



CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.


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



Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 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	33.287.303,85	13,46%	685	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	767.096,80	0,31%	794	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	817.951,61	0,33%	1.132	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	109.770,76	0,04%	34	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	12.539.365,32	5,07%	303	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	6.075.807,40	2,46%	370	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	8.089.473,29	3,27%	201	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	17.441.049,25	7,05%	794	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	130.752,45	0,05%	933	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	55.070.426,86	22,27%	1.710	24,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	168.326,73	0,07%	114	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	17.731.685,06	7,17%	246	1,92%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.493.533,72	4,65%	149	1,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	22.727.102,37	9,19%	404	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG FI RENDA FIXA	D+0	Não há	567.577,09	0,23%	2.096	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	42.647,42	0,02%	71	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	5.694.282,60	2,30%	467	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	D+0	Não há	7.650.905,12	3,09%	176.483	0,07%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	655.108,32	0,26%	478	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	723.686,80	0,29%	6.672	0,28%	Artigo 8º, Inciso I

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



Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

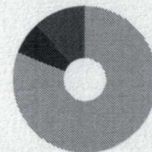
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	899.970,60	0,36%	463	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.225.977,48	0,90%	123	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.041.937,84	2,85%	62	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
MAG SELECTION FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.299.565,39	0,53%	43	2,70%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	344.205,11	0,14%	123	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.766.211,36	1,52%	56	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	D+7	Não há	1.007.527,23	0,41%	38	0,67%	Artigo 8º, Inciso I
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	D+4 du	Não há	3.122.614,24	1,26%	67	4,51%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	3.933.812,88	1,59%	8.273	0,62%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	6.142.361,81	2,48%	4.394	1,02%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	520.824,38	0,21%	377	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.605.134,73	4,69%	24.858	1,57%	Artigo 10º, Inciso I
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	3.590.041,78	1,45%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			247.284.037,75				


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



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%	8,00%	30,00%	74.185.211,33
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	134.497.324,42	54,39%	15,00%	22,00%	70,00%	38.801.502,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	24.728.403,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	58.256.828,26	23,56%	20,00%	30,00%	60,00%	90.113.594,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	37.092.605,66
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	49.456.807,55
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.364.201,89
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	7.650.905,12	3,09%	3,00%	5,00%	5,00%	4.713.296,77
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.364.201,89
Total Renda Fixa	100,00%	200.405.057,80	81,04%	38,00%	66,00%	220,00%	



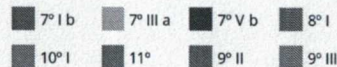
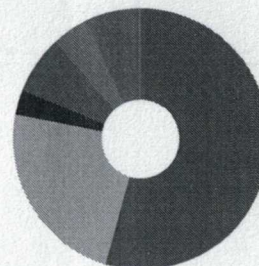
- RENDA FIXA 200.405.057,80
- RENDA VARIÁVEL 17.964.190,13
- EXTERIOR 13.719.613,31
- ESTRUTURADOS 11.605.134,73
- FUNDO IMOBILIÁRIO 3.590.041,78

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

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%	17.964.190,13	7,26%	0,00%	14,00%	30,00%	56.221.021,20
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	24.728.403,78
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	11.605.134,73	4,69%	5,00%	7,00%	10,00%	13.123.269,05
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,01%	3,00%	5,00%	12.364.201,89
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.945.680,76
Artigo 11º	5,00%	3.590.041,78	1,45%	0,01%	1,00%	5,00%	8.774.160,11
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	33.159.366,64	13,41%	5,02%	25,00%	62,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	2.472.840,38
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	13.198.788,93	5,34%	4,49%	5,99%	10,00%	11.529.614,85
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	520.824,38	0,21%	0,10%	2,01%	10,00%	24.207.579,40
Total Exterior	10,00%	13.719.613,31	5,55%	4,59%	8,00%	21,00%	



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



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	71.328.980,90	28,84	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	58.760.618,19	23,76	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	35.120.606,69	14,20	-
CAIXA DTVM	27.887.252,47	11,28	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	12.047.618,56	4,87	-
WESTERN ASSET	11.605.134,73	4,69	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.374.591,92	3,39	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	7.041.937,84	2,85	-
XP ASSET MANAGEMENT	3.933.812,88	1,59	-
TARPON INVESTIMENTOS	3.766.211,36	1,52	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.590.041,78	1,45	-
MONGERAL AEGON RENDA VARIÁVEL	1.299.565,39	0,53	-
VINCI PARTNERS	1.007.527,23	0,41	-
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	655.108,32	0,26	-
BANCO J. SAFRA S/A	520.824,38	0,21	-
META ASSET MANAGEMENT	344.205,11	0,14	-

