

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			13.294.441,24	28,54%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	59.145,96	0,13%	640	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.015.427,15	2,18%	308	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	517.931,66	1,11%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	258.317,99	0,55%	285	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.364.314,40	2,93%	769	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	527.818,70	1,13%	155	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.239.264,76	6,95%	1.186	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.527.606,45	5,43%	244	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	531.901,99	1,14%	433	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	1.386.256,93	2,98%	58	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	504.394,81	1,08%	77	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.199.605,39	4,72%	214	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	713.290,59	1,53%	57.197	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	467.048,37	1,00%	1.000	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	255.987,06	0,55%	1.125	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.260.082,42	2,71%	418	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA...	D+1 du	Não há	611.250,43	1,31%	31	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.976.673,94	4,24%	386	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.235.396,05	6,95%	231	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

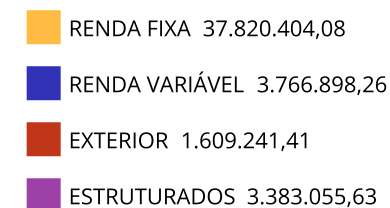
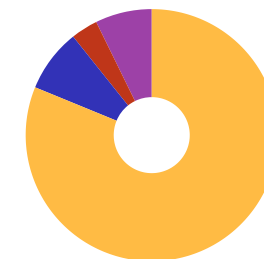
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.874.247,79	4,02%	99	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	D+4	Não há	270.345,57	0,58%	5.894	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	94.691,71	0,20%	1.361	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	419.104,46	0,90%	12.755	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	220.272,58	0,47%	2.633	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB EQUIDADE IS FIC AÇÕES	D+0	Não há	186.411,82	0,40%	1.800	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	217.983,28	0,47%	27.006	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	566.986,99	1,22%	19.220	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	270.290,75	0,58%	205	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	548.907,28	1,18%	6.280	0,53%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	248.057,16	0,53%	17	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	723.846,66	1,55%	9.470	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	490.956,36	1,05%	20.933	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	505.196,71	1,08%	144	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	96.837,40	0,21%	16.413	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	516.250,94	1,11%	473	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	1.815.990,94	3,90%	2.294	0,37%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.567.064,69	3,36%	2.785	0,11%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			46.579.599,38				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.143,84				Artigo 6º
		PL Total	46.585.743,22				

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

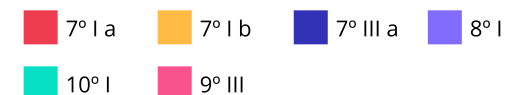
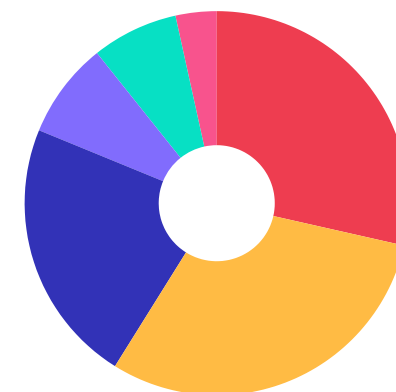
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	13.294.441,24	28,54%	0,00%	33,00%	100,00%	33.285.158,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	14.131.986,19	30,34%	0,00%	8,50%	100,00%	32.447.613,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	10.393.976,65	22,31%	0,00%	33,00%	60,00%	17.553.782,98
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.657.959,94
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	465.795,99
Total Renda Fixa	100,00%	37.820.404,08	81,20%	0,00%	77,50%	271,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.766.898,26	8,09%	0,00%	9,00%	20,00%	5.549.021,62
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	4.657.959,94
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.383.055,63	7,26%	0,00%	10,00%	10,00%	1.274.904,31
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	7.149.953,89	15,35%	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%	1.609.241,41	3,45%	0,00%	3,00%	10,00%	3.048.718,53
Total Exterior	10,00%	1.609.241,41	3,45%	0,00%	3,00%	10,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	13.294.441,24	28,54	-
CAIXA DTVM	11.351.737,95	24,37	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	10.514.164,64	22,57	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.097.617,67	13,09	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	2.427.241,37	5,21	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.386.256,93	2,98	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.260.082,42	2,71	0,00
ITAÚ DTVM	248.057,16	0,53	0,00

