

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			11.245.064,48	4,86%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.587.714,49	2,85%	903	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.139.185,87	2,65%	638	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.995.506,56	0,86%	598	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	15/08/2024	1.635.957,74	0,71%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.788.866,87	1,64%	794	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.543.640,81	3,69%	873	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.332.803,89	2,31%	933	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	23.471,50	0,01%	782	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.282.165,84	0,55%	426	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	4.451.338,32	1,92%	92	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	1.447.869,55	0,63%	1.710	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	12.419.351,65	5,37%	1.116	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.279.297,31	4,44%	426	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.141.150,15	5,25%	385	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	2.198.685,90	0,95%	235	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	5.105.254,23	2,21%	31	2,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.640.347,34	5,03%	114	1,94%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.760.970,42	4,65%	333	1,76%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.009.993,52	0,87%	518	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	12.374.324,28	5,35%	710	5,98%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.752.307,08	2,92%	478	2,82%	Artigo 8º, Inciso I
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	2.668.356,06	1,15%	704	0,87%	Artigo 8º, Inciso I
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	D+7 du ...	Não há	1.332.402,09	0,58%	7	9,25%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.195.456,11	2,25%	3.484	1,95%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	3.899.339,34	1,69%	106	5,63%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.260.923,06	0,55%	1.399	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BRANCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.564.618,21	0,68%	25	0,88%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	9.027.602,63	3,90%	2.619	0,70%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	3.420.502,08	1,48%	288	1,01%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	9.276.364,33	4,01%	62	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	Não há	453.099,09	0,20%	154	1,54%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.682.953,79	2,02%	4.432	2,09%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	5.219.705,60	2,26%	1.902	1,66%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.887.076,14	1,25%	233	1,61%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.699.822,80	2,46%	56	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	3.048.794,82	1,32%	2.697	1,39%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	1.196.920,39	0,52%	197	0,41%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INV...	D+6 du	Não há	1.631.924,81	0,71%	14	0,02%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	2.938.178,24	1,27%	148	0,24%	Artigo 9º, Inciso III

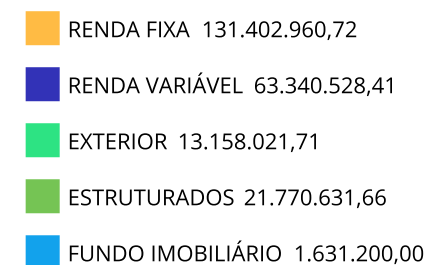
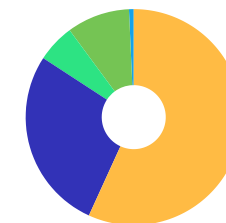


Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.105.197,34	0,91%	506	10,84%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	2.237.006,11	0,97%	3.529	1,42%	Artigo 9º, Inciso III
BRDESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	5.370.299,95	2,32%	533	3,42%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	721.061,37	0,31%	155	0,64%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	3.125.320,19	1,35%	6.682	0,20%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	3.256.247,34	1,41%	10	6,45%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	3.220.826,84	1,39%	22	2,38%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	2.102.528,47	0,91%	20	1,27%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	3.974.347,50	1,72%	4.179	2,12%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.631.200,00	0,71%		1,13%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			231.303.342,50				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	11.245.064,48	4,86%	1,50%	18,90%	84,06%	183.188.525,23
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	41.228.521,44	17,82%	20,45%	20,50%	84,06%	153.205.068,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	66.555.050,52	28,77%	8,00%	12,00%	70,00%	95.357.289,23
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	15,00%	34.695.501,38
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	10,00%	12.374.324,28	5,35%	0,00%	0,00%	10,00%	10.756.009,97
Total Renda Fixa	100,00%	131.402.960,72	56,81%	29,95%	54,40%	263,12%	

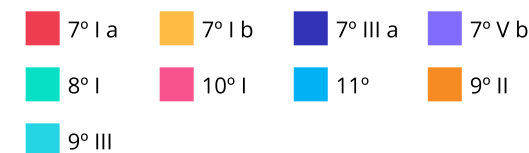
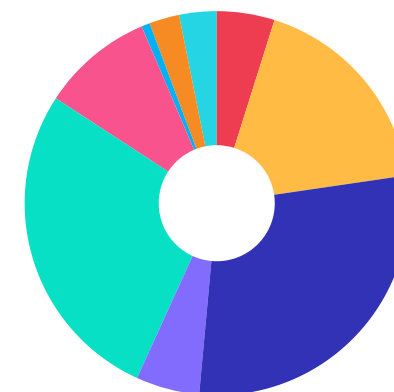


