

Relatório Analítico dos Investimentos

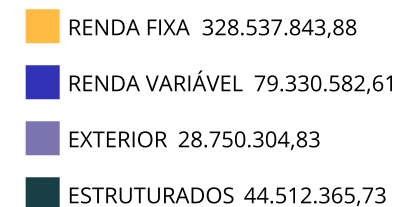
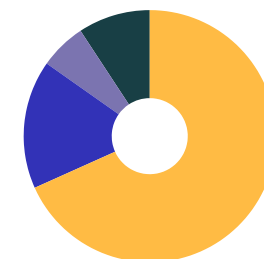
em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	6.229.361,43	1,29%	576	0,86%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.029.706,57	0,42%	2.619	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.614.645,32	2,21%	62	0,62%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	8.796.299,46	1,83%	1.263	1,09%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	14.205.111,67	2,95%	1.902	4,51%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.175.212,88	2,11%	56	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	D+4 du	Não há	7.446.314,39	1,55%	141	4,05%	Artigo 8º, Inciso I
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	4.814.359,38	1,00%	1.667	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	848.045,51	0,18%	52	0,20%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	2.216.483,23	0,46%	39	4,21%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	6.670.012,03	1,39%	8.273	1,05%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	9.265.293,39	1,93%	377	1,34%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	9.750.470,67	2,03%	64.970	0,71%	Artigo 9º, Inciso III
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	7.570.374,30	1,57%	28.434	1,26%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	8.750.437,84	1,82%	2.309	1,75%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	5.694.900,49	1,18%	642	1,87%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	5.506.730,73	1,14%	21	2,43%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	16.989.922,37	3,53%	598	2,28%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			481.131.097,05				

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

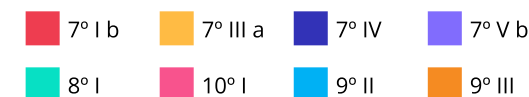
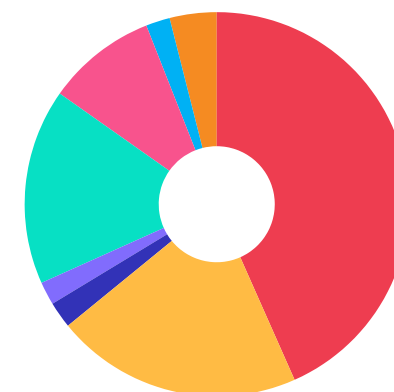
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	50,00%	240.565.548,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	208.610.879,67	43,36%	15,00%	20,00%	75,00%	152.237.443,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	48.113.109,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	99.800.107,53	20,74%	20,00%	30,50%	60,00%	188.878.550,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	9.622.621,94
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	10.722.758,00	2,23%	0,00%	3,00%	20,00%	85.503.461,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	9.404.098,68	1,95%	0,00%	5,00%	5,00%	14.652.456,17
Total Renda Fixa	100,00%	328.537.843,88	68,28%	35,00%	68,50%	222,00%	



