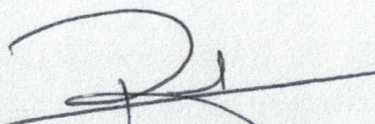


# Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.



Rodrigo Barbosa Franco  
Agente de Controle Interno  
Portaria n° 23.500/2021



Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

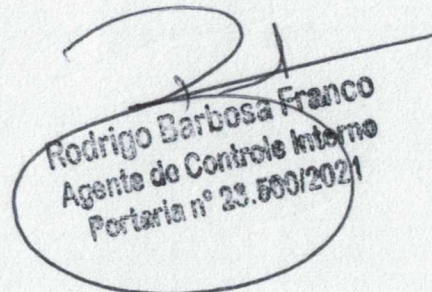
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	41.290.647,97	16,72%	690	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	764.611,53	0,31%	785	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	760.252,96	0,31%	1.139	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	110.847,30	0,04%	32	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	12.595.037,53	5,10%	308	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	6.102.298,16	2,47%	370	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	8.125.434,29	3,29%	204	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	17.485.811,29	7,08%	791	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	130.331,82	0,05%	926	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	22.863.977,49	9,26%	1.723	11,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	167.769,56	0,07%	117	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.942.338,77	2,00%	249	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.455.818,56	4,64%	150	1,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	22.966.730,97	9,30%	418	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG FI RENDA FIXA	D+0	Não há	32.780.427,47	13,27%	2.029	6,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	10.805.915,36	4,38%	465	0,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	42.822,85	0,02%	69	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	D+0	Não há	7.729.140,32	3,13%	186.351	0,06%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	626.923,86	0,25%	470	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIAÇÕES	D+7 du	Não há	670.834,97	0,27%	6.490	0,29%	Artigo 8º, Inciso I

*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2021



Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

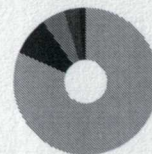
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRADESCO MID SMALL CAPS FIAÇÕES	D+4	Não há	830.993,76	0,34%	455	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.138.442,27	0,87%	121	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.585.774,35	4,29%	68	0,62%	Artigo 8º, Inciso I
MAG SELECTION FIAÇÕES	D+3 du	Não há	1.244.149,89	0,50%	41	3,05%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FIAÇÕES	D+4	Não há	321.761,34	0,13%	117	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.538.680,68	1,43%	58	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI FATORIAL DINÂMICO FIAÇÕES	D+7	Não há	969.296,80	0,39%	37	0,67%	Artigo 8º, Inciso I
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	D+4 du	Não há	2.874.093,84	1,16%	65	4,51%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	3.774.925,92	1,53%	8.018	0,63%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	5.940.165,73	2,41%	4.191	1,07%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	510.131,11	0,21%	357	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	8.238.395,69	3,34%	24.942	1,18%	Artigo 10º, Inciso I
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	3.586.181,12	1,45%		0,00%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>246.970.965,53</b>				

  
Rodrigo Barbosa Franco  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2021



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%	8,00%	30,00%	74.091.289,66
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	110.397.019,90	44,70%	15,00%	22,00%	70,00%	62.482.655,97
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	24.697.096,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	82.951.231,13	33,59%	20,00%	30,00%	60,00%	65.231.348,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	37.045.644,83
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	49.394.193,11
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.348.548,28
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	7.729.140,32	3,13%	3,00%	5,00%	5,00%	4.619.407,96
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.348.548,28
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>201.077.391,35</b>	<b>81,42%</b>	<b>38,00%</b>	<b>66,00%</b>	<b>220,00%</b>	



- RENDA FIXA 201.077.391,35
- RENDA VARIÁVEL 20.926.857,92
- EXTERIOR 13.099.316,60
- ESTRUTURADOS 8.238.395,69
- FUNDO IMOBILIÁRIO 3.586.181,12

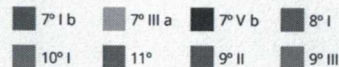
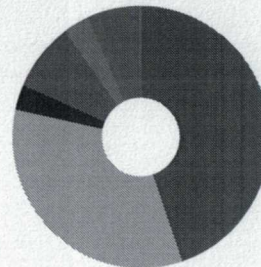
*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2021



