	938.368.843,58
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	46.918.442,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	18.359.951,24	1,96%	0,00%	15,00%	60,00%	544.661.354,91
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	563.021.306,15
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	187.673.768,72
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	46.918.442,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	46.918.442,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	46.918.442,18
Total Renda Fixa	100,00%	622.978.819,64	66,39%	0,00%	77,59%	460,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	179.945.415,65	19,18%	0,00%	1,00%	30,00%	101.565.237,42
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	51.626.492,27	5,50%	0,00%	1,41%	30,00%	229.884.160,80
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	28.850.655,82	3,07%	0,00%	10,00%	10,00%	64.986.228,54
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	46.918.442,18
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	46.918.442,18
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	46.918.442,18
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	260.422.563,74	27,75%	0,00%	12,41%	85,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	93.836.884,36
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	41.278.693,25	4,40%	0,00%	4,50%	10,00%	52.558.191,11
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	13.688.766,95	1,46%	0,00%	5,50%	10,00%	80.148.117,41
Total Exterior	10,00%	54.967.460,20	5,86%	0,00%	10,00%	30,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	407.164.653,82	43,39	-
CAIXA DTVM	176.591.725,54	18,82	-
ITAU UNIBANCO	49.307.684,37	5,25	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	38.435.533,93	4,10	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.319.786,48	3,44	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	31.041.761,53	3,31	-
WESTERN ASSET	27.353.869,77	2,92	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	27.334.933,63	2,91	-
XP ASSET MANAGEMENT	26.761.844,46	2,85	-
TARPON INVESTIMENTOS	26.200.910,29	2,79	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	17.650.894,57	1,88	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	13.299.556,68	1,42	-
VINCI PARTNERS	12.067.202,99	1,29	-
INDIE CAPITAL	11.091.855,63	1,18	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	8.219.367,95	0,88	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.599.847,24	0,70	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	6.074.454,38	0,65	-
BANCO J. SAFRA S/A	5.467.741,23	0,58	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.010.982,32	0,53	-
GENIAL INVESTIMENTOS	3.668.036,77	0,39	-
SICREDI	3.446.636,71	0,37	-
OCCAM BRASIL	1.509.055,79	0,16	-
ICATU VANGUARDA	954.045,83	0,10	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	471.432,78	0,05	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	325.028,89	0,03	-

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
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%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	0,92%	9,95%	3,16%	6,44%	13,39%	24,41%	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%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,32%	8,46%	1,03%	4,23%	9,76%	17,99%	1,50%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	-1,38%	10,23%	-1,13%	6,46%	8,91%	14,71%	2,95%	0,06%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,96%	10,58%	-0,57%	6,43%	10,77%	18,51%	2,53%	0,05%
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	-1,00%	9,76%	-0,69%	5,97%	9,32%	16,30%	2,52%	0,05%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,97%	10,54%	-0,60%	6,39%	10,71%	18,31%	2,53%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,58%	-0,66%	6,49%	10,77%	18,43%	2,54%	0,05%

IRF-M (Benchmark)	0,17%	11,62%	1,83%	7,45%	13,57%	22,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	11,49%	1,77%	7,33%	13,46%	22,40%	1,12%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	11,72%	2,73%	7,91%	13,59%	23,82%	0,14%	0,02%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,97%	9,84%	3,19%	6,42%	13,31%	25,63%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,30%	11,35%	0,97%	6,94%	10,76%	22,65%	1,61%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,79%	3,08%	4,57%	11,73%	22,62%	0,33%	0,02%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	-0,49%	6,94%	0,60%	5,82%	8,01%	17,64%	1,86%	0,04%

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%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,86%	9,48%	2,63%	6,14%	12,99%	24,41%	0,35%	0,00%
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%	-	-
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	0,46%	-2,05%	-4,41%	8,27%	-5,10%	-9,43%	8,00%	0,20%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	0,33%	5,96%	-1,08%	14,60%	1,09%	-4,04%	7,83%	0,21%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7,66%	39,29%	11,58%	45,55%	32,33%	58,35%	8,10%	0,22%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,08%	5,49%	-1,77%	13,76%	1,07%	3,72%	7,85%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26%	2,02%	-1,96%	10,30%	-0,01%	-4,02%	7,72%	0,20%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	-1,13%	4,09%	-3,27%	11,56%	1,22%	10,10%	7,28%	0,20%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	2,33%	11,13%	-1,23%	16,13%	5,99%	15,71%	5,93%	0,19%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,50%	25,70%	3,31%	33,12%	19,17%	31,43%	8,23%	0,22%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-0,29%	4,80%	-2,40%	13,51%	-0,45%	-1,62%	7,39%	0,20%
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	-4,35%	5,28%	-8,23%	16,91%	-12,07%	-41,57%	9,20%	0,29%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,68%	4,17%	-2,52%	11,07%	-0,35%	-0,25%	7,23%	0,21%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-1,20%	7,77%	-1,54%	14,21%	-0,24%	-19,93%	8,09%	0,22%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,00%	6,85%	-4,46%	12,85%	1,02%	4,21%	7,67%	0,18%

