

# 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			50.181.077,48	11,50%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	D+0	Não há	75.102.195,17	17,21%	176	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	20.316.651,05	4,66%	370	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	4.994.982,00	1,14%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA...	D+0	Não há	10.507.935,76	2,41%	36	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	36.934.667,49	8,46%	303	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	25.326.353,34	5,80%	404	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	77.057.530,76	17,66%	985	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	79.277.075,10	18,17%	385	1,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	10.107.581,41	2,32%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	D+0	Não se aplica	6.004.732,31	1,38%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	D+0	Não se aplica	4.003.184,75	0,92%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	479.336,26	0,11%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.880.253,80	0,89%	2.934	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.030.329,97	0,47%	1.294	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.052.500,10	0,47%	27.768	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.124.306,02	0,72%	2.298	1,53%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.856.983,48	0,43%	463	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.937.041,72	0,44%	139	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.925.994,52	0,44%	2.354	0,14%	Artigo 8º, Inciso I

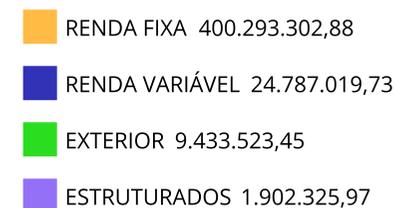
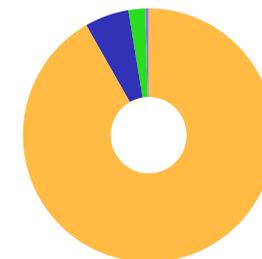
**Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	3.946.384,33	0,90%	36	0,90%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	2.020.981,05	0,46%	3.393	2,71%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	2.012.244,74	0,46%	32	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	4.877.963,36	1,12%	103	0,41%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	1.858.290,35	0,43%	4.394	0,31%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.697.269,74	0,62%	377	0,39%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.902.325,97	0,44%	24.858	0,26%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>436.416.172,03</b>				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	50.181.077,48	11,50%	1,00%	7,00%	15,00%	15.281.348,32
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	147.856.431,47	33,88%	20,00%	23,00%	70,00%	157.634.888,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	181.660.959,20	41,63%	10,00%	30,00%	50,00%	36.547.126,82
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	20.115.498,47	4,61%	0,00%	3,25%	10,00%	23.526.118,73
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	10,00%	479.336,26	0,11%	0,00%	0,25%	0,25%	611.704,17
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>400.293.302,88</b>	<b>91,72%</b>	<b>31,00%</b>	<b>63,50%</b>	<b>145,25%</b>	



**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

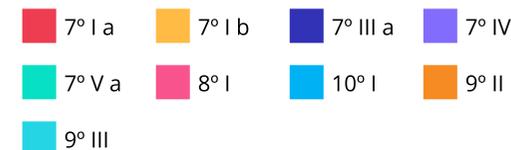
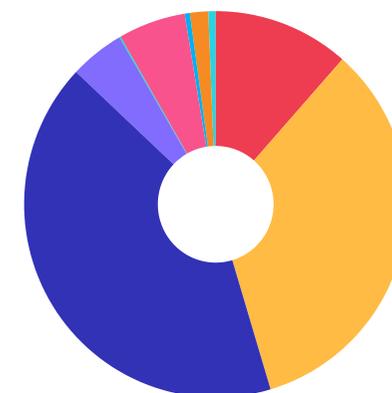




**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2023)**

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	24.787.019,73	5,68%	10,00%	20,00%	28,00%	97.409.508,44
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.902.325,97	0,44%	6,00%	9,50%	10,00%	41.739.291,23
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>40,00%</b>	<b>26.689.345,70</b>	<b>6,12%</b>	<b>16,00%</b>	<b>29,50%</b>	<b>38,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	6.736.253,71	1,54%	2,00%	3,00%	10,00%	36.905.363,49
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.697.269,74	0,62%	1,00%	4,00%	10,00%	40.944.347,46
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>9.433.523,45</b>	<b>2,16%</b>	<b>3,00%</b>	<b>7,00%</b>	<b>20,00%</b>	





Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	113.992.198,25	26,12	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	104.379.639,65	23,92	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	79.277.075,10	18,17	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	50.181.077,48	11,50	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	29.120.378,54	6,67	-
BANCO BTG PACTUAL	20.115.498,47	4,61	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	12.433.930,28	2,85	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	4.994.982,00	1,14	-
ITAÚ DTVM	3.946.384,33	0,90	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.880.253,80	0,89	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.124.306,02	0,72	-
BANCO J. SAFRA S/A	2.697.269,74	0,62	-
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.020.981,05	0,46	-
VINCI PARTNERS	2.012.244,74	0,46	-
WESTERN ASSET	1.902.325,97	0,44	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.858.290,35	0,43	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	479.336,26	0,11	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite	Limite
	Carteira \$	Carteira %	Inferior (%)	Superior (%)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,94%	0,43%	1,87%	5,73%	8,35%	0,33%	0,04%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	1,63%	0,01%	1,22%	4,46%	-45,35%	0,29%	0,05%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,46%	-9,25%	-1,37%	-8,75%	0,98%	-59,73%	0,07%	0,14%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA SIMPLES	0,98%	9,93%	3,23%	6,48%	13,43%	25,85%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03%	10,09%	3,44%	6,80%	13,67%	26,38%	0,01%	0,00%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,31%	3,54%	6,88%	13,98%	27,19%	0,03%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,97%	9,90%	3,21%	6,45%	13,41%	25,83%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,23%	3,54%	6,91%	13,89%	27,22%	0,03%	0,00%

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,82%	3,09%	4,58%	11,76%	-	0,33%	0,02%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	-	-	-	-	-	-	-	-

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

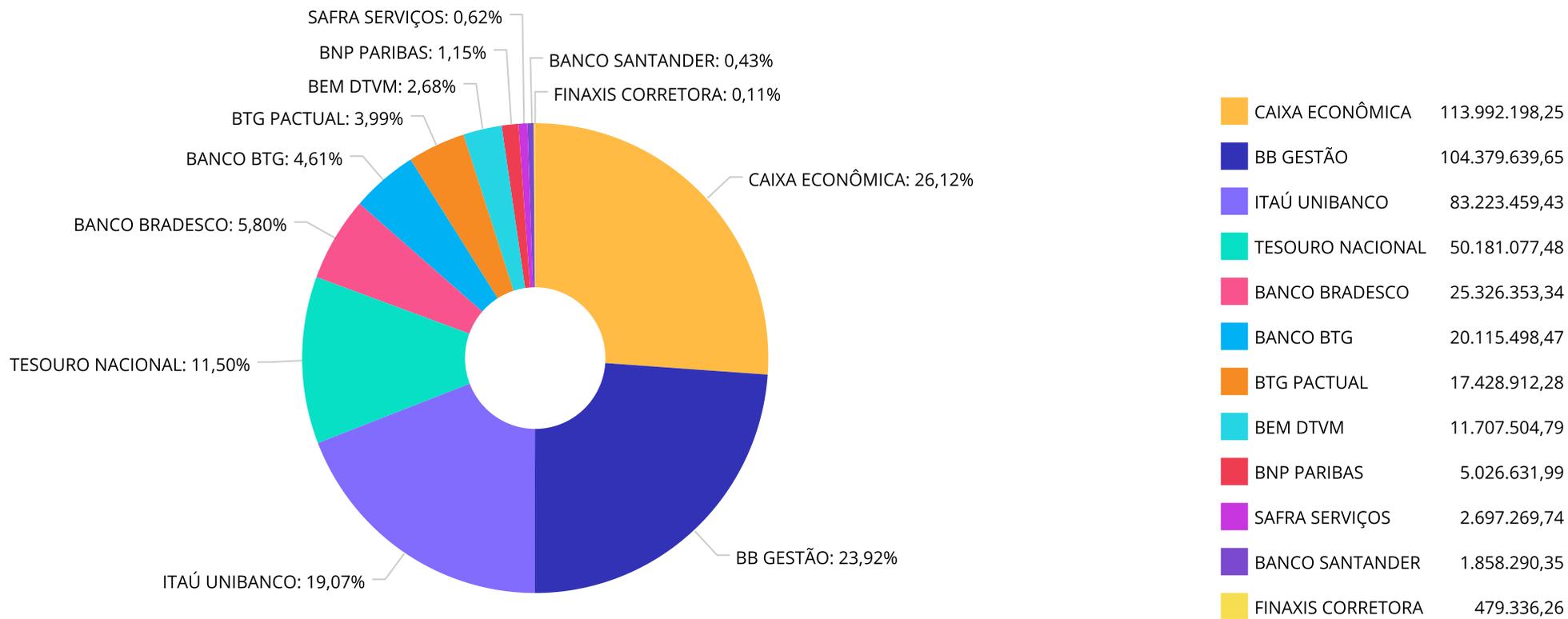
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,62%	2,66%	-3,74%	10,79%	-1,41%	-21,17%	8,11%	0,20%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,68%	4,17%	-2,52%	11,07%	-0,35%	-0,25%	7,23%	0,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,87%	3,35%	0,58%	10,91%	-3,14%	-16,56%	8,29%	0,21%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	0,90%	5,40%	-1,05%	14,24%	4,22%	1,06%	7,77%	0,20%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,07%	5,26%	-1,86%	13,49%	3,70%	0,31%	7,48%	0,19%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-0,96%	0,53%	-4,77%	8,93%	-0,40%	-1,54%	8,76%	0,20%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,48%	4,53%	-2,17%	13,09%	3,71%	-11,31%	7,44%	0,20%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-0,03%	10,30%	-0,93%	18,21%	3,58%	-0,04%	7,85%	0,22%
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	-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%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-2,84%	5,06%	-7,25%	16,09%	-2,94%	-20,83%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,47%	-6,15%	-9,95%	4,31%	-11,45%	-24,24%	9,39%	0,24%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,06%	5,86%	-3,41%	11,98%	2,07%	-11,33%	9,04%	0,19%



