

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 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	2.494.700,88	1,38%	890	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.962.023,74	3,29%	640	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	12.280.928,78	6,77%	308	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	15.162.540,43	8,36%	195	1,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	11.221.974,89	6,19%	370	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	11.089.716,22	6,11%	303	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	4.449.211,77	2,45%	204	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	9.224.269,45	5,09%	83	2,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	2.950.021,10	1,63%	48	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.646.242,94	3,11%	791	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	7.131.535,31	3,93%	863	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.094.626,39	2,81%	926	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.261.686,75	0,70%	769	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.047.263,31	1,68%	30	1,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.266.950,40	0,70%	214	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.148.618,31	1,74%	1.000	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	31.473.088,99	17,35%	1.125	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.603.850,31	0,88%	152	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.909.240,35	2,71%	418	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	6.865.947,21	3,78%	983	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

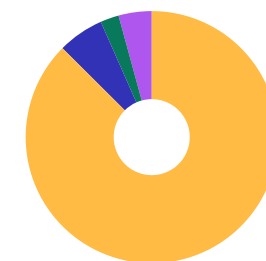
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.911.348,20	2,71%	386	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.532.624,49	0,84%	28	2,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.168.106,47	1,20%	69	0,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.380.388,05	1,31%	2	0,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.179.356,22	0,65%	482	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	214.249,74	0,12%	70	0,30%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.632.301,01	3,10%	551	1,79%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.922.220,60	1,61%	2.633	0,63%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.028.301,85	0,57%	134	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	652.417,28	0,36%	5.617	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	478.884,44	0,26%	68	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.243.727,08	0,69%	144	0,10%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	904.441,61	0,50%	69	0,80%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.164.426,25	1,19%	473	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.366.752,33	0,75%	178	0,41%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	1.077.780,17	0,59%	526	0,72%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.461.630,73	0,81%	5.197	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.102.976,17	1,16%	6.532	0,14%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.135.315,52	0,63%	612	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	559.586,48	0,31%	3.959	0,31%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			181.401.272,22				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 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%	5,00%	20,00%	36.280.254,44
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	98.283.692,36	54,18%	15,00%	48,00%	90,00%	64.977.452,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.140.127,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	60.172.568,60	33,17%	5,00%	23,00%	60,00%	48.668.194,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	3.628.025,44
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,85%	5,00%	9.070.063,61
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	214.249,74	0,12%	0,00%	0,15%	2,00%	3.413.775,70
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	5.442.038,17
Total Renda Fixa	100,00%	158.670.510,70	87,47%	20,00%	78,00%	192,00%	



RENDA FIXA 158.670.510,70

RENDA VARIÁVEL 10.714.125,18

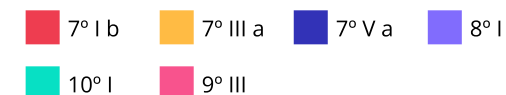
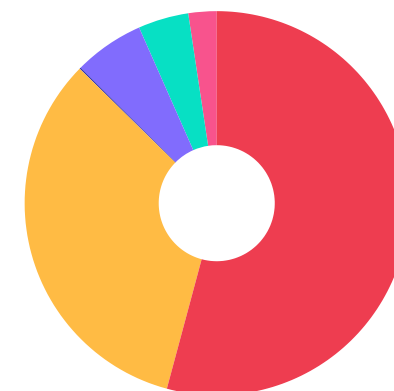
EXTERIOR 4.312.594,94

ESTRUTURADOS 7.704.041,40

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10.714.125,18	5,91%	5,00%	13,00%	30,00%	43.706.256,49
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	7.704.041,40	4,25%	0,00%	5,00%	10,00%	10.436.085,82
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	9.070.063,61
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	9.070.063,61
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	18.418.166,58	10,15%	5,00%	19,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.312.594,94	2,38%	0,00%	3,00%	10,00%	13.827.532,28
Total Exterior	10,00%	4.312.594,94	2,38%	0,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	92.908.877,04	51,22	-
CAIXA DTVM	60.094.707,57	33,13	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	10.360.877,43	5,71	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	9.523.614,29	5,25	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	4.548.494,52	2,51	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.746.874,23	0,96	-
SICREDI	1.738.942,70	0,96	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	478.884,44	0,26	-