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	63.340.528,41	27,38%	10,00%	20,40%	40,00%	29.180.808,59
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	46.260.668,50
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	21.770.631,66	9,41%	3,75%	10,00%	10,00%	1.359.702,59
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	11.565.167,13
Artigo 11º	10,00%	1.631.200,00	0,71%	0,50%	0,70%	5,00%	9.933.967,13
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	86.742.360,07	37,50%	14,25%	35,60%	80,00%	

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%	5.877.640,02	2,54%	2,00%	5,00%	10,00%	17.252.694,23
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.280.381,69	3,15%	3,00%	5,00%	10,00%	15.849.952,56
Total Exterior	10,00%	13.158.021,71	5,69%	5,00%	10,00%	20,00%	





CRÉDITO
& MERCADO

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	36.363.785,52	15,72	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.340.859,87	13,55	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	18.791.174,37	8,12	-
SOMMA INVESTIMENTOS	17.594.029,88	7,61	-
SICREDI	16.745.311,44	7,24	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	13.684.856,88	5,92	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	11.640.347,34	5,03	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	11.245.064,48	4,86	-
4UM INVESTIMENTOS	9.420.663,14	4,07	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	9.276.364,33	4,01	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	9.027.602,63	3,90	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.934.918,16	3,00	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.879.874,18	2,54	-
TARPON INVESTIMENTOS	5.699.822,80	2,46	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.195.456,11	2,25	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	3.899.339,34	1,69	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.420.502,08	1,48	-
XP ASSET MANAGEMENT	3.048.794,82	1,32	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	2.887.076,14	1,25	-
ITAÚ UNIBANCO	2.237.006,11	0,97	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.105.197,34	0,91	-
MIRAE ASSET	1.631.924,81	0,71	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	1.447.869,55	0,63	-
ATHENA CAPITAL	1.332.402,09	0,58	-
MULTINVEST CAPITAL	453.099,09	0,20	-

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 '	11.245.064,48	4,86	1,50	84,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	41.228.521,44	17,82	20,45	84,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	66.555.050,52	28,77	18,00	70,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	12.374.324,28	5,35	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I	63.340.528,41	27,38	10,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	5.877.640,02	2,54	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	7.280.381,69	3,15	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	21.770.631,66	9,41	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	1.631.200,00	0,71	0,50	5,00

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%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	8,59%	1,91%	4,04%	11,22%	20,92%	0,85%	0,02%
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%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	0,11%	8,63%	1,64%	4,15%	11,28%	21,03%	0,99%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	3,06%	0,48%	1,91%	5,85%	8,34%	0,33%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,12%	8,74%	1,68%	4,23%	11,44%	21,54%	0,98%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	8,79%	1,67%	4,28%	11,46%	21,66%	0,98%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
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%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,97%	10,69%	-0,70%	6,72%	10,51%	18,48%	2,49%	0,05%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-1,04%	10,57%	-0,65%	6,50%	10,63%	18,46%	2,66%	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%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,14%	11,64%	1,85%	7,40%	13,34%	23,43%	1,23%	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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,23%	3,54%	6,91%	13,89%	27,22%	0,03%	0,00%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,26%	7,99%	4,19%	7,48%	11,80%	25,42%	0,09%	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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	10,15%	3,42%	6,85%	13,67%	26,52%	0,02%	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%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,21%	-	2,55%	-	-	-	2,11%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	-0,75%	11,50%	0,63%	5,95%	-	-	3,64%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	0,34%	-	0,64%	-	-	-	3,15%	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,32%	2,38%	1,10%	-0,10%	0,65%	-	1,75%	0,05%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	-0,61%	9,14%	1,43%	21,14%	8,14%	1,41%	7,76%	0,22%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	-0,84%	4,69%	-3,14%	12,18%	2,76%	7,54%	7,29%	0,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,00%	6,85%	-4,46%	12,85%	1,02%	4,21%	7,67%	0,18%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,73%	-0,47%	-2,29%	11,85%	-2,06%	-7,98%	7,14%	0,20%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,38%	5,12%	-0,38%	6,24%	6,42%	-	3,63%	0,07%
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%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,04%	9,55%	-2,31%	16,88%	7,47%	13,87%	7,48%	0,17%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7,66%	39,29%	11,58%	45,55%	32,33%	58,35%	8,10%	0,22%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,01%	10,64%	0,04%	13,98%	7,92%	11,25%	6,76%	0,17%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,50%	25,70%	3,31%	33,12%	19,17%	31,43%	8,23%	0,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26%	2,02%	-1,96%	10,30%	-0,01%	-4,02%	7,72%	0,20%

