

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

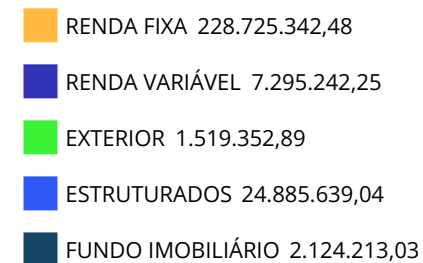
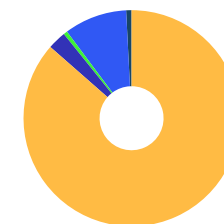
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	5.423.071,00	2,05%	685	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	300.776,18	0,11%	303	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	484.278,04	0,18%	303	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	33.842.743,44	12,79%	794	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	13.332.681,60	5,04%	873	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.929.034,53	8,29%	933	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	3.090.990,62	1,17%	291	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.300.458,19	2,76%	782	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	2.968.646,26	1,12%	156	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	15.463.872,10	5,85%	1.185	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.226.636,25	5,76%	247	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	12.387.993,18	4,68%	426	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	23.666.491,81	8,95%	721	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.266.391,64	0,86%	999	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	11.759.090,30	4,44%	226	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	7.169.952,76	2,71%	119	0,95%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	1.437,70	0,00%	362	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	16.693.305,01	6,31%	985	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	29.007.413,85	10,96%	426	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	6.410.078,02	2,42%	18	15,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	4.604.698,67	1,74%	201	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.766.620,80	0,67%	11.411	0,60%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA IBOVESA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	923.922,78	0,35%	1.713	1,33%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.519.352,89	0,57%	477	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.771.025,48	1,43%	114	0,60%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	9.168.918,74	3,47%	582	5,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.436.772,76	2,06%	6.682	0,35%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	6.508.922,04	2,46%	2.895	0,42%	Artigo 10º, Inciso I
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,02	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.124.213,03	0,80%		1,49%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			264.549.789,69				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			12.360,37				Artigo 6º
PL Total			264.562.150,06				

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

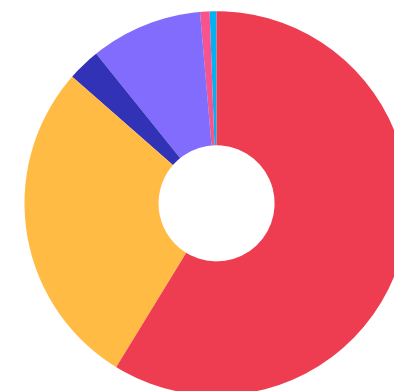
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	1,00%	20,10%	81,95%	216.798.552,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	155.417.673,20	58,75%	18,00%	20,30%	81,95%	61.380.879,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	73.307.669,28	27,71%	15,00%	20,10%	60,00%	85.422.204,53
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	52.909.957,94
Total Renda Fixa	100,00%	228.725.342,48	86,46%	34,00%	60,50%	243,90%	



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%	7.295.242,25	2,76%	3,00%	10,00%	20,00%	45.614.715,69
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	24.885.639,02	9,41%	7,50%	10,00%	10,00%	1.569.339,95
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,02	0,00%	1,00%	1,75%	5,00%	13.227.489,46
Artigo 11º	5,00%	2.124.213,03	0,80%	0,50%	1,75%	5,00%	11.103.276,45
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	34.305.094,32	12,97%	12,00%	23,50%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.519.352,89	0,57%	1,00%	10,00%	10,00%	24.935.626,08
Total Exterior	10,00%	1.519.352,89	0,57%	1,00%	10,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	248.025.259,80	93,75	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.990.238,82	3,02	-
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	6.410.078,02	2,42	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.124.213,03	0,80	-
ARENA CAPITAL	0,02	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 '	0,00	0,00	1,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	155.417.673,20	58,75	18,00	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	73.307.669,28	27,71	15,00	60,00
Artigo 8º, Inciso I	7.295.242,25	2,76	3,00	20,00
Artigo 10º, Inciso I	24.885.639,02	9,41	7,50	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,02	0,00	1,00	5,00
Artigo 11º	2.124.213,03	0,80	0,50	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	8,97%	2,05%	4,08%	11,42%	21,35%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	8,79%	2,06%	4,24%	11,36%	20,79%	0,74%	0,02%
IMA Geral (Benchmark)	0,18%	10,59%	1,80%	6,72%	12,50%	22,90%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	10,54%	1,67%	6,70%	12,49%	22,56%	1,03%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,15%	12,82%	1,26%	8,24%	14,06%	22,31%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,18%	12,55%	1,18%	8,11%	13,58%	21,42%	1,57%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,92%	12,08%	-2,46%	8,17%	10,15%	15,88%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,86%	11,75%	-2,38%	7,97%	9,75%	15,00%	3,94%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	9,92%	3,12%	6,37%	13,31%	24,16%	0,07%	0,00%
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%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,94%	0,43%	1,87%	5,73%	8,35%	0,33%	0,04%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,59%	-40,06%	-3,61%	-9,99%	-46,20%	-55,26%	0,11%	0,34%