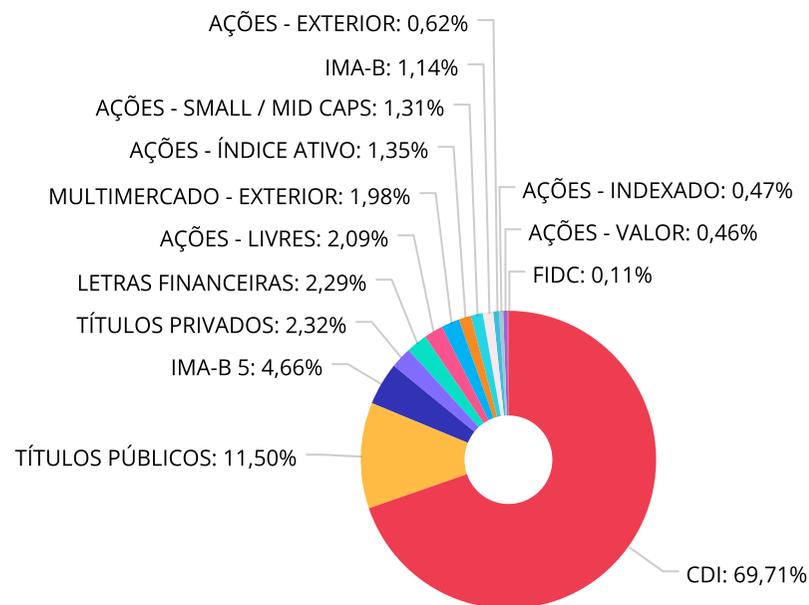
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-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%
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	-2,78%	5,21%	-0,07%	0,75%	11,10%	-12,63%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,85%	7,20%	2,79%	2,26%	16,13%	-4,66%	4,03%	21,077%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-2,79%	2,04%	1,01%	1,13%	10,84%	-19,00%	3,43%	17,904%

