

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023



Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

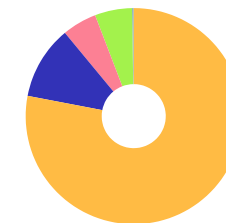
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			584.443.199,73	72,90%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.972.869,95	1,62%	933	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.201.951,08	0,15%	782	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	22.578.578,09	2,82%	985	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	788.892,86	0,10%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.604.942,45	0,32%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	D+1260	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	794.763,07	0,10%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	21.840.763,25	2,72%	19.831	1,62%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.051.121,85	0,38%	201	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	20.355.326,20	2,54%	15.711	1,24%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	10.554.468,51	1,32%	71	3,15%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	14.645.014,83	1,83%	1.165	1,33%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	17.246.597,86	2,15%	1.902	5,48%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	8.474.796,59	1,06%	2.697	3,86%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	9.361.279,26	1,17%	8.273	1,48%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	12.794.959,82	1,60%	4.394	2,12%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	10.847.396,46	1,35%	477	0,54%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	17.901.559,03	2,23%	6.682	1,16%	Artigo 10º, Inciso I
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	18.878.283,39	2,35%	627	1,68%	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
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.083.202,75	0,26%	4.179	1,11%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	747.747,40	0,09%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	757.652,58	0,09%	22	0,56%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	4.273.680,08	0,53%	28	3,47%	Artigo 10º, Inciso II
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.036.973,85	0,25%		1,55%	Artigo 11º
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	434.270,69	0,05%		0,00%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			801.670.291,64				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	584.443.199,73	72,90%	30,00%	60,00%	80,00%	56.893.033,58
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	14.174.821,03	1,77%	0,00%	8,00%	60,00%	466.827.353,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	40.083.514,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	70,00%	23.367.470,95	2,91%	0,00%	4,00%	30,00%	217.133.616,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	80.167.029,16
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	80.167.029,16
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	10,00%	3.399.705,53	0,42%	0,00%	1,00%	5,00%	36.683.809,05
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	40.083.514,58
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	40.083.514,58
Total Renda Fixa	100,00%	625.385.197,24	78,01%	30,00%	73,00%	210,00%	



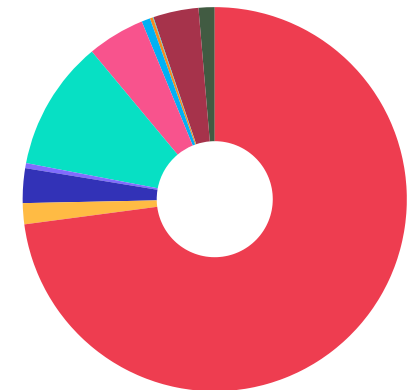
RENDA FIXA	625.385.197,24
RENDA VARIÁVEL	88.127.563,19
EXTERIOR	41.478.432,13
ESTRUTURADOS	44.642.125,23
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.036.973,85

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!

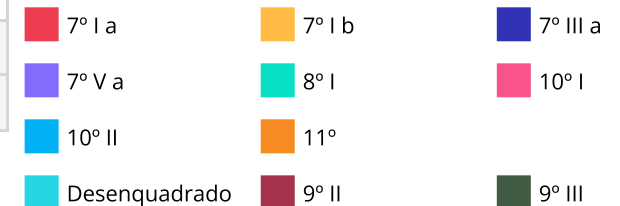


Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2023)

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%	87.693.292,50	10,94%	5,00%	15,00%	40,00%	232.974.824,16
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	80.167.029,16
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	38.863.045,17	4,85%	0,00%	5,00%	10,00%	41.303.983,99
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	5.779.080,06	0,72%	0,00%	1,00%	5,00%	34.304.434,52
Artigo 11º	10,00%	2.036.973,85	0,25%	0,00%	0,50%	5,00%	38.046.540,73
Desenquadrado - RV	0,00%	434.270,69	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-434.270,69
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	134.806.662,27	16,82%	5,00%	21,50%	70,00%	