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	98.283.692,36	54,18	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60.172.568,60	33,17	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	214.249,74	0,12	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	3,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,41%	8,53%	0,64%	2,92%	9,03%	22,65%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29%	8,48%	0,84%	3,19%	9,04%	22,01%	1,24%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33%	8,23%	0,62%	3,00%	8,84%	22,05%	1,32%	0,02%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,81%	9,74%	2,45%	4,48%	12,16%	27,77%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,45%	-2,62%	-1,27%	-2,25%	-2,14%	1,47%	0,14%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	3,39%	-0,19%	1,79%	4,21%	10,47%	0,48%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,32%	8,44%	0,39%	3,03%	9,06%	22,79%	1,43%	0,02%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	-0,34%	8,26%	0,34%	2,89%	8,85%	22,35%	1,44%	0,02%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,04%	5,78%	-1,04%	-0,70%	2,60%	-	2,21%	0,06%

IMA-B (Benchmark)	-0,66%	10,06%	-1,97%	3,75%	8,97%	21,40%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,02%	3,57%	0,32%	1,76%	4,46%	7,94%	0,61%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,66%	9,92%	-1,98%	3,69%	8,75%	20,99%	3,00%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	9,82%	-2,03%	3,63%	8,70%	20,76%	3,00%	0,05%

IRF-M (Benchmark)	0,37%	12,04%	1,31%	6,68%	12,95%	26,45%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,22%	11,88%	1,11%	6,55%	12,59%	27,00%	1,92%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	10,10%	2,88%	6,02%	12,28%	23,94%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,06%	11,40%	3,45%	7,09%	13,86%	27,84%	0,04%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,02%	11,21%	3,32%	6,91%	13,65%	27,03%	0,02%	0,00%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	11,47%	3,41%	7,05%	13,96%	27,79%	0,02%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	10,95%	3,15%	6,60%	13,35%	26,71%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,04%	8,94%	-1,05%	2,26%	8,60%	-	2,21%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	-	2,48%	-	-	-	0,48%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	9,29%	2,46%	4,50%	10,17%	-	0,48%	0,02%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,41%	9,50%	0,83%	5,07%	10,70%	22,21%	1,49%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,21%	11,12%	-0,14%	5,42%	9,56%	22,83%	2,29%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,26%	10,64%	1,30%	6,24%	12,00%	24,61%	0,90%	0,02%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,29%	11,50%	1,00%	6,20%	11,93%	23,99%	1,32%	0,03%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,44%	-	-0,49%	0,02%	-	-	0,48%	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,03%	-	-1,03%	-	-	-	2,21%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	-	-0,41%	-	-	-	0,48%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,41%	7,92%	-0,30%	4,88%	7,71%	21,83%	2,40%	0,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,54%	9,85%	2,05%	5,38%	11,49%	24,89%	0,95%	0,01%
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	0,21%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,41%	6,12%	-1,62%	3,06%	6,42%	-18,84%	7,20%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,03%	21,89%	-4,86%	21,99%	7,80%	40,31%	7,70%	0,21%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-5,07%	-4,56%	-11,92%	3,40%	-10,62%	2,28%	8,24%	0,18%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-3,48%	3,05%	-6,70%	8,25%	-1,93%	8,28%	6,64%	0,18%
IDIV (Benchmark)	-3,15%	7,18%	-4,65%	7,57%	6,28%	23,78%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-6,28%	7,38%	-11,39%	5,29%	-0,93%	10,47%	8,83%	0,18%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,10%	1,94%	-3,96%	-1,70%	4,45%	-23,43%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-1,77%	15,81%	-7,01%	4,37%	16,80%	7,09%	7,21%	0,16%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-2,20%	9,23%	-8,61%	0,58%	8,31%	-8,94%	-	-

