

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.



Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.010.157.844,42	40,61%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	3.413.170,66	0,14%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	10.775.309,25	0,43%	92	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	88.321.582,54	3,55%	873	1,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	1.225,31	0,00%	15.582	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	484.103.769,01	19,46%	1.116	3,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	115.984.133,15	4,66%	385	2,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	43.749.096,65	1,76%	20.043	3,81%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	36.709.886,62	1,48%	27.768	4,43%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	35.694.248,98	1,43%	19.831	2,64%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	25.773.982,67	1,04%	47	9,72%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	62.123.671,76	2,50%	139	14,39%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	34.385.316,18	1,38%	1.003	5,47%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	39.500.348,57	1,59%	201	5,46%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	61.053.233,67	2,45%	91	14,65%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	50.242.921,76	2,02%	15.711	3,05%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	45.807.810,32	1,84%	36	10,49%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	8.314.216,47	0,33%	17	5,53%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	988.075,51	0,04%	3.625	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.662.919,08	0,07%	159	1,12%	Artigo 8º, Inciso I



Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

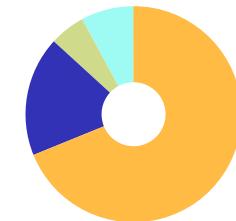
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	31.674.559,84	1,27%	103	2,66%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	27.701.524,89	1,11%	52	6,58%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	11.386.977,38	0,46%	620	17,42%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	5.244.139,01	0,21%	76	8,69%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	D+8	Não há	28.218.637,86	1,13%	4.394	4,68%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	22.859.679,78	0,92%	477	1,14%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	5.248.912,99	0,21%	377	0,76%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	95.969.309,84	3,86%	6.682	6,24%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	98.124.891,20	3,94%	627	8,74%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.446.800,00	0,10%		1,69%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução				2.487.638.195,37			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				14.445,48			Artigo 6º
			PL Total	2.487.652.640,85			



**CRÉDITO
& MERCADO**

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%	1.010.157.844,42	40,61%	10,00%	60,00%	100,00%	1.477.480.350,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	102.511.287,76	4,12%	0,00%	3,00%	90,00%	2.136.363.088,07
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.238.874.375,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	600.087.902,16	24,12%	2,00%	3,00%	65,00%	1.016.876.924,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.616.964.826,99
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	124.381.909,77
Total Renda Fixa	100,00%	1.712.757.034,34	68,85%	12,00%	66,00%	415,00%	



- █ RENDA FIXA 1.712.757.034,34
- █ RENDA VARIÁVEL 446.005.728,24
- █ EXTERIOR 132.334.431,75
- █ ESTRUTURADOS 194.094.201,04
- █ FUNDO IMOBILIÁRIO 2.446.800,00

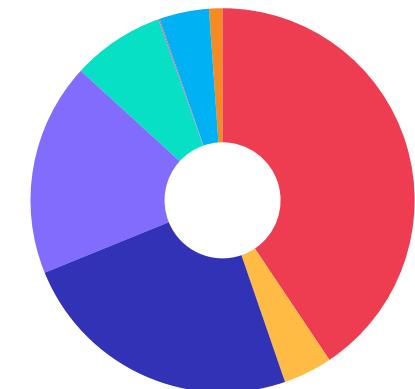


**CRÉDITO
& MERCADO**

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%	446.005.728,24	17,93%	0,00%	18,20%	35,00%	424.667.640,14
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	870.673.368,38
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	194.094.201,04	7,80%	0,00%	9,50%	10,00%	54.669.618,50
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	124.381.909,77
Artigo 11º	5,00%	2.446.800,00	0,10%	0,00%	0,30%	5,00%	121.935.109,77
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	642.546.729,28	25,83%	0,00%	28,00%	90,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	104.225.838,98	4,19%	0,00%	4,30%	10,00%	144.537.980,56
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	28.108.592,77	1,13%	0,00%	1,70%	10,00%	220.655.226,77
Total Exterior	10,00%	132.334.431,75	5,32%	0,00%	6,00%	20,00%	