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral (Benchmark)	0,30%	10,92%	1,11%	5,71%	11,71%	24,89%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,28%	10,85%	1,02%	5,65%	11,62%	24,70%	1,40%	2,47%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,12%	12,95%	0,56%	7,03%	13,15%	26,82%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	12,66%	0,46%	6,89%	12,72%	25,93%	2,54%	4,94%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,98%	10,98%	-4,11%	3,97%	8,37%	19,37%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	10,67%	-4,03%	3,84%	8,00%	18,61%	4,57%	7,96%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,99%	10,76%	-4,15%	3,85%	8,13%	18,79%	4,60%	8,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,96%	11,12%	3,06%	6,61%	13,48%	26,55%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	10,95%	2,99%	6,48%	13,26%	26,00%	0,12%	0,37%
IMA-B (Benchmark)	-0,66%	10,06%	-1,97%	3,75%	8,97%	21,40%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,92%	9,62%	-2,64%	3,42%	7,74%	19,61%	3,21%	5,63%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,66%	9,92%	-1,98%	3,69%	8,75%	20,99%	3,00%	5,22%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	9,82%	-2,03%	3,63%	8,70%	20,76%	3,00%	5,18%
IRF-M (Benchmark)	0,37%	12,04%	1,31%	6,68%	12,95%	26,45%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,35%	11,88%	1,23%	6,56%	12,79%	26,15%	1,78%	3,33%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	10,10%	2,88%	6,02%	12,28%	23,94%	0,01%	0,03%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,39%	11,86%	5,70%	8,07%	14,03%	-	1,88%	2,04%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	11,47%	3,41%	7,05%	13,96%	27,79%	0,02%	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,81%	10,70%	2,65%	6,36%	12,85%	26,77%	0,17%	0,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,70%	10,09%	1,79%	5,68%	11,89%	24,74%	0,40%	0,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,06%	11,40%	3,45%	7,09%	13,86%	27,84%	0,04%	0,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	10,95%	3,15%	6,60%	13,35%	26,71%	0,01%	0,08%
IPCA (Benchmark)	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,21%	11,12%	-0,14%	5,42%	9,56%	22,83%	2,29%	4,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	9,29%	2,46%	4,50%	10,17%	-	0,48%	1,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	-	2,48%	-	-	-	0,48%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,43%	10,55%	1,56%	5,62%	-	-	0,80%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB EQUIDADE IS FIC AÇÕES	-5,54%	-2,48%	-11,39%	0,95%	-12,50%	-11,51%	8,40%	19,00%
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,85%	10,45%	2,63%	6,34%	12,57%	26,96%	0,14%	0,45%
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	20,68%
Ibovespa (Benchmark)	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-3,33%	-0,10%	-6,99%	6,49%	-11,81%	-11,85%	7,60%	19,79%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-6,12%	21,09%	-16,30%	12,06%	-3,07%	18,92%	17,22%	31,70%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,79%	-1,85%	-9,15%	4,80%	-7,15%	-2,25%	7,84%	18,49%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	-3,30%	3,33%	-4,30%	8,56%	2,97%	-7,94%	6,13%	17,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-5,21%	-1,57%	-11,24%	4,08%	-12,29%	-6,68%	9,57%	19,02%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-8,94%	-14,16%	-21,69%	-2,10%	-30,31%	-41,57%	13,28%	26,40%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,74%	5,39%	-9,05%	8,04%	-1,21%	13,64%	9,24%	18,75%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90%	1,40%	-6,64%	8,29%	-5,16%	2,67%	6,99%	18,59%
IDIV (Benchmark)	-3,15%	7,18%	-4,65%	7,57%	6,28%	23,78%	-	-

