

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

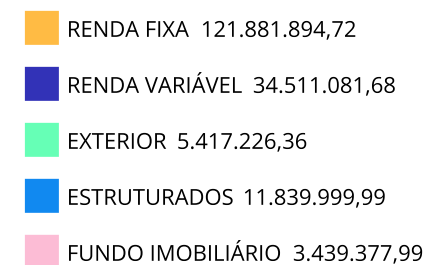
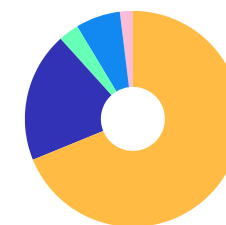
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	4.516.989,78	2,55%	685	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.092.194,05	2,88%	598	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	2.122.187,93	1,20%	192	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	2.098.405,82	1,18%	121	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	2.678.958,69	1,51%	34	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.739.344,73	4,37%	794	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.128.249,03	6,85%	873	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.514.165,61	9,33%	933	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.643.060,18	4,32%	782	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.201.587,20	3,50%	426	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.214.815,48	3,51%	78	1,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	5.495.315,95	3,10%	213	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	30.241.717,36	17,08%	385	0,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	6.173.237,56	3,49%	235	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	530.884,80	0,30%	607	4,73%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	6.490.780,55	3,67%	710	3,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.413.786,43	1,93%	478	1,42%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.151.118,21	0,65%	3.484	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	3.978.254,00	2,25%	106	5,74%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.566.009,11	1,45%	10.305	0,79%	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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	11.113.028,79	6,28%	2.619	0,87%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	Não há	1.471.591,91	0,83%	154	5,01%	Artigo 8º, Inciso I
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	1.626.568,36	0,92%	57	2,48%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	9.190.724,87	5,19%	1.902	2,92%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.857.318,24	2,18%	10.797	0,61%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	891.411,55	0,50%	16.805	0,20%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	668.496,57	0,38%	3.529	0,42%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	5.402.048,97	3,05%	178	1,64%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.929.862,30	1,09%	6.682	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.653.011,68	0,93%	627	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.855.077,04	1,61%	28	2,32%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.047.486,50	0,59%		0,73%	Artigo 11º
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	570.966,60	0,32%		0,19%	Artigo 11º
MACAM SHOPPING FII	Não se ...	Não se aplica	1.820.924,89	1,03%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			177.089.580,74				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			871.109,97				Artigo 6º
PL Total			177.960.690,71				

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

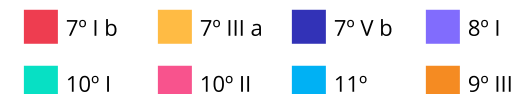
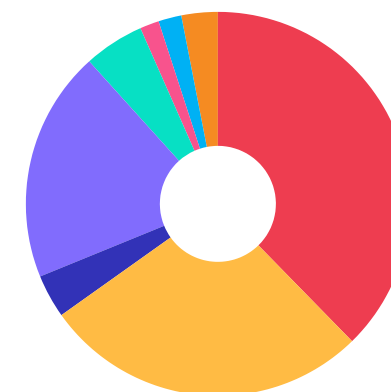
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	14,00%	81,95%	145.124.911,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	66.735.143,02	37,68%	19,09%	28,35%	81,95%	78.389.768,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	48.655.971,15	27,48%	20,86%	23,50%	60,00%	57.597.777,29
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	35.417.916,15
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	6.490.780,55	3,67%	0,00%	5,00%	5,00%	2.363.698,49
Total Renda Fixa	100,00%	121.881.894,72	68,82%	39,95%	70,85%	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%	34.511.081,68	19,49%	14,00%	19,60%	25,00%	9.761.313,51
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	8.984.922,95	5,07%	1,60%	2,70%	10,00%	8.724.035,12
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	2.855.077,04	1,61%	1,00%	2,35%	5,00%	5.999.402,00
Artigo 11º	5,00%	3.439.377,99	1,94%	1,00%	1,50%	5,00%	5.415.101,05
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	49.790.459,66	28,12%	17,60%	26,15%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.417.226,36	3,06%	2,00%	3,00%	10,00%	12.291.731,71
Total Exterior	10,00%	5.417.226,36	3,06%	2,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	54.835.227,74	30,96	-
ITAÚ UNIBANCO	30.910.213,93	17,45	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.546.565,45	14,99	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	19.536.380,67	11,03	-
SOMMA INVESTIMENTOS	15.681.505,42	8,86	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	11.113.028,79	6,28	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	3.978.254,00	2,25	-
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	3.413.786,43	1,93	-
KPTL	2.855.077,04	1,61	-
MACAM ASSET	1.820.924,89	1,03	-
MOS CAPITAL	1.626.568,36	0,92	-
MULTINVEST CAPITAL	1.471.591,91	0,83	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.151.118,21	0,65	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.047.486,50	0,59	-
ZION INVEST	570.966,60	0,32	-
VANQUISH ASSET MANAGEMENT	530.884,80	0,30	-