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%	30.631.035,67	3,82%	0,00%	4,00%	10,00%	49.535.993,49
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	10.847.396,46	1,35%	0,00%	1,50%	5,00%	29.236.118,12
Total Exterior	10,00%	41.478.432,13	5,17%	0,00%	5,50%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	584.443.199,73	72,90	-
CAIXA DTVM	68.553.476,46	8,55	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	49.788.078,10	6,21	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.840.763,25	2,72	-
XP ASSET MANAGEMENT	17.836.075,85	2,22	-
SOMMA INVESTIMENTOS	17.246.597,86	2,15	-
NAVI CAPITAL	14.645.014,83	1,83	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	12.794.959,82	1,60	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	6.225.572,23	0,78	-
KPTL	4.273.680,08	0,53	-
SICREDI	2.083.202,75	0,26	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.505.399,98	0,19	-
CADENCE GESTORA	434.270,69	0,05	-
GENIAL GESTÃO LTDA	0,01	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)

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'	584.443.199,73	72,90	30,00	60,00

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
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,80%	8,86%	2,33%	4,86%	12,55%	29,06%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,45%	-2,18%	-1,14%	-2,12%	-1,76%	1,94%	0,14%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,26%	-2,42%	0,21%	0,47%	-2,67%	-15,94%	0,07%	0,01%
120% do CDI (Benchmark)	1,17%	12,03%	3,87%	7,80%	16,32%	31,68%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-0,38%	-1,98%	-1,25%	-0,94%	-8,55%	-1.177.330.000.100,00%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	8,79%	1,67%	4,28%	11,46%	21,66%	0,98%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,09%	3,55%	0,77%	2,15%	4,96%	7,51%	0,72%	0,01%
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%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03%	10,09%	3,44%	6,80%	13,67%	26,38%	0,01%	0,00%

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
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%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,53%	-1,58%	-5,28%	9,42%	-11,12%	-23,18%	9,63%	0,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,47%	4,43%	-0,70%	13,47%	1,94%	0,42%	7,60%	0,20%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,73%	-0,47%	-2,29%	11,85%	-2,06%	-7,98%	7,14%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,12%	11,80%	-1,69%	17,93%	10,85%	13,29%	8,45%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20%	-4,19%	-2,66%	4,48%	-1,31%	-7,29%	5,34%	0,18%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,47%	5,22%	0,47%	17,17%	2,92%	6,06%	6,45%	0,19%
IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,61%	4,13%	-0,05%	0,10%	9,93%	-14,78%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,46%	17,90%	-1,89%	8,34%	29,34%	17,35%	5,00%	0,17%
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%

