

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

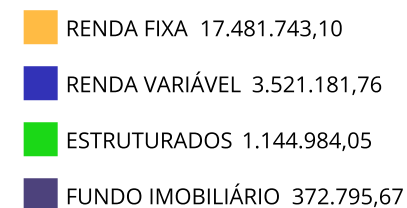
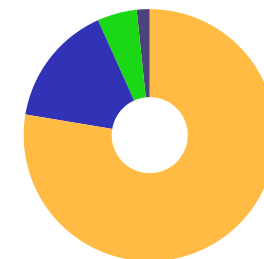
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			3.065.635,62	13,61%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	813.326,28	3,61%	685	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	468.255,26	2,08%	903	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	63.611,07	0,28%	794	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.273.798,71	5,66%	638	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	98.104,67	0,44%	1.132	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	601.398,45	2,67%	598	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.003.110,08	8,89%	794	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.579.779,79	7,01%	873	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.035.419,87	4,60%	933	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.074.542,45	4,77%	782	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	410.090,60	1,82%	1.185	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	507.824,39	2,25%	426	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	942.903,20	4,19%	1.116	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.676.245,71	7,44%	985	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	D+7	Não há	10.729,76	0,05%	6.911	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CDB - BANCO DAYCOVAL	S/Info	Não Há	285.596,82	1,27%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	487.683,42	2,17%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	1.083.686,95	4,81%	111	0,48%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	347.430,12	1,54%	1.003	0,06%	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
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	367.274,85	1,63%	11.411	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.293.716,93	5,74%	416	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	385.957,88	1,71%	3.616	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	247.512,03	1,10%	4.432	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
TARUÁ FIC AÇÕES	D+32	Não há	202.768,55	0,90%	113	1,13%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	676.521,40	3,00%	31	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.029.428,38	4,57%	5.458	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	115.555,67	0,51%	4.179	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	50.570,67	0,22%		0,02%	Artigo 11º
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	285.460,00	1,27%		0,20%	Artigo 11º
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	Não se ...	Não se aplica	36.765,00	0,16%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			22.520.704,58				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			26.646,24				Artigo 6º
PL Total			22.547.350,82				

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

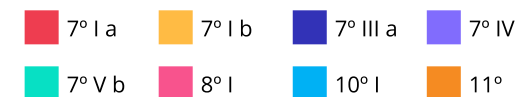
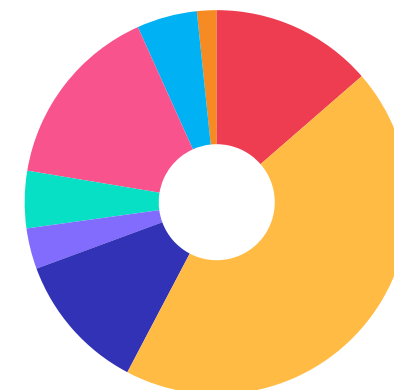
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	3.065.635,62	13,61%	11,00%	15,21%	81,95%	15.390.081,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	9.929.261,62	44,09%	20,31%	21,13%	81,95%	8.526.455,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	2.629.878,67	11,68%	12,71%	27,62%	60,00%	10.882.544,08
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	773.280,24	3,43%	1,26%	1,68%	20,00%	3.730.860,68
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	1.083.686,95	4,81%	4,50%	5,00%	5,00%	42.348,28
Total Renda Fixa	100,00%	17.481.743,10	77,63%	49,78%	70,64%	248,90%	



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%	3.521.181,76	15,64%	1,89%	16,46%	20,00%	982.959,16
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.144.984,05	5,08%	3,75%	5,00%	10,00%	1.107.086,41
Artigo 11º	5,00%	372.795,67	1,66%	1,43%	1,90%	5,00%	753.239,56
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	5.038.961,48	22,37%	7,07%	23,36%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	2.252.070,46
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



