

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

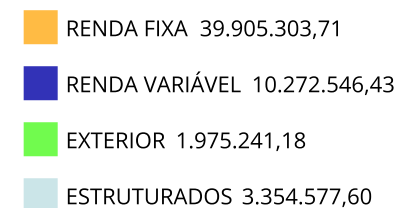
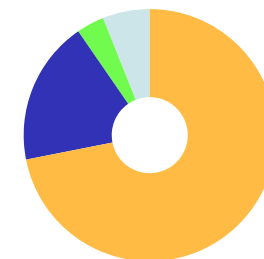
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	2.938.415,87	5,29%	685	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.347.516,76	2,43%	903	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.192.553,00	9,35%	794	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	56.834,92	0,10%	638	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	555.299,70	1,00%	1.132	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	2.079.932,99	3,75%	201	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.565.070,52	6,42%	794	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.928.906,49	8,88%	933	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.296.308,30	2,34%	782	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.363.102,12	6,06%	426	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	66.846,92	0,12%	333	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.985.705,67	8,98%	14.817	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.638.826,15	6,56%	999	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	3.401.336,86	6,13%	1.116	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.200.500,94	2,16%	152	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.098.254,55	1,98%	405	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	189.891,95	0,34%	603	5,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	857.829,82	1,55%	1.399	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	346.201,72	0,62%	151	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	416.236,90	0,75%	5.718	0,06%	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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	942.063,68	1,70%	2.619	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	1.071.790,30	1,93%	288	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.702.009,11	4,87%	15.711	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	24.790,78	0,04%	65	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
MAG BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	291.755,29	0,53%	1.902	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	Não há	1.568.470,30	2,83%	154	5,34%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	549.255,28	0,99%	1.263	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	482.935,00	0,87%	35	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.019.208,25	1,84%	4.432	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.595.564,43	2,87%	10.797	0,25%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	379.676,75	0,68%	1.882	0,40%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	651.849,08	1,17%	178	0,20%	Artigo 10º, Inciso I
BRANCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	668.122,73	1,20%	533	0,43%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.034.605,79	3,67%	4.179	1,08%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			55.507.668,92				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	16,88%	81,95%	45.488.534,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	30.376.493,26	54,72%	20,53%	27,37%	81,95%	15.112.041,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	9.528.810,45	17,17%	20,90%	23,65%	60,00%	23.775.790,90
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	11.101.533,78
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.775.383,45
Total Renda Fixa	100,00%	39.905.303,71	71,89%	41,43%	72,90%	248,90%	



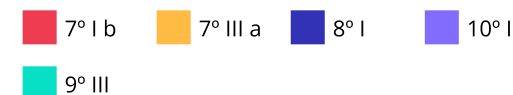
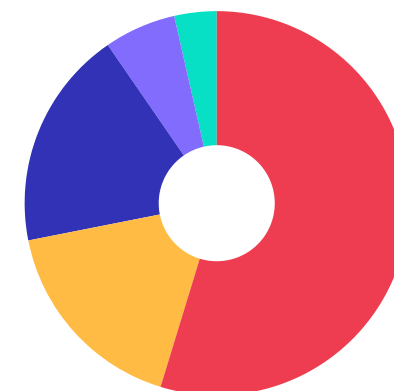
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	10.272.546,43	18,51%	17,00%	17,80%	30,00%	6.379.754,25
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.354.577,60	6,04%	3,75%	5,00%	10,00%	2.196.189,29
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	13.627.124,03	24,55%	20,75%	22,80%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.975.241,18	3,56%	3,00%	3,30%	10,00%	3.575.525,71
Total Exterior	10,00%	1.975.241,18	3,56%	3,00%	3,30%	10,00%	



