

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			11.170.467,64	24,17%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	59.547,25	0,13%	638	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.010.938,78	2,19%	303	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	515.683,26	1,12%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	769.514,95	1,66%	291	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.373.440,42	2,97%	782	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	526.326,82	1,14%	156	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.209.114,26	6,94%	1.185	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.533.759,32	9,81%	247	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	530.064,78	1,15%	426	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	1.400.135,71	3,03%	57	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	443.968,14	0,96%	999	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	253.482,07	0,55%	1.116	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA...	D+1 du	Não há	546.082,21	1,18%	32	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	509.084,33	1,10%	78	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.710.608,14	8,03%	213	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	707.104,09	1,53%	385	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.212.846,92	6,95%	235	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.859.172,52	4,02%	101	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	D+4	Não há	279.562,39	0,60%	6.005	0,18%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

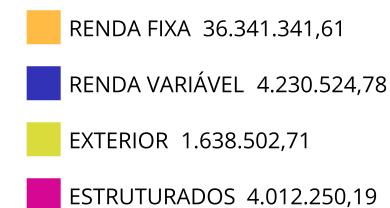
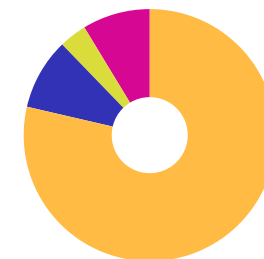
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	98.425,64	0,21%	1.399	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	446.412,73	0,97%	13.446	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	235.038,45	0,51%	2.755	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB EQUIDADE IS FIC AÇÕES	D+0	Não há	197.353,14	0,43%	1.877	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	228.929,65	0,50%	4.049	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	225.501,07	0,49%	27.768	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	583.937,11	1,26%	19.831	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	286.734,00	0,62%	201	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	602.815,08	1,30%	6.362	0,51%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	261.680,93	0,57%	17	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	784.134,59	1,70%	9.872	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	502.968,19	1,09%	21.471	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	513.290,49	1,11%	148	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	98.667,46	0,21%	16.805	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	523.576,57	1,13%	477	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	1.847.244,15	4,00%	2.309	0,37%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	367.305,83	0,79%	114	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.553.816,33	3,36%	2.895	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	243.883,88	0,53%	627	0,02%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			46.222.619,29				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.286,90				Artigo 6º
		PL Total	46.228.906,19				

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

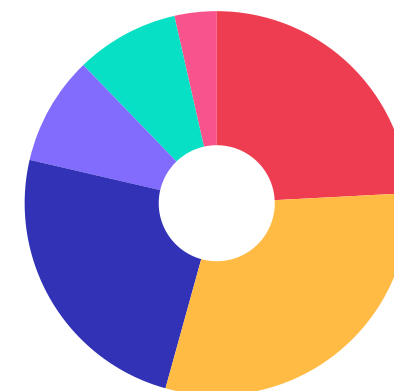
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	11.170.467,64	24,17%	0,00%	33,00%	100,00%	35.052.151,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	13.928.525,55	30,13%	0,00%	8,50%	100,00%	32.294.093,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	11.242.348,42	24,32%	0,00%	33,00%	60,00%	16.491.223,15
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.622.261,93
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	462.226,19
Total Renda Fixa	100,00%	36.341.341,61	78,62%	0,00%	77,50%	271,00%	