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 '	3.065.635,62	13,61	11,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	9.929.261,62	44,09	20,31	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	2.629.878,67	11,68	12,71	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	1.083.686,95	4,81	4,50	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.521.181,76	15,64	1,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.144.984,05	5,08	3,75	10,00
Artigo 11º	372.795,67	1,66	1,43	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	11.400.293,19	50,62	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.261.397,64	18,92	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	3.065.635,62	13,61	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.293.716,93	5,74	0,01
BANCO DAYCOVAL	773.280,24	3,43	0,01
TRÍGONO CAPITAL	676.521,40	3,00	-
GENIAL INVESTIMENTOS	385.957,88	1,71	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	247.512,03	1,10	0,00
TARUÁ CAPITAL	202.768,55	0,90	-
SICREDI	115.555,67	0,51	0,00
ZION INVEST	50.570,67	0,22	-
BV ASSET	36.765,00	0,16	-
V8 CAPITAL	10.729,76	0,05	-

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	8,97%	2,05%	4,08%	11,42%	21,35%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	8,79%	2,06%	4,24%	11,36%	20,79%	0,74%	2,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	8,59%	1,91%	4,04%	11,22%	20,92%	0,85%	2,28%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,72%	8,10%	2,09%	4,37%	11,50%	26,66%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,07%	9,23%	2,15%	4,73%	11,82%	22,25%	0,97%	2,19%
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%	0,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,81%	3,11%	6,35%	13,19%	24,03%	0,06%	0,36%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	8,79%	1,67%	4,28%	11,46%	21,66%	0,98%	2,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,11%	8,75%	1,65%	4,25%	11,41%	21,41%	0,99%	2,21%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	10,65%	-0,53%	6,49%	10,76%	18,68%	2,51%	4,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,56%	-0,64%	6,42%	10,75%	18,44%	2,52%	4,93%
CDB - BANCO DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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 (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%	3,21%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	11,25%	1,65%	7,18%	13,07%	21,93%	1,12%	3,24%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
TARUÁ FIC AÇÕES	-1,75%	2,02%	-6,14%	11,18%	-0,75%	-2,68%	9,10%	20,82%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	0,92%	9,89%	3,14%	6,35%	13,53%	27,01%	0,03%	0,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03%	10,09%	3,44%	6,80%	13,67%	26,38%	0,01%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	9,87%	3,22%	6,49%	13,40%	26,08%	0,01%	0,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	11,72%	2,73%	7,91%	13,59%	23,82%	0,14%	2,28%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	1,42%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,90%	8,06%	1,93%	7,76%	9,73%	20,93%	2,15%	5,99%

Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	-0,84%	4,69%	-3,14%	12,18%	2,76%	7,54%	7,29%	19,86%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,84%	9,30%	-0,67%	13,09%	9,61%	28,84%	7,54%	16,82%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01%	6,08%	-1,83%	14,99%	1,58%	-6,60%	7,55%	19,50%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,02%	14,38%	8,16%	23,03%	17,39%	13,25%	9,80%	20,17%
TARUÁ FIC AÇÕES	-1,75%	2,02%	-6,14%	11,18%	-0,75%	-2,68%	9,10%	20,82%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	0,19%	1,26%	-2,09%	9,70%	1,10%	-1,65%	7,73%	20,00%

IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	-0,98%	13,16%	-2,23%	14,20%	5,28%	-1,03%	4,18%	9,18%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,91%	29,46%	3,66%	30,48%	16,63%	13,25%	4,56%	22,75%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-6,84%	-37,23%	-14,08%	-21,33%	-55,64%	-44,69%	17,30%	34,11%