█ 7º I a █ 7º I b █ 7º III a █ 8º I
█ 10º I █ 11º █ 9º II █ 9º III



Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	1.010.157.844,42	40,61	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	673.821.565,90	27,09	-
CAIXA DTVM	355.924.473,27	14,31	-
ITAÚ UNIBANCO	115.984.133,15	4,66	-
ITAÚ DTVM	104.364.948,55	4,20	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	103.369.030,21	4,16	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	87.897.654,43	3,53	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	28.218.637,86	1,13	-
BANCO J. SAFRA S/A	7.899.907,58	0,32	-

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)

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	1.010.157.844,42	40,61	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	102.511.287,76	4,12	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	600.087.902,16	24,12	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 8º, Inciso I	446.005.728,24	17,93	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	104.225.838,98	4,19	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	28.108.592,77	1,13	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	194.094.201,04	7,80	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.446.800,00	0,10	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00



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%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
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%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,76%	7,77%	2,53%	5,08%	10,50%	19,62%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,23%	3,54%	6,91%	13,89%	27,22%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,79%	3,08%	4,56%	11,72%	22,22%	0,33%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	8,79%	3,08%	4,57%	11,73%	22,62%	0,33%	0,02%



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%	-	-
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	0,70%	6,29%	-1,30%	14,45%	6,06%	5,06%	7,54%	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 FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,07%	5,26%	-1,86%	13,49%	3,70%	0,31%	7,48%	0,19%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-0,56%	6,28%	-1,60%	13,66%	-0,09%	-17,30%	7,86%	0,21%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01%	6,08%	-1,83%	14,99%	1,58%	-6,60%	7,55%	0,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20%	-4,19%	-2,66%	4,48%	-1,31%	-7,29%	5,34%	0,18%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-0,96%	0,53%	-4,77%	8,93%	-0,40%	-1,54%	8,76%	0,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,87%	3,35%	0,58%	10,91%	-3,14%	-16,56%	8,29%	0,21%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,47%	4,43%	-0,70%	13,47%	1,94%	0,42%	7,60%	0,20%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-1,20%	7,77%	-1,54%	14,21%	-0,24%	-19,93%	8,09%	0,22%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	0,67%	5,94%	-1,29%	14,07%	5,77%	4,95%	7,41%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-0,74%	3,84%	-3,36%	12,23%	-0,73%	-12,46%	7,60%	0,20%
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%



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
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%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-4,67%	13,72%	-2,27%	5,40%	23,45%	10,63%	4,87%	0,16%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,44%	17,79%	-1,90%	8,26%	29,28%	17,25%	5,01%	0,17%