IBX (Benchmark)	0,84%	5,50%	-1,02%	13,78%	5,09%	3,69%	-	-
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	-4,43%	1,34%	-2,32%	10,25%	-5,25%	-25,18%	8,01%	0,26%
BRANCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	0,23%	2,96%	-2,27%	11,50%	2,58%	-0,88%	8,06%	0,20%

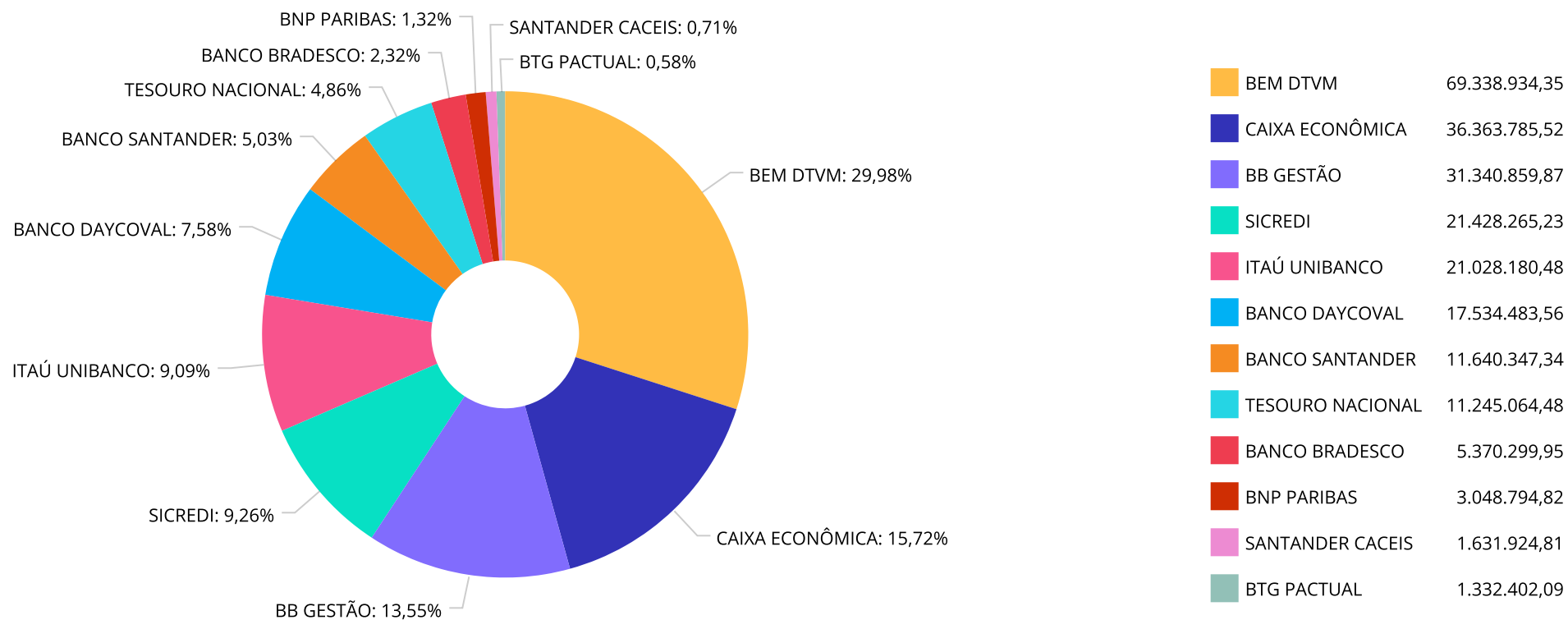
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,91%	29,46%	3,66%	30,48%	16,63%	13,25%	4,56%	0,23%
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%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-4,87%	11,68%	-3,65%	4,35%	19,59%	-0,45%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	-4,42%	18,22%	-1,80%	8,52%	29,82%	17,99%	4,84%	0,17%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	-4,54%	13,82%	-2,15%	4,83%	24,64%	12,01%	5,03%	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%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	0,14%	24,25%	9,53%	42,98%	13,92%	11,64%	6,98%	0,23%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	-0,75%	11,50%	0,63%	5,95%	-	-	3,64%	-

