

# 2023

## Relatório Mensal

# Outubro

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

| Ativo  | Saldo Atual   | % Carteira | PL R\$            | % PL  | Lei      |
|--|---------------|------------|-------------------|-------|----------|
| TÍTULOS PÚBLICOS   | 18.048.295,40 | 9,97%      | 0,00              |       | 7º I a   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 10.404.976,46 | 5,75%      | 5.052.854.726,15  | 0,21% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 177.180,06    | 0,10%      | 189.283.940,27    | 0,09% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO  | 6.097.279,50  | 3,37%      | 2.503.461.334,36  | 0,24% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 245.600,37    | 0,14%      | 49.730.198,24     | 0,49% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 2.126.553,94  | 1,18%      | 3.536.045.684,72  | 0,06% | 7º I b   |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA   | 2.930.144,46  | 1,62%      | 557.432.822,88    | 0,53% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA             | 3.047.037,86  | 1,68%      | 1.801.029.516,58  | 0,17% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA                   | 2.282.761,99  | 1,26%      | 790.012.856,98    | 0,29% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                 | 22.391.886,00 | 12,37%     | 5.136.324.306,86  | 0,44% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 1.494.840,46  | 0,83%      | 5.184.421.071,28  | 0,03% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP         | 1.842.787,25  | 1,02%      | 7.787.487.970,57  | 0,02% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 | 13.319.586,07 | 7,36%      | 12.230.065.528,97 | 0,11% | 7º I b   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                        | 2.039.200,44  | 1,13%      | 263.240.498,33    | 0,77% | 7º I b   |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                                 | 1.291.043,19  | 0,71%      | 303.682.805,99    | 0,43% | 7º I b   |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI     | 1.280.364,47  | 0,71%      | 1.956.756.289,21  | 0,07% | 7º I b   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                 | 137.169,00    | 0,08%      | 3.689.670.141,46  | 0,00% | 7º III a |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                 | 12.277.368,00 | 6,78%      | 8.965.211.424,43  | 0,14% | 7º III a |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                              | 8.084.807,56  | 4,47%      | 5.784.928.154,82  | 0,14% | 7º III a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP                   | 2.403.964,07  | 1,33%      | 1.249.572.305,42  | 0,19% | 7º III a |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA                                    | 811.052,67    | 0,45%      | 74.913.762,20     | 1,08% | 7º III a |
| PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI            | 4.357.508,18  | 2,41%      | 3.070.993.841,12  | 0,14% | 7º III a |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.941.666,29  | 1,07%      | 2.862.461.637,51  | 0,07% | 7º III a |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA                                 | 644.766,52    | 0,36%      | 48.601.625,35     | 1,33% | 7º III a |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA                                    | 599.979,84    | 0,33%      | 65.246.442,75     | 0,92% | 7º III a |
| LF BRADERCO 09/09/2024 IPCA + 6,79%                            | 5.625.355,06  | 3,11%      | 0,00              |       | 7º IV    |
| LF ITAU UNIBANCO 02/09/2024 IPCA + 7,09%                       | 5.652.768,09  | 3,12%      | 0,00              |       | 7º IV    |

**Investimentos**

\$ 180.951.393,93

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 66.990,59

**Total Carteira**

\$ 181.018.384,52

**Governança (Pró Gestão)**
 NIVEL 2 31/12/2025

| Ativo  | Saldo Atual  | % Carteira | PL R\$           | % PL  | Lei    |
|--|--------------|------------|------------------|-------|--------|
| LF SANTANDER 05/09/2024 IPCA + 6,79%                                 | 5.619.389,49 | 3,11%      | 0,00             |       | 7º IV  |
| INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL 1                                   | 0,01         | 0,00%      | 0,00             |       | 7º V a |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1                            | 66.244,97    | 0,04%      | 72.580.615,49    | 0,09% | 7º V a |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO                  | 6.195.233,34 | 3,42%      | 219.428.689,69   | 2,82% | 7º V b |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES  | 1.525.956,10 | 0,84%      | 730.788.793,77   | 0,21% | 8º I   |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES  | 2.186.938,71 | 1,21%      | 1.302.352.358,50 | 0,17% | 8º I   |
| BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES                                     | 2.583.899,14 | 1,43%      | 626.989.168,61   | 0,41% | 8º I   |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES                              | 2.334.625,53 | 1,29%      | 632.410.524,76   | 0,37% | 8º I   |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES                                      | 5.453.094,11 | 3,01%      | 721.013.694,58   | 0,76% | 8º I   |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                               | 1.112.246,14 | 0,61%      | 1.711.519.705,62 | 0,06% | 8º I   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                                 | 932.972,54   | 0,52%      | 306.871.135,96   | 0,30% | 8º I   |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES                      | 2.164.448,95 | 1,20%      | 234.370.892,30   | 0,92% | 8º I   |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES                                  | 1.164.658,65 | 0,64%      | 1.772.465.430,71 | 0,07% | 8º I   |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES           | 870.949,71   | 0,48%      | 51.652.370,46    | 1,69% | 9º II  |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES               | 371.024,01   | 0,21%      | 97.112.745,43    | 0,38% | 9º II  |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 1.269.120,95 | 0,70%      | 555.172.942,68   | 0,23% | 9º II  |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                             | 3.805.240,66 | 2,10%      | 1.935.277.303,73 | 0,20% | 9º III |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                             | 809.435,20   | 0,45%      | 1.436.932.092,12 | 0,06% | 10º I  |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO              | 3.253.199,52 | 1,80%      | 44.243.513,74    | 7,35% | 10º I  |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO                                  | 3.968.332,12 | 2,19%      | 520.571.054,03   | 0,76% | 10º I  |
| W7 FIP MULTISTRATÉGIA  | 2.615.765,02 | 1,45%      | 122.957.332,27   | 2,13% | 10º II |
| HAZ FII - ATR11  | 1.092.675,86 | 0,60%      | 0,00             |       | 11º    |