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	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	66.735.143,02	37,68	19,09	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	48.655.971,15	27,48	20,86	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	6.490.780,55	3,67	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	34.511.081,68	19,49	19,00	25,00
Artigo 9º, Inciso III	5.417.226,36	3,06	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	8.984.922,95	5,07	1,60	3,00
Artigo 10º, Inciso II	2.855.077,04	1,61	2,00	4,50
Artigo 11º	3.439.377,99	1,94	1,00	2,50

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%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,86%	8,24%	2,22%	4,51%	11,65%	26,83%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	2,72%	-0,55%	2,01%	5,39%	13,96%	0,06%	0,04%
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%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,26%	10,64%	-0,98%	6,42%	10,10%	16,54%	2,73%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	10,65%	-0,53%	6,49%	10,76%	18,68%	2,51%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,17%	11,62%	1,83%	7,45%	13,57%	22,67%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	11,25%	1,65%	7,18%	13,07%	21,93%	1,12%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	11,49%	1,77%	7,33%	13,46%	22,40%	1,12%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	0,20%	-88,32%	-7,61%	-88,97%	-87,79%	-85,36%	0,08%	0,88%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,26%	7,99%	4,19%	7,48%	11,80%	25,42%	0,09%	0,01%

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
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,23%	3,54%	6,91%	13,89%	27,22%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,42%	9,32%	2,07%	5,81%	12,22%	24,91%	0,59%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,39%	3,64%	0,75%	1,51%	5,33%	12,88%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,30%	11,35%	0,97%	6,94%	10,76%	22,65%	1,61%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	10,09%	0,81%	4,72%	11,34%	-	1,47%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,22%	10,88%	-0,79%	6,21%	11,04%	-	2,73%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%

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%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	9,25%	2,52%	5,77%	12,29%	24,46%	0,54%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,73%	-0,47%	-2,29%	11,85%	-2,06%	-7,98%	7,14%	0,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,00%	6,85%	-4,46%	12,85%	1,02%	4,21%	7,67%	0,18%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,19%	5,18%	-0,56%	13,91%	1,79%	-5,36%	8,34%	0,19%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,24%	16,74%	0,98%	21,94%	12,41%	7,63%	6,49%	0,18%
QLZ MOS FI AÇÕES	-3,47%	-	-4,46%	32,51%	-	-	9,75%	0,23%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,01%	10,64%	0,04%	13,98%	7,92%	11,25%	6,76%	0,17%
IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-6,84%	-37,23%	-14,08%	-21,33%	-55,64%	-44,69%	17,30%	0,34%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-6,84%	-37,23%	-14,08%	-21,33%	-55,64%	10,83%	17,30%	0,34%
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,61%	4,13%	-0,05%	0,10%	9,93%	-14,78%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,46%	17,90%	-1,89%	8,34%	29,34%	17,35%	5,00%	0,17%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,68%	-12,05%	-	-