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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%	20.926.857,92	8,47%	0,00%	14,00%	30,00%	53.164.431,74
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	24.697.096,55
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	8.238.395,69	3,34%	5,00%	7,00%	10,00%	16.458.700,86
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,01%	3,00%	5,00%	12.348.548,28
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.939.419,31
Artigo 11º	5,00%	3.586.181,12	1,45%	0,01%	1,00%	5,00%	8.762.367,16
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>32.751.434,73</b>	<b>13,26%</b>	<b>5,02%</b>	<b>25,00%</b>	<b>62,00%</b>	

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%	1,00%	2.469.709,66
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	12.589.185,49	5,10%	4,49%	5,99%	10,00%	12.107.911,06
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	510.131,11	0,21%	0,10%	2,01%	10,00%	24.186.965,44
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>13.099.316,60</b>	<b>5,30%</b>	<b>4,59%</b>	<b>8,00%</b>	<b>21,00%</b>	



*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2021



**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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	110.397.019,90	44,70	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	82.951.231,13	33,59	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	7.729.140,32	3,13	3,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	20.926.857,92	8,47	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso II	12.589.185,49	5,10	4,49	10,00
Artigo 9º, Inciso III	510.131,11	0,21	0,10	10,00
Artigo 10º, Inciso I	8.238.395,69	3,34	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,01	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 11º	3.586.181,12	1,45	0,01	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2021



**Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2023)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	66.566.034,22	26,95	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	58.518.498,80	23,69	0,51
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	35.253.543,29	14,27	0,00
CAIXA ASSET	27.880.019,67	11,29	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	16.956.673,50	6,87	0,00
GUEPARDO INVESTIMENTOS	10.585.774,35	4,29	0,20
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.399.975,29	3,40	0,01
WESTERN ASSET	8.238.395,69	3,34	-
XP ASSET MANAGEMENT	3.774.925,92	1,53	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.586.181,12	1,45	-
TARPON INVESTIMENTOS	3.538.680,68	1,43	-
MONGERAL AEGON RENDA VARIÁVEL	1.244.149,89	0,50	3,05
VINCI PARTNERS	969.296,80	0,39	-
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	626.923,86	0,25	0,02
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	510.131,11	0,21	-
META ASSET MANAGEMENT	321.761,34	0,13	0,18

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)



**Rodrigo Barbosa Franco**  
 Agente de Controle Interno  
 Portaria nº 23.500/2021



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
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,96%	11,12%	3,06%	6,61%	13,48%	26,55%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	10,82%	2,97%	6,45%	13,13%	25,83%	0,12%	0,37%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	10,84%	3,09%	6,44%	13,21%	29,37%	0,00%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,32%	8,40%	0,37%	2,99%	8,99%	22,58%	1,43%	2,35%
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%	2,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-0,33%	8,33%	0,35%	2,96%	8,94%	22,26%	1,43%	2,34%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	-0,33%	8,34%	0,37%	2,95%	8,97%	22,59%	1,43%	2,34%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,66%	10,06%	-1,97%	3,75%	8,97%	21,40%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,71%	9,90%	-2,08%	3,95%	8,67%	20,79%	2,97%	5,29%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,68%	9,83%	-2,09%	3,68%	8,73%	20,76%	3,00%	5,21%

<b>CDI (Benchmark)</b>	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	12,67%	2,79%	7,46%	13,41%	26,00%	0,26%	2,26%
MAG FI RENDA FIXA	1,04%	10,60%	3,32%	6,52%	13,00%	26,27%	0,07%	0,19%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,02%	11,29%	3,25%	6,80%	13,78%	27,89%	0,01%	0,04%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	11,47%	3,41%	7,05%	13,96%	27,79%	0,02%	0,07%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01%	11,23%	3,40%	7,03%	13,68%	27,37%	0,02%	0,10%

*Rodolfo*  
Rodrigo Barbosa Franco  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2023



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
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	9,29%	2,46%	4,50%	10,17%	-	0,48%	1,83%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,26%	10,64%	1,30%	6,24%	12,00%	24,61%	0,90%	1,50%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,41%	9,50%	0,83%	5,07%	10,70%	22,21%	1,49%	1,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	-	2,48%	-	-	-	0,48%	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	-	-0,41%	-	-	-	0,48%	-