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	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	30.376.493,26	54,72	20,53	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.528.810,45	17,17	20,90	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	10.272.546,43	18,51	17,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	1.975.241,18	3,56	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.354.577,60	6,04	3,75	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	20.236.026,59	36,46	-
CAIXA DTVM	15.995.759,04	28,82	-
SICREDI	8.185.412,93	14,75	0,01
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	3.106.476,64	5,60	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.868.623,67	3,37	0,00
MULTINVEST CAPITAL	1.568.470,30	2,83	0,07
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.502.143,25	2,71	0,02
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	1.071.790,30	1,93	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	942.063,68	1,70	0,04
OCCAM BRASIL	549.255,28	0,99	0,01
SOMMA INVESTIMENTOS	291.755,29	0,53	-
VANQUISH ASSET MANAGEMENT	189.891,95	0,34	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de 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%	2,28%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,92%	12,08%	-2,46%	8,17%	10,15%	15,88%	-	-
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,63%	-94,84%	-2,08%	-95,14%	-94,60%	-93,47%	0,07%	104,74%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,93%	10,18%	3,26%	6,64%	13,64%	25,17%	0,10%	0,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,81%	3,11%	6,35%	13,19%	24,03%	0,06%	0,36%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,11%	8,75%	1,65%	4,25%	11,41%	21,41%	0,99%	2,21%
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%	2,19%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-1,04%	10,57%	-0,65%	6,50%	10,63%	18,46%	2,66%	5,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	10,65%	-0,53%	6,49%	10,76%	18,68%	2,51%	4,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,56%	-0,64%	6,42%	10,75%	18,44%	2,52%	4,93%
IRF-M (Benchmark)	0,17%	11,62%	1,83%	7,45%	13,57%	22,67%	-	-

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
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	11,49%	1,77%	7,33%	13,46%	22,40%	1,12%	3,21%
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%	0,08%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,98%	9,89%	3,23%	6,48%	13,36%	25,66%	0,02%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,12%	2,96%	5,95%	12,33%	23,32%	0,01%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	11,72%	2,73%	7,91%	13,59%	23,82%	0,14%	2,28%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,14%	11,18%	1,58%	7,35%	12,82%	22,74%	0,98%	2,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	1,42%
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%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	9,25%	2,52%	5,77%	12,29%	24,46%	0,54%	1,09%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	-0,84%	4,69%	-3,14%	12,18%	2,76%	7,54%	7,29%	19,86%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,00%	6,85%	-4,46%	12,85%	1,02%	4,21%	7,67%	18,29%
OCCAM FIC AÇÕES	0,79%	2,14%	-2,31%	9,30%	0,55%	2,27%	7,05%	18,48%
MAG BRASIL FI AÇÕES	0,73%	-0,47%	-2,29%	11,85%	-2,06%	-7,98%	7,14%	19,64%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-0,56%	-2,40%	-5,44%	9,05%	-12,44%	-	9,55%	22,48%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,04%	9,55%	-2,31%	16,88%	7,47%	13,87%	7,48%	17,30%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	-1,13%	4,09%	-3,27%	11,56%	1,22%	10,10%	7,28%	20,31%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20%	-4,19%	-2,66%	4,48%	-1,31%	-7,29%	5,34%	18,50%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26%	2,02%	-1,96%	10,30%	-0,01%	-4,02%	7,72%	19,84%
IDIV (Benchmark)	1,32%	10,67%	1,25%	15,38%	14,16%	22,39%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,54%	9,82%	-0,27%	14,91%	9,96%	14,99%	6,43%	18,05%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,68%	-12,05%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	20,26%

