

# Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

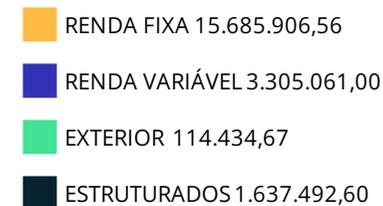
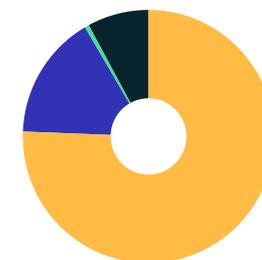
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.471.725,44	7,10%	903	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	990.485,93	4,78%	794	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	322.084,46	1,55%	303	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.010.590,43	4,87%	370	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	336.829,62	1,62%	201	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	500.853,73	2,41%	83	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	313.477,81	1,51%	794	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	74.806,02	0,36%	933	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	592.093,48	2,85%	1.185	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FX...	D+0	Não há	584.623,83	2,82%	426	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	504.753,92	2,43%	30	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	926.298,89	4,47%	999	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	557.175,51	2,69%	246	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.309.877,04	11,14%	1.116	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	863.829,60	4,16%	404	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.806.924,80	8,71%	226	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	221.671,51	1,07%	426	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.281.829,87	11,00%	213	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	983.898,54	4,74%	1.399	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	419.146,93	2,02%	2.755	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
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	538.266,94	2,59%	25	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	457.812,92	2,21%	1.003	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	D+3 du	Não há	132.496,56	0,64%	11.411	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	549.561,52	2,65%	5.718	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	223.877,59	1,08%	71	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	114.434,67	0,55%	477	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	287.656,03	1,39%	178	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	820.118,80	3,95%	114	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	88.959,40	0,43%	6.682	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	440.758,37	2,12%	2.895	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIO...	Não se ...	Não se aplica	15.974,67	0,08%	2.068	0,02%	Desenquadrado - RF
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>20.742.894,83</b>				

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

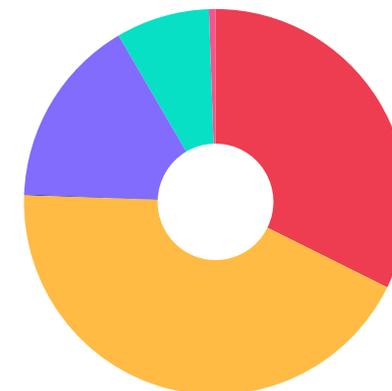
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,39%	81,95%	16.998.802,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	6.702.324,67	32,31%	20,39%	23,00%	81,95%	10.296.477,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	8.967.607,22	43,23%	20,79%	23,00%	60,00%	3.478.129,68
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	4.148.578,97
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	1.037.144,74
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.037.144,74
Desenquadrado - RF	0,00%	15.974,67	0,08%	0,00%	0,00%	0,00%	-15.974,67
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>15.685.906,56</b>	<b>75,62%</b>	<b>41,18%</b>	<b>70,89%</b>	<b>253,90%</b>	



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%	3.305.061,00	15,93%	0,89%	18,11%	20,00%	843.517,97
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.637.492,60	7,89%	3,75%	5,00%	10,00%	436.796,88
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>4.942.553,60</b>	<b>23,83%</b>	<b>4,64%</b>	<b>23,11%</b>	<b>30,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	114.434,67	0,55%	0,00%	5,00%	10,00%	1.959.854,81
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>114.434,67</b>	<b>0,55%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.278.939,20	44,73	-
CAIXA DTVM	7.035.423,04	33,92	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	3.010.461,38	14,51	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.402.096,54	6,76	-
BV ASSET	15.974,67	0,08	-

**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	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	6.702.324,67	32,31	20,39	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	8.967.607,22	43,23	20,79	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.305.061,00	15,93	0,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	114.434,67	0,55	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.637.492,60	7,89	3,75	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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
<b>IPCA + 5,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,69%	7,72%	1,97%	4,13%	10,97%	25,47%	-	-
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR - BBVH11	0,66%	-31,27%	-2,09%	-30,54%	-43,98%	-54,83%	-	-
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,40%	6,89%	0,82%	1,68%	5,19%	-	1,47%	0,06%
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%
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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,58%	-0,66%	6,49%	10,77%	18,43%	2,54%	0,05%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	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
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	10,15%	3,42%	6,85%	13,67%	26,52%	0,02%	0,00%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,31%	3,54%	6,88%	13,98%	27,19%	0,03%	0,00%
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%
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%

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,82%	3,09%	4,58%	11,76%	-	0,33%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,30%	11,35%	0,97%	6,94%	10,76%	22,65%	1,61%	0,04%
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 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	-	3,12%	-	-	-	0,33%	-