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 '	134.497.324,42	54,39	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	58.256.828,26	23,56	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 '	7.650.905,12	3,09	3,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	17.964.190,13	7,26	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	13.198.788,93	5,34	4,49	10,00
Artigo 9º, Inciso III	520.824,38	0,21	0,10	10,00
Artigo 10º, Inciso I	11.605.134,73	4,69	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	3.590.041,78	1,45	0,01	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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 Setembro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,81%	3,11%	6,35%	13,19%	24,03%	0,06%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	9,77%	3,17%	6,36%	13,24%	27,48%	0,01%	0,00%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,10%	8,69%	1,63%	4,20%	11,31%	21,09%	0,99%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	8,79%	1,67%	4,28%	11,46%	21,66%	0,98%	0,02%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,11%	8,70%	1,67%	4,20%	11,40%	21,46%	0,98%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,97%	10,69%	-0,70%	6,72%	10,51%	18,48%	2,49%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,58%	-0,66%	6,49%	10,77%	18,43%	2,54%	0,05%

CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	11,72%	2,73%	7,91%	13,59%	23,82%	0,14%	0,02%
MAG FI RENDA FIXA	0,99%	9,46%	3,30%	6,28%	12,98%	25,72%	0,04%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,31%	3,54%	6,88%	13,98%	27,19%	0,03%	0,00%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,01%	10,16%	3,37%	6,67%	13,82%	27,49%	0,01%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02%	10,12%	3,52%	6,89%	13,72%	26,84%	0,01%	0,00%

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

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
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,19%	9,05%	1,21%	5,61%	11,22%	21,04%	0,85%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	-	3,12%	-	-	-	0,33%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,82%	3,09%	4,58%	11,76%	-	0,33%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	-	0,21%	-	-	-	0,33%	-


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2024



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
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,01%	10,64%	0,04%	13,98%	7,92%	11,25%	6,76%	0,17%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	0,33%	5,96%	-1,08%	14,60%	1,09%	-4,04%	7,83%	0,21%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,08%	5,49%	-1,77%	13,76%	1,07%	3,72%	7,85%	0,21%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,50%	25,70%	3,31%	33,12%	19,17%	31,43%	8,23%	0,22%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7,66%	39,29%	11,58%	45,55%	32,33%	58,35%	8,10%	0,22%
MAG SELECTION FI AÇÕES	0,27%	8,25%	-1,35%	16,57%	5,01%	2,43%	8,46%	0,21%

IBX (Benchmark)	0,84%	5,50%	-1,02%	13,78%	5,09%	3,69%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-3,69%	-10,65%	-8,66%	0,31%	-14,60%	-15,78%	10,33%	0,24%

IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-	-	-	-	-	-	-	-

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-4,87%	11,68%	-3,65%	4,35%	19,59%	-0,45%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-4,43%	17,75%	-1,92%	8,25%	29,14%	17,10%	4,99%	0,17%

SMLL (Benchmark)	-2,84%	5,06%	-7,25%	16,09%	-2,94%	-20,83%	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,47%	-6,15%	-9,95%	4,31%	-11,45%	-24,24%	9,39%	0,24%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-3,13%	4,37%	-5,87%	11,01%	-2,78%	-19,25%	8,93%	0,24%