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
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	0,75%	6,68%	-1,16%	14,72%	6,58%	6,15%	7,54%	0,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,47%	4,43%	-0,70%	13,47%	1,94%	0,42%	7,60%	0,20%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-0,56%	6,28%	-1,60%	13,66%	-0,09%	-17,30%	7,86%	0,21%
OCCAM FIC AÇÕES	0,79%	2,14%	-2,31%	9,30%	0,55%	2,27%	7,05%	0,18%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01%	6,08%	-1,83%	14,99%	1,58%	-6,60%	7,55%	0,20%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,24%	16,74%	0,98%	21,94%	12,41%	7,63%	6,49%	0,18%
IBX (Benchmark)	0,84%	5,50%	-1,02%	13,78%	5,09%	3,69%	-	-
INDIE FIC AÇÕES	1,00%	15,12%	-2,12%	26,25%	9,41%	-20,62%	8,98%	0,24%
IDIV (Benchmark)	1,32%	10,67%	1,25%	15,38%	14,16%	22,39%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,59%	3,98%	-0,29%	11,66%	4,41%	0,60%	7,51%	0,18%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,54%	9,82%	-0,27%	14,91%	9,96%	14,99%	6,43%	0,18%
NASDAQ 100 Index (Benchmark)	-3,42%	29,10%	0,73%	10,04%	24,23%	-7,78%	-	-
TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENTO NO EXTERIOR - N...	-3,57%	28,01%	1,94%	10,65%	25,70%	-7,49%	6,80%	0,26%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-4,87%	11,68%	-3,65%	4,35%	19,59%	-0,45%	-	-
IT NOW S&P500® TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11	-3,28%	7,02%	1,57%	3,93%	13,07%	-6,63%	5,38%	0,21%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-4,43%	17,75%	-1,92%	8,25%	29,14%	17,10%	4,99%	0,17%

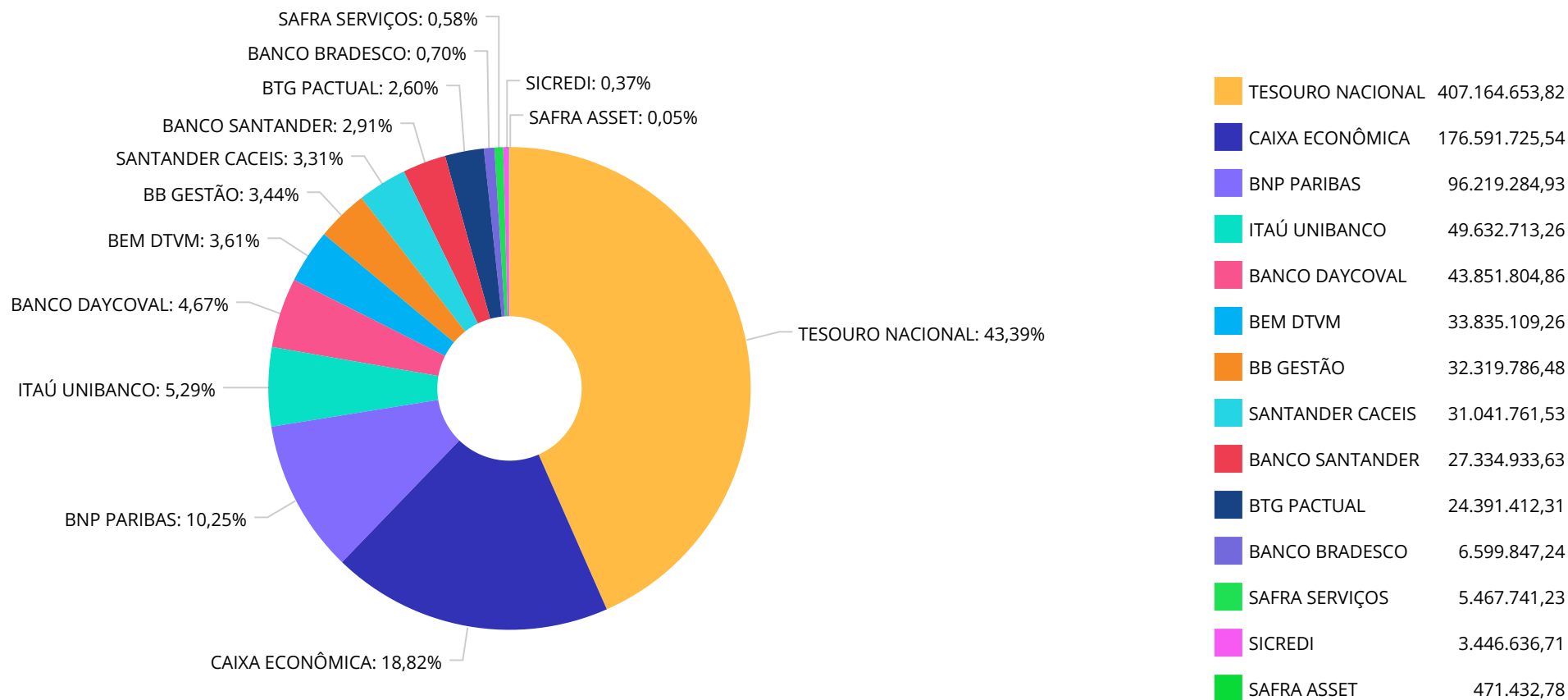
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-4,39%	18,26%	-1,76%	8,64%	30,05%	23,09%	5,04%	0,17%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	-4,42%	18,22%	-1,80%	8,52%	29,82%	17,99%	4,84%	0,17%
SMLL (Benchmark)	-2,84%	5,06%	-7,25%	16,09%	-2,94%	-20,83%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-3,13%	4,37%	-5,87%	11,01%	-2,78%	-19,25%	8,93%	0,24%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-4,10%	14,59%	1,93%	4,87%	18,17%	-15,51%	6,30%	0,24%