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%	4.230.524,78	9,15%	0,00%	9,00%	20,00%	5.013.999,08
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	4.622.261,93
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.012.250,19	8,68%	0,00%	10,00%	10,00%	610.011,74
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	8.242.774,97	17,83%	0,00%	19,50%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.638.502,71	3,54%	0,00%	3,00%	10,00%	2.983.759,22
Total Exterior	10,00%	1.638.502,71	3,54%	0,00%	3,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	14.276.468,36	30,89	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	11.170.467,64	24,17	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	8.383.527,36	18,14	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.693.705,82	12,32	-
ITAÚ UNIBANCO	4.043.442,82	8,75	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	2.393.326,36	5,18	-
ITAÚ DTVM	261.680,93	0,57	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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
IMA Geral (Benchmark)	0,18%	10,59%	1,80%	6,72%	12,50%	22,90%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	10,54%	1,67%	6,70%	12,49%	22,56%	1,03%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,15%	12,82%	1,26%	8,24%	14,06%	22,31%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,18%	12,55%	1,18%	8,11%	13,58%	21,42%	1,57%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,92%	12,08%	-2,46%	8,17%	10,15%	15,88%	-	-
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,93%	11,87%	-2,51%	8,04%	9,90%	15,32%	4,03%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,86%	11,75%	-2,38%	7,97%	9,75%	15,00%	3,94%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	9,92%	3,12%	6,37%	13,31%	24,16%	0,07%	0,00%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,56%	-0,64%	6,42%	10,75%	18,44%	2,52%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,17%	11,62%	1,83%	7,45%	13,57%	22,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	11,49%	1,77%	7,33%	13,46%	22,40%	1,12%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,76%	9,81%	2,91%	6,24%	13,10%	27,68%	0,24%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,42%	9,32%	2,07%	5,81%	12,22%	24,91%	0,59%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,23%	3,54%	6,91%	13,89%	27,22%	0,03%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	9,87%	3,22%	6,49%	13,40%	26,08%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,12%	2,96%	5,95%	12,33%	23,32%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
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 XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,82%	3,09%	4,58%	11,76%	-	0,33%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	-	3,12%	-	-	-	0,33%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	-0,03%	10,08%	2,19%	6,38%	-	-	1,19%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,86%	9,52%	2,78%	6,24%	12,70%	26,54%	0,12%	0,00%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,85%	7,39%	1,94%	6,31%	9,60%	23,26%	1,95%	0,04%
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,58%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,87%	3,35%	0,58%	10,91%	-3,14%	-16,56%	8,29%	0,21%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	2,26%	11,33%	3,10%	13,01%	15,88%	9,71%	6,73%	0,19%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-3,33%	28,98%	-6,35%	27,17%	5,30%	11,14%	12,60%	0,32%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26%	2,02%	-1,96%	10,30%	-0,01%	-4,02%	7,72%	0,20%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	1,70%	6,85%	4,91%	10,68%	14,10%	-10,35%	6,27%	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-0,74%	3,84%	-3,36%	12,23%	-0,73%	-12,46%	7,60%	0,20%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-4,08%	-5,73%	-12,21%	8,36%	-18,78%	-42,13%	8,98%	0,27%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,12%	11,80%	-1,69%	17,93%	10,85%	13,29%	8,45%	0,19%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,47%	4,43%	-0,70%	13,47%	1,94%	0,42%	7,60%	0,20%
IDIV (Benchmark)	1,32%	10,67%	1,25%	15,38%	14,16%	22,39%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,29%	14,58%	-4,52%	17,03%	11,80%	8,54%	6,89%	0,19%