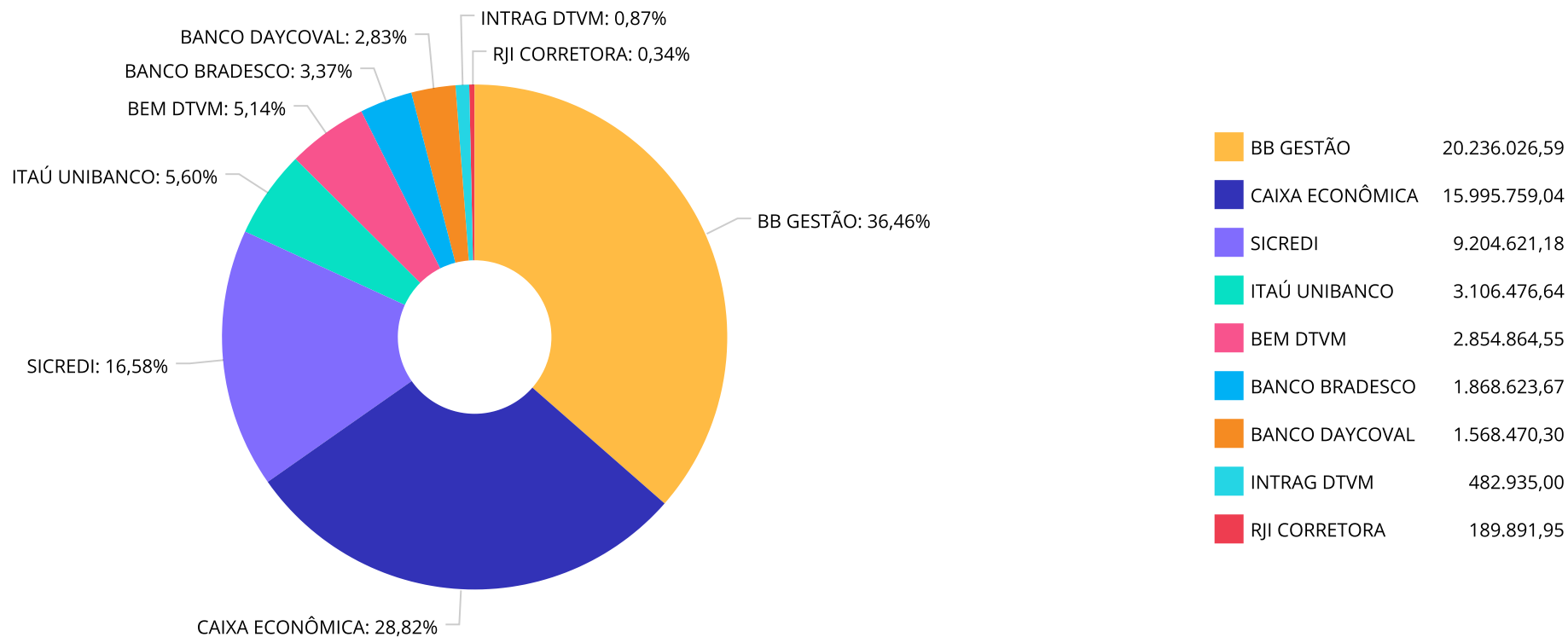
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	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%	-	-
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	-4,54%	13,82%	-2,15%	4,83%	24,64%	12,01%	5,03%	17,35%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	-4,42%	18,22%	-1,80%	8,52%	29,82%	17,99%	4,84%	17,18%
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%	24,20%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-2,87%	4,86%	-7,24%	15,55%	-3,23%	-21,52%	9,40%	24,94%

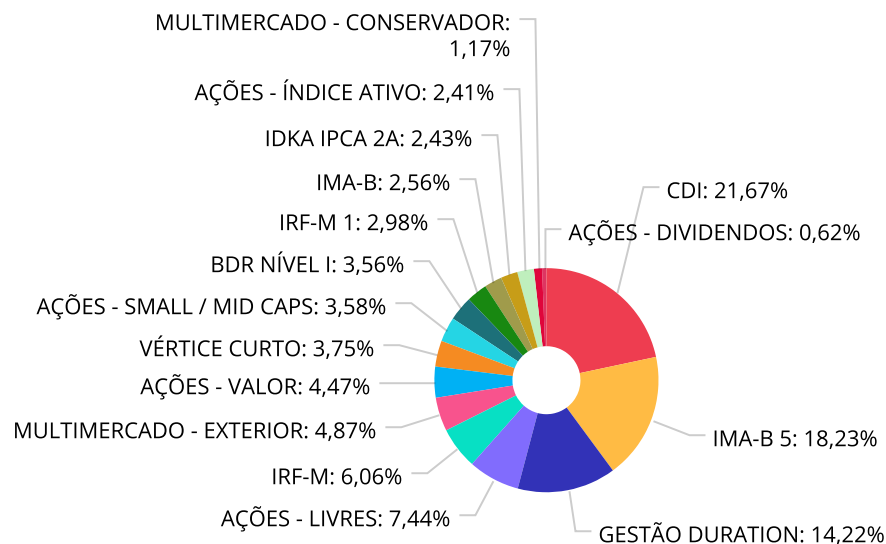
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,68%	-12,05%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	20,255%
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,00%	2,72%	3,43%	5,44%	9,64%	-5,49%	4,96%	19,288%