**Investimentos**

\$ 180.951.393,93

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 66.990,59

**Total Carteira**

\$ 181.018.384,52

**Governança (Pró Gestão)**
 NIVEL 2 31/12/2025

| Título             | Data Compra | Marcacao              | Qtde  | PU           | Valor \$     |
|--------------------|-------------|-----------------------|-------|--------------|--------------|
| NTN-B - 15/08/2024 | 19/11/2004  | A mercado             | 500   | 4.184,881962 | 2.092.440,98 |
| NTN-B - 15/08/2032 | 26/08/2022  | Curva - Taxa: 5,8150% | 1.008 | 4.261,989741 | 4.296.085,66 |
| NTN-B - 15/08/2040 | 26/08/2022  | Curva - Taxa: 5,8420% | 1.904 | 4.282,461495 | 8.153.806,69 |
| NTN-B - 15/05/2055 | 26/08/2022  | Curva - Taxa: 5,9220% | 788   | 4.325,441373 | 3.408.447,80 |
| NTN-B - 15/05/2055 | 21/11/2022  | Curva - Taxa: 6,0710% | 23    | 4.239,751748 | 97.514,29    |

## Investimentos

\$ 180.951.393,93


## Disponibilidades Financeiras

\$ 66.990,59

## Total Carteira

\$ 181.018.384,52

## Governança (Pró Gestão)

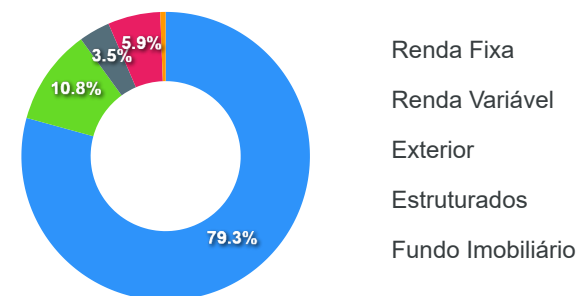
 NIVEL 2 31/12/2025

| Artigos  | Limite (%) | Utilizado | Livre                |
|--|------------|-----------|----------------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC                        | 100,00%    | 9,97%     | 18.048.295,40 90,03% |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN                      | 100,00%    | 39,21%    | 70.971.242,52 60,79% |
| 7º III a - FI Referenciados RF                   | 70,00%     | 17,27%    | 31.258.282,13 52,73% |
| 7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de... | 20,00%     | 9,33%     | 16.897.512,64 10,67% |
| 7º V a - FIDC Cota Sênior                        | 10,00%     | 0,04%     | 66.244,98 9,96%      |
| 7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado          | 10,00%     | 3,42%     | 6.195.233,34 6,58%   |
| 8º I - Fundos de Ações                           | 40,00%     | 10,75%    | 19.458.839,87 29,25% |
| 9º II - Constituídos no Brasil                   | 10,00%     | 1,39%     | 2.511.094,67 8,61%   |
| 9º III - Ações - BDR Nível I                     | 10,00%     | 2,10%     | 3.805.240,66 7,90%   |
| 10º I - Fundos Multimercados                     | 10,00%     | 4,44%     | 8.030.966,84 5,56%   |
| 10º II - Fundos em Participações (FIP)           | 5,00%      | 1,45%     | 2.615.765,02 3,55%   |
| 11º - Fundos Imobiliários                        | 10,00%     | 0,60%     | 1.092.675,86 9,40%   |

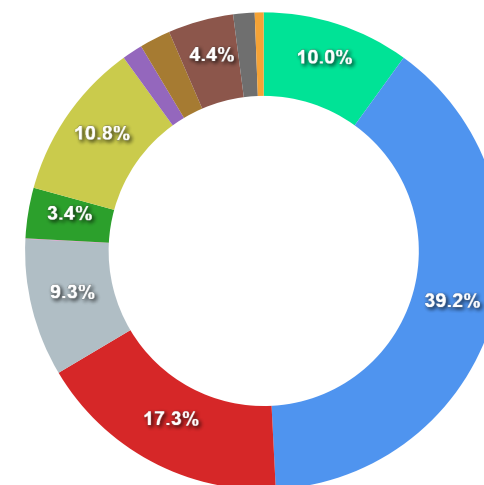
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 2 31/12/2025