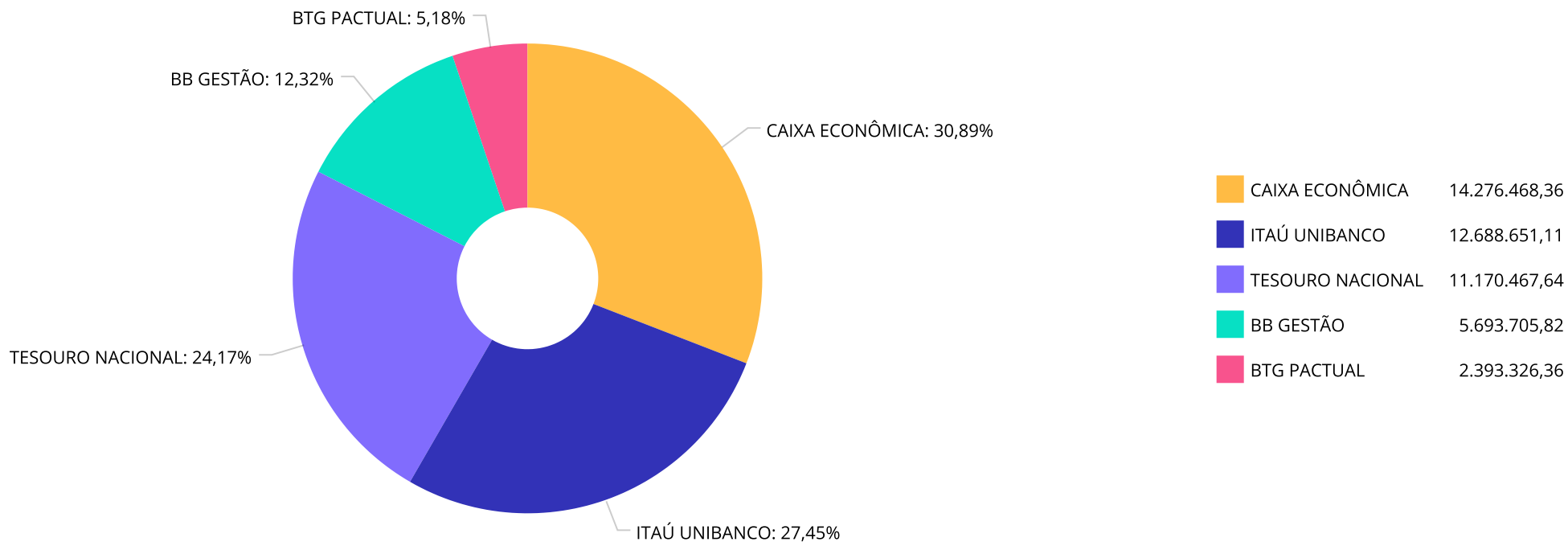
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-4,39%	18,26%	-1,76%	8,64%	30,05%	23,09%	5,04%	0,17%
SMLL (Benchmark)	-2,84%	5,06%	-7,25%	16,09%	-2,94%	-20,83%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-2,22%	3,78%	-6,67%	13,72%	-3,11%	-15,43%	9,13%	0,23%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB EQUIDADE IS FIC AÇÕES	-0,53%	3,24%	-3,30%	10,86%	-2,89%	-10,52%	7,82%	0,20%

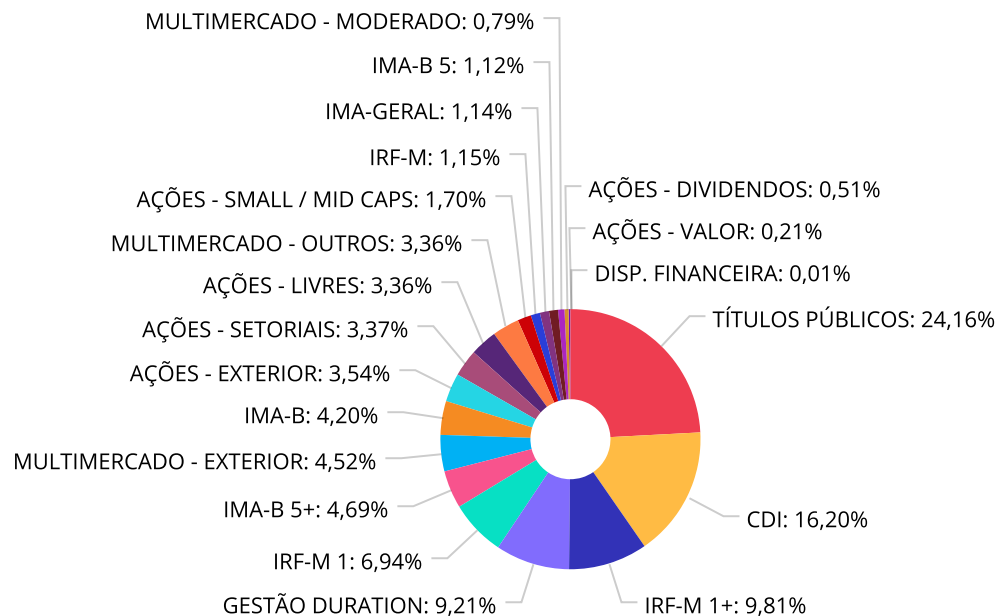
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,29%	9,45%	1,64%	5,78%	15,78%	-7,84%	5,58%	20,254%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,66%	10,28%	-2,13%	3,34%	20,49%	3,74%	5,71%	15,281%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,57%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	22,223%
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)