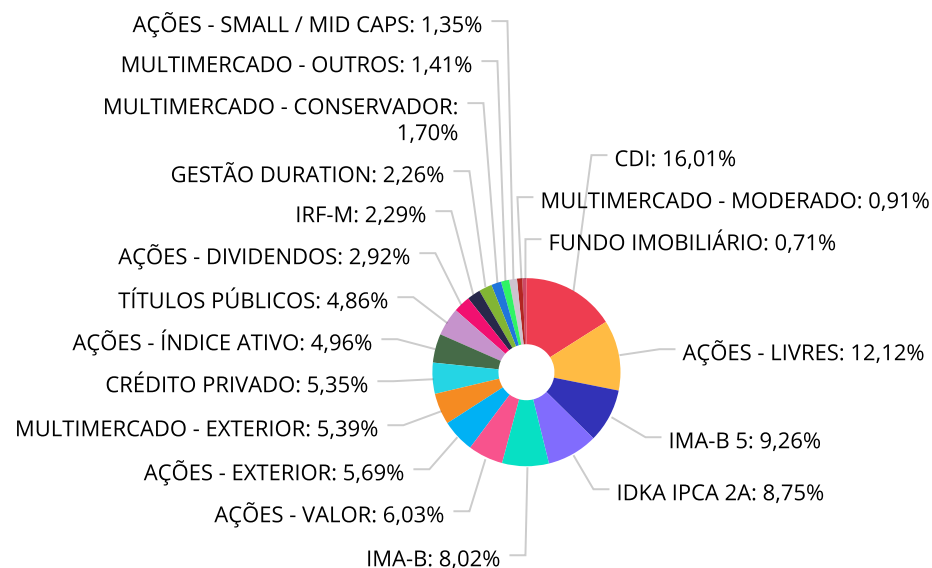
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,60%	14,54%	1,28%	6,49%	18,47%	-6,70%	4,76%	21,662%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	-0,92%	3,54%	3,71%	5,99%	10,83%	-3,41%	4,96%	19,279%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO EXTE...	-6,13%	13,06%	-10,13%	-4,66%	26,05%	-39,79%	8,36%	28,039%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,61%	4,13%	-0,05%	0,10%	9,93%	-14,78%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	-5,72%	23,57%	-0,38%	8,15%	26,65%	-18,22%	6,06%	23,198%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,96%	2,95%	0,08%	-0,04%	13,53%	-14,54%	5,59%	22,121%

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



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



■ CDI	37.038.485,01	■ AÇÕES - LIVRES	28.041.699,11	■ IMA-B 5	21.424.489,55
■ IDKA IPCA 2A	20.236.609,53	■ IMA-B	18.559.585,53	■ AÇÕES - VALOR	13.957.789,47
■ AÇÕES - EXTERIOR	13.158.021,71	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	12.469.967,64	■ CRÉDITO PRIVADO	12.374.324,28
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11.467.277,60	■ TÍTULOS PÚBLICOS	11.245.064,48	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	6.752.307,08
■ IRF-M	5.287.665,92	■ GESTÃO DURATION	5.236.736,42	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	3.941.888,21
■ MULTIMERCADO - OUTROS	3.256.247,34	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	3.121.455,15	■ MULTIMERCADO - MODERADO	2.102.528,47
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.631.200,00				



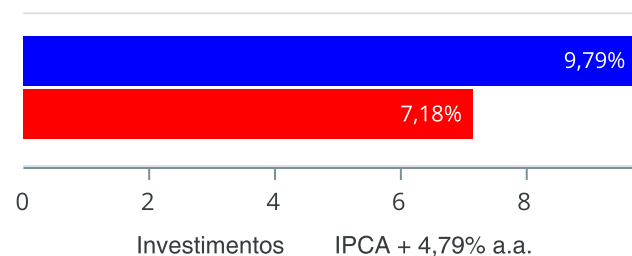
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2023)