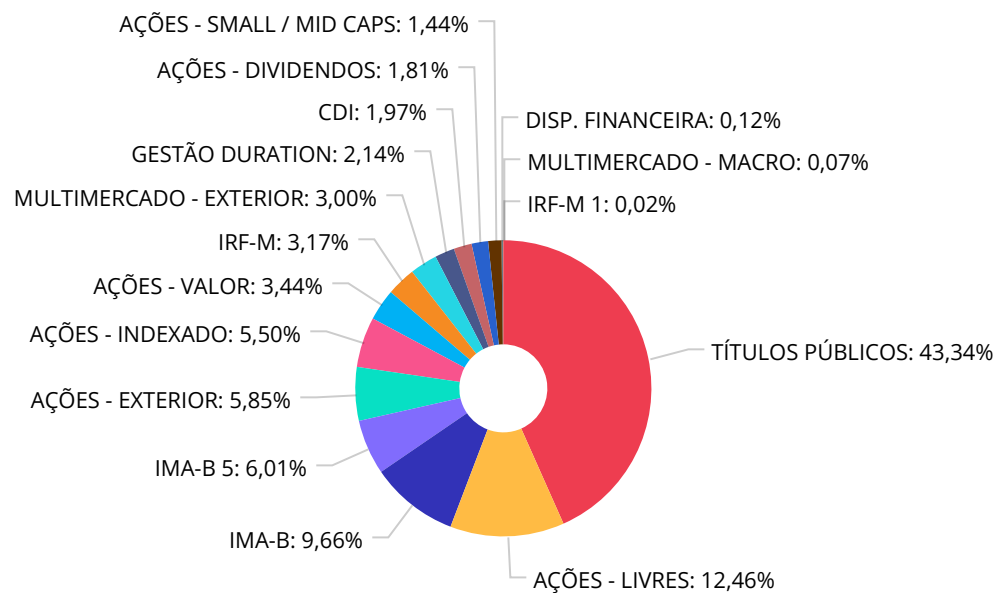
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,80%	10,06%	2,42%	4,91%	14,38%	-13,81%	5,14%	20,560%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,03%	18,24%	-1,41%	5,62%	20,40%	-18,54%	5,70%	23,726%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,78%	5,21%	-0,07%	0,75%	11,10%	-12,63%	-	-
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,03%	17,47%	-2,82%	6,05%	0,98%	-57,64%	12,18%	39,494%
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%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	-4,35%	5,28%	-8,23%	16,91%	-12,07%	-41,57%	9,20%	29,407%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,61%	4,13%	-0,05%	0,10%	9,93%	-14,78%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	-5,72%	23,57%	-0,38%	8,15%	26,65%	-18,22%	6,06%	23,198%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-4,10%	14,59%	1,93%	4,87%	18,17%	-15,51%	6,30%	23,914%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	407.164.653,82	■ AÇÕES - LIVRES	117.097.856,06	■ IMA-B	90.715.687,30	■ IMA-B 5	56.435.637,84
■ AÇÕES - EXTERIOR	54.967.460,20	■ AÇÕES - INDEXADO	51.626.492,27	■ AÇÕES - VALOR	32.354.259,58	■ IRF-M	29.807.052,41
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	28.200.037,34	■ GESTÃO DURATION	20.113.889,00	■ CDI	18.544.792,71	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	16.976.794,83
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	13.516.505,18	■ DISP. FINANCEIRA	1.103.112,28	■ MULTIMERCADO - MACRO	650.618,48	■ IRF-M 1	197.106,56