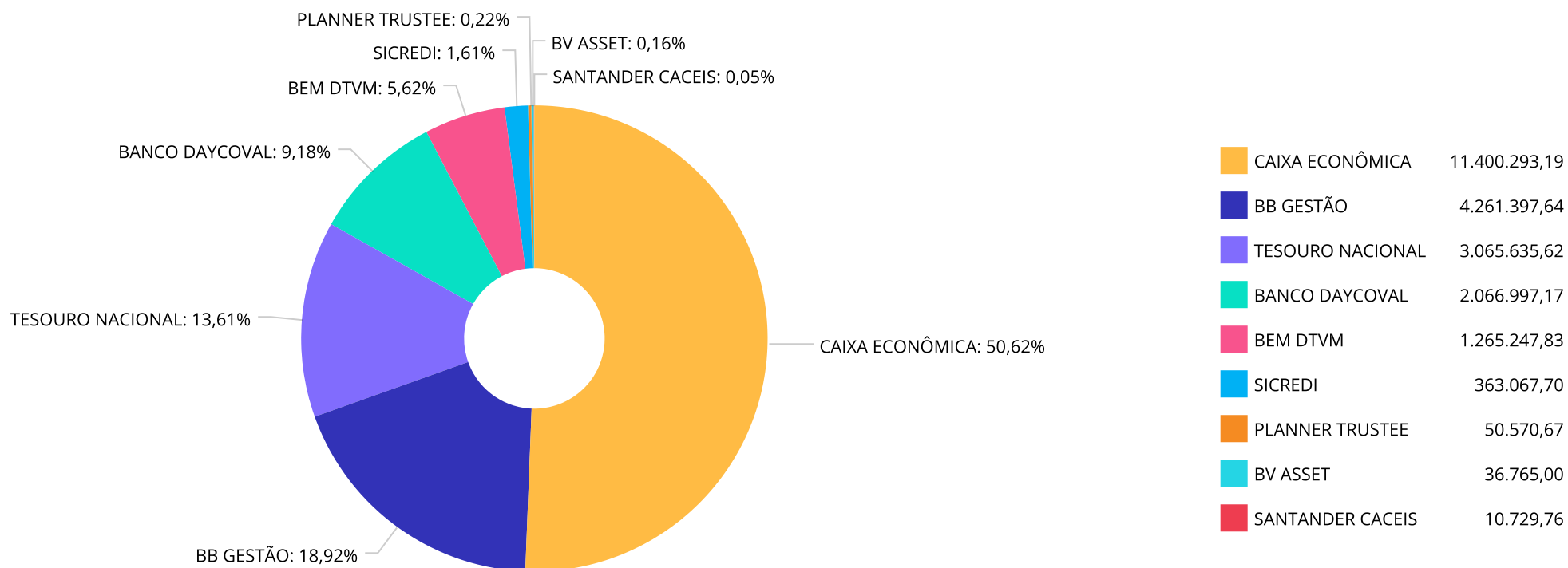
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-4,87%	11,68%	-3,65%	4,35%	19,59%	-0,45%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	-4,42%	18,22%	-1,80%	8,52%	29,82%	17,99%	4,84%	17,18%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
----------------------------------	---	---	---	---	---	---	---	---

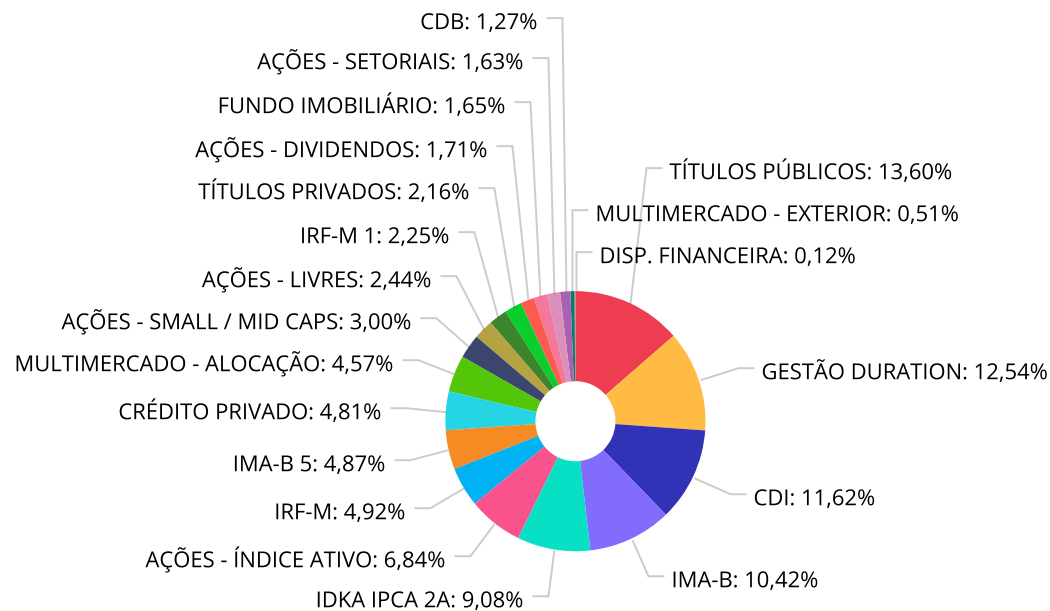
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	4,57%	-12,12%	-7,29%	11,25%	-13,96%	-	12,81%	33,37%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	3.065.635,62	■ GESTÃO DURATION	2.827.166,12	■ CDI	2.619.148,91	■ IMA-B	2.348.341,16
■ IDKA IPCA 2A	2.048.035,05	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.541.228,96	■ IRF-M	1.109.222,84	■ IMA-B 5	1.099.030,94
■ CRÉDITO PRIVADO	1.083.686,95	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.029.428,38	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	676.521,40	■ AÇÕES - LIVRES	550.198,67
■ IRF-M 1	508.195,27	■ TÍTULOS PRIVADOS	487.683,42	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	385.957,88	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	372.795,67
■ AÇÕES - SETORIAIS	367.274,85	■ CDB	285.596,82	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	115.555,67	■ DISP. FINANCEIRA	26.646,24