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
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	10,65%	-0,53%	6,49%	10,76%	18,68%	2,51%	0,05%
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%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	10,15%	3,42%	6,85%	13,67%	26,52%	0,02%	0,00%
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%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,96%	9,74%	3,16%	6,34%	13,18%	25,23%	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%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	11,72%	2,73%	7,91%	13,59%	23,82%	0,14%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	9,91%	3,16%	6,49%	13,34%	25,92%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,45%	10,01%	2,08%	6,48%	12,18%	23,72%	0,54%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	-	3,12%	-	-	-	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%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,86%	9,52%	2,78%	6,24%	12,70%	26,54%	0,12%	0,00%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,85%	7,39%	1,94%	6,31%	9,60%	23,26%	1,95%	0,04%
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%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	0,66%	14,01%	2,70%	11,41%	18,57%	-	4,59%	0,07%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,48%	3,74%	-2,90%	10,63%	1,60%	-4,12%	7,87%	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%
IFIX (Benchmark)	0,20%	12,28%	2,03%	16,60%	7,64%	18,54%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	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%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	0,91%	9,99%	2,68%	5,60%	14,13%	32,70%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-

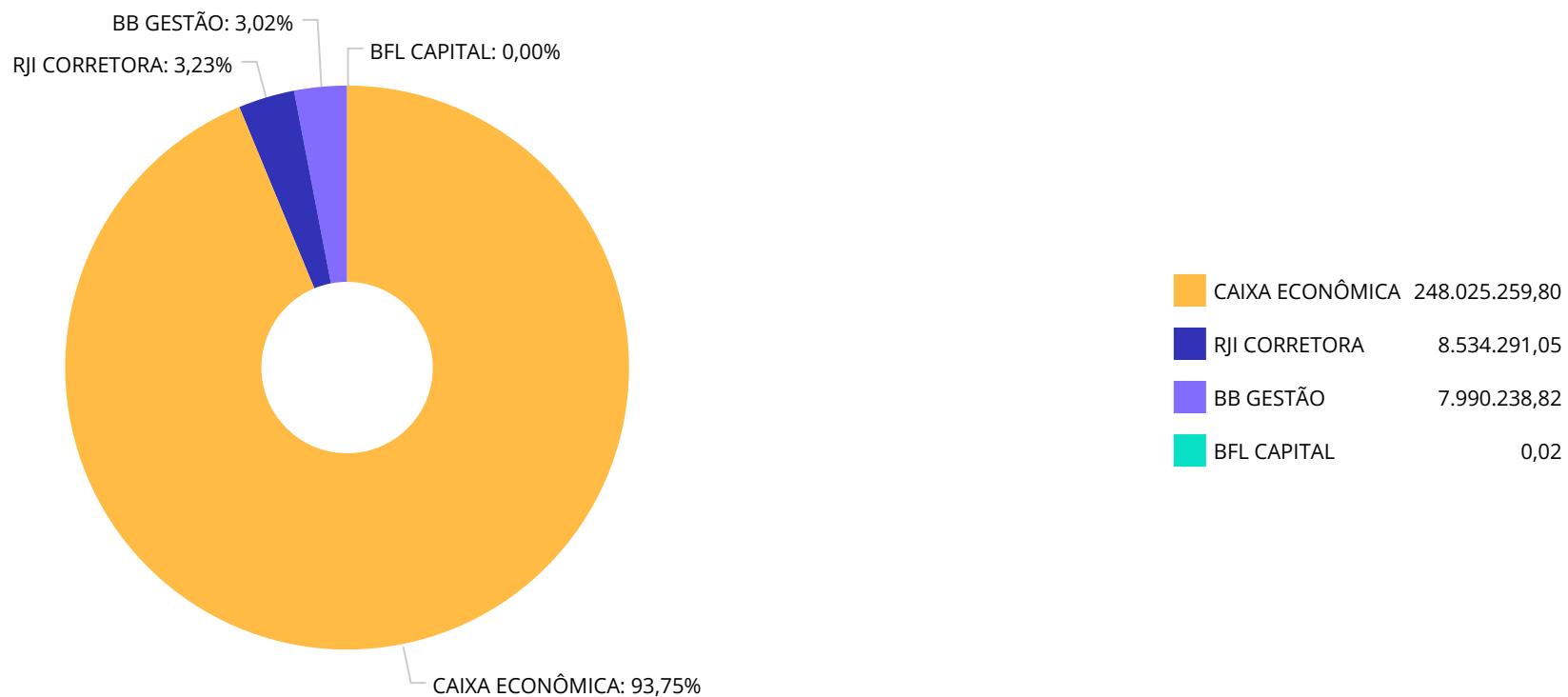
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	4,57%	-12,12%	-7,29%	11,25%	-13,96%	-	12,81%	0,33%