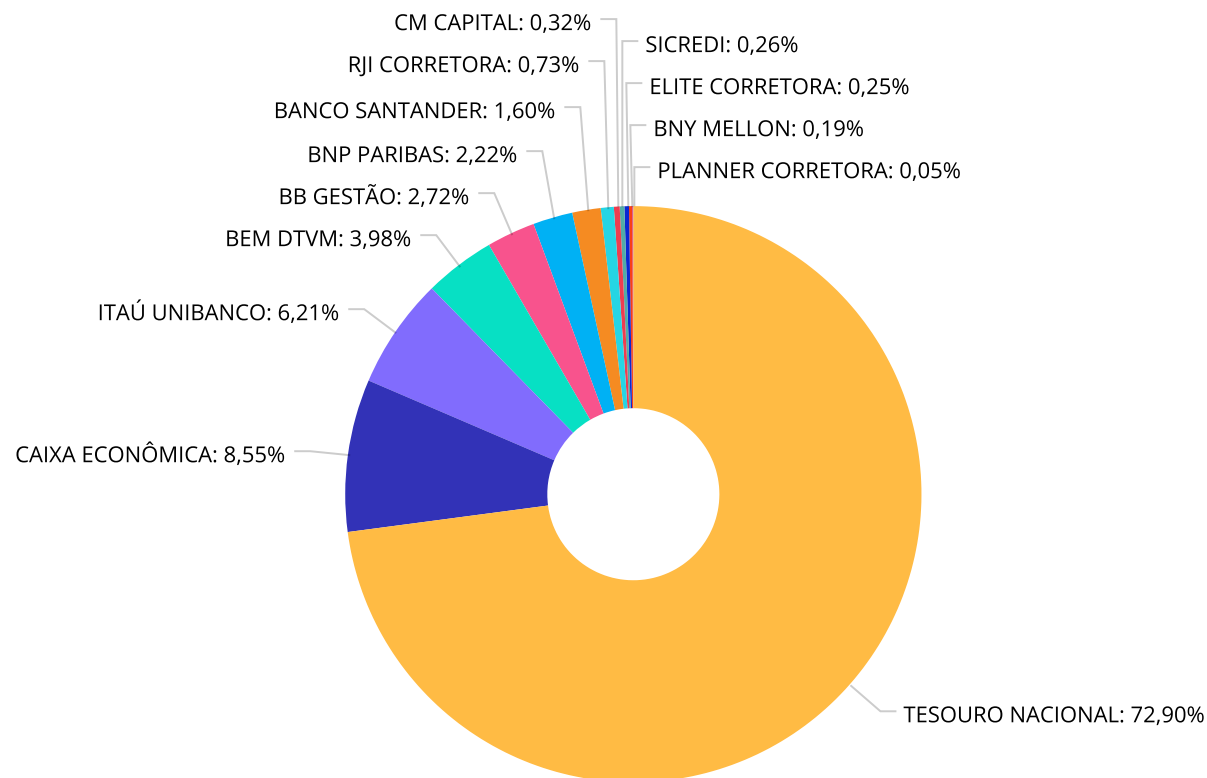
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,44%	17,79%	-1,90%	8,26%	29,28%	17,25%	5,01%	0,17%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,06%	11,50%	3,15%	6,57%	16,23%	37,64%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,14%	-1,31%	-0,45%	-0,87%	-	-10,20%	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,95%	10,37%	2,80%	5,84%	14,65%	33,93%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,03%	-0,27%	-0,08%	-0,17%	-0,36%	-0,92%	-	-

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

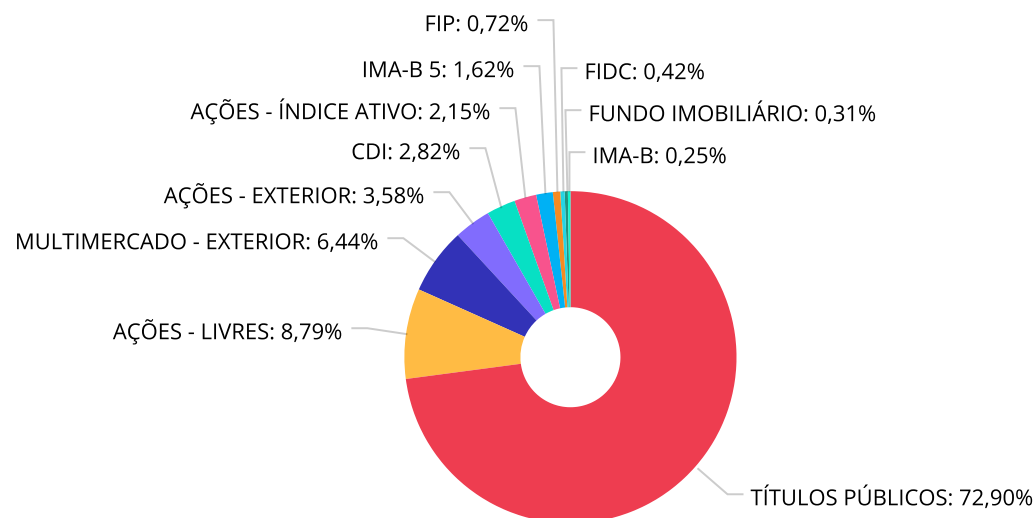
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,57%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	22,223%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,78%	5,21%	-0,07%	0,75%	11,10%	-12,63%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-2,79%	2,04%	1,01%	1,13%	10,84%	-19,00%	3,43%	17,904%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-3,77%	22,95%	1,01%	6,67%	25,17%	-31,61%	7,97%	28,975%
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%