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	15/08/2030	03/08/2022	170	3.977,335032	4.172,366251	676.146,96	709.302,26	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	15/08/2022	240	4.042,830139	4.242,907808	970.279,23	1.018.297,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	16/08/2022	368	4.053,223383	4.252,06598	1.491.586,20	1.564.760,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	11/11/2022	701	4.028,221339	4.181,773174	2.823.783,16	2.931.422,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	12/08/2022	1.268	4.160,660528	4.242,907808	5.275.717,55	5.380.007,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	13/09/2022	4.250	4.049,90807	4.245,196315	17.212.109,30	18.042.084,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	14/10/2022	4.501	4.052,45053	4.240,851469	18.240.079,84	19.088.072,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/08/2022	520	4.068,86026	4.261,244882	2.115.807,34	2.215.847,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	18/11/2022	4.183	3.949,154659	4.212,958222	16.519.313,94	17.622.804,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	15/12/2022	4.054	3.880,301353	4.114,129562	15.730.741,69	16.678.681,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/01/2023	2.808	3.981,78350	4.158,784462	11.180.848,07	11.677.866,76	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	10/02/2023	2.553	3.969,50631	4.121,579646	10.134.149,61	10.522.392,83	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	10/03/2023	4.130	4.030,827035	4.136,728565	16.647.315,65	17.084.688,97	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/08/2022	564	4.029,667122	4.298,922324	2.272.732,26	2.424.592,19	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	12/08/2022	1.293	4.023,63576	4.288,723544	5.202.561,04	5.545.319,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	13/09/2022	3.709	4.017,096069	4.296,878422	14.899.409,32	15.937.122,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	14/10/2022	3.965	4.010,545468	4.302,972815	15.901.812,78	17.061.287,21	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/08/2022	569	4.059,281709	4.261,145382	2.309.731,29	2.424.591,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	13/09/2022	3.749	4.051,669462	4.252,414231	15.189.708,81	15.942.300,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	14/10/2022	3.975	4.098,511687	4.292,342867	16.291.583,96	17.062.062,89	Curva

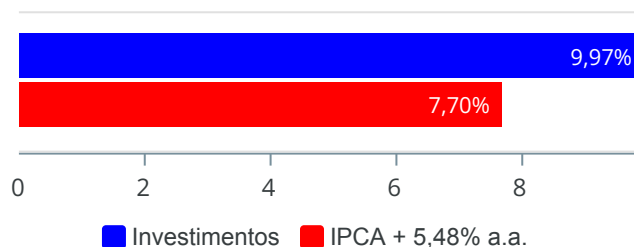
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/12/2022	3.997	4.098,511687	4.047,530704	16.381.751,21	16.177.980,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/11/2022	4.105	4.024,675706	4.168,58524	16.521.293,77	17.112.042,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/08/2022	1.276	4.018,020049	4.222,485374	5.126.993,58	5.387.891,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2023	2.795	3.981,78350	4.053,84068	11.129.084,88	11.330.484,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/02/2023	2.538	3.875,51702	4.020,607584	9.836.062,20	10.204.302,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/03/2023	4.255	3.917,444482	4.020,205437	16.668.726,27	17.105.974,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/08/2022	566	4.019,06785	4.290,842071	2.274.792,40	2.428.616,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	13/09/2022	3.721	4.081,965410	4.285,891932	15.188.993,29	15.947.803,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/10/2022	3.945	4.035,965324	4.331,243334	15.921.883,20	17.086.754,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/11/2022	4.208	3.926,721131	4.189,144487	16.523.642,52	17.627.920,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	15/12/2022	5.274	3.926,721131	4.058,007255	20.709.527,24	21.401.930,26	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/08/2022	1.305	3.985,130583	4.251,485562	5.200.595,41	5.548.188,65	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/01/2023	3.448	3.981,78350	4.097,479847	13.729.189,51	14.128.110,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/02/2023	1.065	3.940,959413	4.078,587231	4.197.121,77	4.343.695,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/03/2023	4.220	3.955,371187	4.058,463298	16.691.666,41	17.126.715,11	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/02/2023	3.277	3.901,91222	4.050,271107	12.786.566,34	13.272.738,41	Curva