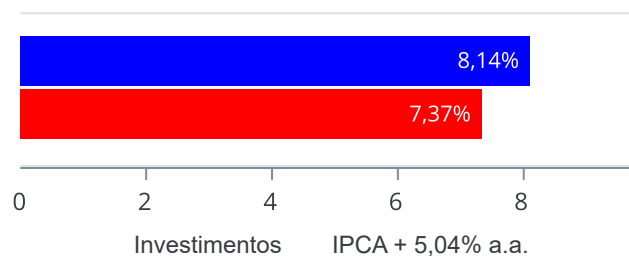
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	16/12/2022	118	4.027,194741	4.219,305511	475.208,98	497.878,05	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	06/05/2022	333	4209,710000	4.290,228486	1.401.833,43	1.428.646,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	16/05/2022	113	4152,810000	4.351,947685	469.267,53	491.770,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	02/09/2022	118	4108,850000	4.329,643037	484.844,30	510.897,88	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	21.160.591,24	1.591.733,85	2.291.390,99	20.742.705,88	281.771,78	281.771,78	1,33%	1,33%	0,96%	0,96%	138,35%	3,35%
Fevereiro	20.742.705,88	655.000,00	7.302,00	21.114.990,72	-275.413,16	6.358,62	-1,29%	0,03%	1,19%	2,17%	1,24%	2,71%
Março	21.114.990,72	743.802,64	676.331,55	21.268.875,69	86.413,88	92.772,50	0,41%	0,43%	1,16%	3,36%	12,96%	3,03%
Abril	21.268.875,69	522.000,00	553.302,00	21.411.108,24	173.534,55	266.307,05	0,82%	1,25%	0,96%	4,35%	28,81%	3,01%
Mai	21.411.108,24	657.000,00	566.302,00	21.973.564,94	471.758,70	738.065,75	2,19%	3,48%	0,66%	5,04%	68,92%	2,92%
Junho	21.973.564,94	1.514.000,00	1.374.954,38	22.899.740,85	787.130,29	1.525.196,04	3,56%	7,16%	0,33%	5,39%	132,82%	2,21%
Julho	22.899.740,85	899.300,00	1.255.293,35	22.801.914,65	258.167,15	1.783.363,19	1,13%	8,37%	0,53%	5,95%	140,63%	2,07%
Agosto	22.801.914,65	3.991.500,00	4.117.805,08	22.604.334,61	-71.274,96	1.712.088,23	-0,31%	8,03%	0,68%	6,67%	120,35%	2,41%
Setembro	22.604.334,61	484.376,91	591.337,00	22.520.704,58	23.330,06	1.735.418,29	0,10%	8,14%	0,65%	7,37%	110,50%	2,56%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