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



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



■ CDI	304.205.757,62	■ TÍTULOS PÚBLICOS	50.181.077,48	■ IMA-B 5	20.316.651,05	■ TÍTULOS PRIVADOS	10.107.581,41
■ LETRAS FINANCEIRAS	10.007.917,06	■ AÇÕES - LIVRES	9.115.045,38	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	8.638.579,68	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.883.426,05
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	5.737.237,28	■ IMA-B	4.994.982,00	■ AÇÕES - EXTERIOR	2.697.269,74	■ AÇÕES - INDEXADO	2.030.329,97
■ AÇÕES - VALOR	2.020.981,05	■ FIDC	479.336,26				



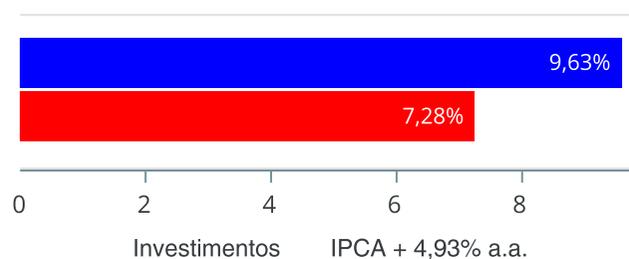
**Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2023)**

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	28/08/2023	7.088	4.232,219518	4.265,374144	29.997.971,94	30.232.971,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	26/09/2023	2.798	4.289,208164	4.291,459802	12.001.204,44	12.007.504,52	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	26/09/2023	1.846	4.332,972337	4.335,264803	7.998.666,93	8.002.898,82	Curva

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	442.489.269,76	80.207.800,23	71.481.073,23	461.039.580,19	9.823.583,43	9.823.583,43	2,18%	2,18%	0,95%	0,95%	228,39%	3,56%
Fevereiro	461.039.580,19	126.377.910,00	131.271.700,37	454.959.267,08	-1.186.522,74	8.637.060,69	-0,26%	1,91%	1,19%	2,15%	88,96%	2,30%
Março	454.959.267,08	23.290.659,62	28.735.277,12	452.472.867,08	2.958.217,50	11.595.278,19	0,65%	2,58%	1,15%	3,33%	77,38%	1,90%
Abril	452.472.867,08	23.491.509,52	28.468.206,39	451.454.306,49	3.958.136,28	15.553.414,47	0,87%	3,47%	0,96%	4,32%	80,45%	1,83%
Mai	451.454.306,49	107.420.294,47	118.068.793,83	446.828.593,72	6.022.786,59	21.576.201,06	1,33%	4,85%	0,65%	5,00%	97,12%	1,00%
Junho	446.828.593,72	79.517.474,01	82.544.489,71	451.478.882,89	7.677.304,87	29.253.505,93	1,72%	6,66%	0,32%	5,34%	124,74%	0,83%
Julho	451.478.882,89	20.149.376,20	36.742.804,61	440.674.135,31	5.788.680,83	35.042.186,76	1,28%	8,02%	0,52%	5,89%	136,32%	0,77%
Agosto	440.674.135,31	63.046.569,31	68.225.651,36	438.653.208,34	3.158.155,08	38.200.341,84	0,72%	8,80%	0,67%	6,60%	133,37%	1,17%
Setembro	438.653.208,34	50.270.404,36	55.855.184,94	436.416.172,03	3.347.744,27	41.548.086,11	0,76%	9,63%	0,64%	7,28%	132,20%	0,75%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