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



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

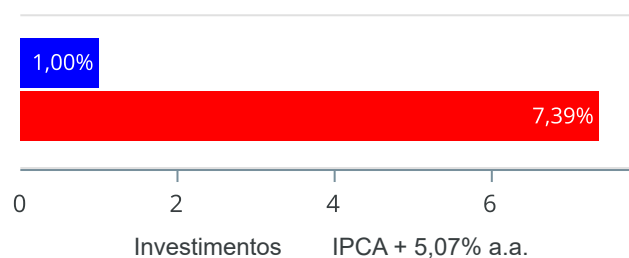


■ CDI	12.025.868,68	■ IMA-B 5	10.121.459,49	■ GESTÃO DURATION	7.893.879,28
■ AÇÕES - LIVRES	4.127.007,79	■ IRF-M	3.363.102,12	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.702.728,52
■ AÇÕES - VALOR	2.478.875,40	■ VÉRTICE CURTO	2.079.932,99	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.984.707,20
■ BDR NÍVEL I	1.975.241,18	■ IRF-M 1	1.653.554,25	■ IMA-B	1.419.990,14
■ IDKA IPCA 2A	1.347.516,76	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.335.754,32	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	651.849,08
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	346.201,72				

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	52.522.268,92	2.705.734,55	3.426.533,99	52.736.908,42	935.438,94	935.438,94	1,78%	1,78%	0,96%	0,96%	184,56%	3,13%
Fevereiro	52.736.908,42	2.972.435,67	2.289.062,08	53.074.340,49	-345.941,52	589.497,42	-0,65%	1,12%	1,20%	2,17%	51,62%	2,50%
Março	53.074.340,49	1.105.006,50	793.038,86	53.772.513,98	386.205,85	975.703,27	0,72%	1,85%	1,17%	3,36%	55,09%	2,73%
Abril	53.772.513,98	4.029.770,66	3.811.579,34	54.524.192,45	533.487,15	1.509.190,42	0,99%	2,86%	0,97%	4,36%	65,55%	2,52%
Mai	54.524.192,45	7.192.812,68	6.949.423,62	52.035.646,48	-2.731.935,03	-1.222.744,61	-4,99%	-2,27%	0,66%	5,06%	-44,92%	3,27%
Junho	52.035.646,48	2.651.636,54	2.541.342,06	53.519.442,27	1.373.501,31	150.756,70	2,63%	0,30%	0,33%	5,41%	5,61%	2,39%
Julho	53.519.442,27	3.076.318,23	2.659.567,62	54.704.194,82	768.001,94	918.758,64	1,42%	1,73%	0,53%	5,97%	29,01%	2,26%
Agosto	54.704.194,82	1.975.129,32	1.630.477,43	54.716.701,65	-332.145,06	586.613,58	-0,60%	1,12%	0,68%	6,69%	16,70%	2,25%
Setembro	54.716.701,65	630.848,89	352.986,73	54.931.208,48	-63.355,33	523.258,25	-0,12%	1,00%	0,65%	7,39%	13,55%	2,18%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