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	817.070.472,10	43.938.113,08	40.308.000,00	837.707.035,82	17.006.450,64	17.006.450,64	2,07%	2,07%	1,00%	1,00%	207,36%	5,92%
Fevereiro	837.707.035,82	58.919.413,97	55.529.299,19	835.952.162,28	-5.144.988,32	11.861.462,32	-0,61%	1,45%	1,23%	2,24%	64,73%	5,20%
Março	835.952.162,28	64.161.426,28	58.852.507,80	848.313.913,73	7.052.832,97	18.914.295,29	0,84%	2,30%	1,20%	3,47%	66,33%	5,66%
Abril	848.313.913,73	9.654.105,52	7.082.000,00	861.160.635,44	10.274.616,19	29.188.911,48	1,21%	3,53%	0,99%	4,49%	78,64%	5,23%
Mai	861.160.635,44	90.553.000,00	85.408.597,58	886.808.690,98	20.503.653,12	49.692.564,60	2,37%	5,98%	0,70%	5,22%	114,57%	5,15%
Junho	886.808.690,98	10.303.000,00	7.732.000,00	913.074.159,11	23.694.468,13	73.387.032,73	2,66%	8,81%	0,37%	5,61%	157,08%	4,95%
Julho	913.074.159,11	23.386.000,00	21.405.000,00	928.584.474,79	13.529.315,68	86.916.348,41	1,48%	10,42%	0,57%	6,21%	167,87%	4,65%
Agosto	928.584.474,79	24.529.785,32	17.531.785,32	931.706.667,51	-3.875.807,28	83.040.541,13	-0,41%	9,96%	0,72%	6,97%	142,90%	4,71%
Setembro	931.706.667,51	13.939.000,00	13.837.000,00	931.913.051,46	104.383,95	83.144.925,08	0,01%	9,97%	0,69%	7,70%	129,46%	4,80%