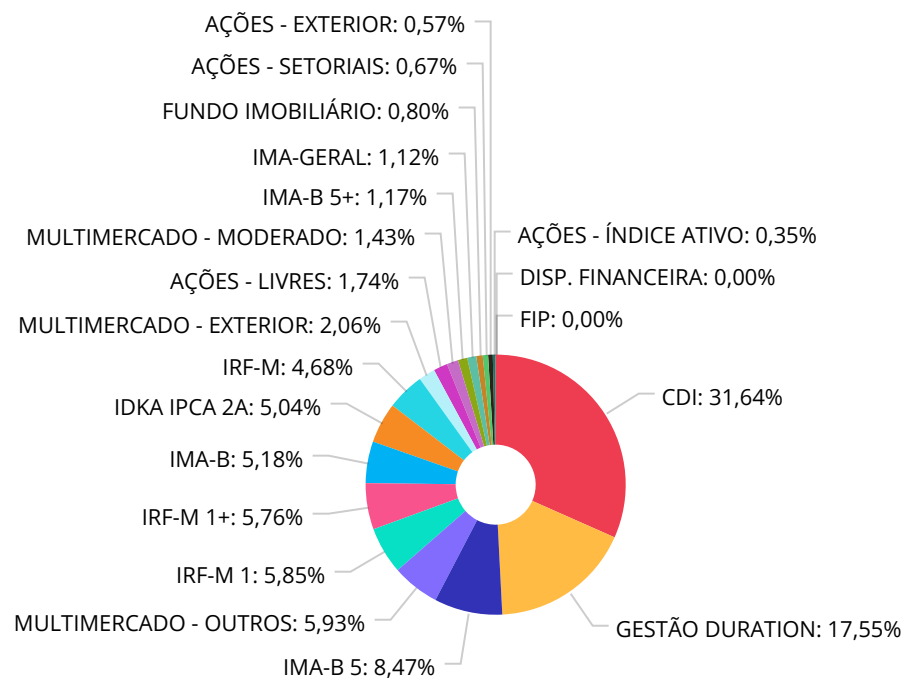
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%

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



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

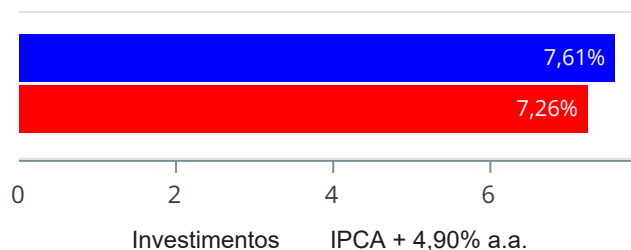


■ CDI	83.694.906,49	■ GESTÃO DURATION	46.435.767,20	■ IMA-B 5	22.413.312,57	■ MULTIMERCADO - OUTROS	15.677.840,78
■ IRF-M 1	15.463.872,10	■ IRF-M 1+	15.226.636,25	■ IMA-B	13.710.536,21	■ IDKA IPCA 2A	13.332.681,60
■ IRF-M	12.387.993,18	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	5.436.772,76	■ AÇÕES - LIVRES	4.604.698,67	■ MULTIMERCADO - MODERADO	3.771.025,48
■ IMA-B 5+	3.090.990,62	■ IMA-GERAL	2.968.646,26	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.124.213,03	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.766.620,80
■ AÇÕES - EXTERIOR	1.519.352,89	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	923.922,78	■ DISP. FINANCEIRA	12.360,37	■ FIP	0,02