*Rodrigo Barbosa Franco*  
 Agente de Controle Interno  
 Portaria nº 23.550/2021



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

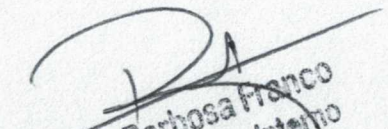
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIAÇÕES	-4,30%	5,88%	-7,02%	6,28%	-1,94%	10,38%	6,99%	16,17%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,03%	21,89%	-4,86%	21,99%	7,80%	40,31%	7,70%	21,27%
MAG SELECTION FIAÇÕES	-4,26%	3,64%	-9,71%	8,48%	-5,31%	4,87%	7,93%	20,24%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,93%	1,34%	-8,80%	6,05%	-8,21%	6,92%	7,73%	19,36%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-6,04%	30,87%	-1,01%	30,79%	11,88%	52,69%	9,41%	21,48%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FIAÇÕES	-3,79%	1,94%	-8,23%	7,28%	-8,74%	1,33%	7,73%	19,98%
<b>IBX (Benchmark)</b>	-3,03%	2,31%	-7,11%	8,24%	-3,47%	7,90%	-	-
META VALOR FIAÇÕES	-6,52%	-16,47%	-18,29%	-5,39%	-25,67%	-14,68%	12,24%	23,96%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	-1,97%	10,06%	-1,30%	10,41%	5,49%	17,94%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	-2,20%	9,23%	-8,61%	0,58%	8,31%	-8,94%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-1,74%	15,71%	-6,98%	4,32%	16,73%	6,88%	7,19%	15,68%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-7,40%	-2,72%	-16,71%	5,49%	-16,24%	-16,19%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIAÇÕES	-7,30%	-3,25%	-14,32%	1,85%	-16,40%	-13,17%	11,29%	23,24%
BRADERCO MID SMALL CAPS FIAÇÕES	-7,66%	-13,35%	-19,20%	-2,92%	-24,59%	-20,02%	12,20%	23,82%

*Rodolfo*  
Rodrigo Barbosa Franco  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.600/2021



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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

  
Rodrigo Barbosa Franco  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2023

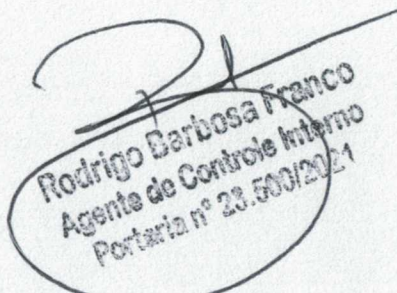


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-2,05%	7,80%	-1,21%	1,98%	9,50%	-22,21%	7,01%	19,352%