Segmentos



Artigos



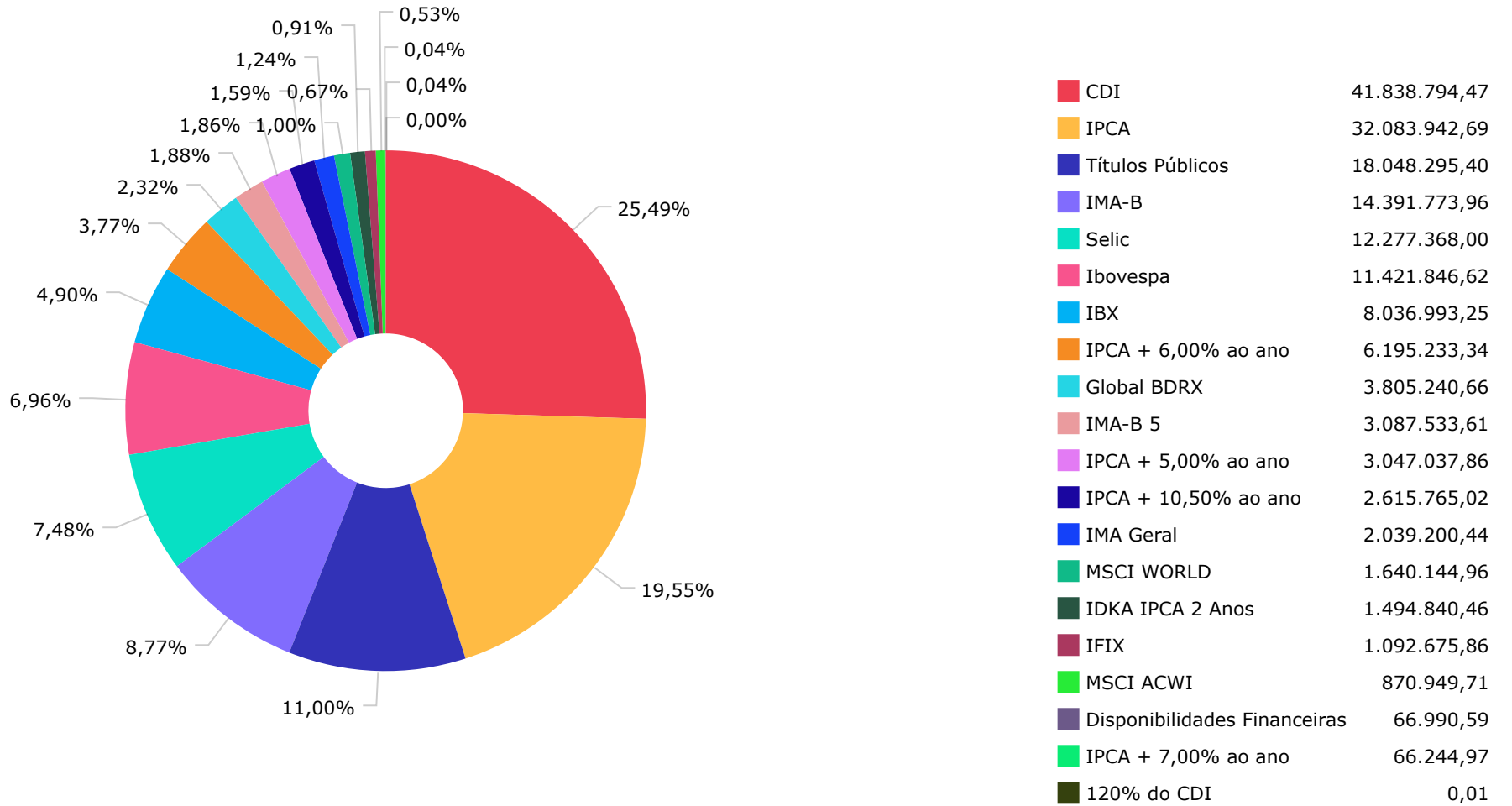
| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior   | Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior  |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|----------------|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC         | 9,97%  | 0,00%    | 10,00% | 100,00%  | 162.970.089,12 | 8° I - Fundos de Ações            | 10,75% | 0,00%    | 13,00% | 30,00%   | 34.846.675,49 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN       | 39,21% | 0,00%    | 25,00% | 100,00%  | 110.047.142,00 | 8° II - ETF de Ações              | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 30,00%   | 54.305.515,36 |
| 7° I c - ETF 100% Títulos TN      | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 100,00%  | 181.018.384,52 | 9° I - Renda Fixa - Dívida Ext... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 18.101.838,45 |
| 7° II - Operações Compromissad... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 9.050.919,23   | 9° II - Constituídos no Brasil    | 1,39%  | 0,00%    | 2,00%  | 10,00%   | 15.590.743,78 |
| 7° III a - FI Referenciados RF    | 17,27% | 0,00%    | 20,00% | 60,00%   | 77.352.748,58  | 9° III - Ações - BDR Nível I      | 2,10%  | 0,00%    | 3,00%  | 10,00%   | 14.296.597,79 |
| 7° III b - FI de Índices Refer... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 60,00%   | 108.611.030,71 | 10° I - Fundos Multimercados      | 4,44%  | 0,00%    | 3,00%  | 10,00%   | 10.070.871,61 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 9,33%  | 0,00%    | 15,00% | 20,00%   | 19.306.164,26  | 10° II - Fundos em Participaçõ... | 1,45%  | 0,00%    | 2,00%  | 5,00%    | 6.435.154,21  |
| 7° V a - FIDC Cota Sênior         | 0,04%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 8.984.674,25   | 10° III - Fundos de Ações - Me... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 9.050.919,23  |
| 7° V b - Fundos de RF - Crédit... | 3,42%  | 0,00%    | 3,00%  | 5,00%    | 2.855.685,89   | 11° - Fundos Imobiliários         | 0,60%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 7.958.243,37  |
| 7° V c - Fundos de Debentures ... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 9.050.919,23   | 12° - Empréstimos Consignados     | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 9.050.919,23  |