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	19/08/2022	760	3.944,24192900	4.163,029807	2.997.623,87	3.163.902,65	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	14/12/2022	747	4.012,12341	4.129,494065	2.997.056,19	3.084.732,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	10/05/2023	1.160	429.378,463500	4.270,452804	498.079.017,66	4.953.725,25	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	193.188.837,21	28.759.181,70	27.851.412,72	198.447.776,34	4.351.170,15	4.351.170,15	2,24%	2,24%	0,94%	0,94%	238,11%	4,19%
Fevereiro	198.447.776,34	2.734.675,74	1.140.768,42	197.229.574,12	-2.812.109,54	1.539.060,61	-1,41%	0,80%	1,18%	2,13%	37,77%	3,89%
Março	197.229.574,12	15.529.364,85	13.488.414,48	200.261.062,02	990.537,53	2.529.598,14	0,50%	1,31%	1,14%	3,30%	39,62%	3,69%
Abril	200.261.062,02	3.593.900,89	2.195.265,45	204.271.497,25	2.611.799,79	5.141.397,93	1,30%	2,62%	0,95%	4,27%	61,25%	3,26%
Mai	204.271.497,25	13.187.247,10	12.065.761,36	210.124.568,81	4.731.585,82	9.872.983,75	2,30%	4,98%	0,64%	4,94%	100,82%	3,32%
Junho	210.124.568,81	2.474.503,32	692.513,20	219.085.217,87	7.178.658,94	17.051.642,69	3,39%	8,54%	0,31%	5,27%	162,11%	3,32%
Julho	219.085.217,87	9.210.353,70	7.361.564,75	225.262.821,96	4.328.815,14	21.380.457,83	1,96%	10,66%	0,51%	5,80%	183,72%	3,04%
Agosto	225.262.821,96	23.490.206,46	21.910.645,17	225.277.460,32	-1.564.922,93	19.815.534,90	-0,69%	9,90%	0,66%	6,50%	152,28%	3,29%
Setembro	225.277.460,32	4.322.746,46	2.861.997,27	226.515.316,74	-222.892,77	19.592.642,13	-0,10%	9,79%	0,63%	7,18%	136,47%	3,45%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