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%	79.330.582,61	16,49%	10,00%	15,00%	30,00%	65.008.746,51
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	48.113.109,71
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	44.512.365,73	9,25%	6,00%	10,00%	10,00%	3.600.743,98
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	123.842.948,34	25,74%	16,00%	26,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	9.734.540,77	2,02%	0,00%	2,00%	10,00%	38.378.568,94
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	19.015.764,06	3,95%	0,00%	3,50%	10,00%	29.097.345,65
Total Exterior	10,00%	28.750.304,83	5,98%	0,00%	5,50%	20,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	119.593.337,56	24,86	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	71.014.429,62	14,76	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	48.015.784,03	9,98	-
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	24.781.171,39	5,15	-
SOMMA INVESTIMENTOS	23.609.210,35	4,91	-
ICATU VANGUARDA	22.375.665,22	4,65	-
TARPON INVESTIMENTOS	17.621.527,27	3,66	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	16.989.922,37	3,53	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	14.794.896,82	3,08	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	14.378.648,56	2,99	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	10.722.758,00	2,23	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	10.614.645,32	2,21	-
WESTERN ASSET	9.750.470,67	2,03	-
BANCO J. SAFRA S/A	9.265.293,39	1,93	-
OCCAM BRASIL	8.796.299,46	1,83	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	8.750.437,84	1,82	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	7.611.691,83	1,58	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	7.570.374,30	1,57	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	7.407.879,68	1,54	-
XP ASSET MANAGEMENT	6.670.012,03	1,39	-
CLARITAS INVESTIMENTOS	6.229.361,43	1,29	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.506.730,73	1,14	-
TRUXT INVESTIMENTOS	4.814.359,38	1,00	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.029.706,57	0,42	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	208.610.879,67	43,36	15,00	75,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	99.800.107,53	20,74	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	9.404.098,68	1,95	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	79.330.582,61	16,49	10,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	9.734.540,77	2,02	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	19.015.764,06	3,95	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	44.512.365,73	9,25	6,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	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%	-	-
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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,15%	12,82%	1,26%	8,24%	14,06%	22,31%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-0,83%	13,41%	-0,02%	9,23%	12,76%	19,95%	2,67%	0,08%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
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%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,97%	10,69%	-0,70%	6,72%	10,51%	18,48%	2,49%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	10,65%	-0,53%	6,49%	10,76%	18,68%	2,51%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,17%	11,62%	1,83%	7,45%	13,57%	22,67%	-	-
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%
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%
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	8,77%	2,96%	5,82%	11,77%	22,06%	0,01%	0,00%

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
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,03%	9,94%	3,27%	6,52%	13,48%	26,07%	0,03%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02%	10,12%	3,52%	6,89%	13,72%	26,84%	0,01%	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%
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%
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%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	10,09%	0,81%	4,72%	11,34%	-	1,47%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	-	0,21%	-	-	-	0,33%	-

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%	-	-
BRASESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	-4,52%	17,31%	-2,07%	7,97%	28,56%	15,92%	4,75%	0,17%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,01%	8,97%	2,96%	6,00%	11,95%	25,57%	0,13%	0,00%

Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	1,69%	-	-	-	-	-	5,49%	-
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,47%	0,02%	-5,38%	11,92%	-1,90%	-14,12%	8,29%	0,23%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,68%	4,17%	-2,52%	11,07%	-0,35%	-0,25%	7,23%	0,21%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,00%	6,85%	-4,46%	12,85%	1,02%	4,21%	7,67%	0,18%
OCCAM FIC AÇÕES	0,79%	2,14%	-2,31%	9,30%	0,55%	2,27%	7,05%	0,18%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,50%	25,70%	3,31%	33,12%	19,17%	31,43%	8,23%	0,22%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,73%	-0,47%	-2,29%	11,85%	-2,06%	-7,98%	7,14%	0,20%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7,66%	39,29%	11,58%	45,55%	32,33%	58,35%	8,10%	0,22%

IBX (Benchmark)	0,84%	5,50%	-1,02%	13,78%	5,09%	3,69%	-	-
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	-1,08%	4,64%	-0,98%	14,05%	0,49%	5,59%	9,03%	0,21%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	-0,07%	13,43%	0,89%	8,50%	19,88%	26,93%	3,11%	0,07%