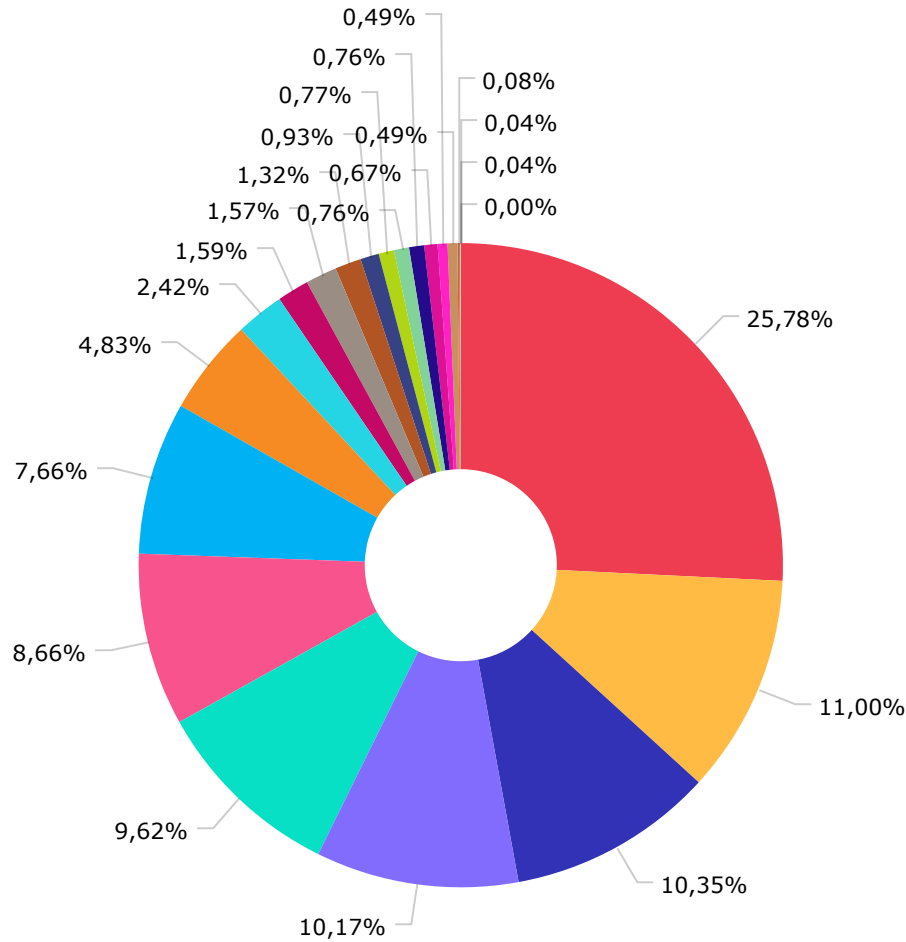
|  | Mês          | Ano          | 3M           | 6M          | 12M          | 24M           | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|--------------|--------------|--------------|-------------|--------------|---------------|-----------|--------------------|
| <b>120% DO CDI - BENCHMARK</b>                                 | <b>1,20</b>  | <b>13,37</b> | <b>3,78</b>  | <b>7,90</b> | <b>16,29</b> | <b>32,49</b>  |           |                    |
| INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL 1                             |              |              |              |             |              |               |           |                    |
| <b>CDI - BENCHMARK</b>   | <b>1,00</b>  | <b>11,02</b> | <b>3,14</b>  | <b>6,55</b> | <b>13,42</b> | <b>26,45</b>  |           |                    |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO                            | -1,74        | 15,49        | -6,97        | 4,18        | 16,47        | 6,69          | 7,16      | 15,09              |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,01         | 11,23        | 3,40         | 7,03        | 13,68        | 27,37         | 0,02      | 0,04               |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                              | 0,99         | 11,24        | 3,26         | 6,97        | 13,64        | 27,19         | 0,03      | 0,06               |
| PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI            | 0,95         | 10,99        | 3,16         | 6,60        | 13,39        | 26,54         | 0,02      | 0,05               |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI     | 0,96         | 11,01        | 3,15         | 6,60        | 13,36        | 26,37         | 0,02      | 0,04               |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 | 0,96         | 10,96        | 3,07         | 6,61        | 13,28        | 26,47         | 0,02      | 0,05               |
| ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP                   | 0,81         | 10,70        | 2,65         | 6,35        | 12,85        | 26,77         | 0,17      | 0,36               |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                 | 0,90         | 10,10        | 2,88         | 6,02        | 12,28        | 23,94         | 0,01      | 0,02               |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA                   | 0,91         | 9,76         | 2,89         | 5,95        | 11,80        | 22,71         | 0,00      | 0,00               |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO        | -3,07        | 16,98        | -7,58        | 6,39        | 8,14         |               | 5,29      | 11,13              |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                       | -0,41        | 7,92         | -0,30        | 4,88        | 7,71         | 21,83         | 2,40      | 5,06               |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                                 | <b>-1,57</b> | <b>15,39</b> | <b>-1,87</b> | <b>6,65</b> | <b>18,36</b> | <b>-16,13</b> |           |                    |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                       | -1,40        | 14,42        | -2,16        | 6,20        | 16,47        | -17,58        | 7,82      | 16,48              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                    | <b>-2,94</b> | <b>3,11</b>  | <b>-7,22</b> | <b>8,34</b> | <b>-2,49</b> | <b>9,32</b>   |           |                    |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES                            | -6,04        | 30,87        | -1,01        | 30,79       | 11,87        | 52,68         | 9,41      | 19,82              |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                         | -3,03        | 21,89        | -4,86        | 21,99       | 7,80         | 40,31         | 7,70      | 16,21              |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES                | -3,38        | 2,47         | -8,08        | 8,29        | -3,51        | 7,04          | 7,52      | 15,84              |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES                                      | -3,61        | 1,59         | -7,80        | 8,08        | -4,91        | 5,72          | 7,29      | 15,35              |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                                  | -2,90        | 1,40         | -6,64        | 8,29        | -5,16        | 2,67          | 6,99      | 14,72              |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES                        | -3,93        | 1,34         | -8,80        | 6,05        | -8,21        | 6,92          | 7,73      | 16,28              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                           | -7,30        | -8,76        | -16,03       | -0,44       | -22,96       | -19,27        | 11,08     | 23,34              |