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



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

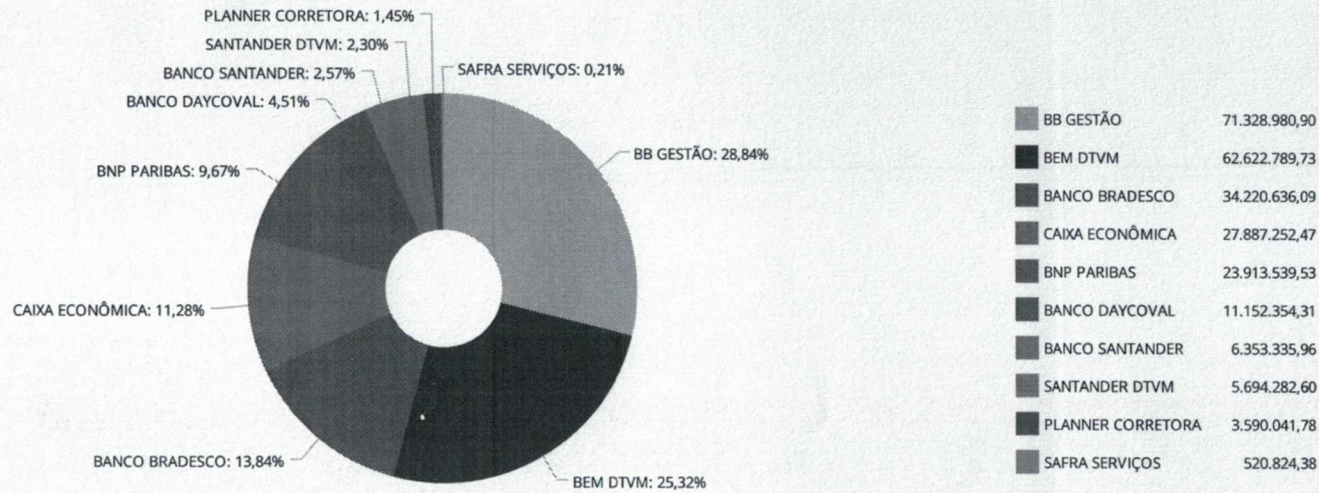

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021



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

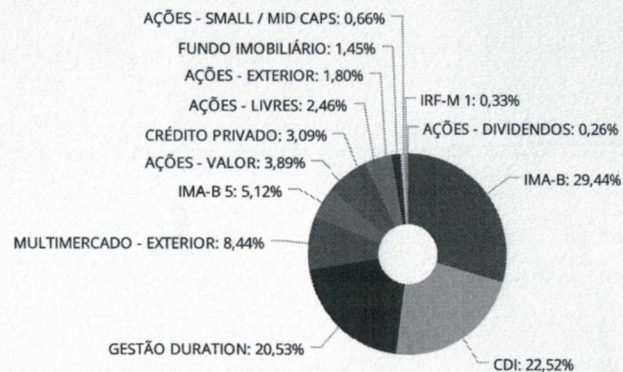
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,80%	10,06%	2,42%	4,91%	14,38%	-13,81%	5,14%	20,560%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,78%	5,21%	-0,07%	0,75%	11,10%	-12,63%	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-3,77%	22,95%	1,01%	6,67%	25,17%	-31,61%	7,97%	28,975%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-2,78%	2,04%	1,01%	1,13%	10,84%	-19,00%	3,43%	17,904%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,61%	4,13%	-0,05%	0,10%	9,93%	-14,78%	-	-
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-6,19%	-5,77%	-5,56%	-7,34%	-4,87%	-44,55%	6,50%	24,908%


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



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

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



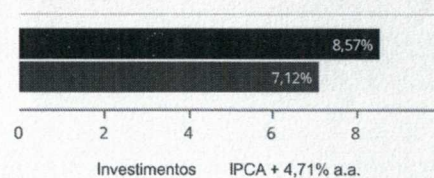
■ IMA-B	72.802.111,92	■ CDI	55.693.608,07	■ GESTÃO DURATION	50.771.000,62	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.870.110,78
■ IMA-B 5	12.669.480,46	■ AÇÕES - VALOR	9.612.120,43	■ CRÉDITO PRIVADO	7.650.905,12	■ AÇÕES - LIVRES	6.073.303,98
■ AÇÕES - EXTERIOR	4.454.637,26	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	3.590.041,78	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.623.657,40	■ IRF-M 1	817.951,61
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	655.108,32						

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

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	247.855.273,07	116.959,28	19.928.286,45	0,05%	8,81%	0,65%	6,45%	136,59%	2,11%
Setembro	247.855.273,07	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%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