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



TESOURO NACIONAL	584.443.199,73
CAIXA ECONÔMICA	68.553.476,46
ITAÚ UNIBANCO	49.788.078,10
BEM DTVM	31.891.612,69
BB GESTÃO	21.840.763,25
BNP PARIBAS	17.836.075,85
BANCO SANTANDER	12.794.959,82
RJI CORRETORA	5.857.336,02
CM CAPITAL	2.604.942,45
SICREDI	2.083.202,75
ELITE CORRETORA	2.036.973,85
BNY MELLON	1.505.399,98
PLANNER CORRETORA	434.270,69

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



TÍTULOS PÚBLICOS	584.443.199,73	AÇÕES - LIVRES	70.446.694,64	MULTIMERCADO - EXTERIOR	51.658.004,99	AÇÕES - EXTERIOR	28.683.472,31
CDI	22.578.578,09	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	17.246.597,86	IMA-B 5	12.972.869,95	FIP	5.779.080,06
FIDC	3.399.705,53	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.471.244,54	IMA-B	1.990.843,94		

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	03/08/2023	1.784	4.203,592272	4.144,833692	7.499.208,61	7.394.383,30	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	24/05/2022	10.309	4.151,368820	4.299,133762	42.796.461,17	44.319.769,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	01/06/2022	1.942	4119,013540	4.256,112325	7.999.124,29	8.265.370,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	18/08/2022	2.161	4.003,343810	4.242,924392	8.651.225,97	9.168.959,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	23/08/2022	3.607	4.003,343810	4.219,902513	14.440.061,12	15.221.188,36	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	13.717	4.009,617406	4.207,278414	54.999.921,96	57.711.238,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/10/2022	1.592	4080,866490	4.272,12358	6.496.739,45	6.801.220,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	09/11/2022	1.600	4060,354006	4.221,710101	6.496.566,41	6.754.736,16	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	02/12/2022	1.724	4.059,444003	4.184,646244	6.998.481,46	7.214.330,12	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	29/12/2022	3.200	4.062,499278	4.158,626919	12.999.997,69	13.307.606,14	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/11/2021	303	4.128,989331	4.280,266020	1.251.083,77	1.296.920,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/12/2021	1.452	4200,155373	4.280,266020	6.098.625,60	6.214.946,26	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	13.639	4.193,558503	4.347,594547	57.195.944,42	59.296.842,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/07/2022	2.940	4081,521882	4.173,207857	11.999.674,33	12.269.231,09	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/08/2022	803	4.010,486989	4.265,958708	3.220.421,05	3.425.564,84	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/03/2023	7.730	3.880,60527900	3.993,738361	29.997.078,81	30.871.597,53	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2023	5.532	3.886,16363200	3.994,057591	21.498.257,21	22.095.126,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	27/03/2023	13.187	4.011,33	4.085,195708	52.897.408,71	53.871.475,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2023	5.530	3.887,58634400	3.990,745061	21.498.352,48	22.068.820,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/04/2023	5.626	4.088,420000	4.140,733451	23.001.450,92	23.295.766,39	Curva

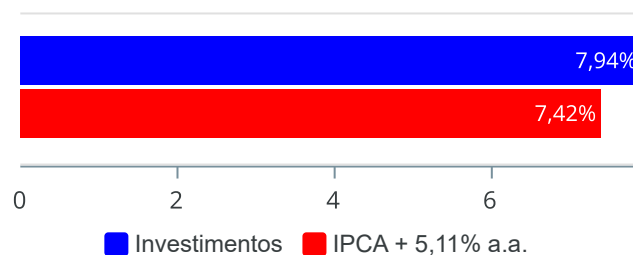
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/11/2021	303	4.128,989331	4.280,266020	1.251.083,77	1.296.920,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/12/2021	1.452	4200,155373	4.280,266020	6.098.625,60	6.214.946,26	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	13.639	4.193,558503	4.347,594547	57.195.944,42	59.296.842,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/07/2022	2.940	4081,521882	4.173,207857	11.999.674,33	12.269.231,09	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	28/11/2022	428	3886,763534	4.136,687106	1.663.534,79	1.770.502,08	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	01/02/2023	1.766	3.849,911563	4.008,543175	6.798.943,82	7.079.087,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	7.752	3.869,91365700	3.981,072804	29.999.570,67	30.861.276,37	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	11/05/2023	1.735	4.263,612425	4.270,55645	7.397.367,56	7.409.415,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	10/07/2023	11.310	4.472,934683	4.551,072634	50.588.891,26	51.472.631,49	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	04/07/2023	1.618	4.511,125907	4.592,398419	7.299.001,72	7.430.500,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/09/2023	4.520	4.424,351235	4.448,773901	19.998.067,58	20.108.458,03	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	19/09/2023	2.835	4.407,941612	4.421,100384	12.496.514,47	12.533.819,58	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