■ TÍTULOS PÚBLICOS	11.170.467,64	■ CDI	7.487.512,52	■ IRF-M 1+	4.533.759,32	■ GESTÃO DURATION	4.256.690,35
■ IRF-M 1	3.209.114,26	■ IMA-B 5+	2.169.650,66	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.091.128,03	■ IMA-B	1.942.072,00
■ AÇÕES - EXTERIOR	1.638.502,71	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.557.719,85	■ AÇÕES - LIVRES	1.555.206,25	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.553.816,33
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	784.134,59	■ IRF-M	530.064,78	■ IMA-GERAL	526.326,82	■ IMA-B 5	515.683,26
■ MULTIMERCADO - MODERADO	367.305,83	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	235.038,45	■ AÇÕES - VALOR	98.425,64	■ DISP. FINANCEIRA	6.286,90

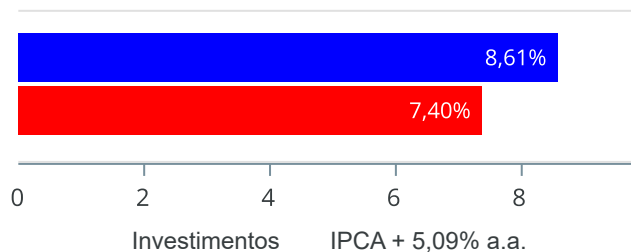
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/08/2023	800	4.218,270404	4.154,195011	3.374.616,32	3.323.356,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	08/08/2023	800	4.216,834106	4.269,408051	3.373.467,28	3.415.526,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	28/07/2023	100	4.449,591058	4.386,54891	444.959,11	438.654,89	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	27/07/2023	100	4.436,234812	4.498,619399	443.623,48	449.861,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/08/2023	390	4.575,033567	4.507,081069	1.784.263,09	1.757.761,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/08/2023	390	4.523,532118	4.577,70969	1.764.177,53	1.785.306,77	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

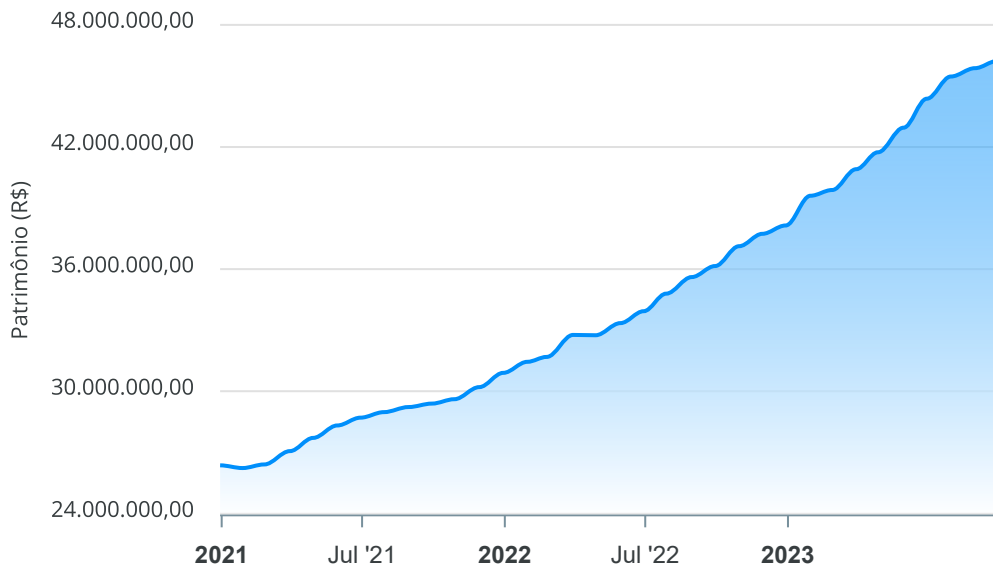
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	38.107.184,17	3.290.124,85	2.392.124,68	39.598.734,19	593.549,85	593.549,85	1,52%	1,52%	0,97%	0,97%	157,42%	1,67%
Fevereiro	39.598.734,19	5.816.115,61	5.528.971,95	39.881.960,90	-3.916,95	589.632,90	-0,01%	1,51%	1,20%	2,18%	69,46%	1,34%
Março	39.881.960,90	2.699.875,72	2.036.577,54	40.904.544,99	359.285,91	948.918,81	0,89%	2,41%	1,17%	3,37%	71,57%	1,39%
Abril	40.904.544,99	4.017.025,34	3.563.222,99	41.734.875,90	376.528,56	1.325.447,37	0,91%	3,34%	0,97%	4,37%	76,53%	1,35%
Mai	41.734.875,90	10.213.038,14	9.900.908,06	42.796.395,17	749.389,19	2.074.836,56	1,78%	5,19%	0,67%	5,06%	102,40%	1,34%
Junho	42.796.395,17	13.052.215,54	12.438.869,71	44.367.022,66	957.281,66	3.032.118,22	2,21%	7,51%	0,33%	5,41%	138,60%	1,92%
Julho	44.367.022,66	2.032.769,18	1.561.729,43	45.457.270,37	619.207,96	3.651.326,18	1,38%	8,99%	0,54%	5,98%	150,36%	1,75%
Agosto	45.457.270,37	11.054.454,63	10.590.738,13	45.866.995,18	-53.991,69	3.597.334,49	-0,12%	8,86%	0,69%	6,71%	132,16%	2,37%
Setembro	45.866.995,18	1.362.630,14	902.045,32	46.222.619,29	-104.960,71	3.492.373,78	-0,23%	8,61%	0,66%	7,40%	116,34%	2,52%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