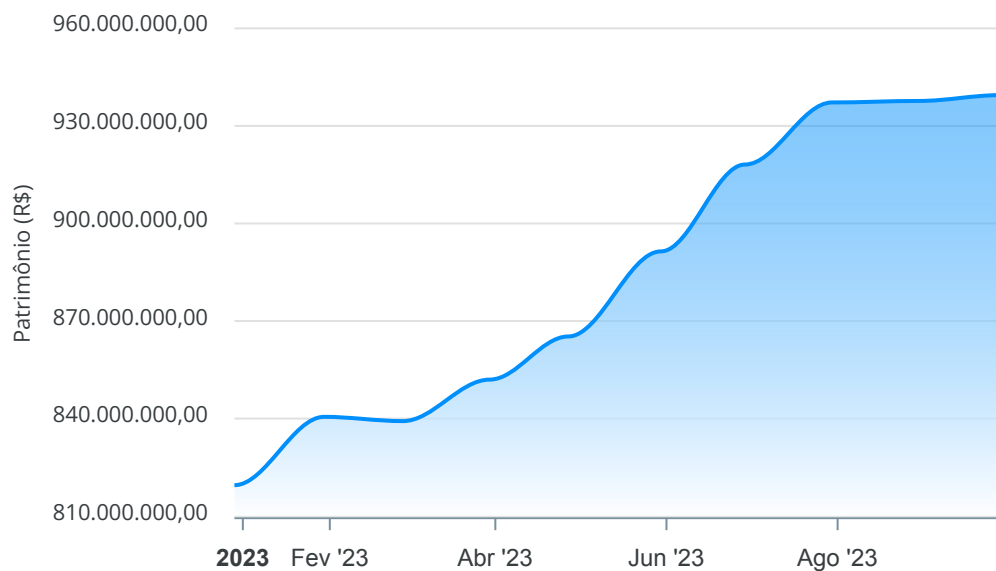
Investimentos x Meta de Rentabilidade



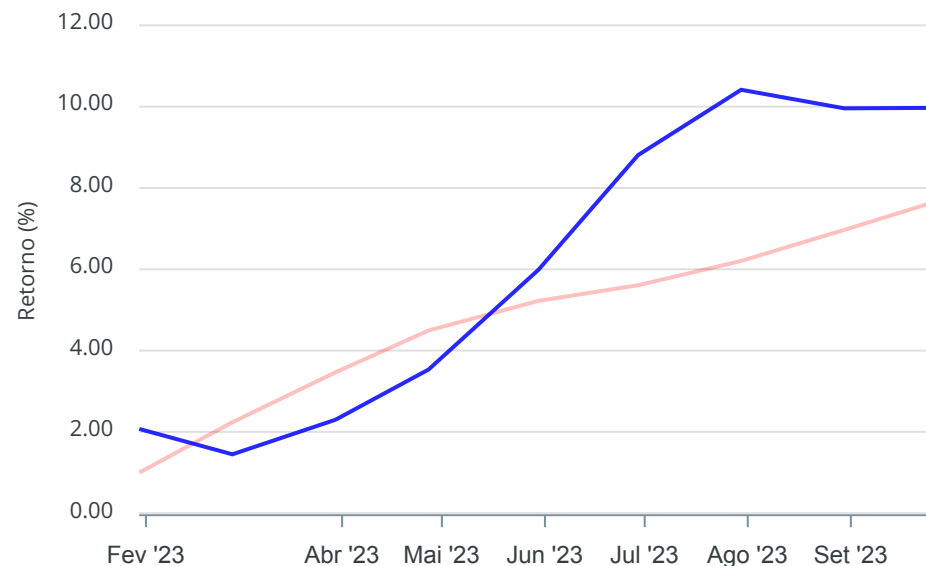
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	928.067,32	0,00	0,00	938.226,47	10.159,15	1,09%	1,09%	0,33%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	19.313,83	0,00	0,00	19.491,44	177,61	0,92%	0,92%	0,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	99.013,94	0,00	0,00	99.914,19	900,25	0,91%	0,91%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	77.004,70	0,00	0,00	77.700,93	696,23	0,90%	0,90%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.976.898,51	0,00	0,00	1.994.262,23	17.363,72	0,88%	0,88%	0,14%
TÍTULOS PÚBLICOS	404.253.775,16	0,00	0,00	407.164.653,82	2.910.878,66	0,72%	-	-
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	18.591.889,08	10.531.000,00	10.750.000,00	18.544.792,71	171.903,63	0,59%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.723.026,98	0,00	0,00	17.794.597,88	71.570,90	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	27.385.517,87	2.387.000,00	0,00	29.807.052,41	34.534,54	0,12%	0,15%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	31.775.683,43	0,00	0,00	31.811.244,33	35.560,90	0,11%	0,11%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.272.114,43	0,00	0,00	17.291.312,66	19.198,23	0,11%	0,11%	0,99%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	326.004,32	0,00	0,00	325.028,89	-975,43	-0,30%	-0,30%	1,61%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	6.415.514,57	0,00	0,00	6.394.854,38	-20.660,19	-0,32%	-0,32%	1,50%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	7.056.550,97	0,00	0,00	7.022.197,55	-34.353,42	-0,49%	-0,49%	1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	58.850.533,55	0,00	0,00	58.287.293,75	-563.239,80	-0,96%	-0,96%	2,51%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	8.526.424,80	0,00	0,00	8.444.242,44	-82.182,36	-0,96%	-0,96%	2,53%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	6.007.670,40	0,00	0,00	5.949.228,76	-58.441,64	-0,97%	-0,97%	2,53%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.770.641,13	0,00	0,00	4.724.195,20	-46.445,93	-0,97%	-0,97%	2,54%
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	2.423.516,97	0,00	0,00	2.399.373,72	-24.143,25	-1,00%	-1,00%	2,52%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	3.943.396,78	0,00	0,00	3.889.155,88	-54.240,90	-1,38%	-1,38%	2,95%



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
Total Renda Fixa	618.422.558,74	12.918.000,00	10.750.000,00	622.978.819,64	2.388.260,90	0,38%		1,52%

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	24.337.856,08	0,00	0,00	26.200.910,29	1.863.054,21	7,65%	7,65%	8,10%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	23.473.460,57	0,00	0,00	24.019.563,98	546.103,41	2,33%	2,33%	5,93%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	17.389.871,46	0,00	0,00	17.650.894,57	261.023,11	1,50%	1,50%	8,23%
INDIE FIC AÇÕES	10.981.649,07	0,00	0,00	11.091.855,63	110.206,56	1,00%	1,00%	8,98%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	645.065,00	0,00	0,00	650.618,48	5.553,48	0,86%	0,86%	0,35%
OCCAM FIC AÇÕES	1.497.297,52	0,00	0,00	1.509.055,79	11.758,27	0,79%	0,79%	7,05%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	22.953.264,77	0,00	0,00	23.125.322,16	172.057,39	0,75%	0,75%	7,54%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	948.499,87	0,00	0,00	954.045,83	5.545,96	0,58%	0,58%	7,51%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.936.842,08	0,00	0,00	16.022.749,00	85.906,92	0,54%	0,54%	6,43%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	5.047.994,28	0,00	0,00	5.071.739,89	23.745,61	0,47%	0,47%	7,60%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	324.922,64	0,00	0,00	326.407,04	1.484,40	0,46%	0,46%	8,00%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.216.606,45	0,00	0,00	2.222.349,10	5.742,65	0,26%	0,26%	7,72%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	11.918.573,34	0,00	1.303.000,00	10.645.513,28	29.939,94	0,25%	0,33%	7,83%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	10.637.608,22	0,00	0,00	10.645.553,08	7.944,86	0,07%	0,07%	7,85%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7.869.158,97	0,00	0,00	7.868.615,82	-543,15	-0,01%	-0,01%	7,55%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	5.283.420,14	795.000,00	0,00	6.074.454,38	-3.965,76	-0,07%	0,24%	6,49%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	1.425.796,79	0,00	0,00	1.421.689,71	-4.107,08	-0,29%	-0,29%	7,39%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	847.283,90	0,00	0,00	842.557,56	-4.726,34	-0,56%	-0,56%	7,86%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9.415.920,63	0,00	0,00	9.352.035,11	-63.885,52	-0,68%	-0,68%	7,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8.302.635,36	0,00	0,00	8.219.367,95	-83.267,41	-1,00%	-1,00%	7,67%