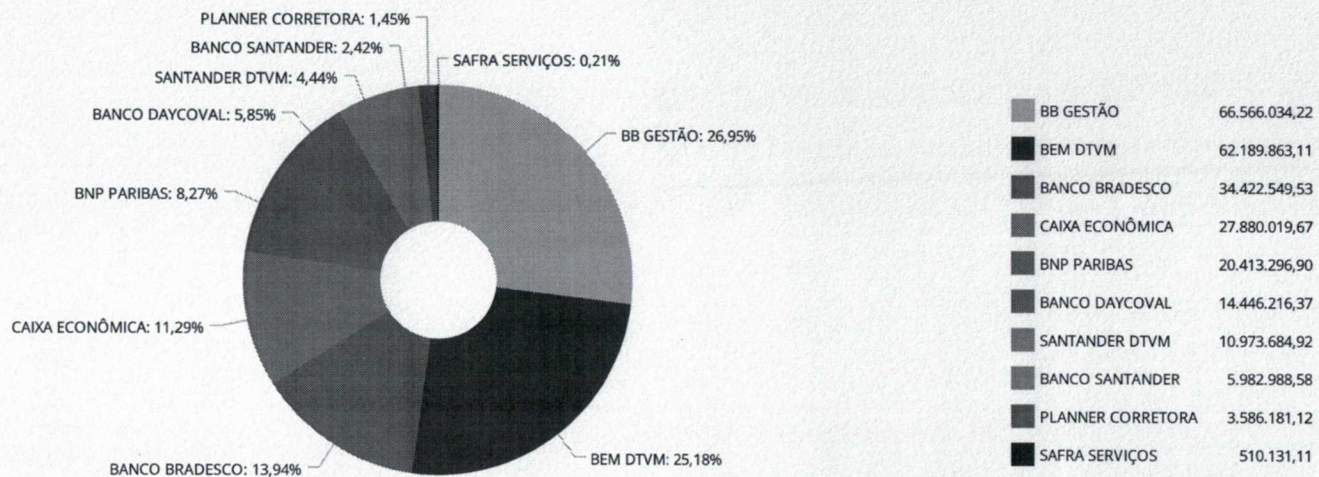
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,00%	3,11%	-3,63%	-1,26%	4,55%	-21,84%	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-4,04%	17,96%	-6,42%	4,14%	22,16%	-38,88%	9,76%	26,023%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-3,29%	-1,32%	-4,02%	-2,07%	3,46%	-27,37%	5,14%	16,424%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,10%	1,94%	-3,96%	-1,70%	4,45%	-23,43%	-	-
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-7,96%	-13,27%	-14,46%	-11,92%	-6,06%	-52,86%	8,23%	22,744%

  
Rodrigo Barbosa Franco  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2021



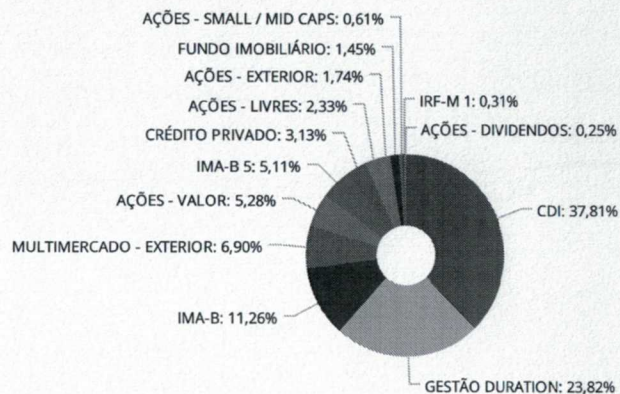
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2023)



*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.650/2021



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



■ CDI	93.375.843,78	■ GESTÃO DURATION	58.819.282,11	■ IMA-B	27.806.316,26	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	17.052.655,26
■ AÇÕES - VALOR	13.045.977,96	■ IMA-B 5	12.629.378,77	■ CRÉDITO PRIVADO	7.729.140,32	■ AÇÕES - LIVRES	5.752.127,37
■ AÇÕES - EXTERIOR	4.285.057,03	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	3.586.181,12	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.501.828,73	■ IRF-M 1	760.252,96
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	626.923,86						

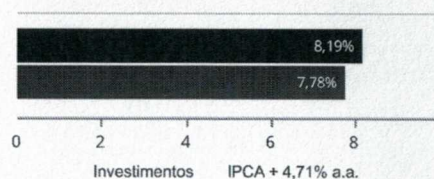
*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 28.600/2021