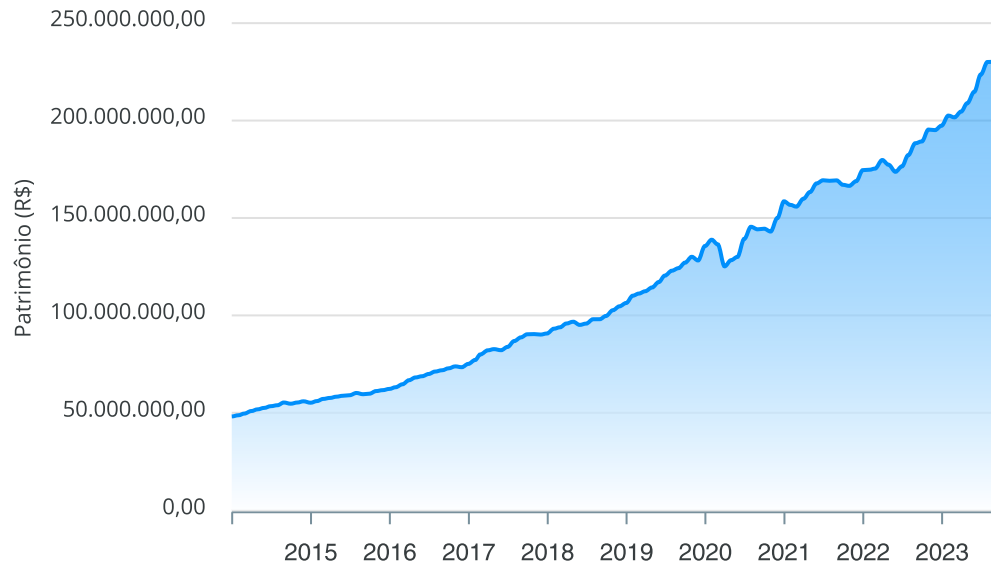




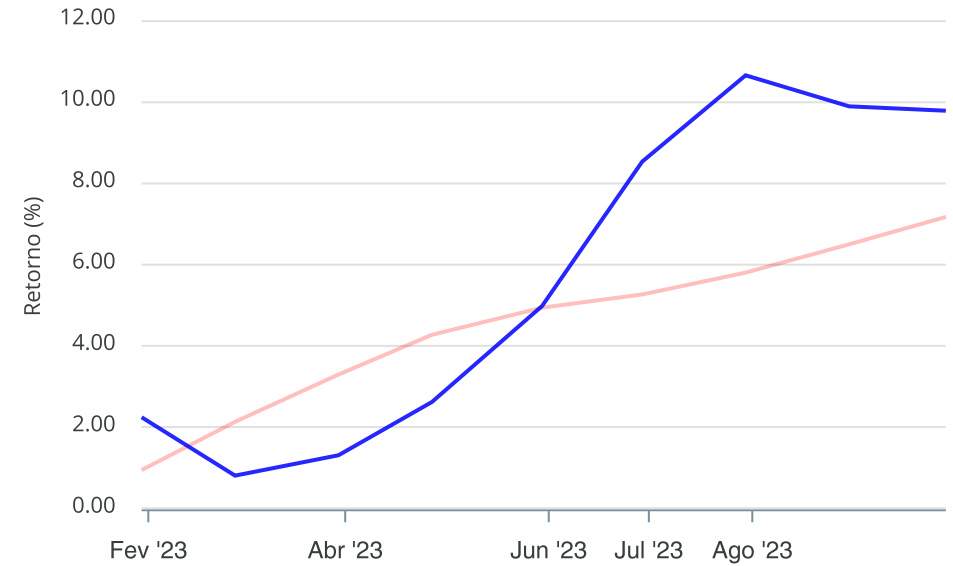
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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	12.220.756,95	0,00	0,00	12.374.324,28	153.567,33	1,26%	1,26%	0,09%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.122.945,28	0,00	0,00	11.245.064,48	122.119,20	1,10%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.618.223,99	0,00	0,00	1.635.957,74	17.733,75	1,10%	1,10%	0,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.921.064,50	40.536,64	2.970.700,81	12.141.150,15	150.249,82	1,00%	1,05%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	9.896.294,50	282.209,82	0,00	10.279.297,31	100.792,99	0,99%	1,02%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	12.300.043,44	0,00	0,00	12.419.351,65	119.308,21	0,97%	0,97%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	2.189.533,38	0,00	0,00	2.198.685,90	9.152,52	0,42%	0,42%	0,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.773.627,83	0,00	0,00	3.788.866,87	15.239,04	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.513.344,94	0,00	0,00	8.543.640,81	30.295,87	0,36%	0,36%	0,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.573.797,68	0,00	0,00	6.587.714,49	13.916,81	0,21%	0,21%	0,85%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	5.094.627,26	0,00	0,00	5.105.254,23	10.626,97	0,21%	0,21%	2,11%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.280.296,23	0,00	0,00	1.282.165,84	1.869,61	0,15%	0,15%	1,12%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	2.007.189,68	0,00	0,00	2.009.993,52	2.803,84	0,14%	0,14%	1,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	4.446.042,09	0,00	0,00	4.451.338,32	5.296,23	0,12%	0,12%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.326.842,50	0,00	0,00	5.332.803,89	5.961,39	0,11%	0,11%	0,98%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	11.628.178,04	0,00	0,00	11.640.347,34	12.169,30	0,10%	0,10%	0,99%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	2.000.000,00	0,00	1.995.506,56	-4.493,44	-0,22%	0,14%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	23.698,31	0,00	0,00	23.471,50	-226,81	-0,96%	-0,96%	2,51%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.461.977,57	0,00	0,00	1.447.869,55	-14.108,02	-0,96%	-0,96%	2,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.199.250,27	0,00	0,00	6.139.185,87	-60.064,40	-0,97%	-0,97%	2,52%



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
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.874.528,60	0,00	0,00	10.760.970,42	-113.558,18	-1,04%	-1,04%	2,66%
Total Renda Fixa	131.472.263,04	2.322.746,46	2.970.700,81	131.402.960,72	578.652,03	0,44%		0,86%