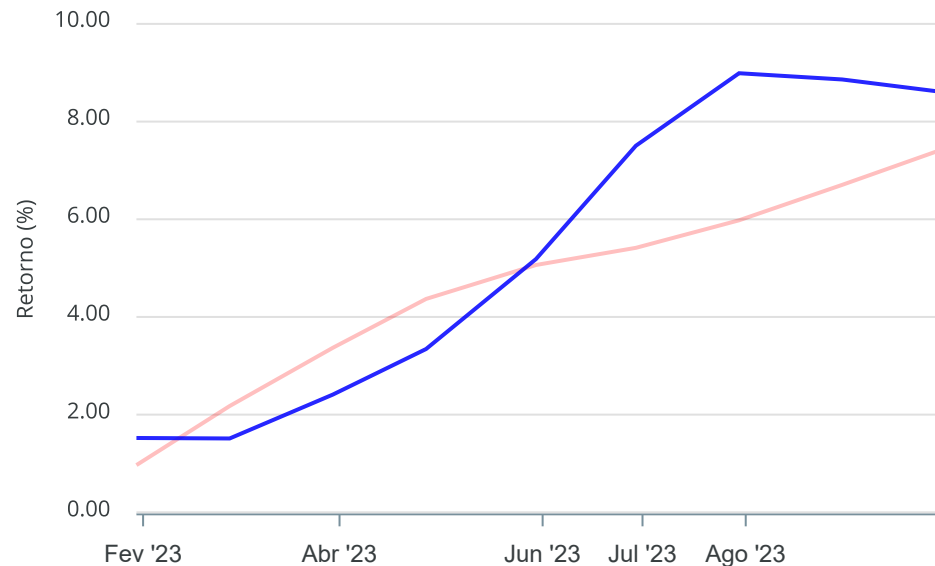
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	999.874,33	0,00	0,00	1.010.938,78	11.064,45	1,11%	1,11%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	510.080,88	0,00	0,00	515.683,26	5.602,38	1,10%	1,10%	0,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	251.046,97	0,00	0,00	253.482,07	2.435,10	0,97%	0,97%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	101.777,45	598.587,57	0,00	707.104,09	6.739,07	0,96%	1,05%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.180.199,35	0,00	0,00	3.209.114,26	28.914,91	0,91%	0,91%	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.845.121,55	0,00	0,00	1.859.172,52	14.050,97	0,76%	0,76%	0,24%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.093.199,51	0,00	0,00	11.170.467,64	77.268,13	0,70%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.199.472,71	0,00	0,00	3.212.846,92	13.374,21	0,42%	0,42%	0,59%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	641.477,69	701.206,28	902.045,32	443.968,14	3.329,49	0,25%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	525.549,66	0,00	0,00	526.326,82	777,16	0,15%	0,15%	1,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	529.291,86	0,00	0,00	530.064,78	772,92	0,15%	0,15%	1,12%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	483.375,64	62.836,29	0,00	546.082,21	-129,72	-0,02%	-0,03%	1,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.541.839,28	0,00	0,00	4.533.759,32	-8.079,96	-0,18%	-0,18%	1,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.721.743,96	0,00	0,00	3.710.608,14	-11.135,82	-0,30%	-0,30%	1,61%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.386.712,21	0,00	0,00	1.373.440,42	-13.271,79	-0,96%	-0,96%	2,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	60.129,85	0,00	0,00	59.547,25	-582,60	-0,97%	-0,97%	2,52%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	515.589,60	0,00	0,00	509.084,33	-6.505,27	-1,26%	-1,26%	2,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	784.101,45	0,00	0,00	769.514,95	-14.586,50	-1,86%	-1,86%	3,94%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.427.754,79	0,00	0,00	1.400.135,71	-27.619,08	-1,93%	-1,93%	4,03%
Total Renda Fixa	35.798.338,74	1.362.630,14	902.045,32	36.341.341,61	82.418,05	0,23%		1,26%