<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1,10%	-	0,12%	-	-	-	0,33%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	-	0,21%	-	-	-	0,33%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,85%	7,39%	1,94%	6,31%	9,60%	23,26%	1,95%	0,04%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,86%	9,52%	2,78%	6,24%	12,70%	26,54%	0,12%	0,00%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	9,25%	2,52%	5,77%	12,29%	24,46%	0,54%	0,01%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-3,58%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	0,22%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26%	2,02%	-1,96%	10,30%	-0,01%	-4,02%	7,72%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,53%	-1,58%	-5,28%	9,42%	-11,12%	-23,18%	9,63%	0,22%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01%	6,08%	-1,83%	14,99%	1,58%	-6,60%	7,55%	0,20%
<b>IBX (Benchmark)</b>	0,84%	5,50%	-1,02%	13,78%	5,09%	3,69%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	0,23%	2,96%	-2,27%	11,50%	2,58%	-0,88%	8,06%	0,20%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	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%
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	-2,61%	4,13%	-0,05%	0,10%	9,93%	-14,78%	-	-

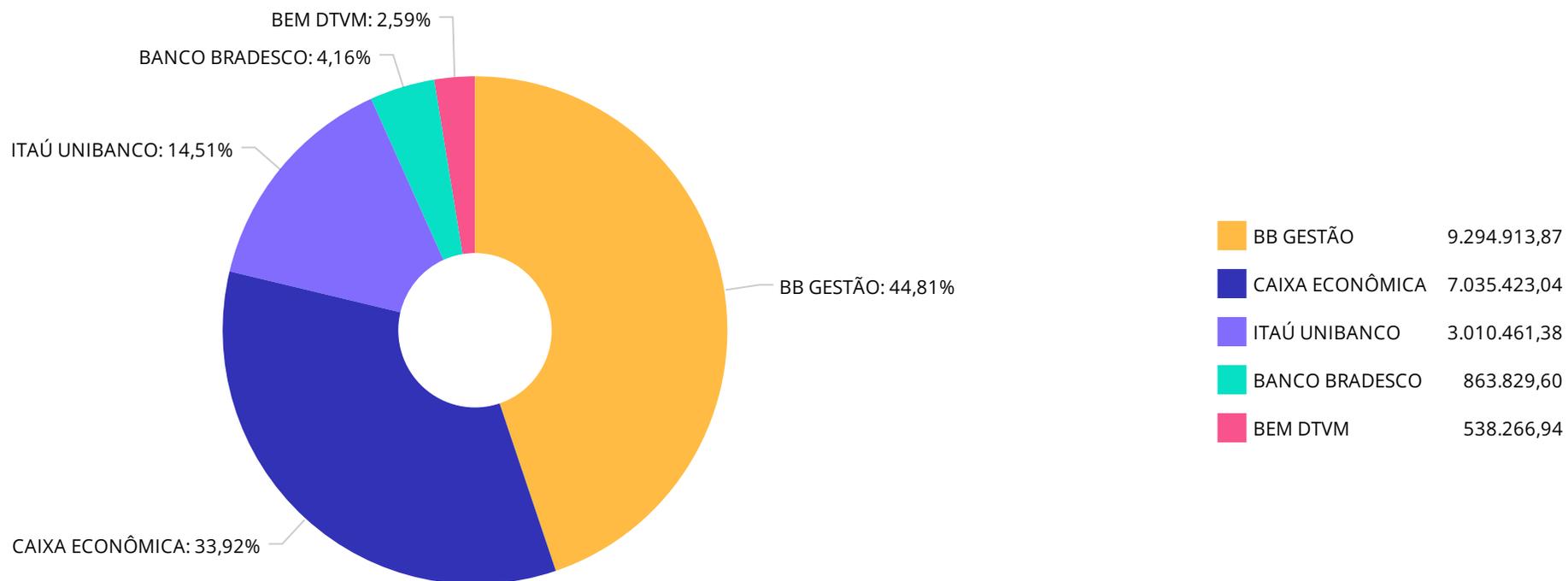
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,46%	17,90%	-1,89%	8,34%	29,34%	17,35%	5,00%	0,17%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-2,84%	5,06%	-7,25%	16,09%	-2,94%	-20,83%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	-2,87%	4,86%	-7,24%	15,55%	-3,23%	-21,52%	9,40%	0,25%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	4,57%	-12,12%	-7,29%	11,25%	-13,96%	-	12,81%	0,33%