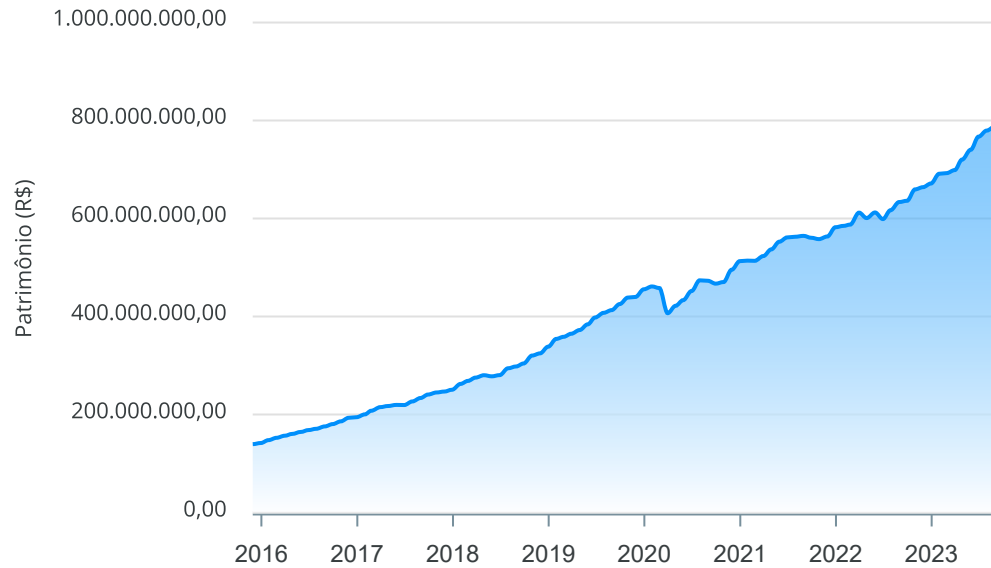
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	671.383.822,37	8.458.835,49	668.824,98	691.351.415,74	12.177.582,86	12.177.582,86	1,79%	1,79%	0,97%	0,97%	185,16%	6,78%
Fevereiro	691.351.415,74	26.072.745,92	17.430.082,46	692.616.110,99	-7.377.968,21	4.799.614,65	-1,05%	0,72%	1,20%	2,18%	33,04%	5,69%
Março	692.616.110,99	213.834.015,77	212.822.035,70	698.789.161,84	5.161.070,78	9.960.685,43	0,74%	1,47%	1,17%	3,37%	43,55%	7,15%
Abril	698.789.161,84	37.424.640,43	24.761.833,48	720.229.823,99	8.777.855,20	18.738.540,63	1,23%	2,72%	0,97%	4,38%	62,20%	6,62%
Mai	720.229.823,99	33.529.164,17	26.886.338,91	740.283.589,20	13.410.939,95	32.149.480,58	1,85%	4,62%	0,67%	5,07%	91,02%	6,40%
Junho	740.283.589,20	21.660.213,55	10.942.037,53	767.076.743,31	16.074.978,09	48.224.458,67	2,14%	6,86%	0,34%	5,42%	126,38%	5,78%
Julho	767.076.743,31	68.387.691,98	64.323.654,23	779.449.124,11	8.308.343,05	56.532.801,72	1,08%	8,01%	0,54%	5,99%	133,66%	5,51%
Agosto	779.449.124,11	38.777.027,02	30.359.489,26	787.452.313,07	-414.348,80	56.118.452,92	-0,05%	7,95%	0,69%	6,72%	118,33%	5,16%
Setembro	787.452.313,07	54.247.852,61	45.890.850,37	795.768.880,53	-40.434,78	56.078.018,14	-0,01%	7,94%	0,66%	7,42%	107,07%	5,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