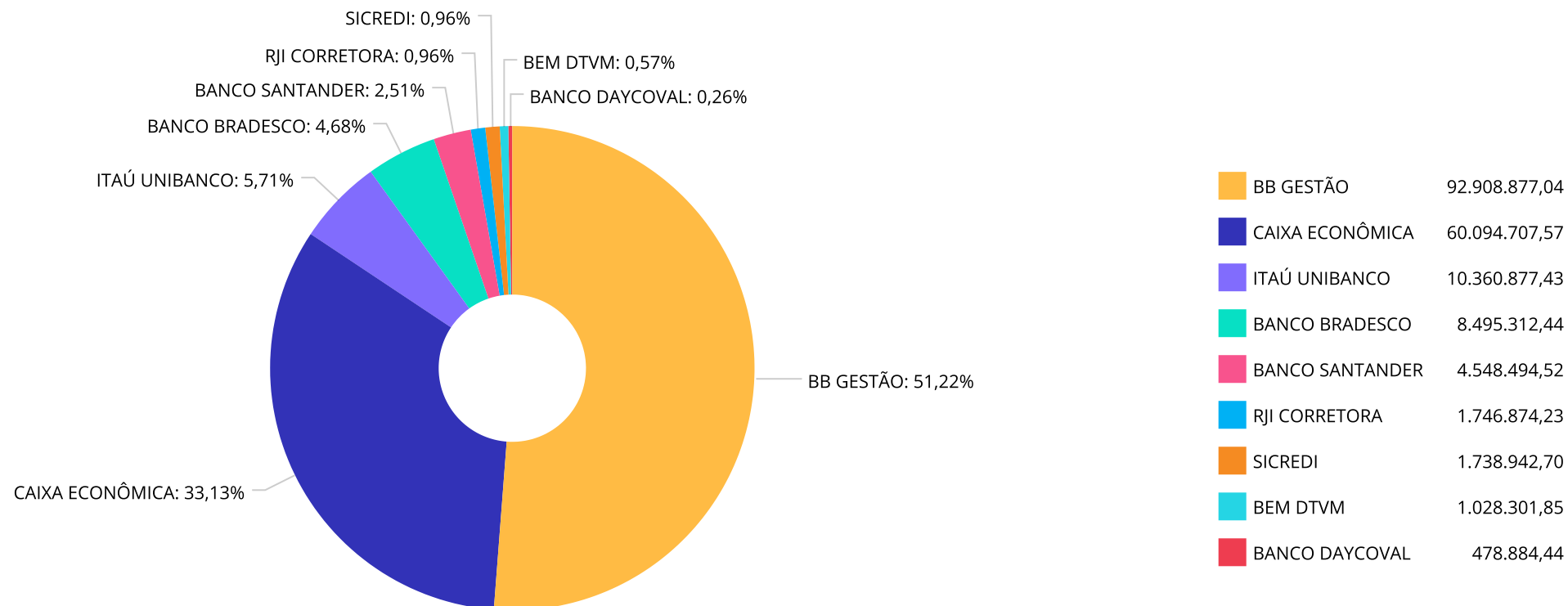
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	-1,74%	16,17%	-6,94%	4,55%	17,28%	7,68%	7,21%	0,16%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-1,75%	15,73%	-7,00%	4,28%	16,83%	7,04%	7,19%	0,16%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	-1,82%	11,75%	-7,24%	0,96%	12,61%	2,23%	7,22%	0,16%
SMLL (Benchmark)	-7,40%	-2,72%	-16,71%	5,49%	-16,24%	-16,19%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-7,45%	-2,95%	-16,62%	4,98%	-16,39%	-17,11%	12,17%	0,25%

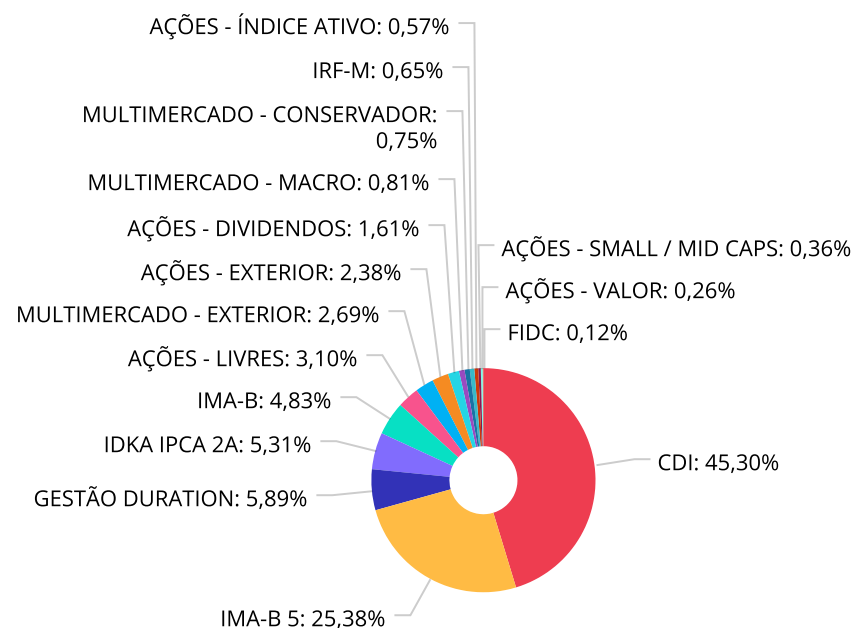
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,58%	7,72%	-2,12%	4,68%	9,14%	-18,02%	7,88%	19,090%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	20,681%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,41%	6,11%	-1,62%	3,06%	6,42%	-18,84%	7,20%	18,623%