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	223.796.588,87	12.539.062,06	12.362.323,08	227.589.514,36	3.616.186,51	3.616.186,51	1,61%	1,61%	0,93%	0,93%	172,73%	2,69%
Fevereiro	227.589.514,36	25.946.684,84	25.647.672,62	227.579.922,73	-308.603,85	3.307.582,66	-0,14%	1,48%	1,17%	2,12%	69,74%	2,27%
Março	227.579.922,73	34.347.476,63	32.777.536,62	230.825.157,11	1.675.294,37	4.982.877,03	0,73%	2,22%	1,13%	3,28%	67,74%	2,09%
Abril	230.825.157,11	61.881.489,12	61.419.086,00	233.661.284,29	2.373.724,06	7.356.601,09	1,03%	3,27%	0,94%	4,25%	76,93%	1,83%
Mai	233.661.284,29	81.094.754,70	80.456.211,96	238.438.151,98	4.138.324,95	11.494.926,04	1,77%	5,09%	0,63%	4,91%	103,74%	2,26%
Junho	238.438.151,98	42.460.829,18	42.651.055,74	243.414.754,17	5.166.828,75	16.661.754,79	2,17%	7,37%	0,30%	5,23%	140,98%	2,34%
Julho	243.414.754,17	67.182.707,58	66.716.831,47	247.030.202,66	3.149.572,38	19.811.327,17	1,29%	8,76%	0,50%	5,76%	152,06%	1,87%
Agosto	247.030.202,66	14.776.549,52	14.268.438,39	247.655.273,07	116.959,28	19.928.286,45	0,05%	8,81%	0,65%	6,45%	136,59%	2,11%
Setembro	247.655.273,07	17.049.073,08	16.874.639,14	247.284.037,75	-545.669,26	19.382.617,19	-0,22%	8,57%	0,63%	7,12%	120,42%	2,05%
Outubro	247.284.037,75	48.486.940,43	47.927.243,91	246.970.965,53	-872.768,74	18.509.848,45	-0,35%	8,19%	0,63%	7,78%	105,15%	1,94%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

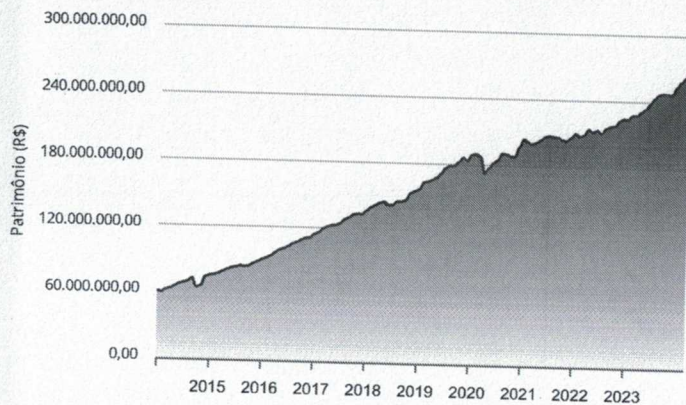


*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.500/2021

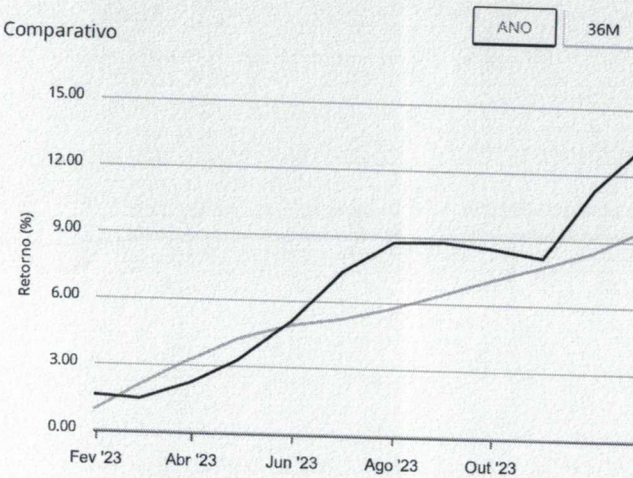


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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