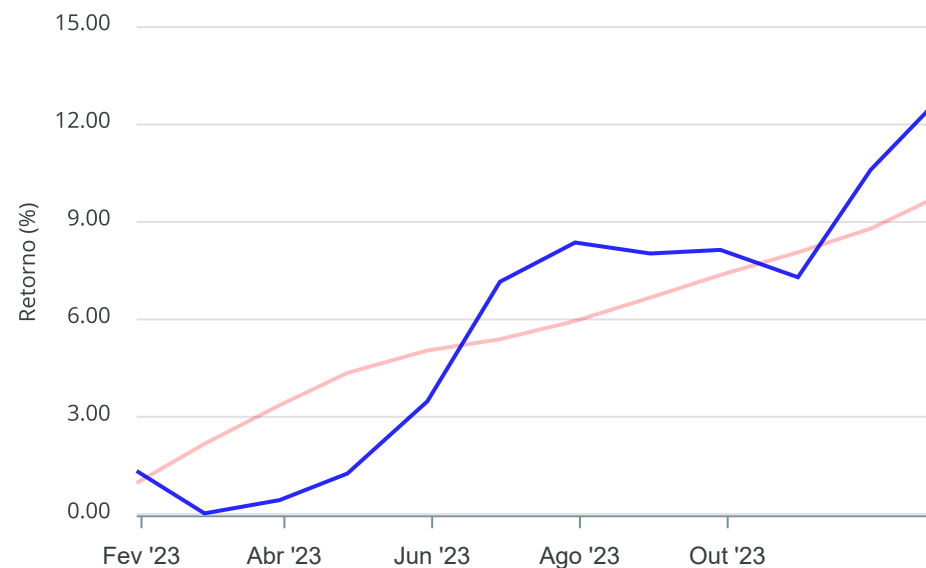
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.498.042,55	162.000,00	0,00	1.676.245,71	16.203,16	0,98%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	406.395,60	0,00	0,00	410.090,60	3.695,00	0,91%	0,91%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	97.225,62	0,00	0,00	98.104,67	879,05	0,90%	0,90%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	806.244,78	0,00	0,00	813.326,28	7.081,50	0,88%	0,88%	0,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	636.675,28	311.665,89	13.000,00	942.903,20	7.562,03	0,80%	0,97%	0,01%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	483.933,36	0,00	0,00	487.683,42	3.750,06	0,77%	-	-
CDB - BANCO DAYCOVAL	283.615,54	0,00	0,00	285.596,82	1.981,28	0,70%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.995.053,47	0,00	0,00	2.003.110,08	8.056,61	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.574.177,89	0,00	0,00	1.579.779,79	5.601,90	0,36%	0,36%	0,74%
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	0,00	10.711,02	0,00	10.729,76	18,74	0,17%	0,92%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	507.083,90	0,00	0,00	507.824,39	740,49	0,15%	0,15%	1,12%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	600.559,78	0,00	0,00	601.398,45	838,67	0,14%	0,14%	1,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.042.941,08	0,00	576.000,00	468.255,26	1.314,18	0,13%	0,21%	0,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.034.262,39	0,00	0,00	1.035.419,87	1.157,48	0,11%	0,11%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	63.540,45	0,00	0,00	63.611,07	70,62	0,11%	0,11%	0,99%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.082.886,89	0,00	0,00	1.083.686,95	800,06	0,07%	0,07%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.084.925,94	0,00	0,00	1.074.542,45	-10.383,49	-0,96%	-0,96%	2,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.286.261,27	0,00	0,00	1.273.798,71	-12.462,56	-0,97%	-0,97%	2,52%
TÍTULOS PÚBLICOS	3.108.615,75	0,00	0,00	3.065.635,62	-42.980,13	-1,38%	-	-
Total Renda Fixa	17.592.441,54	484.376,91	589.000,00	17.481.743,10	-6.075,35	-0,03%		0,90%

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 FI AÇÕES	351.225,90	0,00	0,00	367.274,85	16.048,95	4,57%	4,57%	12,81%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	656.692,25	0,00	0,00	676.521,40	19.829,15	3,02%	3,02%	9,80%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.020.215,46	0,00	0,00	1.029.428,38	9.212,92	0,90%	0,90%	2,15%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	382.753,79	0,00	0,00	385.957,88	3.204,09	0,84%	0,84%	7,54%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.291.235,72	0,00	0,00	1.293.716,93	2.481,21	0,19%	0,19%	7,73%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	347.454,09	0,00	0,00	347.430,12	-23,97	-0,01%	-0,01%	7,55%
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	37.129,80	0,00	342,00	36.765,00	-22,80	-0,06%	-0,06%	4,18%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	249.614,92	0,00	0,00	247.512,03	-2.102,89	-0,84%	-0,84%	7,29%
TARUÁ FIC AÇÕES	206.381,25	0,00	0,00	202.768,55	-3.612,70	-1,75%	-1,75%	9,10%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	294.000,00	0,00	1.995,00	285.460,00	-6.545,00	-2,23%	-2,25%	4,56%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	120.904,99	0,00	0,00	115.555,67	-5.349,32	-4,42%	-4,42%	4,84%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	54.284,90	0,00	0,00	50.570,67	-3.714,23	-6,84%	-6,84%	17,30%
Total Renda Variável	5.011.893,07	0,00	2.337,00	5.038.961,48	29.405,41	0,59%		7,07%