|  | Mês          | Ano          | 3M           | 6M          | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|--------------|--------------|--------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>IBX - BENCHMARK</b>                                       | <b>-3,03</b> | <b>2,31</b>  | <b>-7,11</b> | <b>8,24</b> | <b>-3,47</b> | <b>7,90</b>  |           |                    |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES                              | -5,17        | -0,77        | -10,10       | 7,22        | -9,52        | 9,75         | 9,64      | 20,31              |
| BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES                             | -7,66        | -13,35       | -19,20       | -2,92       | -24,59       | -20,02       | 12,20     | 25,69              |
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                          | <b>-0,41</b> | <b>8,53</b>  | <b>0,64</b>  | <b>2,92</b> | <b>9,03</b>  | <b>22,65</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP  | -0,29        | 8,48         | 0,84         | 3,19        | 9,04         | 22,01        | 1,24      | 2,60               |
| <b>IMA GERAL - BENCHMARK</b>                                 | <b>0,30</b>  | <b>10,92</b> | <b>1,11</b>  | <b>5,71</b> | <b>11,71</b> | <b>24,89</b> |           |                    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                      | -0,67        | 9,84         | -2,01        | 3,63        | 8,72         | 20,85        | 3,00      | 6,33               |
| <b>IMA-B - BENCHMARK</b>                                     | <b>-0,66</b> | <b>10,06</b> | <b>-1,97</b> | <b>3,75</b> | <b>8,97</b>  | <b>21,40</b> |           |                    |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 0,98         | 10,79        | 3,07         | 6,41        | 13,14        | 29,21        | 0,00      | 0,00               |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | -0,67        | 9,82         | -2,03        | 3,63        | 8,70         | 20,76        | 3,00      | 6,32               |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | -0,68        | 9,78         | -2,05        | 3,59        | 8,65         | 20,62        | 3,01      | 6,34               |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA                                  | 0,02         | 3,57         | 0,32         | 1,76        | 4,46         | 7,94         | 0,61      | 1,29               |
| <b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>                                   | <b>-0,31</b> | <b>8,55</b>  | <b>0,43</b>  | <b>3,06</b> | <b>9,21</b>  | <b>23,11</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP       | -0,32        | 8,44         | 0,39         | 3,03        | 9,06         | 22,79        | 1,43      | 3,01               |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA                                  | -0,11        | -6,33        | -0,57        | -1,24       | -5,85        | -25,04       | 0,08      | 0,18               |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA                               | -0,47        | -10,63       | -13,32       | -12,13      | -10,02       | -6,16        | 0,16      | 0,33               |
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                      | <b>0,24</b>  | <b>3,75</b>  | <b>0,73</b>  | <b>1,00</b> | <b>4,82</b>  | <b>11,60</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA               | 0,26         | 10,64        | 1,30         | 6,24        | 12,00        | 24,61        | 0,90      | 1,91               |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                               | 0,41         | 9,50         | 0,83         | 5,07        | 10,70        | 22,21        | 1,49      | 3,13               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 0,44         | 9,29         | 2,46         | 4,49        | 10,17        |              | 0,48      | 1,00               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 0,43         | 9,27         | 2,45         | 4,48        | 10,14        | 24,15        | 0,47      | 1,00               |

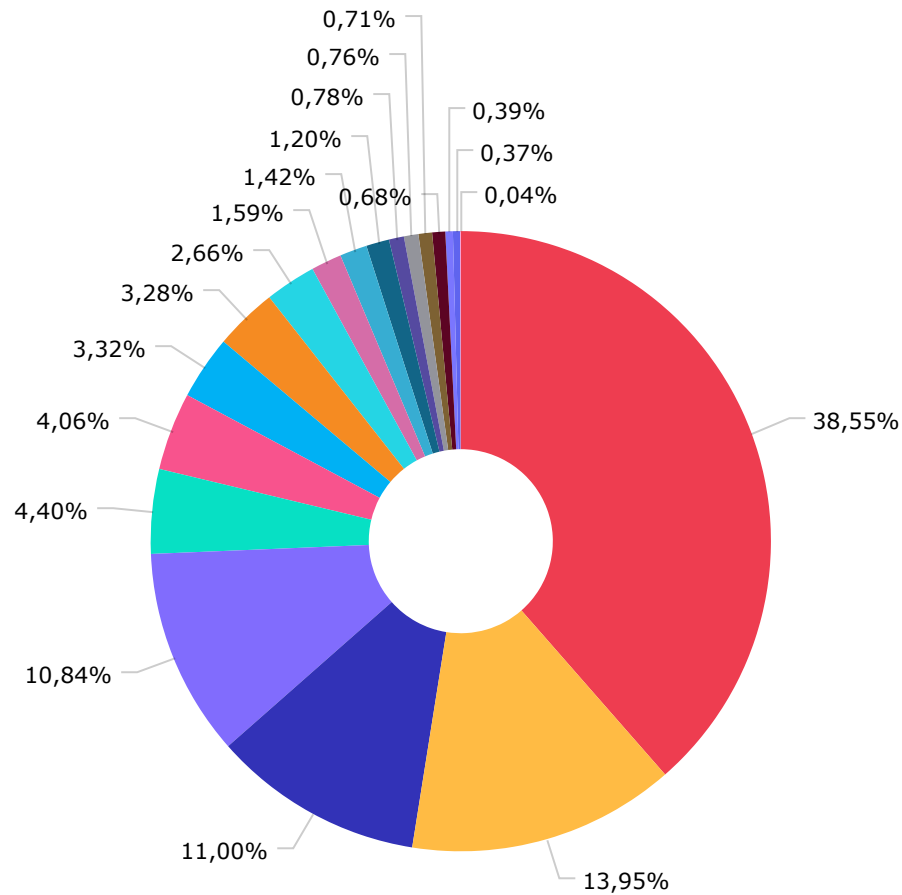


|  | Mês          | Ano          | 3M           | 6M           | 12M          | 24M           | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|-----------|--------------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                  | 0,44         |              | 2,48         |              |              |               | 0,48      | 1,00               |
| <b>IPCA + 10,50% AO ANO - BENCHMARK</b>  | <b>1,08</b>  | <b>12,70</b> | <b>3,28</b>  | <b>6,17</b>  | <b>15,83</b> | <b>36,27</b>  |           |                    |
| W7 FIP MULTISTRATÉGIA  | -0,15        | -1,45        | -0,45        | -0,89        | -1,74        | -10,23        |           |                    |
| <b>IPCA + 7,00% AO ANO - BENCHMARK</b>   | <b>0,81</b>  | <b>9,74</b>  | <b>2,45</b>  | <b>4,48</b>  | <b>12,16</b> | <b>27,77</b>  |           |                    |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1                                      | -0,45        | -2,62        | -1,27        | -2,25        | -2,14        | 1,47          | 0,14      | 0,28               |
| <b>SELIC - BENCHMARK</b>   | <b>1,00</b>  | <b>11,02</b> | <b>3,14</b>  | <b>6,55</b>  | <b>13,42</b> | <b>26,45</b>  |           |                    |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                                 | 1,05         | 11,47        | 3,41         | 7,05         | 13,96        | 27,79         | 0,02      | 0,03               |
| <b>IPCA + 5,00% AO ANO - BENCHMARK</b>   | <b>0,65</b>  | <b>8,03</b>  | <b>1,97</b>  | <b>3,50</b>  | <b>10,06</b> | <b>23,04</b>  |           |                    |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                             | 0,44         |              | -0,41        |              |              |               | 0,48      | 1,00               |
| <b>IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK</b>   | <b>0,73</b>  | <b>8,88</b>  | <b>2,21</b>  | <b>3,99</b>  | <b>11,11</b> | <b>25,39</b>  |           |                    |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO                            | -0,31        | 8,89         | 0,69         | 3,48         | 9,55         | 23,60         | 1,62      | 3,41               |
| <b>MSCI WORLD - BENCHMARK</b>  | <b>-2,00</b> | <b>3,11</b>  | <b>-3,63</b> | <b>-1,26</b> | <b>4,55</b>  | <b>-21,84</b> |           |                    |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIME... | -3,29        | -1,32        | -4,02        | -2,07        | 3,46         | -27,37        | 5,14      | 10,82              |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                         | -9,79        | 5,97         | -16,89       | 2,76         | -6,68        | -65,54        | 14,32     | 30,17              |
| <b>MSCI ACWI - BENCHMARK</b>   | <b>-2,10</b> | <b>1,94</b>  | <b>-3,96</b> | <b>-1,70</b> | <b>4,45</b>  | <b>-23,43</b> |           |                    |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                     | -2,66        | -1,18        | -1,86        | -3,54        | 6,13         | -19,45        | 5,89      | 12,40              |
| <b>IFIX - BENCHMARK</b>  | <b>-1,97</b> | <b>10,06</b> | <b>-1,30</b> | <b>10,41</b> | <b>5,49</b>  | <b>17,94</b>  |           |                    |
| HAZ FII - ATCR11   |              |              |              |              |              |               |           |                    |