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
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	816.956,85	0,00	0,00	807.137,36	-9.819,49	-1,20%	-1,20%	8,09%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	4.287.830,51	795.000,00	0,00	5.010.982,32	-71.848,19	-1,41%	-1,13%	7,28%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	15.949.673,85	0,00	1.918.000,00	13.516.505,18	-515.168,67	-3,23%	-3,13%	8,93%
IT NOW S&P500@ TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11	27.069.706,15	0,00	0,00	26.182.362,21	-887.343,94	-3,28%	-3,28%	5,38%
TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENTO ...	2.404.633,71	0,00	0,00	2.318.807,90	-85.825,81	-3,57%	-3,57%	6,80%
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	492.858,02	0,00	0,00	471.432,78	-21.425,24	-4,35%	-4,35%	9,20%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13.909.719,02	0,00	0,00	13.299.556,68	-610.162,34	-4,39%	-4,39%	5,04%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	3.606.188,81	0,00	0,00	3.446.636,71	-159.552,10	-4,42%	-4,42%	4,84%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11.984.553,78	0,00	0,00	11.453.843,95	-530.709,83	-4,43%	-4,43%	4,99%
Total Renda Variável	261.975.847,84	1.590.000,00	3.221.000,00	260.422.563,74	77.715,90	0,03%		7,04%

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.927.847,11	0,00	0,00	3.818.046,31	-109.800,80	-2,80%	-2,80%	5,14%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	3.782.768,05	0,00	0,00	3.668.036,77	-114.731,28	-3,03%	-3,03%	12,18%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.412.444,93	0,00	0,00	4.254.705,08	-157.739,85	-3,57%	-3,57%	4,97%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	20.515.956,60	0,00	0,00	19.742.232,64	-773.723,96	-3,77%	-3,77%	7,97%
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI A...	13.730.208,34	0,00	0,00	13.167.619,92	-562.588,42	-4,10%	-4,10%	6,30%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.913.446,85	0,00	0,00	5.616.015,56	-297.431,29	-5,03%	-5,03%	5,70%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	4.985.741,87	0,00	0,00	4.700.803,92	-284.937,95	-5,72%	-5,72%	6,06%
Total Exterior	57.268.413,75	0,00	0,00	54.967.460,20	-2.300.953,55	-4,02%		7,03%

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	403.949.523,21	0,00	4.795.217,53	407.164.653,82	8.010.348,14	1,98%	-
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	25.725.649,09	33.365.217,53	41.183.217,53	18.544.792,71	637.143,62	1,08%	3,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	31.289.333,37	0,00	0,00	31.811.244,33	521.910,96	1,67%	1,67%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	17.130.335,42	12.332.217,53	0,00	29.807.052,41	344.499,46	1,17%	1,77%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.456.058,76	0,00	0,00	17.794.597,88	338.539,12	1,94%	1,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.010.737,19	0,00	0,00	17.291.312,66	280.575,47	1,65%	1,65%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	6.329.625,84	0,00	0,00	6.394.854,38	65.228,54	1,03%	1,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.941.299,02	0,00	0,00	1.994.262,23	52.963,21	2,73%	2,73%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	6.980.287,16	0,00	0,00	7.022.197,55	41.910,39	0,60%	0,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	937.099,41	0,00	27.350,26	938.226,47	28.477,32	3,04%	3,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	321.910,58	0,00	0,00	325.028,89	3.118,31	0,97%	0,97%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	96.888,31	0,00	0,00	99.914,19	3.025,88	3,12%	3,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	75.357,30	0,00	0,00	77.700,93	2.343,63	3,11%	3,11%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	18.895,00	0,00	0,00	19.491,44	596,44	3,16%	3,16%
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	2.415.936,74	0,00	0,00	2.399.373,72	-16.563,02	-0,69%	-0,69%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.505.524,54	2.240.000,00	0,00	4.724.195,20	-21.329,34	-0,45%	-0,66%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	5.985.172,13	0,00	0,00	5.949.228,76	-35.943,37	-0,60%	-0,60%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	3.933.407,73	0,00	0,00	3.889.155,88	-44.251,85	-1,13%	-1,13%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	8.493.020,84	0,00	0,00	8.444.242,44	-48.778,40	-0,57%	-0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	58.599.875,94	0,00	0,00	58.287.293,75	-312.582,19	-0,53%	-0,53%