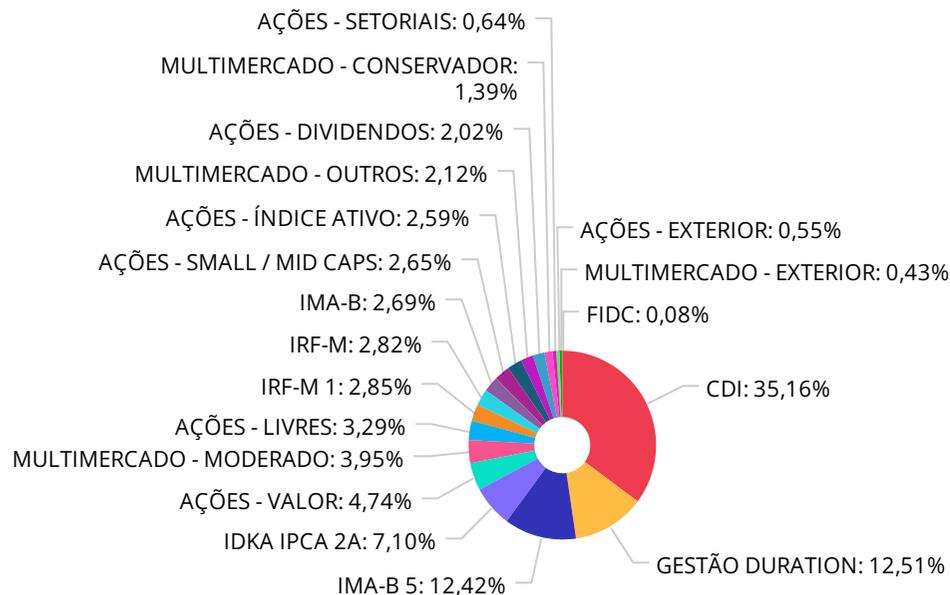
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 FIAÇÕES 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)

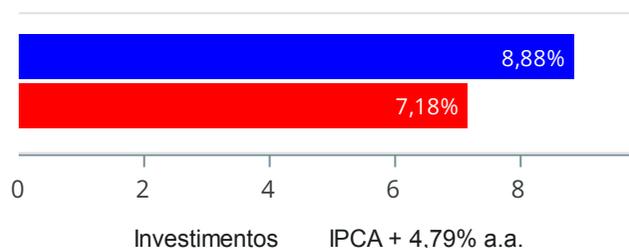


■ CDI	7.292.269,84	■ GESTÃO DURATION	2.595.307,68	■ IMA-B 5	2.576.736,11
■ IDKA IPCA 2A	1.471.725,44	■ AÇÕES - VALOR	983.898,54	■ MULTIMERCADO - MODERADO	820.118,80
■ AÇÕES - LIVRES	681.690,51	■ IRF-M 1	592.093,48	■ IRF-M	584.623,83
■ IMA-B	557.175,51	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	549.561,52	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	538.266,94
■ MULTIMERCADO - OUTROS	440.758,37	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	419.146,93	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	287.656,03
■ AÇÕES - SETORIAIS	132.496,56	■ AÇÕES - EXTERIOR	114.434,67	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	88.959,40
■ FIDC	15.974,67				

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	15.748.217,86	3.020.333,62	3.365.388,50	15.637.150,23	233.987,25	233.987,25	1,49%	1,49%	0,94%	0,94%	157,82%	2,47%
Fevereiro	15.637.150,23	5.060.253,79	4.304.184,87	16.271.289,18	-121.929,97	112.057,28	-0,74%	0,73%	1,18%	2,13%	34,32%	2,32%
Março	16.271.289,18	3.001.843,79	3.218.801,39	16.171.701,81	117.370,23	229.427,51	0,72%	1,46%	1,14%	3,30%	44,23%	2,18%
Abril	16.171.701,81	4.597.311,25	3.921.479,95	17.035.386,42	187.853,31	417.280,82	1,12%	2,59%	0,95%	4,27%	60,58%	2,18%
Mai	17.035.386,42	3.706.926,65	3.572.930,06	17.523.315,29	353.932,28	771.213,10	2,06%	4,70%	0,64%	4,94%	95,20%	2,08%
Junho	17.523.315,29	2.059.051,97	2.430.526,78	17.631.312,65	479.472,17	1.250.685,27	2,74%	7,57%	0,31%	5,27%	143,70%	2,11%
Julho	17.631.312,65	3.210.931,07	2.369.150,54	18.734.869,00	261.775,82	1.512.461,09	1,42%	9,09%	0,51%	5,80%	156,64%	1,89%
Agosto	18.734.869,00	3.397.729,07	2.465.780,23	19.554.908,22	-111.909,62	1.400.551,47	-0,57%	8,47%	0,66%	6,50%	130,30%	1,90%
Setembro	19.554.908,22	2.706.705,07	2.518.591,97	19.816.595,94	73.574,62	1.474.126,09	0,37%	8,88%	0,63%	7,18%	123,69%	1,93%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