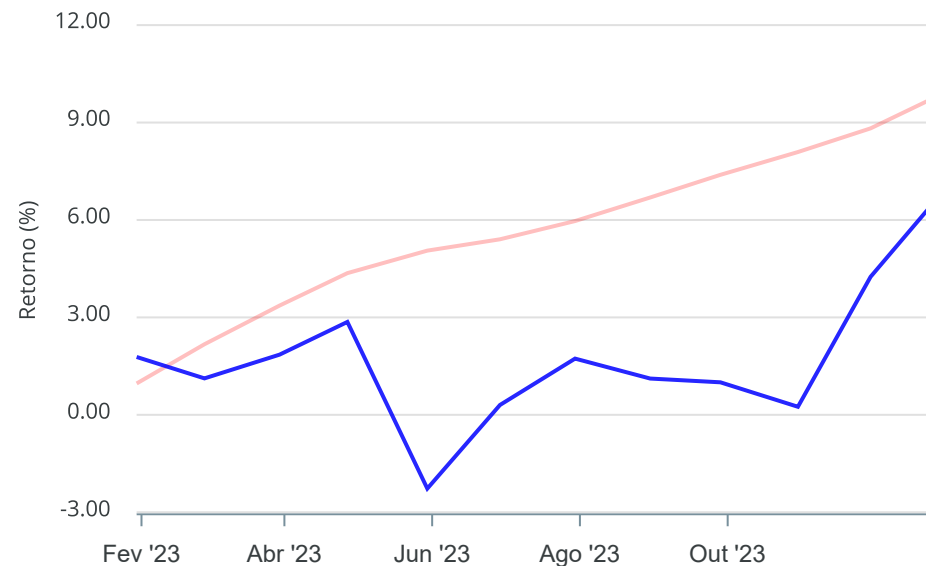
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.057.177,48	0,00	0,00	2.079.932,99	22.755,51	1,11%	1,11%	0,33%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	4.937.110,44	0,00	0,00	4.985.705,67	48.595,23	0,98%	0,98%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.413.920,76	1.340,93	46.937,24	3.401.336,86	33.012,41	0,97%	0,97%	0,01%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.088.137,18	0,00	0,00	1.098.254,55	10.117,37	0,93%	0,93%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.912.831,56	0,00	0,00	2.938.415,87	25.584,31	0,88%	0,88%	0,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	900.389,24	0,00	352.924,93	555.299,70	7.835,39	0,87%	0,90%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.980.226,77	630.848,89	61,80	3.638.826,15	27.812,29	0,77%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.550.731,58	0,00	0,00	3.565.070,52	14.338,94	0,40%	0,40%	0,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.344.670,08	0,00	0,00	1.347.516,76	2.846,68	0,21%	0,21%	0,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.358.198,17	0,00	0,00	3.363.102,12	4.903,95	0,15%	0,15%	1,12%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.198.848,16	0,00	0,00	1.200.500,94	1.652,78	0,14%	0,14%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.923.396,62	0,00	0,00	4.928.906,49	5.509,87	0,11%	0,11%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.186.787,80	0,00	0,00	5.192.553,00	5.765,20	0,11%	0,11%	0,99%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	191.100,42	0,00	0,00	189.891,95	-1.208,47	-0,63%	-0,63%	0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.308.834,75	0,00	0,00	1.296.308,30	-12.526,45	-0,96%	-0,96%	2,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	57.390,98	0,00	0,00	56.834,92	-556,06	-0,97%	-0,97%	2,52%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	67.552,34	0,00	0,00	66.846,92	-705,42	-1,04%	-1,04%	2,66%
Total Renda Fixa	39.477.304,33	632.189,82	399.923,97	39.905.303,71	195.733,53	0,49%		0,58%

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 FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	646.461,47	0,00	0,00	651.849,08	5.387,61	0,83%	0,83%	0,54%
OCCAM FIC AÇÕES	544.975,59	0,00	0,00	549.255,28	4.279,69	0,79%	0,79%	7,05%
MAG BRASIL FI AÇÕES	289.637,82	0,00	0,00	291.755,29	2.117,47	0,73%	0,73%	7,14%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	344.345,54	0,00	0,00	346.201,72	1.856,18	0,54%	0,54%	6,43%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	855.613,15	0,00	0,00	857.829,82	2.216,67	0,26%	0,26%	7,72%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.071.398,90	0,00	0,00	1.071.790,30	391,40	0,04%	0,04%	7,48%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.707.500,08	0,00	0,00	2.702.009,11	-5.490,97	-0,20%	-0,20%	5,34%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	24.930,17	0,00	0,00	24.790,78	-139,39	-0,56%	-0,56%	9,55%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.027.867,54	0,00	0,00	1.019.208,25	-8.659,29	-0,84%	-0,84%	7,29%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	951.607,38	0,00	0,00	942.063,68	-9.543,70	-1,00%	-1,00%	7,67%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	488.452,40	0,00	0,00	482.935,00	-5.517,40	-1,13%	-1,13%	7,28%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	1.610.941,72	0,00	0,00	1.568.470,30	-42.471,42	-2,64%	-2,64%	8,74%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	428.523,46	0,00	0,00	416.236,90	-12.286,56	-2,87%	-2,87%	9,40%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	2.128.791,99	0,00	0,00	2.034.605,79	-94.186,20	-4,42%	-4,42%	4,84%
BRDESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	699.925,30	0,00	0,00	668.122,73	-31.802,57	-4,54%	-4,54%	5,03%
Total Renda Variável	13.820.972,51	0,00	0,00	13.627.124,03	-193.848,48	-1,40%		6,37%