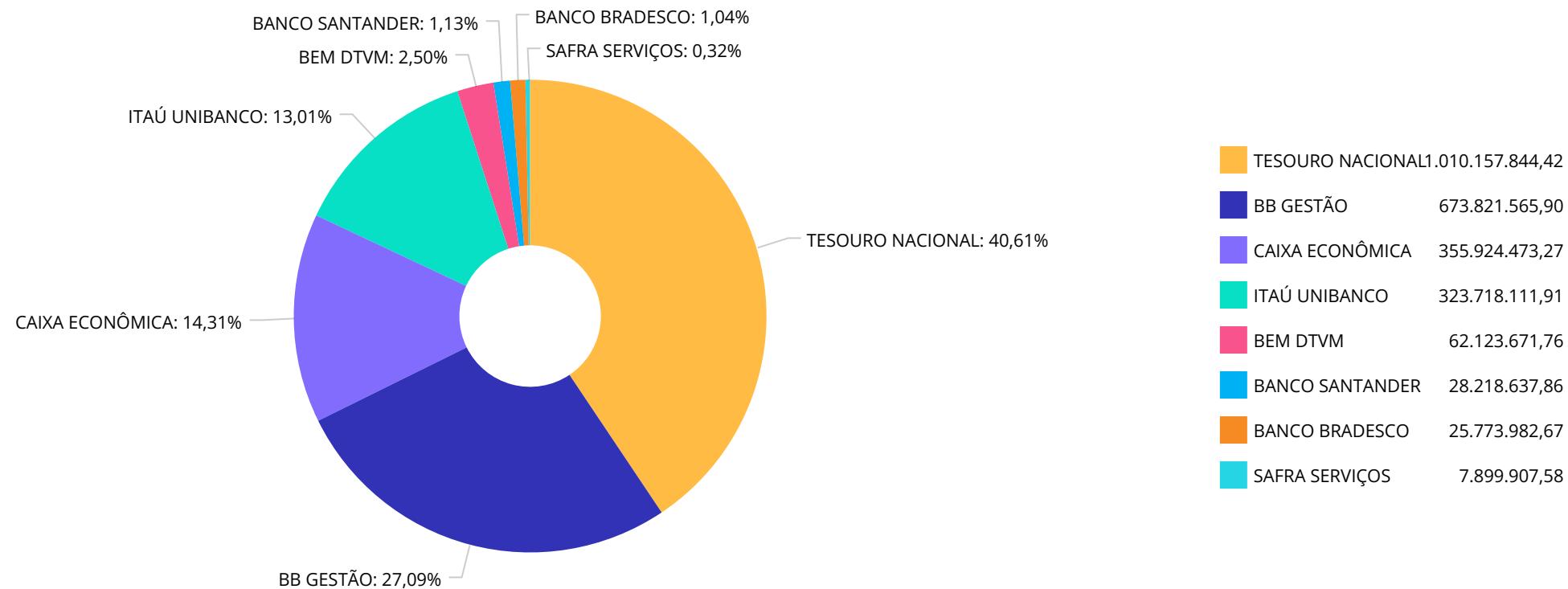
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
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%	-	-
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	-3,30%	3,49%	0,27%	-0,17%	10,05%	-25,79%	3,32%	19,204%
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%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,85%	7,20%	2,79%	2,26%	16,13%	-4,66%	4,03%	21,077%
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%
ITAU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-0,99%	-2,18%	1,86%	-2,12%	6,04%	-24,47%	4,52%	18,280%

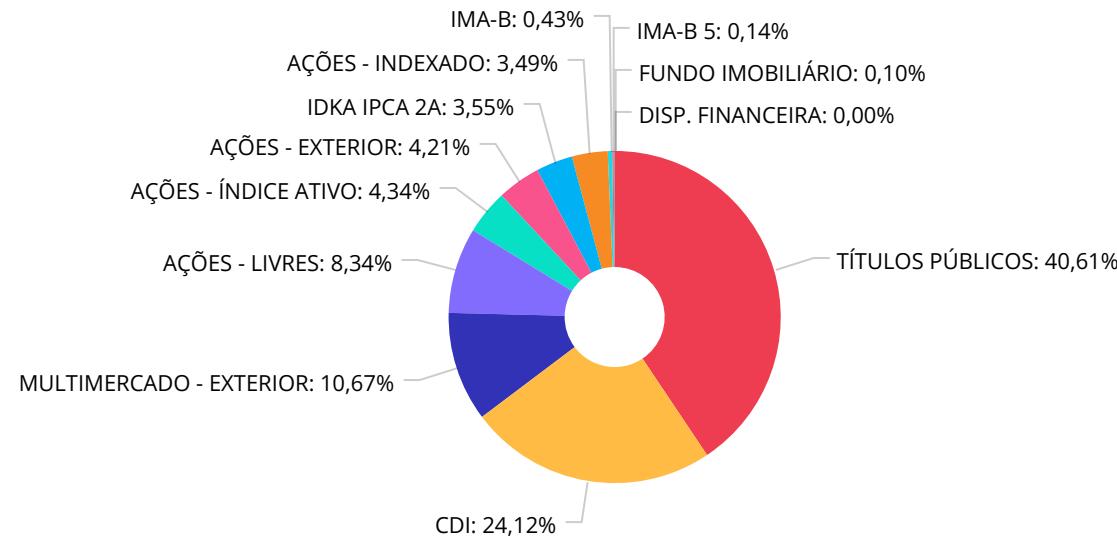


Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2023)





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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	1.010.157.844,42	■ CDI	600.089.127,47	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	265.374.376,12	■ AÇÕES - LIVRES	207.497.933,17
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	107.931.482,08	■ AÇÕES - EXTERIOR	104.803.353,32	■ IDKA IPCA 2A	88.321.582,54	■ AÇÕES - INDEXADO	86.827.216,34
■ IMA-B	10.775.309,25	■ IMA-B 5	3.413.170,66	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.446.800,00	■ DISP. FINANCEIRA	14.445,48