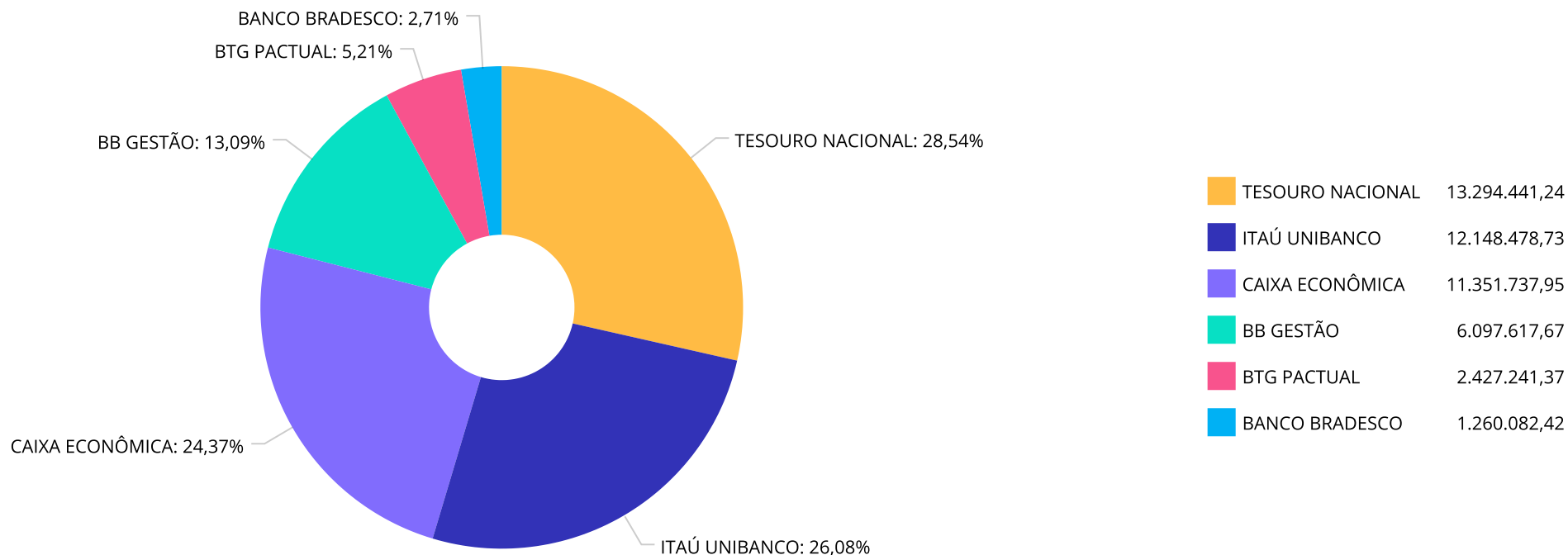
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-6,28%	7,38%	-11,39%	5,29%	-0,93%	10,47%	8,83%	17,92%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-2,20%	9,23%	-8,61%	0,58%	8,31%	-8,94%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-1,69%	16,26%	-6,85%	4,68%	17,46%	12,36%	7,20%	15,71%
SMLL (Benchmark)	-7,40%	-2,72%	-16,71%	5,49%	-16,24%	-16,19%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-7,69%	-4,20%	-16,15%	2,34%	-15,43%	-12,28%	11,33%	22,67%