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
Total Renda Fixa	611.195.937,58	47.937.435,06	46.005.785,32	622.978.819,64	9.851.232,32	1,61%	

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	23.481.650,54	0,00	0,00	26.200.910,29	2.719.259,75	11,58%	11,58%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.373.235,81	3.863.000,00	0,00	17.650.894,57	414.658,76	2,41%	3,31%
IT NOW S&P500® TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11	25.777.410,72	0,00	0,00	26.182.362,21	404.951,49	1,57%	1,57%
TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENTO ...	2.274.580,36	0,00	0,00	2.318.807,90	44.227,54	1,94%	1,94%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	633.932,17	0,00	0,00	650.618,48	16.686,31	2,63%	2,63%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	956.828,82	0,00	0,00	954.045,83	-2.782,99	-0,29%	-0,29%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	819.724,01	0,00	0,00	807.137,36	-12.586,65	-1,54%	-1,54%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	856.211,08	0,00	0,00	842.557,56	-13.653,52	-1,59%	-1,59%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	341.450,85	0,00	0,00	326.407,04	-15.043,81	-4,41%	-4,41%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	1.456.632,39	0,00	0,00	1.421.689,71	-34.942,68	-2,40%	-2,40%
OCCAM FIC AÇÕES	1.544.796,68	0,00	0,00	1.509.055,79	-35.740,89	-2,31%	-2,31%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	5.107.554,82	0,00	0,00	5.071.739,89	-35.814,93	-0,70%	-0,70%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,00	6.110.350,26	0,00	6.074.454,38	-35.895,88	-0,59%	0,98%
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	513.700,92	0,00	0,00	471.432,78	-42.268,14	-8,23%	-8,23%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	16.065.331,34	0,00	0,00	16.022.749,00	-42.582,34	-0,27%	-0,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.266.752,98	0,00	0,00	2.222.349,10	-44.403,88	-1,96%	-1,96%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	3.509.672,05	0,00	0,00	3.446.636,71	-63.035,34	-1,80%	-1,80%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9.986.880,30	0,00	2.000.000,00	7.868.615,82	-118.264,48	-1,18%	-1,83%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	14.087.153,10	0,00	3.303.000,00	10.645.513,28	-138.639,82	-0,98%	-1,08%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	4.382.644,41	795.000,00	0,00	5.010.982,32	-166.662,09	-3,22%	-3,27%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	10.837.854,82	0,00	0,00	10.645.553,08	-192.301,74	-1,77%	-1,77%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11.677.846,51	0,00	0,00	11.453.843,95	-224.002,56	-1,92%	-1,92%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13.537.691,69	0,00	0,00	13.299.556,68	-238.135,01	-1,76%	-1,76%
INDIE FIC AÇÕES	11.332.517,76	0,00	0,00	11.091.855,63	-240.662,13	-2,12%	-2,12%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9.593.452,29	0,00	0,00	9.352.035,11	-241.417,18	-2,52%	-2,52%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	23.397.451,75	0,00	0,00	23.125.322,16	-272.129,59	-1,16%	-1,16%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	23.204.278,20	1.120.000,00	0,00	24.019.563,98	-304.714,22	-1,25%	-1,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	7.496.485,10	1.120.000,00	0,00	8.219.367,95	-397.117,15	-4,61%	-4,46%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	16.414.794,14	0,00	1.918.000,00	13.516.505,18	-980.288,96	-5,97%	-5,87%
Total Renda Variável	254.928.515,61	13.008.350,26	7.221.000,00	260.422.563,74	-293.302,13	-0,11%	

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
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI A...	12.917.978,17	0,00	0,00	13.167.619,92	249.641,75	1,93%	1,93%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	19.545.645,60	0,00	0,00	19.742.232,64	196.587,04	1,01%	1,01%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.727.679,09	0,00	0,00	3.818.046,31	90.367,22	2,42%	2,42%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.199.092,27	0,00	0,00	4.254.705,08	55.612,81	1,32%	1,32%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	4.718.734,53	0,00	0,00	4.700.803,92	-17.930,61	-0,38%	-0,38%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.125.244,03	2.575.000,00	0,00	5.616.015,56	-84.228,47	-1,48%	-1,41%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	3.774.327,41	0,00	0,00	3.668.036,77	-106.290,64	-2,82%	-2,82%
Total Exterior	52.008.701,10	2.575.000,00	0,00	54.967.460,20	383.759,10	0,70%	

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.