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/09/2023

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	14/06/2022	9.875	3.971,848591	4.177,627328	39.222.004,84	41.254.069,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	29/08/2022	7.642	3925,476529	4.153,195862	29.998.491,63	31.738.722,77	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	3.761	3988,237004	4.150,870043	14.999.759,37	15.611.422,23	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	1.254	3.988,237004	4.150,870043	5.001.249,20	5.205.191,03	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	2.515	3977,260022	4.140,932452	10.002.808,96	10.414.445,11	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	3.771	3.977,260022	4.140,932452	14.998.247,54	15.615.456,27	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/05/2023	9.712	4.118,503984	4.128,092769	39.998.910,69	40.092.036,97	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3.855,205568	4.193,008414	39.843.549,55	43.334.741,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4089,215327	4.180,525274	40.000.704,33	40.893.898,23	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4062,955171	4.153,175133	30.000.860,98	30.667.045,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4004,964372	4.202,572879	39.997.579,18	41.971.095,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.326,612424	39.997.709,63	43.469.475,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.312,90626	58.915.192,29	65.081.755,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4047,135758	4.272,144309	1.197.952,18	1.264.554,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.231,896443	1.984.874,49	2.107.484,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.261,580695	39.862.509,79	43.374.368,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.239,798424	39.994.357,14	43.351.938,88	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.205,267679	15.078.262,63	16.358.491,27	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4039,820802	4.272,077976	900.880,04	952.673,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.272,077976	2.086.995,07	2.221.480,54	Curva



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

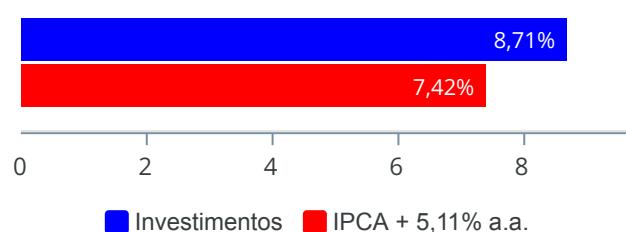
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/05/2022	4.840	4131,678715	4.321,716181	19.997.324,98	20.917.106,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4113,158402	4.296,791359	9.501.395,91	9.925.588,03	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4039,820802	4.272,077976	900.880,04	952.673,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.272,077976	2.086.995,07	2.221.480,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.229,9935	19.725.991,27	20.896.167,88	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.213,60912	39.229.327,99	41.251.233,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/02/2023	10.000	3.785,199052	3.929,817719	37.851.990,52	39.298.177,19	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3816,987204	3.929,817719	39.998.208,91	41.180.559,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.175,69951	19.846.240,66	21.087.282,52	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3851,268116	3.964,638673	39.999.270,65	41.176.737,25	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.157,515833	19.568.465,57	20.517.340,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.069,810476	19.536.375,31	20.446.727,83	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.052,638385	40.000.529,76	41.389.595,82	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	3.903,495747	38.836.282,35	40.311.400,57	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3792,196447	3.903,495747	40.003.880,32	41.177.976,63	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	2.228.676,184,81	156.376.748,48	133.604.967,93	2.300.984.841,17	49.536.875,81	49.536.875,81	2,20%	2,20%	0,97%	0,97%	227,21%	5,89%
Fevereiro	2.300.984.841,17	228.773.683,89	228.216.386,55	2.285.153.296,15	-16.388.842,36	33.148.033,45	-0,71%	1,47%	1,20%	2,18%	67,56%	5,13%
Março	2.285.153.296,15	169.763.712,54	159.464.712,55	2.313.038.391,41	17.586.095,27	50.734.128,72	0,77%	2,25%	1,17%	3,37%	66,68%	5,96%
Abril	2.313.038.391,41	55.915.092,17	39.403.674,98	2.352.917.925,44	23.368.116,84	74.102.245,56	1,00%	3,28%	0,97%	4,38%	74,86%	5,37%
Maio	2.352.917.925,44	438.719.161,85	427.333.355,28	2.401.513.041,85	37.209.309,84	111.311.555,40	1,57%	4,90%	0,67%	5,07%	96,63%	3,98%
Junho	2.401.513.041,85	50.802.600,00	38.447.144,74	2.471.521.037,72	57.652.540,61	168.964.096,01	2,39%	7,41%	0,34%	5,42%	136,53%	3,54%
Julho	2.471.521.037,72	48.416.570,48	42.713.570,48	2.513.079.886,22	35.855.848,50	204.819.944,51	1,45%	8,96%	0,54%	5,99%	149,59%	3,29%
Agosto	2.513.079.886,22	46.803.376,65	62.288.049,02	2.492.695.308,12	-4.899.905,73	199.920.038,78	-0,19%	8,75%	0,69%	6,72%	130,27%	3,34%
Setembro	2.492.695.308,12	39.635.307,60	47.101.023,91	2.484.306.350,49	-923.241,32	198.996.797,46	-0,04%	8,71%	0,66%	7,42%	117,42%	3,31%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