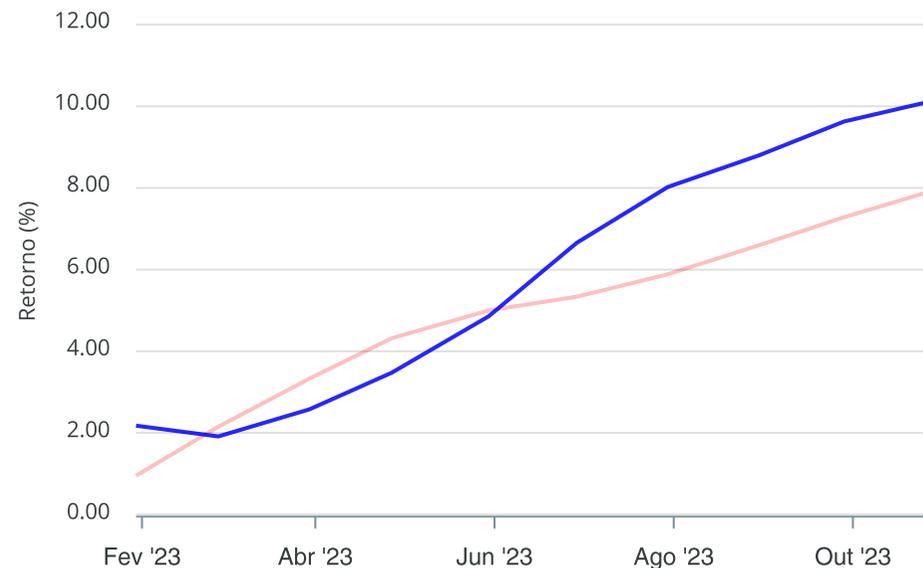
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Setembro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	20.095.931,06	0,00	0,00	20.316.651,05	220.719,99	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	36.533.489,76	0,00	0,00	36.934.667,49	401.177,73	1,10%	1,10%	0,33%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	78.451.975,16	0,00	0,00	79.277.075,10	825.099,94	1,05%	1,05%	0,03%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	33.628.189,28	0,00	8.650.432,43	25.326.353,34	348.596,49	1,04%	1,05%	0,03%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	10.405.941,93	0,00	0,00	10.507.935,76	101.993,83	0,98%	0,98%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	73.807.531,64	571.843,50	0,00	75.102.195,17	722.820,03	0,97%	0,97%	0,01%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.949.284,50	0,00	0,00	4.994.982,00	45.697,50	0,92%	0,92%	0,29%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	83.177.309,52	19.698.689,49	26.646.054,95	77.057.530,76	827.586,70	0,80%	1,03%	0,01%
LETRA FINANCEIRA BTG	10.041.585,98	0,00	0,00	10.107.581,41	65.995,43	0,66%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	30.028.054,79	19.999.871,37	0,00	50.181.077,48	153.151,32	0,31%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	0,00	4.000.000,00	0,00	4.003.184,75	3.184,75	0,08%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	0,00	6.000.000,00	0,00	6.004.732,31	4.732,31	0,08%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	20.549.383,51	0,00	20.558.697,56	0,00	9.314,05	0,05%	0,05%	1,37%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	481.546,14	0,00	0,00	479.336,26	-2.209,88	-0,46%	-0,46%	0,07%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>402.150.223,27</b>	<b>50.270.404,36</b>	<b>55.855.184,94</b>	<b>400.293.302,88</b>	<b>3.727.860,19</b>	<b>0,93%</b>		<b>0,08%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.012.176,14	0,00	0,00	2.030.329,97	18.153,83	0,90%	0,90%	7,77%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.034.816,88	0,00	0,00	2.052.500,10	17.683,22	0,87%	0,87%	8,29%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.914.058,95	0,00	0,00	1.925.994,52	11.935,57	0,62%	0,62%	8,11%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.011.317,76	0,00	0,00	2.020.981,05	9.663,29	0,48%	0,48%	7,44%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3.943.637,04	0,00	0,00	3.946.384,33	2.747,29	0,07%	0,07%	7,48%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.012.844,59	0,00	0,00	2.012.244,74	-599,85	-0,03%	-0,03%	7,85%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.145.648,74	0,00	0,00	3.124.306,02	-21.342,72	-0,68%	-0,68%	7,23%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.955.837,20	0,00	0,00	1.937.041,72	-18.795,48	-0,96%	-0,96%	8,76%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.921.649,35	0,00	0,00	3.880.253,80	-41.395,55	-1,06%	-1,06%	9,04%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.904.065,79	0,00	0,00	1.856.983,48	-47.082,31	-2,47%	-2,47%	9,39%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.990.469,58	0,00	0,00	1.902.325,97	-88.143,61	-4,43%	-4,43%	4,99%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>26.846.522,02</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>26.689.345,70</b>	<b>-157.176,32</b>	<b>-0,59%</b>		<b>7,88%</b>