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

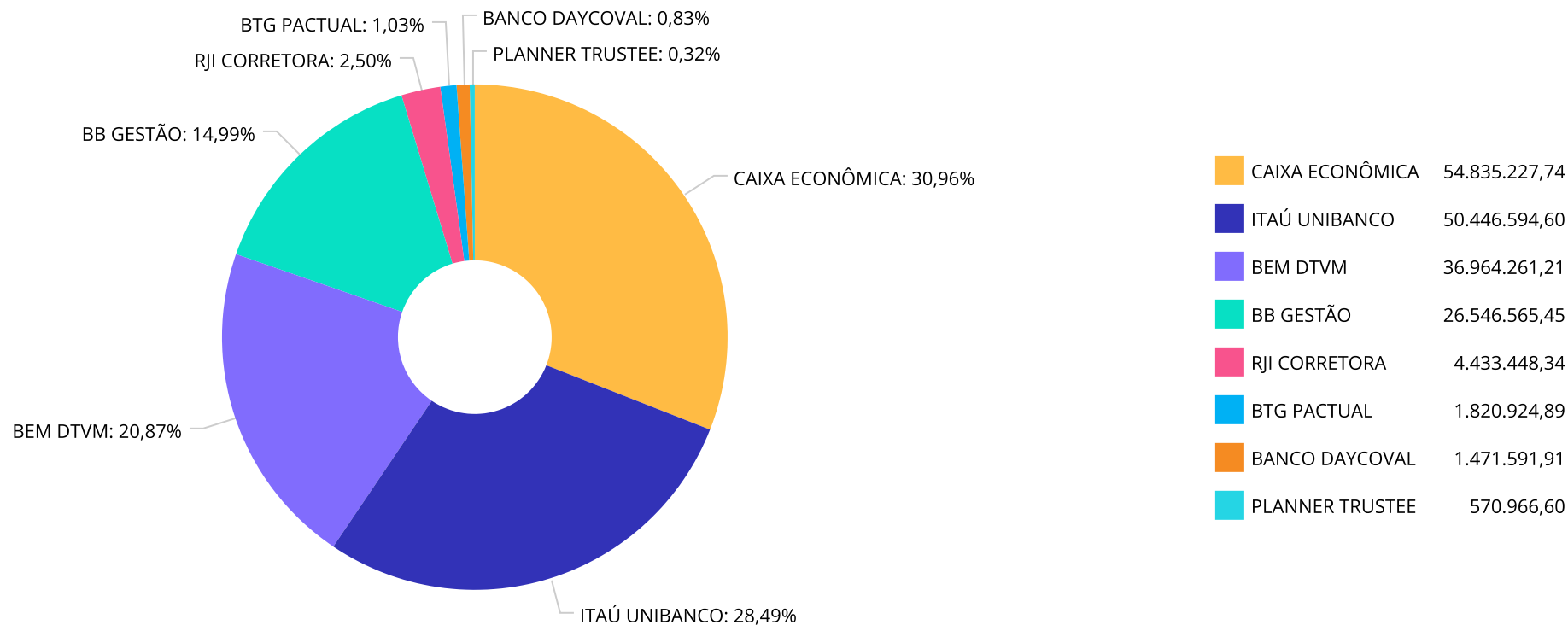
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	0,20%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-4,87%	11,68%	-3,65%	4,35%	19,59%	-0,45%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,44%	17,79%	-1,90%	8,26%	29,28%	17,25%	5,01%	0,17%
SMLL (Benchmark)	-2,84%	5,06%	-7,25%	16,09%	-2,94%	-20,83%	-	-
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,64%	3,43%	-6,61%	12,08%	-6,34%	-18,29%	8,74%	0,24%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-3,69%	6,32%	-7,35%	18,22%	-3,12%	-21,29%	10,12%	0,26%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,19%	11,65%	3,29%	6,71%	16,38%	37,82%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,14%	-1,31%	-0,45%	-0,87%	-	-10,20%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,01%	9,76%	2,70%	5,49%	13,75%	31,66%	-	-
MACAM SHOPPING FII	-	-	-	-	-	-	-	-