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.294.528,52	0,00	0,00	5.699.822,80	405.294,28	7,65%	7,65%	8,10%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.139.184,56	0,00	0,00	9.276.364,33	137.179,77	1,50%	1,50%	8,23%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5.134.585,01	0,00	0,00	5.195.456,11	60.871,10	1,19%	1,19%	8,34%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	5.181.822,66	0,00	0,00	5.219.705,60	37.882,94	0,73%	0,73%	7,14%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3.208.686,59	0,00	0,00	3.220.826,84	12.140,25	0,38%	0,38%	3,63%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	718.654,62	0,00	0,00	721.061,37	2.406,75	0,33%	0,33%	3,15%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	2.095.884,72	0,00	0,00	2.102.528,47	6.643,75	0,32%	0,32%	1,75%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.257.664,78	0,00	0,00	1.260.923,06	3.258,28	0,26%	0,26%	7,72%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	3.890.130,28	0,00	0,00	3.899.339,34	9.209,06	0,24%	0,24%	6,49%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	1.561.032,10	0,00	0,00	1.564.618,21	3.586,11	0,23%	0,23%	8,06%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	2.664.555,00	0,00	0,00	2.668.356,06	3.801,06	0,14%	0,14%	6,98%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.418.562,99	2.000.000,00	0,00	3.420.502,08	1.939,09	0,06%	0,04%	7,48%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.753.015,13	0,00	0,00	6.752.307,08	-708,05	-0,01%	-0,01%	6,76%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	1.340.629,73	0,00	0,00	1.332.402,09	-8.227,64	-0,61%	-0,61%	7,76%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	3.280.880,25	0,00	0,00	3.256.247,34	-24.632,91	-0,75%	-0,75%	3,64%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	4.722.740,63	0,00	0,00	4.682.953,79	-39.786,84	-0,84%	-0,84%	7,29%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	9.119.057,99	0,00	0,00	9.027.602,63	-91.455,36	-1,00%	-1,00%	7,67%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	465.368,22	0,00	0,00	453.099,09	-12.269,13	-2,64%	-2,64%	8,74%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.680.000,00	0,00	0,00	1.631.200,00	-48.800,00	-2,90%	-2,25%	4,56%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	4.158.328,46	0,00	0,00	3.974.347,50	-183.980,96	-4,42%	-4,42%	4,84%



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
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	3.020.979,06	0,00	0,00	2.887.076,14	-133.902,92	-4,43%	-4,43%	8,01%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.271.168,76	0,00	0,00	3.125.320,19	-145.848,57	-4,46%	-4,46%	5,00%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	5.625.925,69	0,00	0,00	5.370.299,95	-255.625,74	-4,54%	-4,54%	5,03%
Total Renda Variável	85.003.385,75	2.000.000,00	0,00	86.742.360,07	-261.025,68	-0,30%		6,69%

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	2.257.696,19	0,00	0,00	2.237.006,11	-20.690,08	-0,92%	-0,92%	4,96%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.233.460,51	0,00	0,00	1.196.920,39	-36.540,12	-2,96%	-2,96%	5,59%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	3.037.976,98	0,00	0,00	2.938.178,24	-99.798,74	-3,29%	-3,29%	5,58%
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.183.914,63	0,00	0,00	2.105.197,34	-78.717,29	-3,60%	-3,60%	4,76%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	3.233.596,69	0,00	0,00	3.048.794,82	-184.801,87	-5,72%	-5,72%	6,06%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	1.738.571,17	0,00	0,00	1.631.924,81	-106.646,36	-6,13%	-6,13%	8,36%
Total Exterior	13.685.216,17	0,00	0,00	13.158.021,71	-527.194,46	-3,85%		5,80%