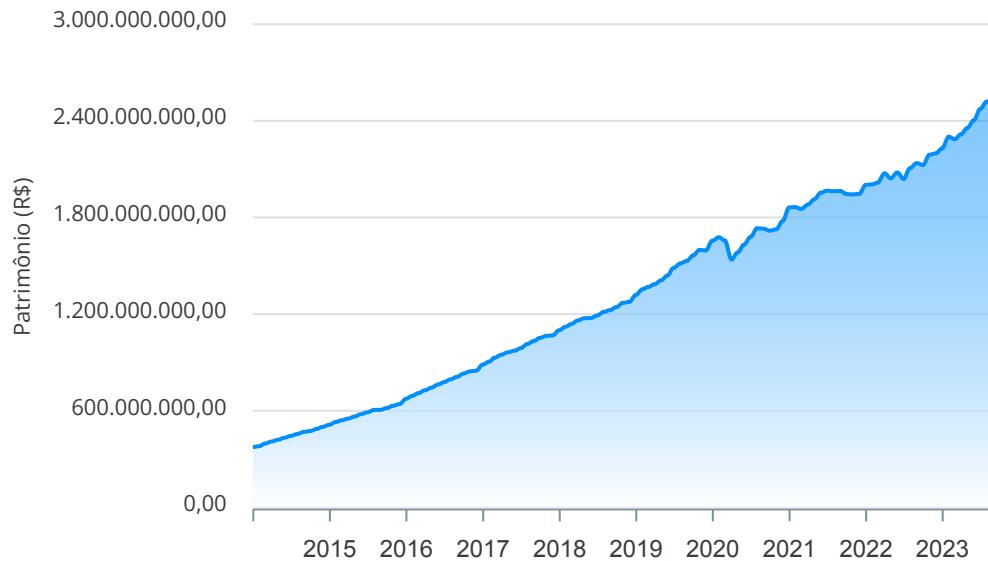




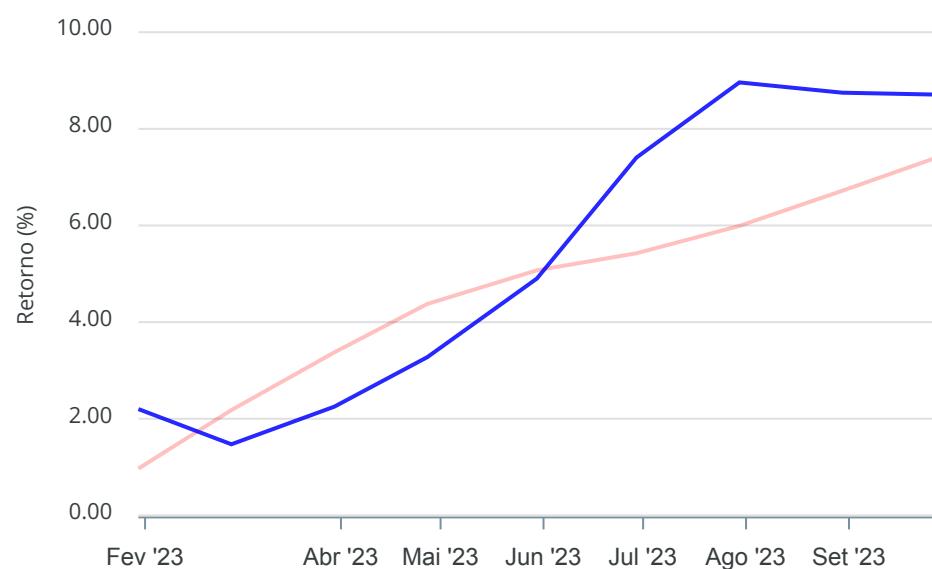
CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 SMILL IDIV