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	230.898.376,17	2.192.192,19	2.498.507,02	233.353.491,72	2.761.430,38	2.761.430,38	1,20%	1,20%	0,95%	0,95%	125,79%	1,20%
Fevereiro	233.353.491,72	5.653.512,64	3.493.155,45	236.362.402,77	848.553,86	3.609.984,24	0,36%	1,56%	1,19%	2,15%	72,68%	1,36%
Março	236.362.402,77	10.977.112,94	9.097.801,52	237.873.711,25	-368.002,94	3.241.981,30	-0,15%	1,40%	1,15%	3,32%	42,25%	2,52%
Abril	237.873.711,25	4.479.585,41	3.139.510,01	241.643.865,44	2.430.078,79	5.672.060,09	1,02%	2,43%	0,95%	4,31%	56,49%	1,09%
Mai	241.643.865,44	8.612.970,61	6.200.011,16	247.018.090,43	2.961.265,54	8.633.325,63	1,21%	3,68%	0,65%	4,99%	73,74%	1,16%
Junho	247.018.090,43	19.476.735,54	17.045.083,45	254.127.636,66	4.677.894,14	13.311.219,77	1,88%	5,62%	0,32%	5,32%	105,63%	1,07%
Julho	254.127.636,66	4.603.675,06	2.786.760,11	258.755.794,76	2.811.243,15	16.122.462,92	1,10%	6,78%	0,52%	5,87%	115,55%	1,05%
Agosto	258.755.794,76	4.402.639,84	2.456.490,15	261.738.865,10	1.036.920,65	17.159.383,57	0,40%	7,21%	0,67%	6,58%	109,57%	1,11%
Setembro	261.738.865,10	3.711.992,71	1.885.439,98	264.549.789,69	984.371,86	18.143.755,43	0,37%	7,61%	0,64%	7,26%	104,77%	1,08%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