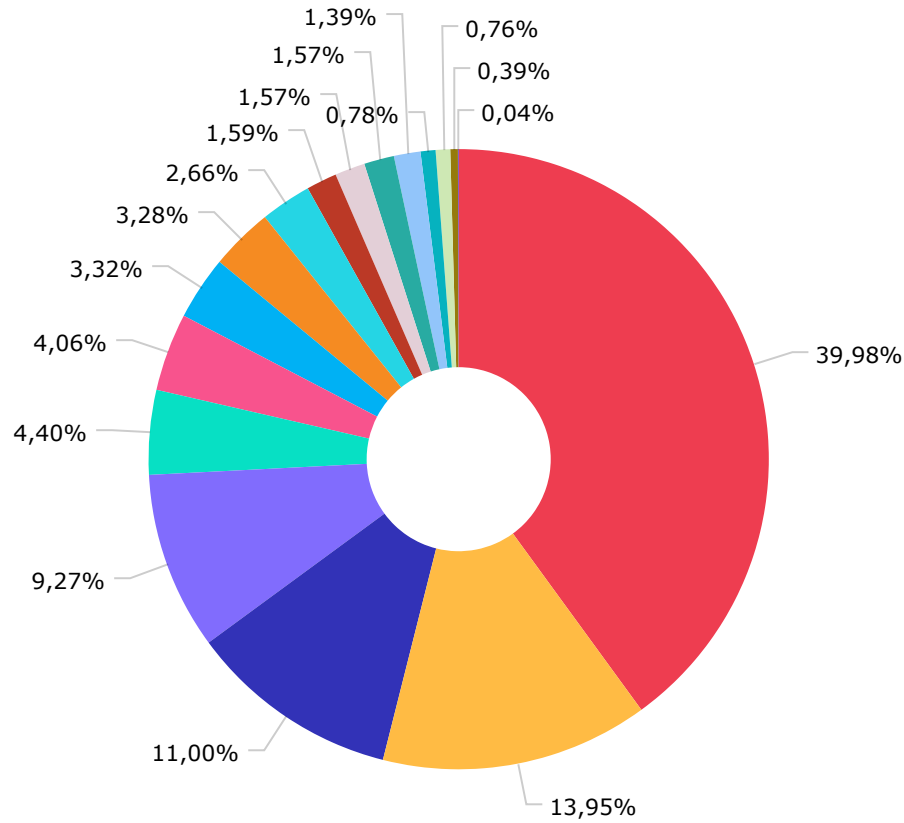




|   |               |
|---|---------------|
| Renda Fixa Duração Livre Soberano             | 42.304.814,03 |
| Títulos Públicos                              | 18.048.295,40 |
| Ações Livre                                   | 16.989.776,34 |
| Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento | 16.684.004,97 |
| Renda Fixa Indexados                          | 15.781.804,61 |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 14.219.034,29 |
| Não classificado                              | 12.574.696,94 |
| Renda Fixa Duração Baixa Soberano             | 7.920.634,64  |
| Multimercados Estratégia Específica           | 3.968.332,12  |
| Fundos de Participações                       | 2.615.765,02  |
| Ações Small Caps                              | 2.583.899,14  |
| Ações Índice Ativo                            | 2.164.448,95  |
| Ações Sustentabilidade/Governança             | 1.525.956,10  |
| Multimercados Investimento no Exterior        | 1.269.120,95  |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento  | 1.244.746,36  |
| Ações Investimento no Exterior                | 1.241.973,72  |
| FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa   | 1.092.675,86  |
| Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre        | 811.052,67    |
| Multimercados Macro                           | 809.435,20    |
| Renda Fixa Simples                            | 137.169,00    |
| Disponibilidades Financeiras                  | 66.990,59     |
| FIDC Financeiro                               | 66.244,97     |
| FIDC Outros                                   | 0,01          |



|                                   |               |
|-----------------------------------|---------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 63.273.616,39 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 22.901.654,14 |
| TESOURO NACIONAL                  | 18.048.295,40 |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME... | 17.791.411,60 |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.      | 7.221.531,64  |
| SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC... | 6.666.279,38  |
| CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU... | 5.453.094,11  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 5.376.137,05  |
| PORTO SEGURO INVESTIMENTOS LTD... | 4.357.508,18  |
| A5 GESTAO DE INVESTIMENTOS LTD... | 2.615.765,02  |
| VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU... | 2.334.625,53  |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.       | 1.969.973,50  |
| CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ... | 1.280.364,47  |
| PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE... | 1.241.973,72  |
| TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA      | 1.164.658,65  |
| GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA       | 1.112.246,14  |
| RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL... | 644.766,52    |
| GENIAL GESTÃO LTDA                | 599.979,85    |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA        | 66.990,59     |