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.376.212,71	0,00	0,00	3.413.170,66	36.957,95	1,09%	1,09%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.658.641,79	0,00	0,00	10.775.309,25	116.667,46	1,09%	1,09%	0,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	114.776.993,50	0,00	0,00	115.984.133,15	1.207.139,65	1,05%	1,05%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	486.324.095,44	39.365.000,00	46.437.716,31	484.103.769,01	4.852.389,88	0,92%	0,97%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.002.870.544,44	0,00	0,00	1.010.157.844,42	7.287.299,98	0,73%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	87.991.390,21	17.100,00	0,00	88.321.582,54	313.092,33	0,36%	0,36%	0,74%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	423,07	1.031.207,60	1.031.207,60	1.225,31	802,24	0,08%	0,76%	0,01%
Total Renda Fixa	1.705.998.301,16	40.413.307,60	47.468.923,91	1.712.757.034,34	13.814.349,49	0,81%		0,11%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	36.393.614,37	0,00	0,00	36.709.886,62	316.272,25	0,87%	0,87%	8,29%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	25.593.765,49	0,00	0,00	25.773.982,67	180.217,18	0,70%	0,70%	7,54%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	60.646.929,20	0,00	0,00	61.053.233,67	406.304,47	0,67%	0,67%	7,41%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	35.527.130,49	0,00	0,00	35.694.248,98	167.118,49	0,47%	0,47%	7,60%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	45.775.921,10	0,00	0,00	45.807.810,32	31.889,22	0,07%	0,07%	7,48%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	34.387.689,73	0,00	0,00	34.385.316,18	-2.373,55	-0,01%	-0,01%	7,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	39.548.235,54	0,00	0,00	39.500.348,57	-47.886,97	-0,12%	-0,12%	8,45%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	50.345.024,37	0,00	0,00	50.242.921,76	-102.102,61	-0,20%	-0,20%	5,34%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.672.247,24	0,00	0,00	1.662.919,08	-9.328,16	-0,56%	-0,56%	7,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	8.376.032,28	0,00	0,00	8.314.216,47	-61.815,81	-0,74%	-0,74%	7,60%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	62.726.469,42	0,00	0,00	62.123.671,76	-602.797,66	-0,96%	-0,96%	8,76%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.000.096,26	0,00	0,00	988.075,51	-12.020,75	-1,20%	-1,20%	8,09%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.520.000,00	0,00	17.100,00	2.446.800,00	-56.100,00	-2,23%	-2,25%	4,56%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	102.685.888,97	0,00	0,00	98.124.891,20	-4.560.997,77	-4,44%	-4,44%	5,01%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	100.447.886,68	0,00	0,00	95.969.309,84	-4.478.576,84	-4,46%	-4,46%	5,00%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	45.892.451,50	0,00	0,00	43.749.096,65	-2.143.354,85	-4,67%	-4,67%	4,87%
Total Renda Variável	653.539.382,64	0,00	17.100,00	642.546.729,28	-10.975.553,36	-1,68%		6,61%