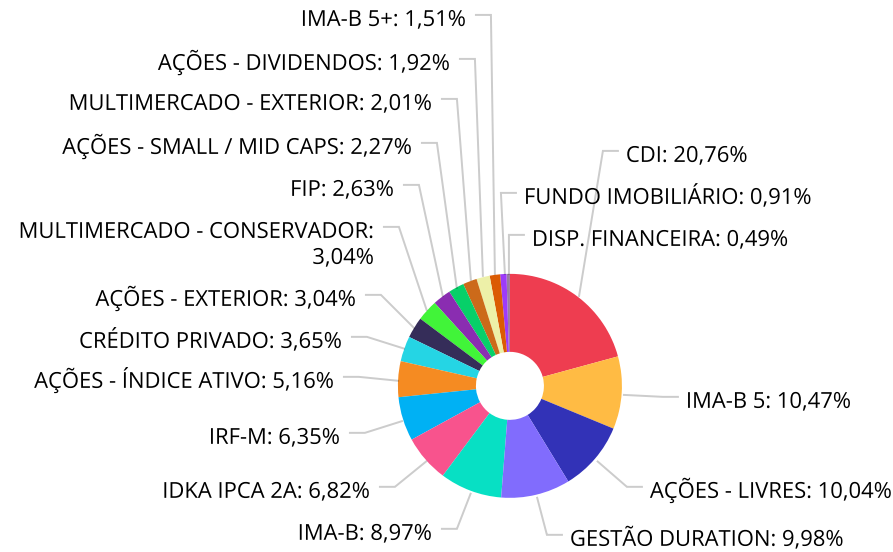
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,68%	-12,05%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	20,255%
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	-0,92%	3,54%	3,71%	5,99%	10,83%	-3,41%	4,96%	19,279%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,35%	29,82%	1,07%	16,55%	16,22%	-16,75%	6,92%	18,641%

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



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

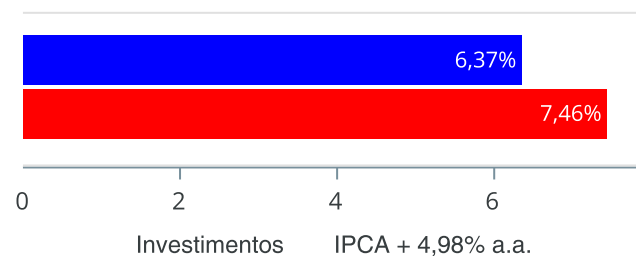


■ CDI	36.945.839,72	■ IMA-B 5	18.636.353,54	■ AÇÕES - LIVRES	17.868.969,36
■ GESTÃO DURATION	17.751.650,46	■ IMA-B	15.956.281,48	■ IDKA IPCA 2A	12.128.249,03
■ IRF-M	11.293.781,25	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	9.190.724,87	■ CRÉDITO PRIVADO	6.490.780,55
■ AÇÕES - EXTERIOR	5.417.226,36	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.402.048,97	■ FIP	4.676.001,93
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.037.601,02	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.582.873,98	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.413.786,43
■ IMA-B 5+	2.678.958,69	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.618.453,10	■ DISP. FINANCEIRA	871.109,97