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

FUNDOS EXTERIOR

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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.671.767,37	531.000,00	1.600.000,00	1.676.245,71	73.478,34	2,29%	3,44%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.856.180,31	995.965,89	2.954.500,00	942.903,20	45.257,00	1,17%	3,22%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.348.583,04	0,00	390.000,00	2.003.110,08	44.527,04	1,90%	1,94%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.547.899,17	0,00	0,00	1.579.779,79	31.880,62	2,06%	2,06%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.060.844,53	0,00	0,00	1.083.686,95	22.842,42	2,15%	2,15%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	791.726,13	0,00	0,00	813.326,28	21.600,15	2,73%	2,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.025.613,25	0,00	576.000,00	468.255,26	18.642,01	1,82%	1,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.018.432,24	0,00	0,00	1.035.419,87	16.987,63	1,67%	1,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	397.671,12	0,00	0,00	410.090,60	12.419,48	3,12%	3,12%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	477.135,57	0,00	0,00	487.683,42	10.547,85	2,21%	-
CDB - BANCO DAYCOVAL	280.201,20	0,00	0,00	285.596,82	5.395,62	1,93%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	95.145,62	0,00	0,00	98.104,67	2.959,05	3,11%	3,11%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	60.696,64	538.000,00	0,00	601.398,45	2.701,81	0,45%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.127,58	505.000,00	0,00	507.824,39	1.696,81	0,34%	1,77%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	62.578,89	0,00	0,00	63.611,07	1.032,18	1,65%	1,65%
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	0,00	10.711,02	0,00	10.729,76	18,74	0,17%	3,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.100.000,00	0,00	1.074.542,45	-25.457,55	-2,31%	-0,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	1.304.500,00	0,00	1.273.798,71	-30.701,29	-2,35%	-0,64%
TÍTULOS PÚBLICOS	3.169.047,66	0,00	58.968,08	3.065.635,62	-44.443,96	-1,40%	-

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	17.864.650,32	4.985.176,91	5.579.468,08	17.481.743,10	211.383,95	0,93%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕE...	625.502,86	0,00	0,00	676.521,40	51.018,54	8,16%	8,16%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.009.921,07	0,00	0,00	1.029.428,38	19.507,31	1,93%	1,93%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	275.380,00	0,00	6.090,00	285.460,00	16.170,00	5,87%	3,66%
DAYCOVAL TOP SELEÇÃO FIC AÇÕES	368.035,46	0,00	377.851,35	0,00	9.815,89	2,67%	-4,64%
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	37.604,80	0,00	1.026,00	36.765,00	186,20	0,50%	-2,23%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	117.669,06	0,00	0,00	115.555,67	-2.113,39	-1,80%	-1,80%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	390.000,00	0,00	385.957,88	-4.042,12	-1,04%	-0,67%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	353.917,97	0,00	0,00	347.430,12	-6.487,85	-1,83%	-1,83%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	255.528,84	0,00	0,00	247.512,03	-8.016,81	-3,14%	-3,14%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	58.856,26	0,00	0,00	50.570,67	-8.285,59	-14,08%	-14,08%
TARUÁ FIC AÇÕES	216.030,84	0,00	0,00	202.768,55	-13.262,29	-6,14%	-6,14%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.320.485,02	0,00	0,00	1.293.716,93	-26.768,09	-2,03%	-2,09%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	396.158,35	0,00	0,00	367.274,85	-28.883,50	-7,29%	-7,29%
Total Renda Variável	5.035.090,53	390.000,00	384.967,35	5.038.961,48	-1.161,70	-0,02%	

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.