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



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

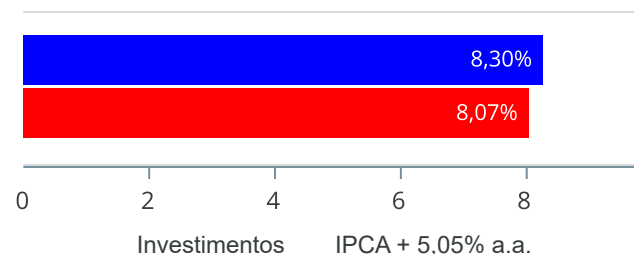


CDI	82.175.363,14	IMA-B 5	46.033.820,31	GESTÃO DURATION	10.685.150,12
IDKA IPCA 2A	9.626.236,19	IMA-B	8.756.334,98	AÇÕES - LIVRES	5.632.301,01
MULTIMERCADO - EXTERIOR	4.875.658,34	AÇÕES - EXTERIOR	4.312.594,94	AÇÕES - DIVIDENDOS	2.922.220,60
MULTIMERCADO - MACRO	1.461.630,73	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.366.752,33	IRF-M	1.179.356,22
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.028.301,85	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	652.417,28	AÇÕES - VALOR	478.884,44
FIDC	214.249,74				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

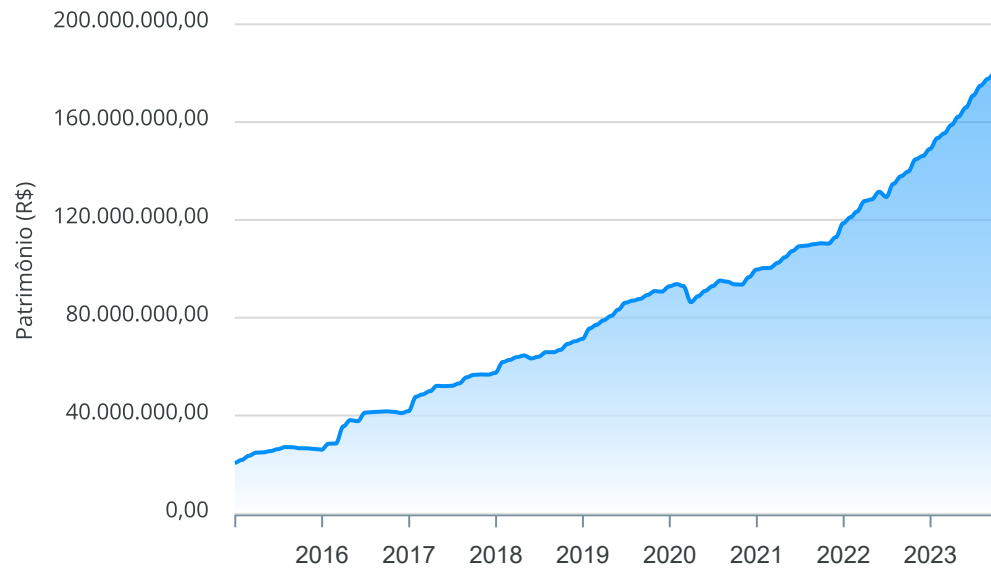
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	149.026.369,79	4.261.786,48	2.390.211,84	153.454.138,15	2.556.193,72	2.556.193,72	1,69%	1,69%	0,96%	0,96%	175,85%	2,51%
Fevereiro	153.454.138,15	6.642.643,87	4.830.239,78	155.360.872,21	94.329,97	2.650.523,69	0,06%	1,76%	1,20%	2,17%	80,90%	2,40%
Março	155.360.872,21	35.447.451,34	33.403.632,54	158.830.497,02	1.425.806,01	4.076.329,70	0,91%	2,68%	1,16%	3,36%	79,70%	1,88%
Abril	158.830.497,02	2.457.287,00	581.313,62	162.149.870,27	1.443.399,87	5.519.729,57	0,90%	3,60%	0,96%	4,36%	82,63%	1,75%
Maio	162.149.870,27	36.207.673,72	34.338.124,14	165.989.462,23	1.970.042,38	7.489.771,95	1,20%	4,84%	0,66%	5,05%	95,97%	1,75%
Junho	165.989.462,23	8.688.924,05	6.575.100,73	170.861.426,33	2.758.140,78	10.247.912,73	1,64%	6,56%	0,33%	5,40%	121,67%	1,38%
Julho	170.861.426,33	4.382.978,99	2.499.703,33	174.913.829,41	2.169.127,42	12.417.040,15	1,26%	7,90%	0,53%	5,96%	132,69%	1,23%
Agosto	174.913.829,41	7.420.259,38	5.272.503,18	177.685.219,63	623.634,02	13.040.674,17	0,35%	8,28%	0,68%	6,68%	124,02%	1,71%
Setembro	177.685.219,63	14.992.841,50	12.893.232,00	180.161.478,50	376.649,37	13.417.323,54	0,21%	8,51%	0,65%	7,37%	115,39%	1,31%
Outubro	180.161.478,50	4.540.984,13	2.946.935,18	181.401.272,22	-354.255,23	13.063.068,31	-0,19%	8,30%	0,65%	8,07%	102,76%	1,65%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