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	163.444.886,17	12.606.458,22	11.034.186,59	168.444.557,99	3.427.400,19	3.427.400,19	2,08%	2,08%	0,96%	0,96%	216,93%	2,80%
Fevereiro	168.444.557,99	11.553.393,00	10.882.600,77	168.106.417,11	-1.008.933,11	2.418.467,08	-0,60%	1,47%	1,19%	2,16%	67,98%	2,60%
Março	168.106.417,11	2.321.975,87	758.254,23	170.806.544,04	1.136.405,29	3.554.872,37	0,67%	2,15%	1,16%	3,34%	64,26%	2,36%
Abril	170.806.544,04	1.214.844,06	766.434,57	173.074.494,61	1.819.541,08	5.374.413,45	1,06%	3,23%	0,96%	4,33%	74,59%	2,18%
Mai	173.074.494,61	1.817.837,95	1.467.213,38	172.930.545,85	-494.573,33	4.879.840,12	-0,29%	2,94%	0,66%	5,02%	58,55%	2,65%
Junho	172.930.545,85	5.662.425,54	5.784.453,32	177.258.107,92	4.449.589,85	9.329.429,97	2,57%	5,59%	0,33%	5,36%	104,23%	2,42%
Julho	177.258.107,92	15.176.553,81	15.636.196,14	178.862.142,14	2.063.676,55	11.393.106,52	1,16%	6,82%	0,53%	5,92%	115,24%	2,01%
Agosto	178.862.142,14	6.773.288,04	6.954.654,61	178.107.335,05	-573.440,52	10.819.666,00	-0,32%	6,47%	0,68%	6,63%	97,64%	2,25%
Setembro	178.107.335,05	4.895,99	846.443,47	177.089.580,74	-176.206,83	10.643.459,17	-0,10%	6,37%	0,78%	7,46%	85,32%	2,48%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



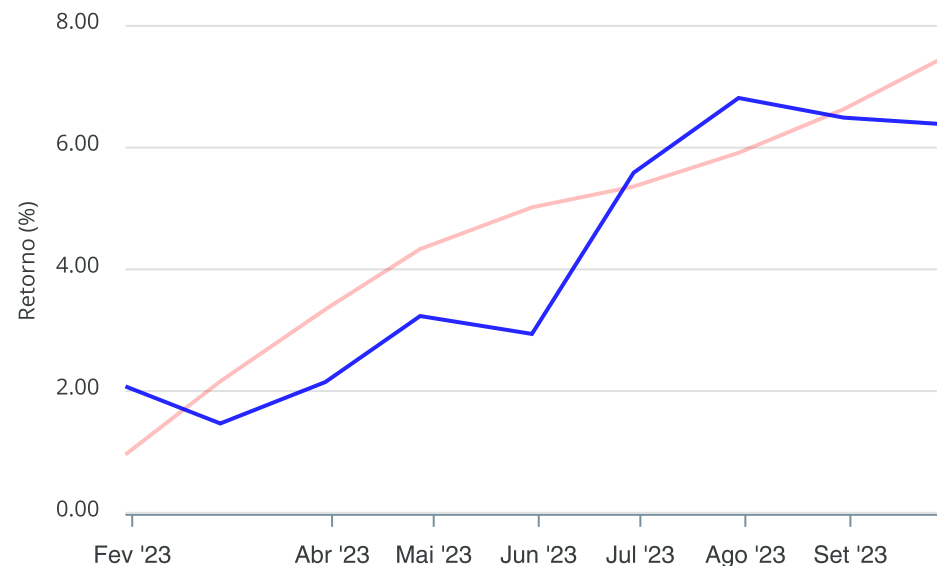
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