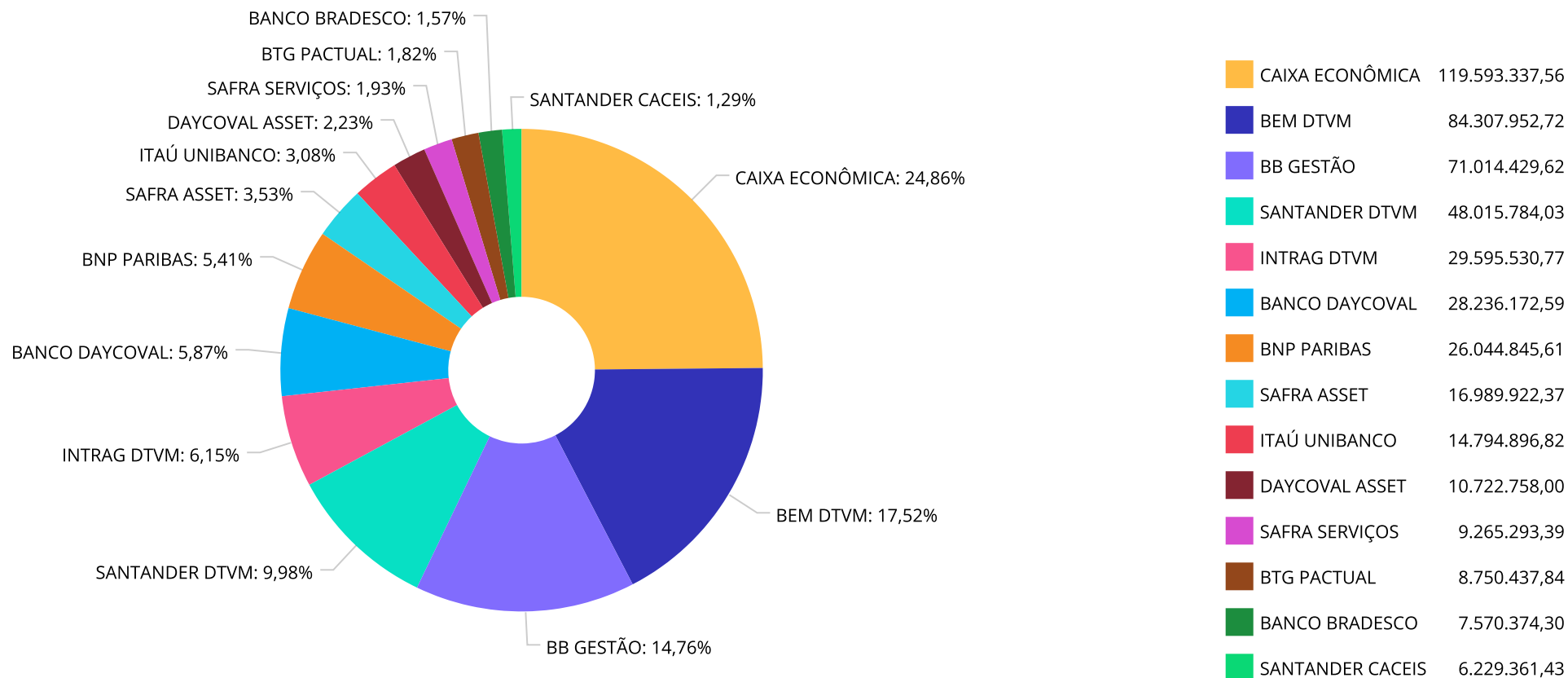
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	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%	-	-
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%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,06%	5,86%	-3,41%	11,98%	2,07%	-11,33%	9,04%	0,19%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,31%	9,82%	2,28%	6,29%	10,76%	-	0,67%	0,03%

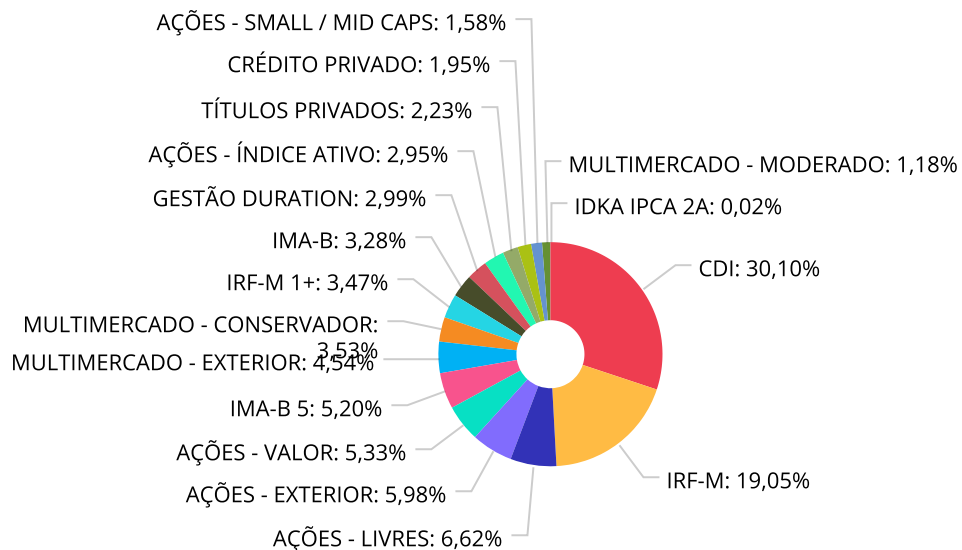
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,80%	10,06%	2,42%	4,91%	14,38%	-13,81%	5,14%	20,560%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,03%	18,24%	-1,41%	5,62%	20,40%	-18,54%	5,70%	23,726%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,78%	5,21%	-0,07%	0,75%	11,10%	-12,63%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-3,09%	-3,95%	-2,15%	-5,97%	3,46%	-19,07%	4,69%	20,627%
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%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,45%	1,53%	0,98%	0,08%	8,79%	-11,19%	4,44%	21,872%