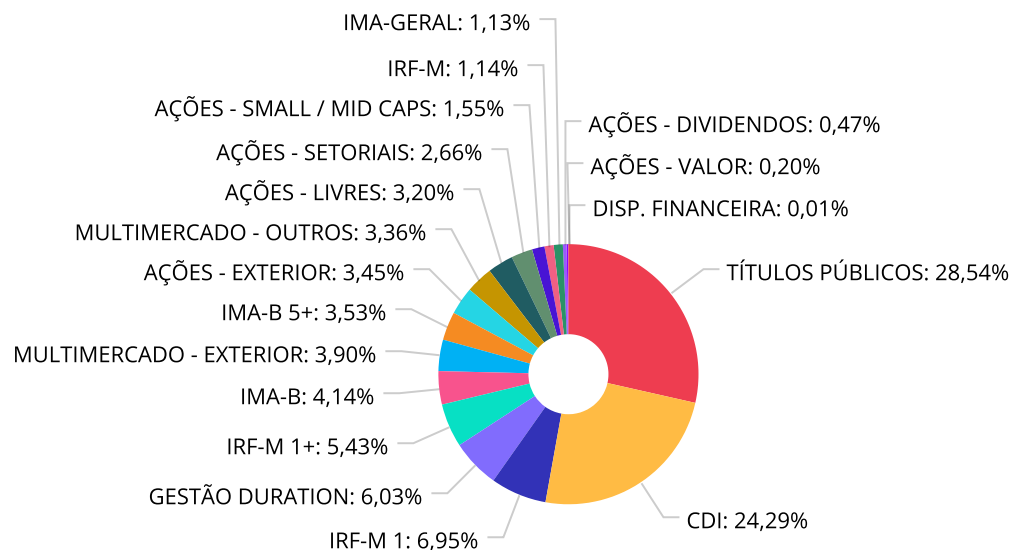
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,85%	27,41%	-3,16%	16,51%	10,47%	-13,23%	8,85%	18,061%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,58%	7,72%	-2,12%	4,68%	9,14%	-18,02%	7,88%	19,090%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,39%	7,65%	-7,21%	-0,74%	10,70%	-4,39%	6,17%	13,996%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	20,681%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	13.294.441,24	■ CDI	11.316.085,03	■ IRF-M 1	3.239.264,76	■ GESTÃO DURATION	2.810.855,82
■ IRF-M 1+	2.527.606,45	■ IMA-B	1.927.855,17	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.815.990,94	■ IMA-B 5+	1.644.574,92
■ AÇÕES - EXTERIOR	1.609.241,41	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.567.064,69	■ AÇÕES - LIVRES	1.489.730,00	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.238.357,31
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	723.846,66	■ IRF-M	531.901,99	■ IMA-GERAL	527.818,70	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	220.272,58
■ AÇÕES - VALOR	94.691,71	■ DISP. FINANCEIRA	6.143,84				

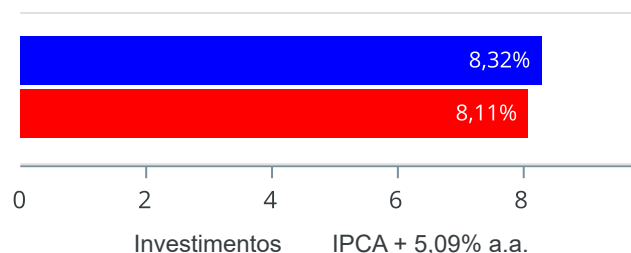
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2023)

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	4.186,793656	3.374.616,32	3.349.434,92	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	03/10/2023	120	4.169,170000	4.197,35369	500.300,40	503.682,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	08/08/2023	800	4.159,770000	4.299,808044	3.327.816,00	3.439.846,43	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	03/10/2023	120	4.161,160000	4.284,123838	499.339,20	514.094,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	03/10/2023	120	4.236,300000	4.265,405856	508.356,00	511.848,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	28/07/2023	100	4.294,800000	4.419,089465	429.480,00	441.908,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	03/10/2023	120	4.266,530000	4.297,069334	511.983,60	515.648,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	27/07/2023	100	4.387,000000	4.534,239963	438.700,00	453.423,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/08/2023	390	4.457,720000	4.544,347008	1.738.510,80	1.772.295,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/08/2023	390	4.465,490000	4.617,124384	1.741.541,10	1.800.678,50	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