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	34.519.115,41	4.801.062,07	28.018.750,77	12.141.150,15	839.723,44	7,43%	3,54%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.877.289,08	0,00	0,00	12.374.324,28	497.035,20	4,18%	4,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	10.347.357,81	1.699.312,66	0,00	12.419.351,65	372.681,18	3,09%	3,22%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	8.440.593,35	1.520.722,86	0,00	10.279.297,31	317.981,10	3,19%	3,42%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.351.234,04	0,00	326.827,34	11.245.064,48	220.657,78	2,00%	-
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	11.453.043,07	0,00	0,00	11.640.347,34	187.304,27	1,64%	1,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.371.226,50	0,00	0,00	8.543.640,81	172.414,31	2,06%	2,06%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	4.978.519,75	0,00	0,00	5.105.254,23	126.734,48	2,55%	2,55%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.464.578,07	0,00	0,00	6.587.714,49	123.136,42	1,90%	1,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.245.311,28	0,00	0,00	5.332.803,89	87.492,61	1,67%	1,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	4.377.806,02	0,00	0,00	4.451.338,32	73.532,30	1,68%	1,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.716.784,32	0,00	0,00	3.788.866,87	72.082,55	1,94%	1,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	2.154.039,27	0,00	0,00	2.198.685,90	44.646,63	2,07%	2,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.011.832,75	248.615,70	0,00	1.282.165,84	21.717,39	1,72%	1,77%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,00	2.000.000,00	0,00	2.009.993,52	9.993,52	0,50%	1,85%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.628.223,61	0,00	0,00	1.635.957,74	7.734,13	0,48%	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	23.559,20	0,00	23.471,50	-87,70	-0,37%	-0,53%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	2.000.000,00	0,00	1.995.506,56	-4.493,44	-0,22%	1,65%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.458.137,90	0,00	0,00	1.447.869,55	-10.268,35	-0,70%	-0,70%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.178.915,52	0,00	0,00	6.139.185,87	-39.729,65	-0,64%	-0,64%

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
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,00	11.000.000,00	0,00	10.760.970,42	-239.029,58	-2,17%	-0,65%
Total Renda Fixa	133.574.007,75	23.293.272,49	28.345.578,11	131.402.960,72	2.881.258,59	1,84%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.108.267,07	0,00	0,00	5.699.822,80	591.555,73	11,58%	11,58%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.979.443,79	0,00	0,00	9.276.364,33	296.920,54	3,31%	3,31%
MULTINVEST FI AÇÕES	1.988.531,76	0,00	2.069.847,09	0,00	81.315,33	4,09%	-
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	2.600.000,00	0,00	2.668.356,06	68.356,06	2,63%	9,53%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.573.600,00	0,00	0,00	1.631.200,00	57.600,00	3,66%	3,66%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	2.079.586,97	0,00	0,00	2.102.528,47	22.941,50	1,10%	1,10%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	3.235.813,51	0,00	0,00	3.256.247,34	20.433,83	0,63%	0,63%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	1.313.648,92	0,00	0,00	1.332.402,09	18.753,17	1,43%	1,43%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	716.481,58	0,00	0,00	721.061,37	4.579,79	0,64%	0,64%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.749.370,25	0,00	0,00	6.752.307,08	2.936,83	0,04%	0,04%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3.233.161,97	0,00	0,00	3.220.826,84	-12.335,13	-0,38%	-0,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.286.117,06	0,00	0,00	1.260.923,06	-25.194,00	-1,96%	-1,96%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5.224.918,45	0,00	0,00	5.195.456,11	-29.462,34	-0,56%	-0,56%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	485.153,83	0,00	0,00	453.099,09	-32.054,74	-6,61%	-6,61%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.452.651,13	2.000.000,00	0,00	3.420.502,08	-32.149,05	-0,93%	-2,31%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	1.600.983,34	0,00	0,00	1.564.618,21	-36.365,13	-2,27%	-2,27%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.033.783,76	0,00	1.996.172,25	0,00	-37.611,51	-1,85%	-2,66%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.185.477,07	0,00	0,00	3.125.320,19	-60.156,88	-1,89%	-1,89%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	4.047.034,12	0,00	0,00	3.974.347,50	-72.686,62	-1,80%	-1,80%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,00	4.000.000,00	0,00	3.899.339,34	-100.660,66	-2,52%	0,98%



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
Total Renda Variável	54.294.024,58	8.600.000,00	4.066.019,34	59.554.721,96	726.716,72	1,24%	

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	2.156.993,84	0,00	0,00	2.237.006,11	80.012,27	3,71%	3,71%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	2.890.809,91	0,00	0,00	2.938.178,24	47.368,33	1,64%	1,64%
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.078.661,01	0,00	0,00	2.105.197,34	26.536,33	1,28%	1,28%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.195.920,30	0,00	0,00	1.196.920,39	1.000,09	0,08%	0,08%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	3.060.424,06	0,00	0,00	3.048.794,82	-11.629,24	-0,38%	-0,38%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	1.815.863,19	0,00	0,00	1.631.924,81	-183.938,38	-10,13%	-10,13%
Total Exterior	13.198.672,31	0,00	0,00	13.158.021,71	-40.650,60	-0,31%	

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.