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



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

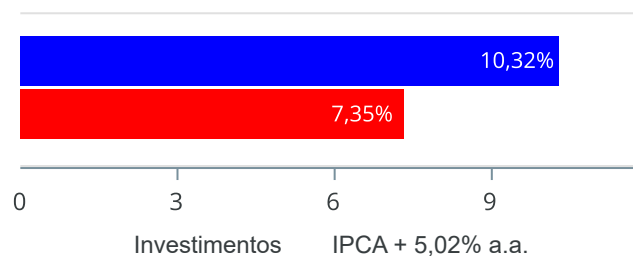


■ CDI	144.825.374,53	■ IRF-M	91.631.474,37	■ AÇÕES - LIVRES	31.873.472,90
■ AÇÕES - EXTERIOR	28.750.304,83	■ AÇÕES - VALOR	25.640.306,21	■ IMA-B 5	25.012.438,11
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	21.827.542,87	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	16.989.922,37	■ IRF-M 1+	16.680.764,73
■ IMA-B	15.794.164,70	■ GESTÃO DURATION	14.378.648,56	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.205.111,67
■ TÍTULOS PRIVADOS	10.722.758,00	■ CRÉDITO PRIVADO	9.404.098,68	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.611.691,83
■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.694.900,49	■ IDKA IPCA 2A	88.122,20		

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	412.396.291,87	15.444.363,04	10.882.802,49	424.062.538,44	7.104.686,02	7.104.686,02	1,70%	1,70%	0,96%	0,96%	177,35%	2,84%
Fevereiro	424.062.538,44	14.238.389,30	11.728.733,81	424.360.562,78	-2.211.631,15	4.893.054,87	-0,52%	1,18%	1,19%	2,17%	54,33%	2,45%
Março	424.360.562,78	37.577.193,22	34.989.554,38	429.774.024,83	2.825.823,21	7.718.878,08	0,66%	1,85%	1,16%	3,35%	55,08%	2,65%
Abril	429.774.024,83	12.021.049,97	9.025.429,94	437.723.128,58	4.953.483,72	12.672.361,80	1,14%	3,01%	0,96%	4,35%	69,29%	2,47%
Mai	437.723.128,58	100.065.323,81	97.067.701,76	450.830.850,91	10.110.100,28	22.782.462,08	2,29%	5,38%	0,66%	5,04%	106,75%	2,58%
Junho	450.830.850,91	16.181.157,17	13.451.670,13	466.019.892,20	12.459.554,25	35.242.016,33	2,75%	8,27%	0,33%	5,38%	153,70%	2,40%
Julho	466.019.892,20	40.368.832,57	37.613.566,44	476.772.835,92	7.997.677,59	43.239.693,92	1,71%	10,12%	0,53%	5,94%	170,37%	2,20%
Agosto	476.772.835,92	8.413.646,07	6.682.715,05	478.660.740,07	156.973,13	43.396.667,05	0,03%	10,15%	0,68%	6,66%	152,50%	2,44%
Setembro	478.660.740,07	63.063.282,84	61.318.157,15	481.131.097,05	725.231,29	44.121.898,34	0,15%	10,32%	0,65%	7,35%	140,37%	2,43%