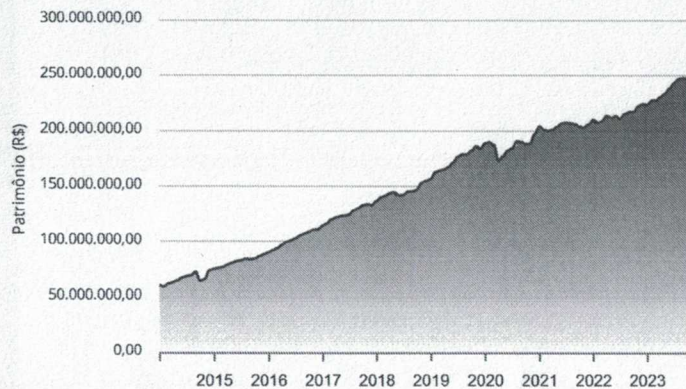


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.509/2021



ANO 36M

Evolução do Patrimônio



- 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 23.500/2021



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...	12.402.125,35	0,00	0,00	12.539.365,32	137.239,97	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.000.970,42	0,00	0,00	8.089.473,29	88.502,87	1,11%	1,11%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.009.799,86	0,00	0,00	6.075.807,40	66.007,54	1,10%	1,10%	0,33%
MAG FI RENDA FIXA	562.010,42	0,00	0,00	567.577,09	5.566,67	0,99%	0,99%	0,04%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.039.840,39	600.000,00	0,00	5.694.282,60	54.442,21	0,97%	1,02%	0,01%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CR...	8.959.583,65	0,00	1.394.566,79	7.650.905,12	85.888,26	0,96%	1,01%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	118.984,60	0,00	10.264,54	109.770,76	1.050,70	0,88%	0,96%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	890.231,12	0,00	80.000,00	817.951,61	7.720,49	0,87%	0,90%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	28.821.291,19	4.196.435,92	0,00	33.287.303,95	269.576,84	0,82%	0,88%	0,14%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.547.191,80	10.000.000,00	0,00	22.727.102,37	179.910,57	0,80%	1,05%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.221.501,86	150.000,00	0,00	17.441.049,25	69.547,39	0,40%	0,40%	0,60%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	665.662,78	0,00	500.000,00	168.326,73	2.663,95	0,40%	0,11%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.051.849,02	0,00	3.300.211,36	767.096,80	15.459,14	0,38%	0,11%	0,99%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	142.187,49	0,00	100.000,00	42.647,42	459,93	0,32%	0,19%	0,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	279.946,10	0,00	150.000,00	130.752,45	806,35	0,29%	0,11%	0,98%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	21.441.809,82	0,00	10.000.000,00	11.493.533,72	51.723,90	0,24%	0,10%	0,99%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	54.843.428,32	763.040,71	0,00	55.070.426,86	-536.042,17	-0,96%	-0,96%	2,49%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.906.014,15	0,00	0,00	17.731.685,06	-174.329,09	-0,97%	-0,97%	2,54%
Total Renda Fixa	199.904.428,34	15.709.476,63	15.535.042,69	200.405.057,80	326.195,52	0,16%		1,10%

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



Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	3.498.409,37	0,00	0,00	3.766.211,36	267.801,99	7,65%	7,65%	8,10%
MAG FI AÇÕES	1.300.558,23	0,00	1.339.596,45	0,00	39.038,22	3,00%	-	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.937.800,99	0,00	0,00	7.041.937,84	104.136,85	1,50%	1,50%	8,23%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	1.004.182,04	0,00	0,00	1.007.527,23	3.345,19	0,33%	0,33%	7,83%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.224.316,21	0,00	0,00	2.225.977,48	1.661,27	0,07%	0,07%	7,85%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	655.177,02	0,00	0,00	655.108,32	-68,70	-0,01%	-0,01%	6,76%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	922.788,62	0,00	0,00	899.970,60	-22.818,02	-2,47%	-2,47%	9,39%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	3.689.222,68	0,00	0,00	3.590.041,78	-99.180,90	-2,69%	-	-
MAG SELECTION FI AÇÕES	0,00	1.339.596,45	0,00	1.299.565,39	-40.031,06	-2,99%	0,27%	8,46%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	747.064,19	0,00	0,00	723.686,80	-23.377,39	-3,13%	-3,13%	8,93%
META VALOR FI AÇÕES	357.399,12	0,00	0,00	344.205,11	-13.194,01	-3,69%	-3,69%	10,33%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12.142.854,57	0,00	0,00	11.605.134,73	-537.719,84	-4,43%	-4,43%	4,99%
Total Renda Variável	33.479.773,04	1.339.596,45	1.339.596,45	33.159.366,64	-320.406,40	-0,92%		6,95%


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



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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	6.318.603,69	0,00	0,00	6.142.361,81	-176.241,88	-2,79%	-2,79%	3,43%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	535.802,44	0,00	0,00	520.824,38	-14.978,06	-2,80%	-2,80%	5,14%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	4.087.984,17	0,00	0,00	3.933.812,88	-154.171,29	-3,77%	-3,77%	7,97%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	3.328.681,39	0,00	0,00	3.122.614,24	-206.067,15	-6,19%	-6,19%	6,50%
Total Exterior	14.271.071,69	0,00	0,00	13.719.613,31	-551.458,38	-3,86%		5,50%