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

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
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	6.410.228,93	0,00	0,00	6.490.780,55	80.551,62	1,26%	1,26%	0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.767.887,38	4.895,99	846.443,47	30.241.717,36	315.377,46	1,02%	1,05%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.477.661,07	0,00	0,00	4.516.989,78	39.328,71	0,88%	0,88%	0,14%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.659.554,54	0,00	0,00	2.678.958,69	19.404,15	0,73%	0,73%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	6.147.540,04	0,00	0,00	6.173.237,56	25.697,52	0,42%	0,42%	0,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.708.216,64	0,00	0,00	7.739.344,73	31.128,09	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.085.242,10	0,00	0,00	12.128.249,03	43.006,93	0,36%	0,36%	0,74%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	529.805,15	0,00	0,00	530.884,80	1.079,65	0,20%	0,20%	0,08%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.192.544,27	0,00	0,00	6.201.587,20	9.042,93	0,15%	0,15%	1,12%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.085.092,78	0,00	0,00	5.092.194,05	7.101,27	0,14%	0,14%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.495.704,91	0,00	0,00	16.514.165,61	18.460,70	0,11%	0,11%	0,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.511.807,83	0,00	0,00	5.495.315,95	-16.491,88	-0,30%	-0,30%	1,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.130.794,23	0,00	0,00	2.122.187,93	-8.606,30	-0,40%	-0,40%	1,47%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.716.916,33	0,00	0,00	7.643.060,18	-73.856,15	-0,96%	-0,96%	2,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	2.124.309,29	0,00	0,00	2.098.405,82	-25.903,47	-1,22%	-1,22%	2,73%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.294.230,76	0,00	0,00	6.214.815,48	-79.415,28	-1,26%	-1,26%	2,73%
Total Renda Fixa	122.337.536,25	4.895,99	846.443,47	121.881.894,72	385.905,95	0,32%		0,84%



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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.137.631,46	0,00	0,00	1.151.118,21	13.486,75	1,19%	1,19%	8,34%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5.357.400,39	0,00	0,00	5.402.048,97	44.648,58	0,83%	0,83%	0,54%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	9.124.021,53	0,00	0,00	9.190.724,87	66.703,34	0,73%	0,73%	7,14%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	3.968.858,56	0,00	0,00	3.978.254,00	9.395,44	0,24%	0,24%	6,49%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.414.144,40	0,00	0,00	3.413.786,43	-357,97	-0,01%	-0,01%	6,76%
MACAM SHOPPING FII	1.822.242,98	0,00	0,00	1.820.924,89	-1.318,09	-0,07%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.048.902,40	0,00	0,00	1.047.486,50	-1.415,90	-0,13%	0,00%	0,00%
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	2.859.067,46	0,00	0,00	2.855.077,04	-3.990,42	-0,14%	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.225.610,85	0,00	0,00	11.113.028,79	-112.582,06	-1,00%	-1,00%	7,67%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	1.511.440,04	0,00	0,00	1.471.591,91	-39.848,13	-2,64%	-2,64%	8,74%
QLZ MOS FI AÇÕES	1.684.949,39	0,00	0,00	1.626.568,36	-58.381,03	-3,46%	-3,46%	9,75%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.664.310,61	0,00	0,00	2.566.009,11	-98.301,50	-3,69%	-3,69%	10,12%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.729.846,24	0,00	0,00	1.653.011,68	-76.834,56	-4,44%	-4,44%	5,01%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.019.922,72	0,00	0,00	1.929.862,30	-90.060,42	-4,46%	-4,46%	5,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	612.902,00	0,00	0,00	570.966,60	-41.935,40	-6,84%	-6,84%	17,30%
Total Renda Variável	50.181.251,03	0,00	0,00	49.790.459,66	-390.791,37	-0,78%		6,53%



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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	674.679,50	0,00	0,00	668.496,57	-6.182,93	-0,92%	-0,92%	4,96%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	922.320,64	0,00	0,00	891.411,55	-30.909,09	-3,35%	-3,35%	6,92%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.991.547,63	0,00	0,00	3.857.318,24	-134.229,39	-3,36%	-3,36%	5,58%
Total Exterior	5.588.547,77	0,00	0,00	5.417.226,36	-171.321,41	-3,07%		5,73%