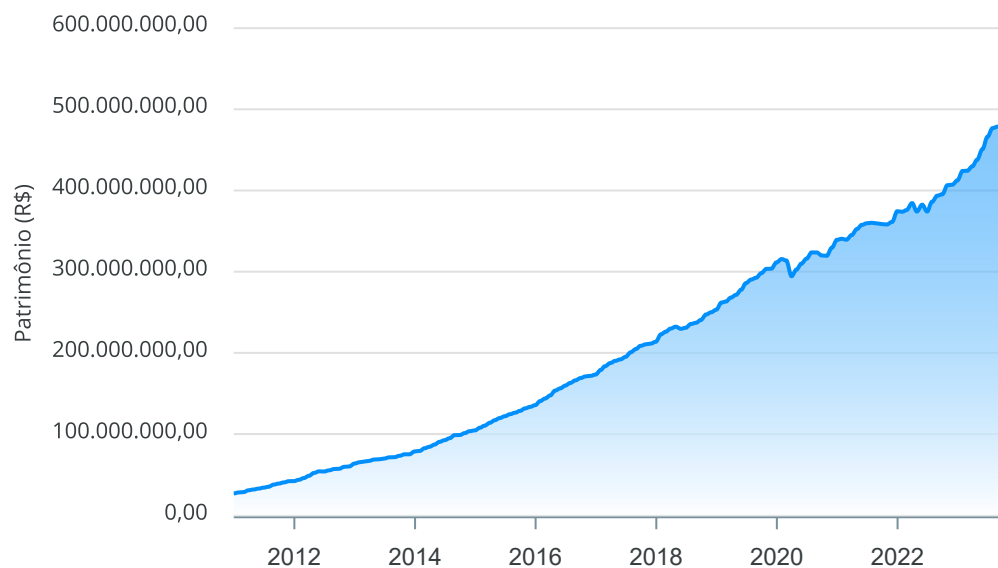
Investimentos x Meta de Rentabilidade



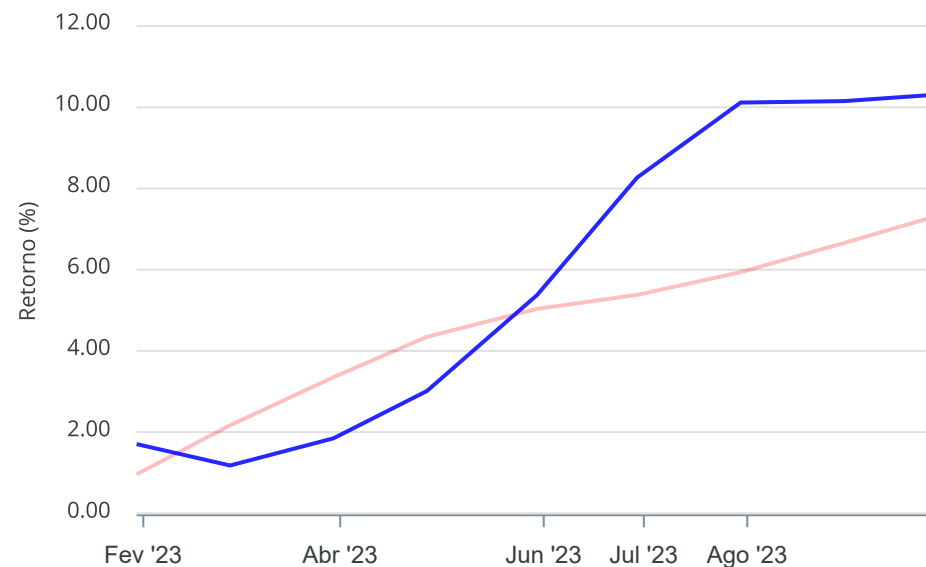
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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	9.287.392,32	0,00	0,00	9.404.098,68	116.706,36	1,26%	1,26%	0,09%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.022.615,10	0,00	0,00	20.244.095,61	221.480,51	1,11%	1,11%	0,33%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	24.529.162,88	0,00	0,00	24.781.171,39	252.008,51	1,03%	1,03%	0,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	47.530.989,51	0,00	0,00	48.015.784,03	484.794,52	1,02%	1,02%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.834.613,45	0,00	0,00	3.873.668,68	39.055,23	1,02%	1,02%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	17.959.854,68	0,00	0,00	18.134.062,04	174.207,36	0,97%	0,97%	0,01%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	10.636.623,97	0,00	0,00	10.722.758,00	86.134,03	0,81%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	82.911.519,88	0,00	57.000.000,00	26.528.504,97	616.985,09	0,74%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	87.809,72	0,00	0,00	88.122,20	312,48	0,36%	0,36%	0,74%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.351.984,66	5.063.282,84	3.260.728,93	3.173.156,28	18.617,71	0,29%	0,90%	0,01%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	41.681.641,32	0,00	0,00	41.739.849,25	58.207,93	0,14%	0,14%	1,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	14.777.293,74	0,00	0,00	14.794.896,82	17.603,08	0,12%	0,12%	0,98%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.131.205,00	0,00	1.057.428,22	74.931,53	1.154,75	0,10%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	50.000.000,00	0,00	49.891.625,12	-108.374,88	-0,22%	0,15%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	10.258.977,43	0,00	0,00	10.217.541,29	-41.436,14	-0,40%	-0,40%	1,47%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	16.820.525,64	0,00	0,00	16.680.764,73	-139.760,91	-0,83%	-0,83%	2,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.932.218,12	6.000.000,00	0,00	15.794.164,70	-138.053,42	-0,87%	-0,96%	2,51%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	14.518.753,92	0,00	0,00	14.378.648,56	-140.105,36	-0,96%	-0,96%	2,49%
Total Renda Fixa	327.273.181,34	61.063.282,84	61.318.157,15	328.537.843,88	1.519.536,85	0,46%		0,82%