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 I	383.518,83	0,00	0,00	379.676,75	-3.842,08	-1,00%	-1,00%	4,96%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.651.087,88	0,00	0,00	1.595.564,43	-55.523,45	-3,36%	-3,36%	5,58%
Total Exterior	2.034.606,71	0,00	0,00	1.975.241,18	-59.365,53	-2,92%		5,47%

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 TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	4.829.838,11	0,00	0,00	4.985.705,67	155.867,56	3,23%	3,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.321.509,26	106.137,07	134.257,43	3.401.336,86	107.947,96	3,15%	3,22%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.726.290,24	2.743.728,43	1.928.523,92	3.638.826,15	97.331,40	1,78%	2,96%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.108.296,64	0,00	0,00	5.192.553,00	84.256,36	1,65%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.848.040,42	0,00	0,00	4.928.906,49	80.866,07	1,67%	1,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.860.378,02	0,00	0,00	2.938.415,87	78.037,85	2,73%	2,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.497.245,66	0,00	0,00	3.565.070,52	67.824,86	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.304.632,82	0,00	0,00	3.363.102,12	58.469,30	1,77%	1,77%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.063.549,68	0,00	0,00	1.098.254,55	34.704,87	3,26%	3,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.322.329,21	0,00	0,00	1.347.516,76	25.187,55	1,90%	1,90%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.181.855,29	0,00	0,00	1.200.500,94	18.645,65	1,58%	1,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	585.933,54	649.012,78	696.922,72	555.299,70	17.276,10	1,40%	3,11%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.017.059,30	57.890,77	0,00	2.079.932,99	4.982,92	0,24%	0,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	57.202,72	0,00	0,00	56.834,92	-367,80	-0,64%	-0,64%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	67.285,13	0,00	0,00	66.846,92	-438,21	-0,65%	-0,65%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	193.930,66	0,00	0,00	189.891,95	-4.038,71	-2,08%	-2,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.303.260,13	0,00	0,00	1.296.308,30	-6.951,83	-0,53%	-0,53%
Total Renda Fixa	38.288.636,83	3.556.769,05	2.759.704,07	39.905.303,71	819.601,90	2,10%	

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 FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	635.824,07	0,00	0,00	651.849,08	16.025,01	2,52%	2,52%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	347.121,80	0,00	0,00	346.201,72	-920,08	-0,27%	-0,27%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	26.216,28	0,00	0,00	24.790,78	-1.425,50	-5,44%	-5,44%
MAG BRASIL FI AÇÕES	298.595,19	0,00	0,00	291.755,29	-6.839,90	-2,29%	-2,29%
OCCAM FIC AÇÕES	562.263,99	0,00	0,00	549.255,28	-13.008,71	-2,31%	-2,31%
BRDESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	682.794,02	0,00	0,00	668.122,73	-14.671,29	-2,15%	-2,15%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	482.935,00	-17.065,00	-3,41%	-3,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	874.969,78	0,00	0,00	857.829,82	-17.139,96	-1,96%	-1,96%
MULTINVEST FI AÇÕES	652.121,10	0,00	630.383,93	0,00	-21.737,17	-3,33%	-
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.412.236,29	0,00	1.387.201,21	0,00	-25.035,08	-1,77%	8,16%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.097.144,66	0,00	0,00	1.071.790,30	-25.354,36	-2,31%	-2,31%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	448.705,64	0,00	0,00	416.236,90	-32.468,74	-7,24%	-7,24%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.052.219,97	0,00	0,00	1.019.208,25	-33.011,72	-3,14%	-3,14%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	2.071.816,57	0,00	0,00	2.034.605,79	-37.210,78	-1,80%	-1,80%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	942.063,68	-57.936,32	-5,79%	-4,46%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.775.892,64	0,00	0,00	2.702.009,11	-73.883,53	-2,66%	-2,66%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	1.037.226,27	630.383,93	0,00	1.568.470,30	-99.139,90	-5,95%	-6,61%
Total Renda Variável	13.975.148,27	2.130.383,93	2.017.585,14	13.627.124,03	-460.823,03	-3,27%	

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 AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.573.876,46	0,00	0,00	1.595.564,43	21.687,97	1,38%	1,38%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	367.097,07	0,00	0,00	379.676,75	12.579,68	3,43%	3,43%
Total Exterior	1.940.973,53	0,00	0,00	1.975.241,18	34.267,65	1,77%	

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.