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 MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.296.434,92	0,00	0,00	5.244.139,01	-52.295,91	-0,99%	-0,99%	4,52%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	32.272.282,85	0,00	0,00	31.674.559,84	-597.723,01	-1,85%	-1,85%	4,03%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	29.028.311,01	0,00	0,00	28.218.637,86	-809.673,15	-2,79%	-2,79%	3,43%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.399.863,18	0,00	0,00	5.248.912,99	-150.950,19	-2,80%	-2,80%	5,14%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	28.584.205,67	0,00	0,00	27.701.524,89	-882.680,78	-3,09%	-3,09%	4,69%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	11.775.180,19	0,00	0,00	11.386.977,38	-388.202,81	-3,30%	-3,30%	3,32%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	23.707.184,44	0,00	0,00	22.859.679,78	-847.504,66	-3,57%	-3,57%	4,97%
Total Exterior	136.063.462,26	0,00	0,00	132.334.431,75	-3.729.030,51	-2,74%		4,20%



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	1.011.547.088,18	0,00	21.556.686,33	1.010.157.844,42	20.167.442,57	1,99%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	463.261.145,17	135.664.176,65	130.329.388,68	484.103.769,01	15.507.835,87	2,59%	3,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	112.015.345,07	0,00	0,00	115.984.133,15	3.968.788,08	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	86.487.722,89	52.200,00	0,00	88.321.582,54	1.781.659,65	2,06%	2,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.763.373,05	0,00	314.992,92	10.775.309,25	326.929,12	3,04%	3,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.409.070,51	0,00	99.497,40	3.413.170,66	103.597,55	3,04%	3,08%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	330,47	1.096.878,08	1.096.878,08	1.225,31	894,84	0,08%	2,53%
Total Renda Fixa	1.687.484.075,34	136.813.254,73	153.397.443,41	1.712.757.034,34	41.857.147,68	2,29%	



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
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	36.497.520,09	0,00	0,00	36.709.886,62	212.366,53	0,58%	0,58%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.360.400,00	0,00	52.200,00	2.446.800,00	138.600,00	5,87%	3,66%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.003.483,74	0,00	0,00	988.075,51	-15.408,23	-1,54%	-1,54%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.689.866,44	0,00	0,00	1.662.919,08	-26.947,36	-1,59%	-1,59%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	35.946.309,87	0,00	0,00	35.694.248,98	-252.060,89	-0,70%	-0,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	8.603.221,95	0,00	0,00	8.314.216,47	-289.005,48	-3,36%	-3,36%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	26.113.163,31	0,00	0,00	25.773.982,67	-339.180,64	-1,30%	-1,30%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	35.027.421,77	0,00	0,00	34.385.316,18	-642.105,59	-1,83%	-1,83%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	40.178.751,91	0,00	0,00	39.500.348,57	-678.403,34	-1,69%	-1,69%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	61.850.268,14	0,00	0,00	61.053.233,67	-797.034,47	-1,29%	-1,29%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	46.675.276,80	0,00	0,00	45.807.810,32	-867.466,48	-1,86%	-1,86%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	44.766.780,02	0,00	0,00	43.749.096,65	-1.017.683,37	-2,27%	-2,27%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	51.616.760,39	0,00	0,00	50.242.921,76	-1.373.838,63	-2,66%	-2,66%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	97.816.549,69	0,00	0,00	95.969.309,84	-1.847.239,85	-1,89%	-1,89%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	100.027.480,90	0,00	0,00	98.124.891,20	-1.902.589,70	-1,90%	-1,90%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	65.236.997,07	0,00	0,00	62.123.671,76	-3.113.325,31	-4,77%	-4,77%
Total Renda Variável	655.410.252,09	0,00	52.200,00	642.546.729,28	-12.811.322,81	-1,95%	



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	30.816.294,60	0,00	0,00	31.674.559,84	858.265,24	2,79%	2,79%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.560.883,28	0,00	0,00	22.859.679,78	298.796,50	1,32%	1,32%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	27.936.387,32	0,00	0,00	28.218.637,86	282.250,54	1,01%	1,01%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.124.679,38	0,00	0,00	5.248.912,99	124.233,61	2,42%	2,42%
ITAU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.148.276,81	0,00	0,00	5.244.139,01	95.862,20	1,86%	1,86%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	11.356.074,61	0,00	0,00	11.386.977,38	30.902,77	0,27%	0,27%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	28.309.344,75	0,00	0,00	27.701.524,89	-607.819,86	-2,15%	-2,15%
Total Exterior	131.251.940,75	0,00	0,00	132.334.431,75	1.082.491,00	0,82%	

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.