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	9.451.689,40	0,00	0,00	10.175.212,88	723.523,48	7,65%	7,65%	8,10%
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	7.322.815,47	0,00	0,00	7.446.314,39	123.498,92	1,69%	1,69%	5,49%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.457.674,92	0,00	0,00	10.614.645,32	156.970,40	1,50%	1,50%	8,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.029.706,57	29.706,57	1,49%	-1,00%	7,67%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	16.820.469,06	0,00	0,00	16.989.922,37	169.453,31	1,01%	1,01%	0,13%
OCCAM FIC AÇÕES	8.727.760,38	0,00	0,00	8.796.299,46	68.539,08	0,79%	0,79%	7,05%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	14.102.015,53	0,00	0,00	14.205.111,67	103.096,14	0,73%	0,73%	7,14%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	5.489.910,76	0,00	0,00	5.506.730,73	16.819,97	0,31%	0,31%	0,67%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	5.698.912,59	0,00	0,00	5.694.900,49	-4.012,10	-0,07%	-0,07%	3,11%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.458.484,29	0,00	0,00	7.407.879,68	-50.604,61	-0,68%	-0,68%	7,23%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.692.895,31	0,00	0,00	7.611.691,83	-81.203,48	-1,06%	-1,06%	9,04%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	6.297.320,74	0,00	0,00	6.229.361,43	-67.959,31	-1,08%	-1,08%	9,03%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.886.109,71	0,00	0,00	4.814.359,38	-71.750,33	-1,47%	-1,47%	8,29%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9.151.893,91	0,00	0,00	8.750.437,84	-401.456,07	-4,39%	-4,39%	5,04%
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	7.928.888,75	0,00	0,00	7.570.374,30	-358.514,45	-4,52%	-4,52%	4,75%
Total Renda Variável	121.486.840,82	2.000.000,00	0,00	123.842.948,34	356.107,52	0,29%		5,75%

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.531.748,14	0,00	0,00	9.265.293,39	-266.454,75	-2,80%	-2,80%	5,14%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	875.067,62	0,00	0,00	848.045,51	-27.022,11	-3,09%	-3,09%	4,69%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.295.615,70	0,00	0,00	2.216.483,23	-79.132,47	-3,45%	-3,45%	4,44%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	6.931.418,54	0,00	0,00	6.670.012,03	-261.406,51	-3,77%	-3,77%	7,97%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.266.867,91	0,00	0,00	9.750.470,67	-516.397,24	-5,03%	-5,03%	5,70%
Total Exterior	29.900.717,91	0,00	0,00	28.750.304,83	-1.150.413,08	-3,85%		5,92%