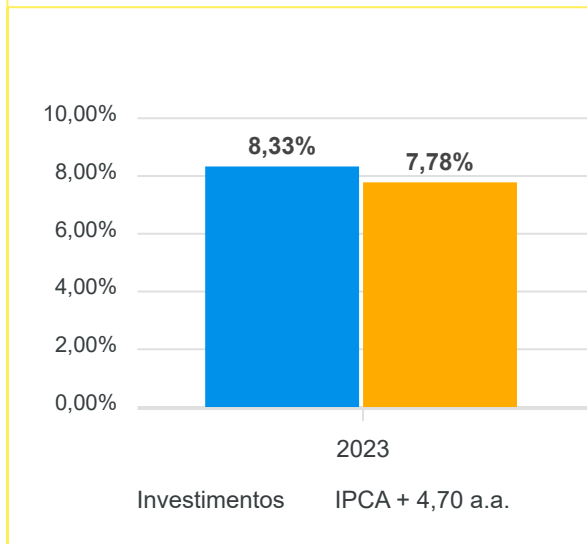
|                                   |               |
|-----------------------------------|---------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 65.608.241,92 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 22.901.654,14 |
| TESOURO NACIONAL                  | 18.048.295,40 |
| BANCO BRADESCO S.A.               | 15.207.512,46 |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.      | 7.221.531,64  |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.     | 6.666.279,38  |
| SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRI... | 5.453.094,11  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 5.376.137,05  |
| INTRAG DTVM LTDA                  | 4.357.508,18  |
| PLANNER CORRETORA DE VALORES S... | 2.615.765,02  |
| BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 2.583.899,14  |
| RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL... | 2.569.953,35  |
| BANCO DAYCOVAL S.A.               | 2.276.904,79  |
| BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.    | 1.280.364,47  |
| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.     | 1.241.973,72  |
| GENIAL GESTÃO LTDA                | 644.766,52    |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA        | 66.990,59     |

| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$   | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|--------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro   | 153.616.904,07 | 5.070.940,17  | 2.371.393,42  | 158.401.303,88 | 2.084.853,06 | 2.084.853,06         | 1,33% ▲   | 1,33%               | 0,93%  | 0,93%            | 143,01%                    | 2,45%       |
| Fevereiro | 158.401.303,88 | 22.355.495,92 | 24.875.139,98 | 156.085.063,74 | 203.403,92   | 2.288.256,98         | 0,13% ▲   | 1,46%               | 1,17%  | 2,12%            | 68,87%                     | 1,65%       |
| Março     | 156.085.063,74 | 12.728.002,98 | 8.114.964,51  | 162.096.105,66 | 1.398.003,45 | 3.686.260,43         | 0,87% ▲   | 2,35%               | 1,13%  | 3,27%            | 71,87%                     | 1,68%       |
| Abril     | 162.096.105,66 | 6.445.496,86  | 2.225.282,77  | 167.809.665,58 | 1.493.345,83 | 5.179.606,26         | 0,90% ▲   | 3,27%               | 0,94%  | 4,24%            | 77,12%                     | 1,51%       |
| Mai       | 167.809.665,58 | 34.608.520,19 | 33.925.089,53 | 171.108.175,93 | 2.615.079,69 | 7.794.685,95         | 1,55% ▲   | 4,87%               | 0,63%  | 4,90%            | 99,39%                     | 1,75%       |
| Junho     | 171.108.175,93 | 27.969.773,35 | 27.775.758,50 | 174.967.301,22 | 3.665.110,44 | 11.459.796,39        | 2,14% ▲   | 7,11%               | 0,30%  | 5,22%            | 136,21%                    | 1,76%       |
| Julho     | 174.967.301,22 | 3.641.454,91  | 2.188.790,32  | 178.892.699,84 | 2.472.734,03 | 13.932.530,42        | 1,40% ▲   | 8,61%               | 0,50%  | 5,75%            | 149,74%                    | 1,64%       |
| Agosto    | 178.892.699,84 | 7.123.281,11  | 6.295.294,65  | 179.676.516,02 | -44.170,28   | 13.888.360,14        | -0,02% ▼  | 8,59%               | 0,65%  | 6,44%            | 133,39%                    | 1,81%       |
| Setembro  | 179.676.516,02 | 3.072.045,33  | 2.208.022,75  | 180.741.770,40 | 201.231,80   | 14.089.591,94        | 0,11% ▲   | 8,71%               | 0,63%  | 7,11%            | 122,50%                    | 1,72%       |
| Outubro   | 180.741.770,40 | 3.010.227,93  | 2.166.306,00  | 180.951.393,93 | -634.298,40  | 13.455.293,54        | -0,35% ▼  | 8,33%               | 0,62%  | 7,78%            | 107,07%                    | 1,99%       |

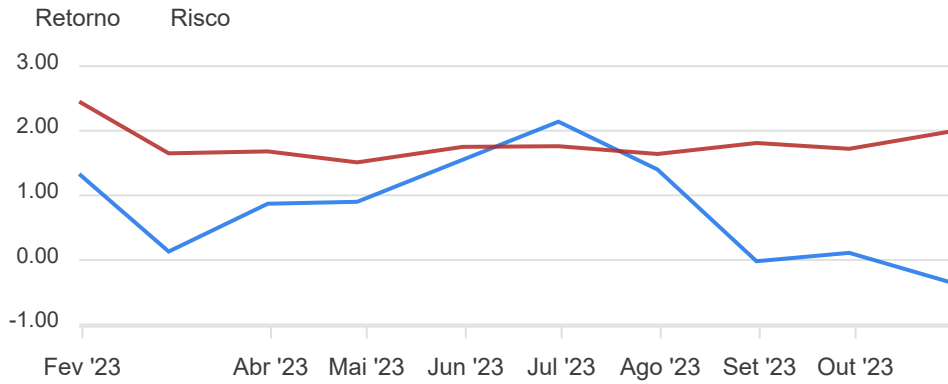
Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$    | Retorno % | Meta % |
|---------|---------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 3.686.260,43  | 2,35%     | 3,27%  |
| 2º Trim | 7.773.535,96  | 4,66%     | 1,89%  |
| 1º Sem  | 11.459.796,39 | 7,11%     | 5,22%  |
| 3º Trim | 2.629.795,55  | 1,49%     | 1,79%  |