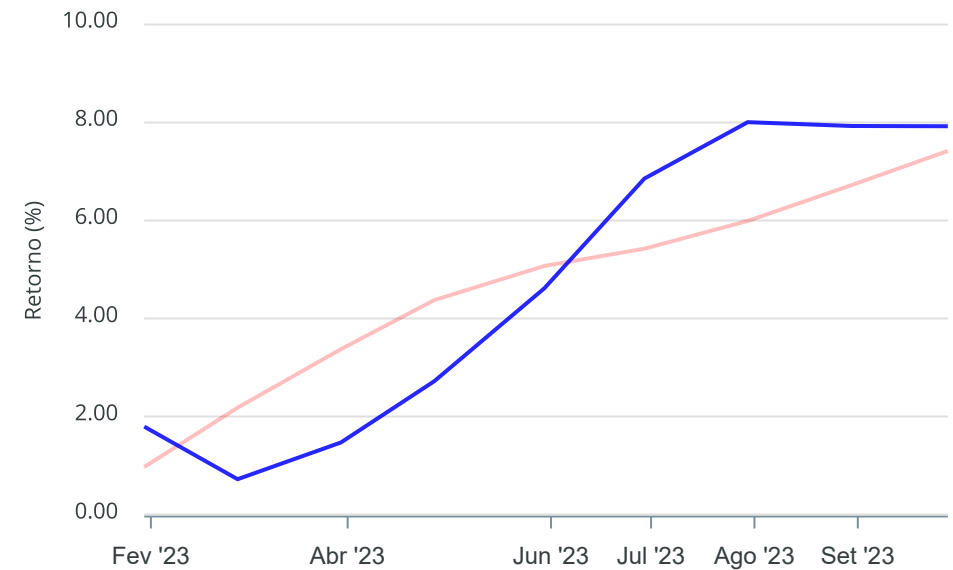
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	549.235.915,05	32.494.582,05	0,00	584.443.199,73	2.712.702,63	0,47%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	28.243.610,15	31.540.906,96	37.379.844,88	22.578.578,09	173.905,86	0,29%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.958.367,95	0,00	0,00	12.972.869,95	14.502,00	0,11%	0,11%	0,98%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	789.593,48	0,00	0,00	788.892,86	-700,62	-0,09%	-0,09%	0,72%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.611.639,60	0,00	0,00	2.604.942,45	-6.697,15	-0,26%	-0,26%	0,07%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	798.384,11	0,00	0,00	794.763,07	-3.621,04	-0,45%	-0,45%	0,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.213.565,73	0,00	0,00	1.201.951,08	-11.614,65	-0,96%	-0,96%	2,51%
Total Renda Fixa	595.851.076,08	64.035.489,01	37.379.844,88	625.385.197,24	2.878.477,03	0,46%		0,41%

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 EQUITIES FI AÇÕES	12.190.335,34	0,00	12.444.745,88	0,00	254.410,54	2,09%	0,48%	7,44%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.432.272,32	0,00	0,00	14.645.014,83	212.742,51	1,47%	1,47%	6,45%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	17.121.427,60	0,00	0,00	17.246.597,86	125.170,26	0,73%	0,73%	7,14%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	21.738.506,01	0,00	0,00	21.840.763,25	102.257,24	0,47%	0,47%	7,60%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.036.310,14	0,00	0,00	2.036.973,85	663,71	0,03%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	757.652,58	0,00	0,00	757.652,58	0,00	0,00%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	747.747,40	0,00	0,00	747.747,40	0,00	0,00%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	434.754,08	0,00	0,00	434.270,69	-483,39	-0,11%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.054.820,78	0,00	0,00	3.051.121,85	-3.698,93	-0,12%	-0,12%	8,45%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.279.653,32	0,00	0,00	4.273.680,08	-5.973,24	-0,14%	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	20.396.691,87	0,00	0,00	20.355.326,20	-41.365,67	-0,20%	-0,20%	5,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.610.391,72	0,00	0,00	10.554.468,51	-55.923,21	-0,53%	-0,53%	9,63%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	2.179.638,62	0,00	0,00	2.083.202,75	-96.435,87	-4,42%	-4,42%	4,84%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	19.755.775,40	0,00	0,00	18.878.283,39	-877.492,01	-4,44%	-4,44%	5,01%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18.736.966,82	0,00	0,00	17.901.559,03	-835.407,79	-4,46%	-4,46%	5,00%
Total Renda Variável	148.472.944,00	0,00	12.444.745,88	134.806.662,27	-1.221.535,85	-0,82%		6,33%