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
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	80.974.240,68	0,00	57.000.000,00	26.528.504,97	2.554.264,29	3,15%	3,44%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	46.382.193,71	0,00	0,00	48.015.784,03	1.633.590,32	3,52%	3,52%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	23.997.525,36	0,00	0,00	24.781.171,39	783.646,03	3,27%	3,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	41.061.773,81	0,00	0,00	41.739.849,25	678.075,44	1,65%	1,65%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.202.346,34	0,00	579.819,06	20.244.095,61	621.568,33	3,08%	0,21%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	17.567.757,88	0,00	0,00	18.134.062,04	566.304,16	3,22%	3,22%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	9.031.639,08	0,00	0,00	9.404.098,68	372.459,60	4,12%	4,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	14.550.497,73	0,00	0,00	14.794.896,82	244.399,09	1,68%	1,68%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	10.497.831,69	0,00	0,00	10.722.758,00	224.926,31	2,14%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.745.529,20	0,00	0,00	3.873.668,68	128.139,48	3,42%	3,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	10.135.072,86	0,00	0,00	10.217.541,29	82.468,43	0,81%	0,81%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.680.995,00	14.702.051,13	13.273.215,96	3.173.156,28	63.326,11	0,39%	2,96%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.673.176,10	0,00	11.717.983,81	0,00	44.807,71	0,38%	2,95%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.317.370,56	950.000,00	2.199.709,46	74.931,53	7.270,43	0,32%	2,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	86.343,85	0,00	0,00	88.122,20	1.778,35	2,06%	2,06%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	16.684.739,51	0,00	0,00	16.680.764,73	-3.974,78	-0,02%	-0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	50.000.000,00	0,00	49.891.625,12	-108.374,88	-0,22%	1,77%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,00	14.500.000,00	0,00	14.378.648,56	-121.351,44	-0,84%	-0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.073.455,60	8.850.000,00	0,00	15.794.164,70	-129.290,90	-0,81%	-0,53%
Total Renda Fixa	316.662.488,96	89.002.051,13	84.770.728,29	328.537.843,88	7.644.032,08	2,38%	

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	9.119.179,07	0,00	0,00	10.175.212,88	1.056.033,81	11,58%	11,58%
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	0,00	13.895.806,90	6.947.903,45	7.446.314,39	498.410,94	3,59%	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	16.501.089,59	0,00	0,00	16.989.922,37	488.832,78	2,96%	2,96%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.274.888,71	0,00	0,00	10.614.645,32	339.756,61	3,31%	3,31%
TARPON INTERSECTION FIC AÇÕES	6.793.248,31	6.947.903,45	13.895.806,90	0,00	154.655,14	1,13%	8,75%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	5.383.938,51	0,00	0,00	5.506.730,73	122.792,22	2,28%	2,28%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	5.644.738,88	0,00	0,00	5.694.900,49	50.161,61	0,89%	0,89%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.029.706,57	29.706,57	1,49%	-4,46%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	6.291.198,92	0,00	0,00	6.229.361,43	-61.837,49	-0,98%	-0,98%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.907.118,68	0,00	0,00	8.750.437,84	-156.680,84	-1,76%	-1,76%
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	7.730.464,57	0,00	0,00	7.570.374,30	-160.090,27	-2,07%	-2,07%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.599.109,64	0,00	0,00	7.407.879,68	-191.229,96	-2,52%	-2,52%
OCCAM FIC AÇÕES	9.004.633,40	0,00	0,00	8.796.299,46	-208.333,94	-2,31%	-2,31%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.880.139,80	0,00	0,00	7.611.691,83	-268.447,97	-3,41%	-3,41%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.087.973,99	0,00	0,00	4.814.359,38	-273.614,61	-5,38%	-5,38%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	14.538.136,04	0,00	0,00	14.205.111,67	-333.024,37	-2,29%	-2,29%
Total Renda Variável	120.755.858,11	22.843.710,35	20.843.710,35	123.842.948,34	1.087.090,23	0,89%	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.045.998,29	0,00	0,00	9.265.293,39	219.295,10	2,42%	2,42%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	6.603.594,12	0,00	0,00	6.670.012,03	66.417,91	1,01%	1,01%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.194.984,63	0,00	0,00	2.216.483,23	21.498,60	0,98%	0,98%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	866.653,12	0,00	0,00	848.045,51	-18.607,61	-2,15%	-2,15%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.890.314,97	0,00	0,00	9.750.470,67	-139.844,30	-1,41%	-1,41%
Total Exterior	28.601.545,13	0,00	0,00	28.750.304,83	148.759,70	0,52%	

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.