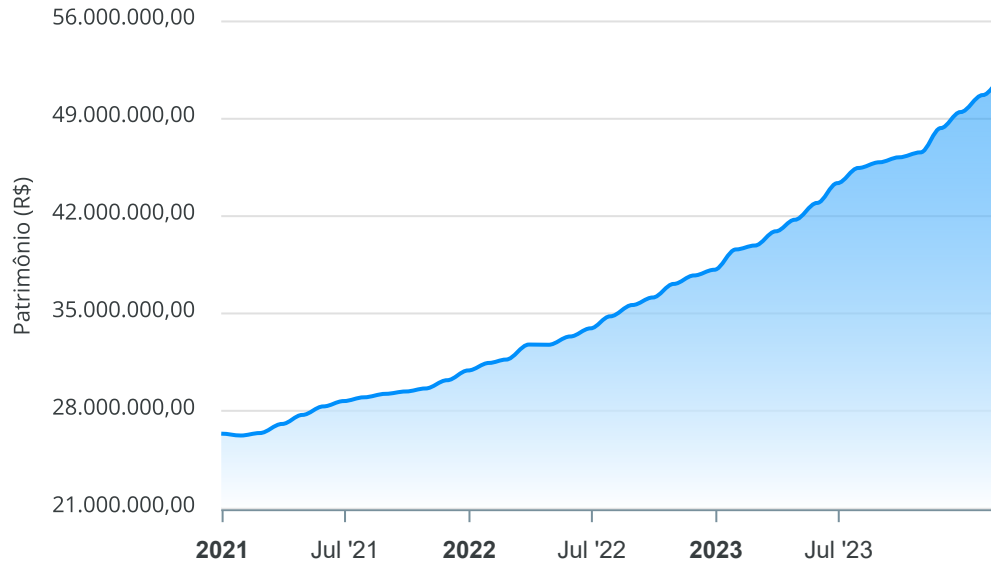
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	38.107.184,17	3.290.124,85	2.392.124,68	39.598.734,19	593.549,85	593.549,85	1,52%	1,52%	0,97%	0,97%	157,42%	1,67%
Fevereiro	39.598.734,19	5.816.115,61	5.528.971,95	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%
Outubro	46.222.619,29	7.318.118,82	6.832.970,91	46.579.599,38	-128.167,82	3.364.205,96	-0,27%	8,32%	0,66%	8,11%	102,56%	2,87%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