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 INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	223.879,52	0,00	0,00	228.929,65	5.050,13	2,26%	2,26%	6,73%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	274.886,67	0,00	0,00	279.562,39	4.675,72	1,70%	1,70%	6,27%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	223.558,28	0,00	0,00	225.501,07	1.942,79	0,87%	0,87%	8,29%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.540.631,79	0,00	0,00	1.553.816,33	13.184,54	0,86%	0,86%	0,12%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	364.208,33	0,00	0,00	367.305,83	3.097,50	0,85%	0,85%	1,95%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	581.203,15	0,00	0,00	583.937,11	2.733,96	0,47%	0,47%	7,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	98.171,30	0,00	0,00	98.425,64	254,34	0,26%	0,26%	7,72%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	287.081,61	0,00	0,00	286.734,00	-347,61	-0,12%	-0,12%	8,45%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	235.721,83	0,00	0,00	235.038,45	-683,38	-0,29%	-0,29%	6,89%
BB EQUIDADE IS FIC AÇÕES	198.408,50	0,00	0,00	197.353,14	-1.055,36	-0,53%	-0,53%	7,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	263.626,52	0,00	0,00	261.680,93	-1.945,59	-0,74%	-0,74%	7,60%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	801.945,82	0,00	0,00	784.134,59	-17.811,23	-2,22%	-2,22%	9,13%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	461.807,11	0,00	0,00	446.412,73	-15.394,38	-3,33%	-3,33%	12,60%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	628.455,12	0,00	0,00	602.815,08	-25.640,04	-4,08%	-4,08%	8,98%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1.931.992,73	0,00	0,00	1.847.244,15	-84.748,58	-4,39%	-4,39%	5,04%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	255.219,98	0,00	0,00	243.883,88	-11.336,10	-4,44%	-4,44%	5,01%
Total Renda Variável	8.370.798,26	0,00	0,00	8.242.774,97	-128.023,29	-1,53%		5,77%

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 AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	530.725,01	0,00	0,00	513.290,49	-17.434,52	-3,29%	-3,29%	5,58%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	102.088,68	0,00	0,00	98.667,46	-3.421,22	-3,35%	-3,35%	6,92%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	542.987,76	0,00	0,00	523.576,57	-19.411,19	-3,57%	-3,57%	4,97%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	522.056,73	0,00	0,00	502.968,19	-19.088,54	-3,66%	-3,66%	5,71%
Total Exterior	1.697.858,18	0,00	0,00	1.638.502,71	-59.355,47	-3,50%		5,51%