*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 28.600/2011



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
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	22.727.102,37	0,00	0,00	22.966.730,97	239.628,60	1,05%	1,05%	0,02%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CR...	7.650.905,12	0,00	0,00	7.729.140,32	78.235,20	1,02%	1,02%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	109.770,76	0,00	0,00	110.847,30	1.076,54	0,98%	0,98%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.694.282,60	5.010.672,52	0,00	10.805.915,36	100.960,24	0,94%	1,01%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	817.951,61	0,00	65.000,00	760.252,96	7.301,35	0,89%	0,92%	0,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	33.287.303,95	7.669.978,50	0,00	41.290.647,97	333.365,52	0,81%	0,85%	0,26%
MAG FI RENDA FIXA	567.577,09	32.000.000,00	0,00	32.780.427,47	212.850,38	0,65%	1,04%	0,07%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.089.473,29	0,00	0,00	8.125.434,29	35.961,00	0,44%	0,44%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	12.539.365,32	0,00	0,00	12.595.037,53	55.672,21	0,44%	0,44%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.075.807,40	0,00	0,00	6.102.298,16	26.490,76	0,44%	0,44%	0,48%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	42.647,42	0,00	0,00	42.822,85	175,43	0,41%	0,41%	1,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.441.049,25	0,00	0,00	17.485.811,29	44.762,04	0,26%	0,26%	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	130.752,45	0,00	0,00	130.331,82	-420,63	-0,32%	-0,32%	1,43%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	767.096,80	0,00	0,00	764.611,53	-2.485,27	-0,32%	-0,32%	1,43%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	11.493.533,72	0,00	0,00	11.455.818,56	-37.715,16	-0,33%	-0,33%	1,43%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	168.326,73	0,00	0,00	167.769,56	-557,17	-0,33%	-0,33%	1,43%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	55.070.426,86	0,00	32.000.000,00	22.863.977,49	-206.449,37	-0,37%	-0,71%	2,97%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.731.685,06	0,00	12.662.243,91	4.942.338,77	-127.102,38	-0,72%	-0,68%	3,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>200.405.057,80</b>	<b>44.680.651,02</b>	<b>44.727.243,91</b>	<b>201.120.214,20</b>	<b>761.749,29</b>	<b>0,38%</b>		<b>0,71%</b>

*Rodrigo Barbosa Franco*  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.503/2023



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
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	3.590.041,78	0,00	0,00	3.586.181,12	-3.860,66	-0,11%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11.605.134,73	0,00	3.200.000,00	8.238.395,69	-166.739,04	-1,44%	-1,74%	7,19%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.041.937,84	3.806.289,41	0,00	10.585.774,35	-262.452,90	-2,42%	-3,03%	7,70%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FIAÇÕES	1.007.527,23	0,00	0,00	969.296,80	-38.230,43	-3,79%	-3,79%	7,73%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.225.977,48	0,00	0,00	2.138.442,27	-87.535,21	-3,93%	-3,93%	7,73%
MAG SELECTION FIAÇÕES	1.299.565,39	0,00	0,00	1.244.149,89	-55.415,50	-4,26%	-4,26%	7,93%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIAÇÕES	655.108,32	0,00	0,00	626.923,86	-28.184,46	-4,30%	-4,30%	6,99%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	3.766.211,36	0,00	0,00	3.538.680,68	-227.530,68	-6,04%	-6,04%	9,41%
META VALOR FIAÇÕES	344.205,11	0,00	0,00	321.761,34	-22.443,77	-6,52%	-6,52%	12,24%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIAÇÕES	723.686,80	0,00	0,00	670.834,97	-52.851,83	-7,30%	-7,30%	11,29%
BRAPRES MID SMALL CAPS FIAÇÕES	899.970,60	0,00	0,00	830.993,76	-68.976,84	-7,66%	-7,66%	12,20%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>33.159.366,64</b>	<b>3.806.289,41</b>	<b>3.200.000,00</b>	<b>32.751.434,73</b>	<b>-1.014.221,32</b>	<b>-3,00%</b>		<b>8,02%</b>

*Rodolfo*  
**Rodrigo Barbosa Franco**  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 28.500/2021



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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	520.824,38	0,00	0,00	510.131,11	-10.693,27	-2,05%	-2,05%	7,01%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	6.142.361,81	0,00	0,00	5.940.165,73	-202.196,08	-3,29%	-3,29%	5,14%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	3.933.812,88	0,00	0,00	3.774.925,92	-158.886,96	-4,04%	-4,04%	9,76%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	3.122.614,24	0,00	0,00	2.874.093,84	-248.520,40	-7,96%	-7,96%	8,23%
<b>Total Exterior</b>	<b>13.719.613,31</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>13.099.316,60</b>	<b>-620.296,71</b>	<b>-4,52%</b>		<b>7,22%</b>

*Rodolfo*  
**Rodrigo Barbosa Franco**  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 23.600/2021



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>.

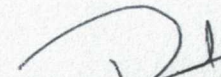
Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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.

  
**Rodrigo Barbosa Franco**  
Agente de Controle Interno  
Portaria nº 28.600/2021