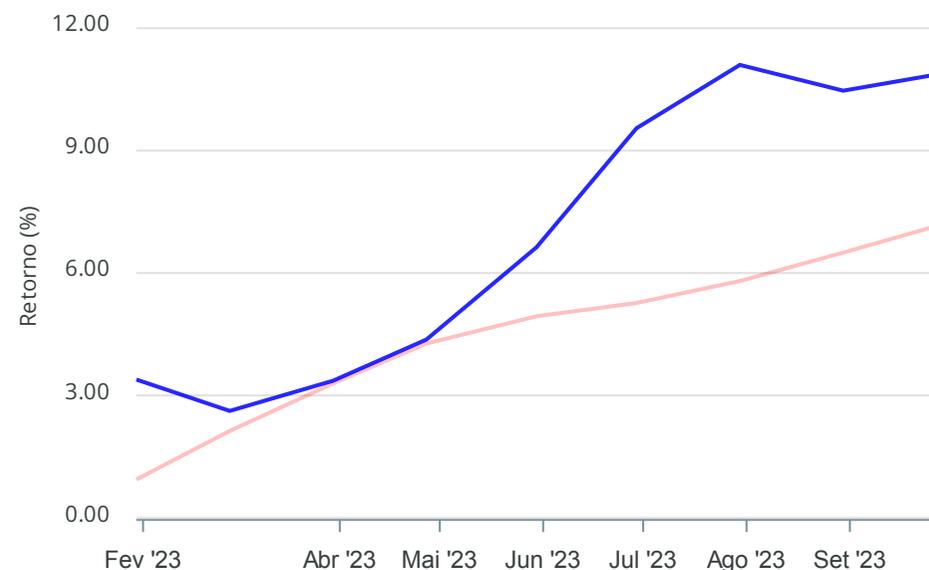
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	318.559,33	0,00	0,00	322.084,46	3.525,13	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	333.144,54	0,00	0,00	336.829,62	3.685,08	1,11%	1,11%	0,33%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	499.257,42	0,00	0,00	504.753,92	5.496,50	1,10%	1,10%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	999.611,39	0,00	0,00	1.010.590,43	10.979,04	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	219.436,56	0,00	0,00	221.671,51	2.234,95	1,02%	1,02%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	586.758,58	0,00	0,00	592.093,48	5.334,90	0,91%	0,91%	0,07%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.645.237,54	234.012,66	89.293,63	1.806.924,80	16.968,23	0,90%	0,96%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.316.991,53	455.518,90	487.522,65	2.309.877,04	24.889,26	0,90%	0,97%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.055.388,10	0,00	138.076,44	926.298,89	8.987,23	0,85%	0,90%	0,01%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	15.870,43	0,00	0,00	15.974,67	104,24	0,66%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	790.399,92	2.002.386,91	1.941.775,69	863.829,60	12.818,46	0,46%	1,05%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	312.216,99	0,00	0,00	313.477,81	1.260,82	0,40%	0,40%	0,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.468.616,36	0,00	0,00	1.471.725,44	3.109,08	0,21%	0,21%	0,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	583.771,35	0,00	0,00	584.623,83	852,48	0,15%	0,15%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	74.722,39	0,00	0,00	74.806,02	83,63	0,11%	0,11%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	989.386,22	0,00	0,00	990.485,93	1.099,71	0,11%	0,11%	0,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.273.953,75	14.786,60	0,00	2.281.829,87	-6.910,48	-0,30%	-0,30%	1,61%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	502.879,12	0,00	0,00	500.853,73	-2.025,39	-0,40%	-0,40%	1,47%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	562.653,38	0,00	0,00	557.175,51	-5.477,87	-0,97%	-0,97%	2,54%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>15.548.854,90</b>	<b>2.706.705,07</b>	<b>2.656.668,41</b>	<b>15.685.906,56</b>	<b>87.015,00</b>	<b>0,56%</b>		<b>0,63%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	126.706,81	0,00	0,00	132.496,56	5.789,75	4,57%	4,57%	12,81%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	437.018,42	0,00	0,00	440.758,37	3.739,95	0,86%	0,86%	0,12%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	813.202,71	0,00	0,00	820.118,80	6.916,09	0,85%	0,85%	1,95%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	285.278,52	0,00	0,00	287.656,03	2.377,51	0,83%	0,83%	0,54%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	981.356,10	0,00	0,00	983.898,54	2.542,44	0,26%	0,26%	7,72%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	537.033,23	0,00	0,00	538.266,94	1.233,71	0,23%	0,23%	8,06%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	457.844,52	0,00	0,00	457.812,92	-31,60	-0,01%	-0,01%	7,55%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	420.365,61	0,00	0,00	419.146,93	-1.218,68	-0,29%	-0,29%	6,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	225.063,81	0,00	0,00	223.877,59	-1.186,22	-0,53%	-0,53%	9,63%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	565.783,59	0,00	0,00	549.561,52	-16.222,07	-2,87%	-2,87%	9,40%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	93.110,85	0,00	0,00	88.959,40	-4.151,45	-4,46%	-4,46%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>4.942.764,17</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>4.942.553,60</b>	<b>-210,57</b>	<b>0,00%</b>		<b>5,98%</b>