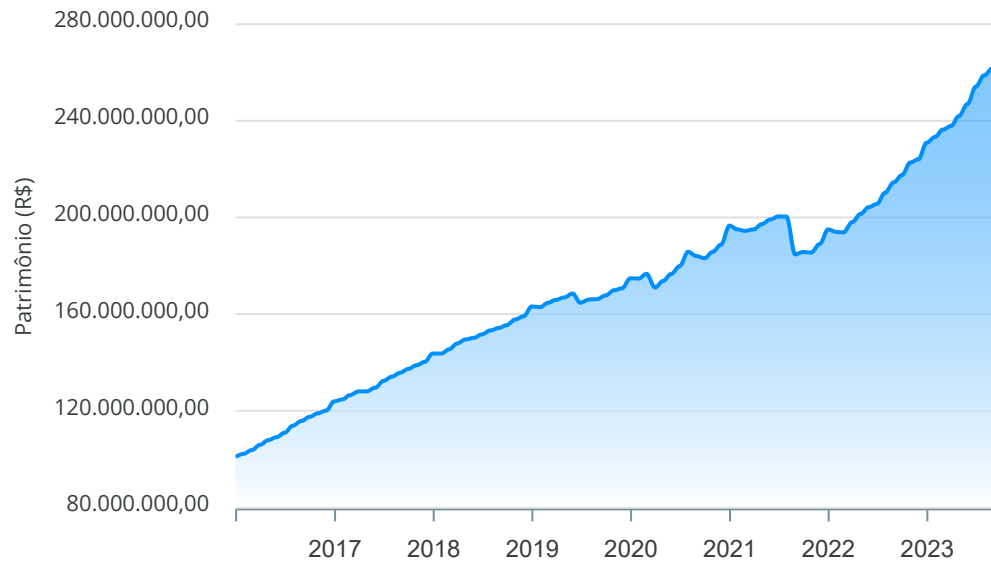




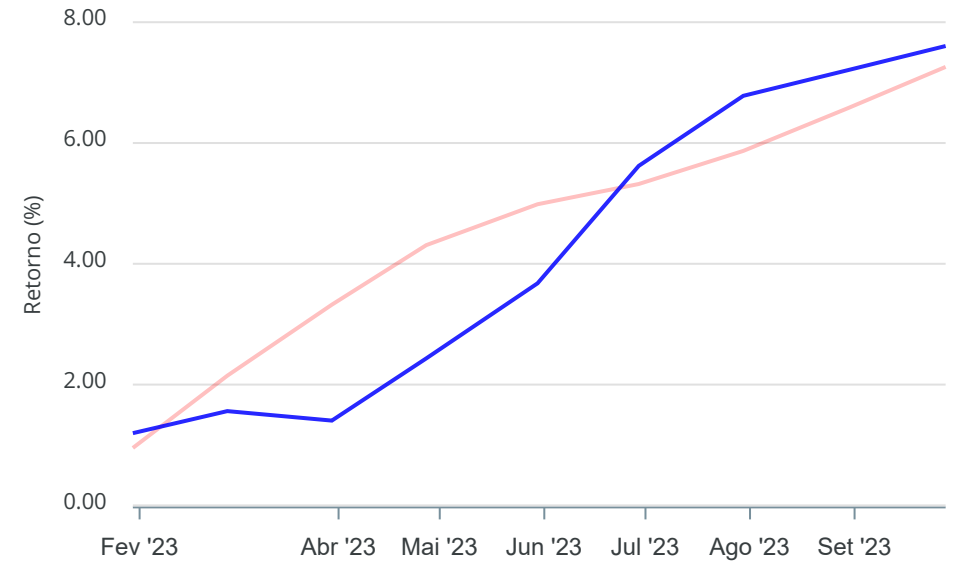
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	297.484,26	0,00	0,00	300.776,18	3.291,92	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	479.017,90	0,00	0,00	484.278,04	5.260,14	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.523.727,12	0,00	0,00	16.693.305,01	169.577,89	1,03%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	27.918.781,97	799.000,00	0,00	29.007.413,85	289.631,88	1,01%	1,02%	0,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	11.828.153,76	0,00	182.000,00	11.759.090,30	112.936,54	0,95%	0,96%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	23.442.946,57	0,00	0,00	23.666.491,81	223.545,24	0,95%	0,95%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.946.645,40	379.000,00	0,00	15.463.872,10	138.226,70	0,90%	0,91%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.095.292,74	151.309,55	0,00	2.266.391,64	19.789,35	0,88%	0,90%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	5.375.853,19	0,00	0,00	5.423.071,00	47.217,81	0,88%	0,88%	0,14%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	7.137.672,80	0,00	0,00	7.169.952,76	32.279,96	0,45%	0,45%	0,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	33.706.625,99	0,00	0,00	33.842.743,44	136.117,45	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.285.403,73	0,00	0,00	13.332.681,60	47.277,87	0,36%	0,36%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.191.977,39	1.772.119,51	0,00	2.968.646,26	4.549,36	0,15%	0,15%	1,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.369.929,46	0,00	0,00	12.387.993,18	18.063,72	0,15%	0,15%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.934.439,69	0,00	30.000,00	21.929.034,53	24.594,84	0,11%	0,11%	0,98%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	943,01	610.563,65	610.439,98	1.437,70	371,02	0,06%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.356.395,03	0,00	103.000,00	15.226.636,25	-26.758,78	-0,17%	-0,18%	1,57%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	6.447.974,50	0,00	0,00	6.410.078,02	-37.896,48	-0,59%	-0,59%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.371.003,71	0,00	0,00	7.300.458,19	-70.545,52	-0,96%	-0,96%	2,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.114.659,62	0,00	960.000,00	3.090.990,62	-63.669,00	-1,55%	-1,86%	3,94%



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
Total Renda Fixa	225.824.927,84	3.711.992,71	1.885.439,98	228.725.342,48	1.073.861,91	0,47%		0,57%