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	30.603.445,42	3.448.256,30	4.883.687,72	30.241.717,36	1.073.703,36	3,15%	3,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.243.226,07	0,00	0,00	16.514.165,61	270.939,54	1,67%	1,67%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	6.230.067,61	0,00	0,00	6.490.780,55	260.712,94	4,18%	4,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.883.495,81	0,00	0,00	12.128.249,03	244.753,22	2,06%	2,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.518.850,76	0,00	9.000.000,00	7.739.344,73	220.493,97	1,33%	1,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	6.047.883,43	0,00	0,00	6.173.237,56	125.354,13	2,07%	2,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	9.399.005,03	0,00	5.000.000,00	4.516.989,78	117.984,75	1,26%	2,73%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.100.981,96	5.000.000,00	0,00	6.201.587,20	100.605,24	1,65%	1,77%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.092.194,05	92.194,05	1,84%	1,65%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.693.777,43	0,00	68.635,87	2.678.958,69	53.817,13	2,00%	-0,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.442.594,15	0,00	0,00	5.495.315,95	52.721,80	0,97%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.105.059,20	0,00	0,00	2.122.187,93	17.128,73	0,81%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	2.171.189,73	0,00	56.881,47	2.098.405,82	-15.902,44	-0,73%	-0,79%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.684.048,26	0,00	0,00	7.643.060,18	-40.988,08	-0,53%	-0,53%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	574.621,51	0,00	0,00	530.884,80	-43.736,71	-7,61%	-7,61%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.276.221,87	0,00	0,00	6.214.815,48	-61.406,39	-0,98%	-0,98%
Total Renda Fixa	124.974.468,24	13.448.256,30	19.009.205,06	121.881.894,72	2.468.375,24	1,78%	

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5.269.245,37	0,00	0,00	5.402.048,97	132.803,60	2,52%	2,52%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.712.266,58	0,00	1.734.972,02	0,00	22.705,44	1,33%	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.412.301,64	0,00	0,00	3.413.786,43	1.484,79	0,04%	0,04%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.052.114,61	0,00	0,00	1.047.486,50	-4.628,11	-0,44%	-
MACAM SHOPPING FII	1.826.415,52	0,00	0,00	1.820.924,89	-5.490,63	-0,30%	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.157.645,96	0,00	0,00	1.151.118,21	-6.527,75	-0,56%	-0,56%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.867.847,13	0,00	0,00	2.855.077,04	-12.770,09	-0,45%	-0,45%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,00	4.000.000,00	0,00	3.978.254,00	-21.746,00	-0,54%	0,98%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	2.724.050,00	0,00	2.693.117,14	0,00	-30.932,86	-1,14%	8,16%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.685.062,71	0,00	0,00	1.653.011,68	-32.051,03	-1,90%	-1,90%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.967.008,74	0,00	0,00	1.929.862,30	-37.146,44	-1,89%	-1,89%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	664.514,80	0,00	0,00	570.966,60	-93.548,20	-14,08%	-14,08%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	1.575.700,46	0,00	0,00	1.471.591,91	-104.108,55	-6,61%	-6,61%
QLZ MOS FI AÇÕES	0,00	1.734.972,02	0,00	1.626.568,36	-108.403,66	-6,25%	-4,46%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	2.771.509,52	0,00	2.566.009,11	-205.500,41	-7,41%	-7,34%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	9.406.192,05	0,00	0,00	9.190.724,87	-215.467,18	-2,29%	-2,29%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.631.830,43	0,00	0,00	11.113.028,79	-518.801,64	-4,46%	-4,46%
Total Renda Variável	46.952.196,00	8.506.481,54	4.428.089,16	49.790.459,66	-1.240.128,72	-2,43%	



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 AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.804.887,01	0,00	0,00	3.857.318,24	52.431,23	1,38%	1,38%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	644.586,07	0,00	0,00	668.496,57	23.910,50	3,71%	3,71%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	881.970,60	0,00	0,00	891.411,55	9.440,95	1,07%	1,07%
Total Exterior	5.331.443,68	0,00	0,00	5.417.226,36	85.782,68	1,61%	

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.