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	13.162.083,69	0,00	0,00	12.794.959,82	-367.123,87	-2,79%	-2,79%	3,43%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.249.555,16	0,00	0,00	10.847.396,46	-402.158,70	-3,57%	-3,57%	4,97%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	9.728.160,06	0,00	0,00	9.361.279,26	-366.880,80	-3,77%	-3,77%	7,97%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	8.988.494,08	0,00	0,00	8.474.796,59	-513.697,49	-5,72%	-5,72%	6,06%
Total Exterior	43.128.292,99	0,00	0,00	41.478.432,13	-1.649.860,86	-3,83%		5,39%

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	540.082.065,57	97.881.683,64	62.916.503,81	584.443.199,73	9.395.954,33	1,47%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.751.482,88	73.318.524,37	68.991.348,78	22.578.578,09	499.919,62	0,55%	3,44%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.760.030,64	0,00	0,00	12.972.869,95	212.839,31	1,67%	1,67%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	782.879,13	0,00	0,00	788.892,86	6.013,73	0,77%	0,77%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.599.586,19	0,00	0,00	2.604.942,45	5.356,26	0,21%	0,21%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.208.396,89	0,00	0,00	1.201.951,08	-6.445,81	-0,53%	-0,53%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	803.939,19	0,00	0,00	794.763,07	-9.176,12	-1,14%	-1,14%
Total Renda Fixa	575.988.380,50	171.200.208,01	131.907.852,59	625.385.197,24	10.104.461,32	1,64%	

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
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.576.786,10	0,00	0,00	14.645.014,83	68.228,73	0,47%	0,47%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.192.379,22	0,00	155.135,78	2.036.973,85	-269,59	-0,01%	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	758.026,25	0,00	0,00	757.652,58	-373,67	-0,05%	-0,08%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	748.234,89	0,00	0,00	747.747,40	-487,49	-0,07%	-
OSASCO PROPERTIES FII	435.006,84	0,00	0,00	434.270,69	-736,15	-0,17%	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.292.795,26	0,00	0,00	4.273.680,08	-19.115,18	-0,45%	-0,45%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	2.121.302,33	0,00	0,00	2.083.202,75	-38.099,58	-1,80%	-1,80%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.103.523,70	0,00	0,00	3.051.121,85	-52.401,85	-1,69%	-1,69%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	12.521.137,25	0,00	12.444.745,88	0,00	-76.391,37	-0,61%	-2,17%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	21.994.995,44	0,00	0,00	21.840.763,25	-154.232,19	-0,70%	-0,70%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18.246.132,45	0,00	0,00	17.901.559,03	-344.573,42	-1,89%	-1,89%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	19.244.323,31	0,00	0,00	18.878.283,39	-366.039,92	-1,90%	-1,90%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	17.650.926,77	0,00	0,00	17.246.597,86	-404.328,91	-2,29%	-2,29%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	20.911.920,70	0,00	0,00	20.355.326,20	-556.594,50	-2,66%	-2,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.143.094,73	0,00	0,00	10.554.468,51	-588.626,22	-5,28%	-5,28%
Total Renda Variável	149.940.585,24	0,00	12.599.881,66	134.806.662,27	-2.534.041,31	-1,69%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	10.705.611,28	0,00	0,00	10.847.396,46	141.785,18	1,32%	1,32%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	12.666.981,12	0,00	0,00	12.794.959,82	127.978,70	1,01%	1,01%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	9.268.062,54	0,00	0,00	9.361.279,26	93.216,72	1,01%	1,01%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	8.507.122,63	0,00	0,00	8.474.796,59	-32.326,04	-0,38%	-0,38%
Total Exterior	41.147.777,57	0,00	0,00	41.478.432,13	330.654,56	0,80%	