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
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	11.185.106,79	157.492,43	11.170.467,64	142.853,28	1,28%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.748.042,85	598.587,57	6.748.083,61	707.104,09	108.557,28	1,48%	3,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.111.927,02	0,00	0,00	3.209.114,26	97.187,24	3,12%	3,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.147.606,66	0,00	0,00	3.212.846,92	65.240,26	2,07%	2,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.275.837,90	0,00	4.081.919,32	253.482,07	59.563,49	1,39%	3,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.481.043,16	0,00	0,00	4.533.759,32	52.716,16	1,18%	1,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.806.560,49	0,00	0,00	1.859.172,52	52.612,03	2,91%	2,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.675.008,73	0,00	0,00	3.710.608,14	35.599,41	0,97%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.009.348,40	0,00	29.441,09	1.010.938,78	31.031,47	3,07%	3,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	514.264,70	0,00	14.270,71	515.683,26	15.689,27	3,05%	3,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	76.174,17	2.377.650,72	2.023.305,72	443.968,14	13.448,97	0,55%	2,96%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	520.849,33	0,00	0,00	530.064,78	9.215,45	1,77%	1,77%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	517.701,40	0,00	0,00	526.326,82	8.625,42	1,67%	1,67%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	349.194,39	188.508,87	0,00	546.082,21	8.378,95	1,56%	2,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	59.932,61	0,00	0,00	59.547,25	-385,36	-0,64%	-0,64%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	514.114,41	0,00	0,00	509.084,33	-5.030,08	-0,98%	-0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.380.805,89	0,00	0,00	1.373.440,42	-7.365,47	-0,53%	-0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	788.300,42	0,00	0,00	769.514,95	-18.785,47	-2,38%	-2,38%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.436.179,68	0,00	0,00	1.400.135,71	-36.043,97	-2,51%	-2,51%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	34.412.892,21	14.349.853,95	13.054.512,88	36.341.341,61	633.108,33	1,77%	

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
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.511.853,81	0,00	0,00	1.553.816,33	41.962,52	2,78%	2,78%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	266.479,06	0,00	0,00	279.562,39	13.083,33	4,91%	4,91%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	360.326,37	0,00	0,00	367.305,83	6.979,46	1,94%	1,94%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	222.041,19	0,00	0,00	228.929,65	6.888,46	3,10%	3,10%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	224.196,55	0,00	0,00	225.501,07	1.304,52	0,58%	0,58%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	100.392,24	0,00	0,00	98.425,64	-1.966,60	-1,96%	-1,96%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	588.060,68	0,00	0,00	583.937,11	-4.123,57	-0,70%	-0,70%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	248.612,65	0,00	0,00	243.883,88	-4.728,77	-1,90%	-1,90%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	291.658,55	0,00	0,00	286.734,00	-4.924,55	-1,69%	-1,69%
BB EQUIDADE IS FIC AÇÕES	204.080,69	0,00	0,00	197.353,14	-6.727,55	-3,30%	-3,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	270.777,07	0,00	0,00	261.680,93	-9.096,14	-3,36%	-3,36%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	246.168,19	0,00	0,00	235.038,45	-11.129,74	-4,52%	-4,52%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	476.673,67	0,00	0,00	446.412,73	-30.260,94	-6,35%	-6,35%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1.880.319,94	0,00	0,00	1.847.244,15	-33.075,79	-1,76%	-1,76%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	840.138,16	0,00	0,00	784.134,59	-56.003,57	-6,67%	-6,67%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	686.671,65	0,00	0,00	602.815,08	-83.856,57	-12,21%	-12,21%
Total Renda Variável	8.418.450,47	0,00	0,00	8.242.774,97	-175.675,50	-2,09%	

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 INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	505.015,39	0,00	0,00	513.290,49	8.275,10	1,64%	1,64%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	516.732,96	0,00	0,00	523.576,57	6.843,61	1,32%	1,32%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	100.000,00	0,00	98.667,46	-1.332,54	-1,33%	1,07%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	513.931,63	0,00	0,00	502.968,19	-10.963,44	-2,13%	-2,13%
Total Exterior	1.535.679,98	100.000,00	0,00	1.638.502,71	2.822,73	0,17%	

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 MOSAICO CONSULTORIA. 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.