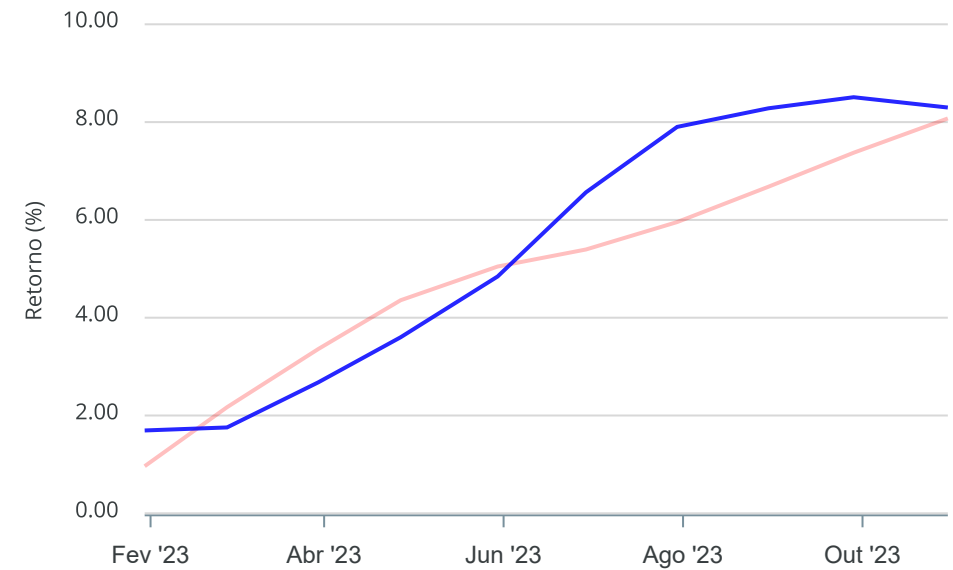
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B
- ☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1
- ☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2023**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.859.731,29	0,00	0,00	4.911.348,20	51.616,91	1,06%	1,06%	0,04%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.858.018,68	0,00	0,00	4.909.240,35	51.221,67	1,05%	1,05%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.796.826,42	0,00	0,00	6.865.947,21	69.120,79	1,02%	1,02%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	28.873.772,66	2.300.000,00	0,00	31.473.088,99	299.316,33	0,96%	0,99%	0,01%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.429.520,75	0,00	0,00	4.449.211,77	19.691,02	0,44%	0,44%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	12.226.644,98	0,00	0,00	12.280.928,78	54.283,80	0,44%	0,44%	0,48%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	3.033.979,73	0,00	0,00	3.047.263,31	13.283,58	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.041.544,65	0,00	0,00	11.089.716,22	48.171,57	0,44%	0,44%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	11.173.259,05	0,00	0,00	11.221.974,89	48.715,84	0,44%	0,44%	0,48%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.159.224,99	0,00	0,00	2.168.106,47	8.881,48	0,41%	0,41%	1,49%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.830.514,39	2.240.984,13	2.946.935,18	3.148.618,31	24.054,97	0,40%	0,90%	0,01%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.599.221,16	0,00	0,00	1.603.850,31	4.629,15	0,29%	0,29%	1,32%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.631.789,10	0,00	0,00	5.646.242,94	14.453,84	0,26%	0,26%	0,90%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1.176.821,49	0,00	0,00	1.179.356,22	2.534,73	0,22%	0,22%	1,92%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.532.352,25	0,00	0,00	1.532.624,49	272,24	0,02%	0,02%	0,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.269.591,36	0,00	0,00	1.266.950,40	-2.640,96	-0,21%	-0,21%	2,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.152.401,60	0,00	0,00	7.131.535,31	-20.866,29	-0,29%	-0,29%	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.111.068,65	0,00	0,00	5.094.626,39	-16.442,26	-0,32%	-0,32%	1,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.502.954,10	0,00	0,00	2.494.700,88	-8.253,22	-0,33%	-0,33%	1,32%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	2.388.504,02	0,00	0,00	2.380.388,05	-8.115,97	-0,34%	-0,34%	1,44%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	215.213,13	0,00	0,00	