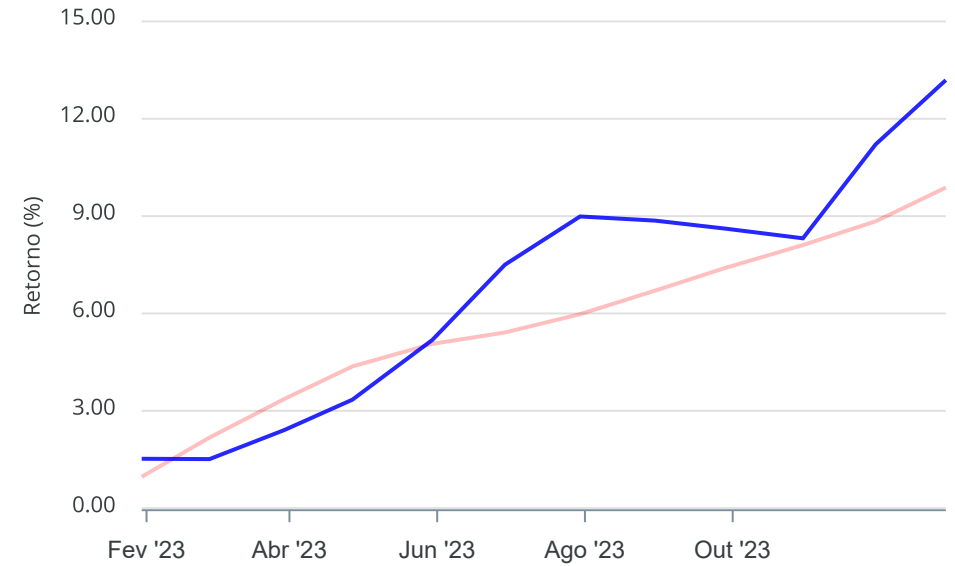
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Outubro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	707.104,09	1.250.000,00	0,00	1.976.673,94	19.569,85	1,00%	1,06%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	253.482,07	0,00	0,00	255.987,06	2.504,99	0,99%	0,99%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.209.114,26	0,00	0,00	3.239.264,76	30.150,50	0,94%	0,94%	0,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.859.172,52	0,00	0,00	1.874.247,79	15.075,27	0,81%	0,81%	0,17%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.250.000,00	0,00	1.260.082,42	10.082,42	0,81%	1,05%	0,02%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	708.093,33	0,00	713.290,59	5.197,26	0,73%	1,39%	1,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.212.846,92	0,00	0,00	3.235.396,05	22.549,13	0,70%	0,70%	0,40%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.170.467,64	2.031.380,59	0,00	13.294.441,24	92.593,01	0,70%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.010.938,78	0,00	0,00	1.015.427,15	4.488,37	0,44%	0,44%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	515.683,26	0,00	0,00	517.931,66	2.248,40	0,44%	0,44%	0,48%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	546.082,21	62.836,29	0,00	611.250,43	2.331,93	0,38%	0,43%	0,80%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	530.064,78	0,00	0,00	531.901,99	1.837,21	0,35%	0,35%	1,78%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	526.326,82	0,00	0,00	527.818,70	1.491,88	0,28%	0,28%	1,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	443.968,14	2.015.808,61	1.998.729,78	467.048,37	6.001,40	0,24%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.533.759,32	0,00	2.000.000,00	2.527.606,45	-6.152,87	-0,14%	0,09%	2,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.710.608,14	0,00	1.500.000,00	2.199.605,39	-11.002,75	-0,30%	-0,21%	2,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.373.440,42	0,00	0,00	1.364.314,40	-9.126,02	-0,66%	-0,66%	3,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	59.547,25	0,00	0,00	59.145,96	-401,29	-0,67%	-0,67%	3,00%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	509.084,33	0,00	0,00	504.394,81	-4.689,52	-0,92%	-0,92%	3,21%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.400.135,71	0,00	0,00	1.386.256,93	-13.878,78	-0,99%	-0,99%	4,60%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	769.514,95	0,00	500.000,00	258.317,99	-11.196,96	-1,46%	-0,96%	4,57%
Total Renda Fixa	36.341.341,61	7.318.118,82	5.998.729,78	37.820.404,08	159.673,43	0,42%		1,27%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.553.816,33	0,00	0,00	1.567.064,69	13.248,36	0,85%	0,85%	0,14%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	367.305,83	0,00	365.532,40	0,00	-1.773,43	-0,48%	-0,36%	2,45%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	243.883,88	0,00	242.295,96	0,00	-1.587,92	-0,65%	-1,75%	7,19%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	228.929,65	0,00	226.412,77	0,00	-2.516,88	-1,10%	-2,40%	7,65%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1.847.244,15	0,00	0,00	1.815.990,94	-31.253,21	-1,69%	-1,69%	7,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	583.937,11	0,00	0,00	566.986,99	-16.950,12	-2,90%	-2,90%	6,99%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	279.562,39	0,00	0,00	270.345,57	-9.216,82	-3,30%	-3,30%	6,13%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	225.501,07	0,00	0,00	217.983,28	-7.517,79	-3,33%	-3,33%	7,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	98.425,64	0,00	0,00	94.691,71	-3.733,93	-3,79%	-3,79%	7,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	261.680,93	0,00	0,00	248.057,16	-13.623,77	-5,21%	-5,21%	9,57%
BB EQUIDADE IS FIC AÇÕES	197.353,14	0,00	0,00	186.411,82	-10.941,32	-5,54%	-5,54%	8,40%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	286.734,00	0,00	0,00	270.290,75	-16.443,25	-5,73%	-5,73%	9,24%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	446.412,73	0,00	0,00	419.104,46	-27.308,27	-6,12%	-6,12%	17,22%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	235.038,45	0,00	0,00	220.272,58	-14.765,87	-6,28%	-6,28%	8,83%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	784.134,59	0,00	0,00	723.846,66	-60.287,93	-7,69%	-7,69%	11,33%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	602.815,08	0,00	0,00	548.907,28	-53.907,80	-8,94%	-8,94%	13,28%
Total Renda Variável	8.242.774,97	0,00	834.241,13	7.149.953,89	-258.579,95	-3,14%		7,33%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	523.576,57	0,00	0,00	516.250,94	-7.325,63	-1,40%	-1,40%	7,82%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	513.290,49	0,00	0,00	505.196,71	-8.093,78	-1,58%	-1,58%	7,88%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	98.667,46	0,00	0,00	96.837,40	-1.830,06	-1,85%	-1,85%	8,85%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	502.968,19	0,00	0,00	490.956,36	-12.011,83	-2,39%	-2,39%	6,17%
Total Exterior	1.638.502,71	0,00	0,00	1.609.241,41	-29.261,30	-1,79%		7,40%

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.