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	118.677,25	0,00	0,00	114.434,67	-4.242,58	-3,57%	-3,57%	4,97%
<b>Total Exterior</b>	<b>118.677,25</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>114.434,67</b>	<b>-4.242,58</b>	<b>-3,57%</b>		<b>4,97%</b>

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.562.619,22	3.886.773,17	3.226.706,66	2.309.877,04	87.191,31	1,60%	3,22%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.267.945,24	669.483,04	178.766,94	1.806.924,80	48.263,46	2,49%	3,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.230.529,19	0,00	336.793,74	926.298,89	32.563,44	2,65%	2,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.007.810,48	0,00	27.966,48	1.010.590,43	30.746,43	3,05%	3,09%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	4.744.322,40	3.910.702,75	863.829,60	30.209,95	0,64%	3,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.444.216,21	0,00	0,00	1.471.725,44	27.509,23	1,90%	1,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.245.398,92	14.786,60	0,00	2.281.829,87	21.644,35	0,96%	0,97%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	574.162,09	0,00	0,00	592.093,48	17.931,39	3,12%	3,12%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	974.413,96	0,00	0,00	990.485,93	16.071,97	1,65%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	574.459,84	0,00	0,00	584.623,83	10.163,99	1,77%	1,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	321.577,76	0,00	9.379,91	322.084,46	9.886,61	3,07%	3,12%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	214.338,70	0,00	0,00	221.671,51	7.332,81	3,42%	3,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	307.513,94	0,00	0,00	313.477,81	5.963,87	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	496.806,64	0,00	0,00	500.853,73	4.047,09	0,81%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	73.578,71	0,00	0,00	74.806,02	1.227,31	1,67%	1,67%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	336.134,98	0,00	0,00	336.829,62	694,64	0,21%	0,21%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	504.133,01	0,00	0,00	504.753,92	620,91	0,12%	0,12%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	16.315,65	0,00	0,00	15.974,67	-340,98	-2,09%	-2,09%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	560.900,34	0,00	0,00	557.175,51	-3.724,83	-0,66%	-0,66%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>13.712.854,88</b>	<b>9.315.365,21</b>	<b>7.690.316,48</b>	<b>15.685.906,56</b>	<b>348.002,95</b>	<b>2,27%</b>	

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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	804.535,09	0,00	0,00	820.118,80	15.583,71	1,94%	1,94%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	428.855,20	0,00	0,00	440.758,37	11.903,17	2,78%	2,78%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	280.584,31	0,00	0,00	287.656,03	7.071,72	2,52%	2,52%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	90.671,70	0,00	0,00	88.959,40	-1.712,30	-1,89%	-1,89%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	466.362,04	0,00	0,00	457.812,92	-8.549,12	-1,83%	-1,83%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	142.916,47	0,00	0,00	132.496,56	-10.419,91	-7,29%	-7,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	236.363,32	0,00	0,00	223.877,59	-12.485,73	-5,28%	-5,28%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	550.777,43	0,00	0,00	538.266,94	-12.510,49	-2,27%	-2,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.003.557,42	0,00	0,00	983.898,54	-19.658,88	-1,96%	-1,96%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	438.994,73	0,00	0,00	419.146,93	-19.847,80	-4,52%	-4,52%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	592.430,32	0,00	0,00	549.561,52	-42.868,80	-7,24%	-7,24%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>5.036.048,03</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>4.942.553,60</b>	<b>-93.494,43</b>	<b>-1,86%</b>	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	112.938,93	0,00	0,00	114.434,67	1.495,74	1,32%	1,32%
<b>Total Exterior</b>	<b>112.938,93</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>114.434,67</b>	<b>1.495,74</b>	<b>1,32%</b>	

## 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.