214.249,74	-963,39	-0,45%	-0,45%	0,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.270.126,29	0,00	0,00	1.261.686,75	-8.439,54	-0,66%	-0,66%	3,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.002.475,02	0,00	0,00	5.962.023,74	-40.451,28	-0,67%	-0,67%	3,00%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.980.809,08	0,00	0,00	2.950.021,10	-30.787,98	-1,03%	-1,03%	2,21%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.321.057,16	0,00	0,00	9.224.269,45	-96.787,71	-1,04%	-1,04%	2,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	15.322.078,43	0,00	0,00	15.162.540,43	-159.538,00	-1,04%	-1,04%	2,21%
Total Renda Fixa	156.759.500,43	4.540.984,13	2.946.935,18	158.670.510,70	316.961,32	0,20%		0,90%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.359.367,16	0,00	0,00	1.366.752,33	7.385,17	0,54%	0,54%	0,95%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.467.603,10	0,00	0,00	1.461.630,73	-5.972,37	-0,41%	-0,41%	2,40%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	569.465,82	0,00	0,00	559.586,48	-9.879,34	-1,73%	-1,73%	7,21%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.155.506,91	0,00	0,00	1.135.315,52	-20.191,39	-1,75%	-1,75%	7,19%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.140.905,62	0,00	0,00	2.102.976,17	-37.929,45	-1,77%	-1,77%	7,21%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	1.097.775,94	0,00	0,00	1.077.780,17	-19.995,77	-1,82%	-1,82%	7,22%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	493.865,85	0,00	0,00	478.884,44	-14.981,41	-3,03%	-3,03%	7,70%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5.835.130,73	0,00	0,00	5.632.301,01	-202.829,72	-3,48%	-3,48%	6,64%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.083.202,23	0,00	0,00	1.028.301,85	-54.900,38	-5,07%	-5,07%	8,24%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.118.110,30	0,00	0,00	2.922.220,60	-195.889,70	-6,28%	-6,28%	8,83%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	704.915,93	0,00	0,00	652.417,28	-52.498,65	-7,45%	-7,45%	12,17%
Total Renda Variável	19.025.849,59	0,00	0,00	18.418.166,58	-607.683,01	-3,19%		6,69%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.195.139,58	0,00	0,00	2.164.426,25	-30.713,33	-1,40%	-1,40%	7,82%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	917.336,03	0,00	0,00	904.441,61	-12.894,42	-1,41%	-1,41%	7,20%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.263.652,87	0,00	0,00	1.243.727,08	-19.925,79	-1,58%	-1,58%	7,88%
Total Exterior	4.376.128,48	0,00	0,00	4.312.594,94	-63.533,54	-1,45%		7,71%

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.