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
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	1.689.424,09	0,00	0,00	1.766.620,80	77.196,71	4,57%	4,57%	12,81%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	6.453.692,11	0,00	0,00	6.508.922,04	55.229,93	0,86%	0,86%	0,12%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.739.224,31	0,00	0,00	3.771.025,48	31.801,17	0,85%	0,85%	1,95%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	9.108.505,36	0,00	0,00	9.168.918,74	60.413,38	0,66%	0,66%	4,59%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	919.554,93	0,00	0,00	923.922,78	4.367,85	0,47%	0,47%	7,87%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,02	0,00	0,00	0,02	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.610.281,04	0,00	0,00	4.604.698,67	-5.582,37	-0,12%	-0,12%	8,45%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.127.084,35	0,00	0,00	2.124.213,03	-2.871,32	-0,13%	0,00%	0,00%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.690.489,34	0,00	0,00	5.436.772,76	-253.716,58	-4,46%	-4,46%	5,00%
Total Renda Variável	34.338.255,55	0,00	0,00	34.305.094,32	-33.161,23	-0,10%		4,26%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.575.681,71	0,00	0,00	1.519.352,89	-56.328,82	-3,57%	-3,57%	4,97%
Total Exterior	1.575.681,71	0,00	0,00	1.519.352,89	-56.328,82	-3,57%		4,97%

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 MATRIZ FI RENDA FIXA	26.407.919,76	1.678.119,51	0,00	29.007.413,85	921.374,58	3,28%	3,42%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	22.581.944,32	362.349,00	0,00	23.666.491,81	722.198,49	3,15%	3,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	33.198.891,18	0,00	0,00	33.842.743,44	643.852,26	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.137.639,96	0,00	0,00	16.693.305,01	555.665,05	3,44%	3,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.408.107,12	1.607.000,00	3.000,00	15.463.872,10	451.764,98	3,01%	3,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.698.449,10	236.000,00	1.369.139,51	21.929.034,53	363.724,94	1,59%	1,67%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	10.945.688,17	634.237,88	183.000,00	11.759.090,30	362.164,25	3,13%	3,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.074.981,71	100.000,00	110.000,00	13.332.681,60	267.699,89	2,03%	2,06%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.172.621,44	0,00	0,00	12.387.993,18	215.371,74	1,77%	1,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.875.616,16	479.000,00	1.317.119,51	15.226.636,25	189.139,60	1,16%	1,18%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	6.786.646,24	279.103,01	40.000,00	7.169.952,76	144.203,51	2,04%	2,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	5.257.669,00	21.574,85	0,00	5.423.071,00	143.827,15	2,72%	2,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.023.362,88	181.636,32	0,00	2.266.391,64	61.392,44	2,78%	2,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	300.303,00	0,00	8.759,36	300.776,18	9.232,54	3,07%	3,12%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	0,00	2.964.481,36	0,00	2.968.646,26	4.164,90	0,14%	1,67%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.205,05	2.963.805,68	2.967.671,86	1.437,70	3.098,83	0,10%	2,96%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	482.224,78	0,00	0,00	484.278,04	2.053,26	0,43%	0,43%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.033.826,33	311.000,00	0,00	7.300.458,19	-44.368,14	-0,60%	-0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.110.137,35	200.000,00	1.130.000,00	3.090.990,62	-89.146,73	-2,07%	-2,38%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	6.650.286,40	0,00	0,00	6.410.078,02	-240.208,38	-3,61%	-3,61%

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
Total Renda Fixa	219.148.519,95	12.018.307,61	7.128.690,24	228.725.342,48	4.687.205,16	2,09%	

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
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	8.927.616,29	0,00	0,00	9.168.918,74	241.302,45	2,70%	2,70%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	5.835.556,12	500.000,00	0,00	6.508.922,04	173.365,92	2,74%	2,78%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.699.369,32	0,00	0,00	3.771.025,48	71.656,16	1,94%	1,94%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,02	0,00	0,00	0,02	0,00	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.133.598,42	0,00	0,00	2.124.213,03	-9.385,39	-0,44%	-
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	951.502,82	0,00	0,00	923.922,78	-27.580,04	-2,90%	-2,90%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.485.006,41	200.000,00	0,00	4.604.698,67	-80.307,74	-1,71%	-1,69%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.541.421,02	0,00	0,00	5.436.772,76	-104.648,26	-1,89%	-1,89%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	1.905.552,70	0,00	0,00	1.766.620,80	-138.931,90	-7,29%	-7,29%
Total Renda Variável	33.479.623,12	700.000,00	0,00	34.305.094,32	125.471,20	0,37%	

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 FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.499.493,59	0,00	0,00	1.519.352,89	19.859,30	1,32%	1,32%
Total Exterior	1.499.493,59	0,00	0,00	1.519.352,89	19.859,30	1,32%	

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.