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4.970.014,23	0,00	0,00	4.877.963,36	-92.050,87	-1,85%	-1,85%	4,03%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	1.911.609,99	0,00	0,00	1.858.290,35	-53.319,64	-2,79%	-2,79%	3,43%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.774.838,83	0,00	0,00	2.697.269,74	-77.569,09	-2,80%	-2,80%	5,14%
<b>Total Exterior</b>	<b>9.656.463,05</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>9.433.523,45</b>	<b>-222.939,60</b>	<b>-2,31%</b>		<b>4,23%</b>

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	76.564.342,76	0,00	0,00	79.277.075,10	2.712.732,34	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	72.554.355,26	55.906.684,33	54.007.242,02	77.057.530,76	2.603.733,19	2,03%	3,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	69.843.219,99	2.961.862,06	0,00	75.102.195,17	2.297.113,12	3,16%	3,21%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	55.182.913,07	4.452.000,03	35.755.909,32	25.326.353,34	1.447.349,56	2,43%	3,54%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	36.778.070,52	0,00	966.666,91	36.934.667,49	1.123.263,88	3,05%	0,43%
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	49.291.631,22	147.960,14	40.000.000,00	10.507.935,76	1.068.344,40	2,16%	3,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	20.260.763,67	0,00	562.231,03	20.316.651,05	618.118,41	3,05%	3,09%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	20.190.202,64	0,00	20.558.697,56	0,00	368.494,92	1,83%	1,83%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	49.997.843,31	0,00	50.181.077,48	183.234,17	0,37%	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.994.351,10	0,00	145.932,08	4.994.982,00	146.562,98	2,93%	0,01%
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	10.000.000,00	0,00	10.107.581,41	107.581,41	1,08%	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	0,00	6.000.000,00	0,00	6.004.732,31	4.732,31	0,08%	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	0,00	4.000.000,00	0,00	4.003.184,75	3.184,75	0,08%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	485.997,36	0,00	0,00	479.336,26	-6.661,10	-1,37%	-1,37%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>406.145.847,59</b>	<b>133.466.349,87</b>	<b>151.996.678,92</b>	<b>400.293.302,88</b>	<b>12.677.784,34</b>	<b>2,35%</b>	



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	4.242.317,87	0,00	4.376.961,99	0,00	134.644,12	3,17%	-1,76%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.850.675,21	0,00	850.000,00	2.052.500,10	51.824,89	1,82%	0,58%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.473.817,90	0,00	450.000,00	2.012.244,74	-11.573,16	-0,47%	-0,93%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.244.365,85	0,00	200.000,00	2.030.329,97	-14.035,88	-0,63%	-1,05%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.939.529,71	0,00	0,00	1.902.325,97	-37.203,74	-1,92%	-1,92%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.360.878,18	0,00	300.000,00	2.020.981,05	-39.897,13	-1,69%	-2,17%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.512.364,56	0,00	500.000,00	3.946.384,33	-65.980,23	-1,46%	-1,86%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.305.344,21	0,00	300.000,00	1.925.994,52	-79.349,69	-3,44%	-3,74%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.276.756,69	0,00	250.000,00	1.937.041,72	-89.714,97	-3,94%	-4,77%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.719.598,56	0,00	500.000,00	3.124.306,02	-95.292,54	-2,56%	-2,52%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.979.553,71	0,00	950.000,00	3.880.253,80	-149.299,91	-3,00%	-3,41%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.208.911,76	0,00	150.000,00	1.856.983,48	-201.928,28	-9,14%	-9,95%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>36.114.114,21</b>	<b>0,00</b>	<b>8.826.961,99</b>	<b>26.689.345,70</b>	<b>-597.806,52</b>	<b>-1,66%</b>	



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4.745.788,31	0,00	0,00	4.877.963,36	132.175,05	2,79%	2,79%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.633.429,56	0,00	0,00	2.697.269,74	63.840,18	2,42%	2,42%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	1.839.703,22	0,00	0,00	1.858.290,35	18.587,13	1,01%	1,01%
<b>Total Exterior</b>	<b>9.218.921,09</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>9.433.523,45</b>	<b>214.602,36</b>	<b>2,33%</b>	

### Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

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

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.