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



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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.728.582,70	29.871.782,14	6.000.000,00	33.287.303,95	686.939,11	1,78%	2,73%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.140.652,09	30.000.000,00	12.000.000,00	22.727.102,37	586.450,28	1,72%	3,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	11.995.220,48	518.019,84	349.881,53	12.539.365,32	376.006,53	3,00%	3,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.729.476,70	4.381.693,77	0,00	17.441.049,25	329.878,78	1,93%	1,94%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CR...	7.200.217,10	1.571.892,12	1.394.566,79	7.650.905,12	273.362,69	3,12%	3,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	29.233.124,84	12.000.000,00	30.000.000,00	11.493.533,72	260.408,88	0,63%	1,63%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.072.790,42	0,00	231.693,77	8.089.473,29	248.376,64	3,08%	0,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.059.093,97	0,00	168.138,31	6.075.807,40	184.851,74	3,05%	3,09%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	2.900.989,59	2.635.486,94	0,00	5.694.282,60	157.806,07	2,85%	3,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.361.380,61	582,85	8.694.587,67	767.096,80	99.721,01	1,07%	1,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.127.399,81	0,00	339.149,52	817.951,61	29.701,32	2,63%	3,11%
MAG FI RENDA FIXA	5.418.670,66	0,00	4.879.862,90	567.577,09	28.769,33	0,53%	3,30%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	3.299.773,91	0,00	3.157.903,99	168.326,73	26.456,81	0,80%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.274.257,11	0,00	4.150.000,00	130.752,45	6.495,34	0,15%	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	160.366,68	0,00	54.329,12	109.770,76	3.733,20	2,33%	3,17%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	140.750,49	0,00	100.000,00	42.647,42	1.896,93	1,35%	1,21%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.559.829,14	11.313.710,25	25.000.000,00	17.731.685,06	-141.854,33	-0,33%	-0,66%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	50.061.102,45	5.375.565,82	0,00	55.070.426,86	-366.241,41	-0,66%	-0,70%
Total Renda Fixa	196.463.678,75	97.668.733,73	96.520.113,60	200.405.057,80	2.792.758,92	1,41%	

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



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	3.375.335,36	0,00	0,00	3.766.211,36	390.876,00	11,58%	11,58%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.816.537,48	0,00	0,00	7.041.937,84	225.400,36	3,31%	3,31%
MAG FIC AÇÕES	1.330.781,02	0,00	1.339.596,45	0,00	8.815,43	0,66%	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIC AÇÕES	654.823,40	0,00	0,00	655.108,32	284,92	0,04%	0,04%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FIC AÇÕES	1.018.486,34	0,00	0,00	1.007.527,23	-10.959,11	-1,08%	-1,08%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	15.928,08	0,00	198,95	0,00	-15.729,13	-98,75%	-
META VALOR FIC AÇÕES	376.838,58	0,00	0,00	344.205,11	-32.633,47	-8,66%	-8,66%
MAG SELECTION FIC AÇÕES	0,00	1.339.596,45	0,00	1.299.565,39	-40.031,06	-2,99%	-1,35%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.266.187,63	0,00	0,00	2.225.977,48	-40.210,15	-1,77%	-1,77%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	768.849,87	0,00	0,00	723.686,80	-45.163,07	-5,87%	-5,87%
BRDESCO MID SMALL CAPS FIC AÇÕES	999.406,02	0,00	0,00	899.970,60	-99.435,42	-9,95%	-9,95%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	3.705.189,98	0,00	0,00	3.590.041,78	-115.148,20	-3,11%	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FIC MULTIMERCADO	11.832.096,07	0,00	0,00	11.605.134,73	-226.961,34	-1,92%	-1,92%
Total Renda Variável	33.160.459,83	1.339.596,45	1.339.795,40	33.159.366,64	-894,24	0,00%	


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



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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	6.080.924,23	0,00	0,00	6.142.361,81	61.437,58	1,01%	1,01%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	3.894.641,20	0,00	0,00	3.933.812,88	39.171,68	1,01%	1,01%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	508.497,28	0,00	0,00	520.824,38	12.327,10	2,42%	2,42%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	3.306.552,88	0,00	0,00	3.122.614,24	-183.938,64	-5,56%	-5,56%
Total Exterior	13.790.615,59	0,00	0,00	13.719.613,31	-71.002,28	-0,51%	


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



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 23.500/2021