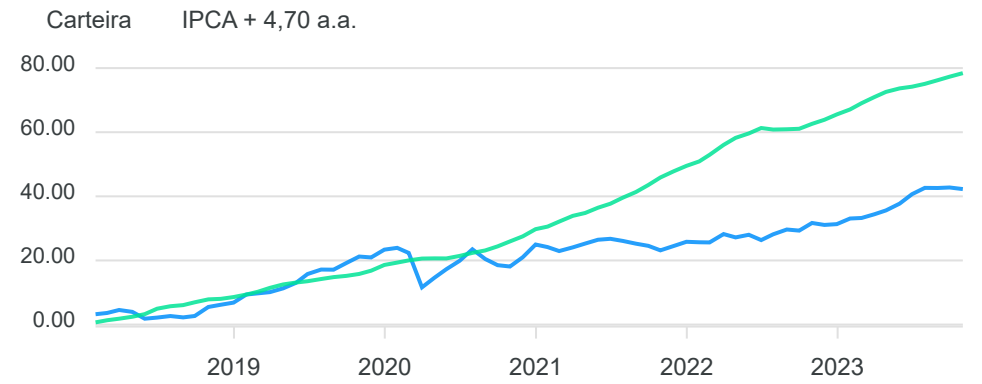
Gráfico Retorno e Meta Acumulado



**Gráfico Risco x Retorno**

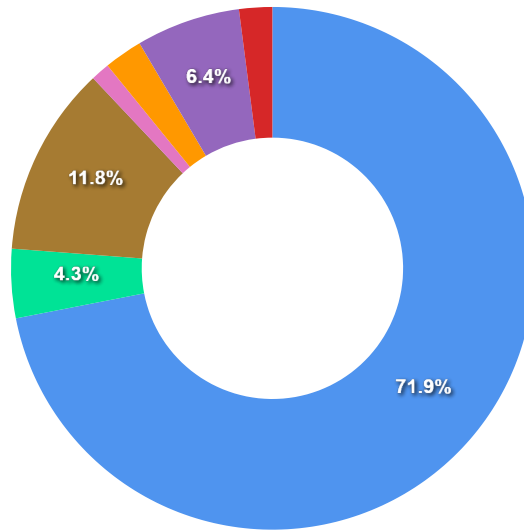


**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



**Liquidez - 31/10/2023**

| Disponibilidade | Valor          | %     |
|-----------------|----------------|-------|
| Até D+30        | 130.208.358,69 | 71,96 |
| Até D+180       | 7.729.998,90   | 4,27  |
| Até D+360       | 21.293.687,62  | 11,77 |
| Até D+720       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+1800      | 2.122.044,01   | 1,17  |
| Até D+3600      | 4.296.085,66   | 2,37  |
| Acima D+3600    | 11.659.768,78  | 6,44  |
| Indeterminado   | 3.708.440,88   | 2,05  |



| RENDA FIXA  | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|-----------|-------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS  | 17.925.144,29  | 0,00         | 0,00         | 18.048.295,40 | 123.151,11 | 0,69% ▲   | -           |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                | 134.737,65     | 2.572,96     | 1.376,14     | 137.169,00    | 1.234,53   | 0,90% ▲   | 0,01%       |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 10.475.572,40  | 0,00         | 0,00         | 10.404.976,46 | -70.595,94 | -0,67% ▼  | 3,00%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 176.412,93     | 0,00         | 0,00         | 177.180,06    | 767,13     | 0,43% ▲   | 0,47%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 6.070.328,49   | 0,00         | 0,00         | 6.097.279,50  | 26.951,01  | 0,44% ▲   | 0,48%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | 243.228,40     | 0,00         | 0,00         | 245.600,37    | 2.371,97   | 0,98% ▲   | 0,00%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | 2.117.322,34   | 0,00         | 0,00         | 2.126.553,94  | 9.231,60   | 0,44% ▲   | 0,48%       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA  | 2.950.275,88   | 0,00         | 0,00         | 2.930.144,46  | -20.131,42 | -0,68% ▼  | 3,01%       |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                | 12.149.269,28  | 0,00         | 0,00         | 12.277.368,00 | 128.098,72 | 1,05% ▲   | 0,02%       |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA            | 3.033.552,48   | 0,00         | 0,00         | 3.047.037,86  | 13.485,38  | 0,44% ▲   | 0,48%       |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA                  | 1.478.150,02   | 2.939.321,48 | 2.163.709,96 | 2.282.761,99  | 29.000,45  | 0,66% ▲   | 0,00%       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 22.266.358,76  | 68.333,49    | 0,00         | 22.391.886,00 | 57.193,75  | 0,26% ▲   | 0,90%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 1.499.214,23   | 0,00         | 0,00         | 1.494.840,46  | -4.373,77  | -0,29% ▼  | 1,24%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 1.848.734,63   | 0,00         | 0,00         | 1.842.787,25  | -5.947,38  | -0,32% ▼  | 1,43%       |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO           | 6.214.452,87   | 0,00         | 0,00         | 6.195.233,34  | -19.219,53 | -0,31% ▼  | 1,62%       |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                             | 8.005.465,83   | 0,00         | 0,00         | 8.084.807,56  | 79.341,73  | 0,99% ▲   | 0,03%       |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                | 13.193.504,53  | 0,00         | 0,00         | 13.319.586,07 | 126.081,54 | 0,96% ▲   | 0,02%       |
| INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL 1                            | 0,01           | 0,00         | 0,00         | 0,01          | 0,00       | 0,00%     | -           |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                       | 2.052.988,32   | 0,00         | 0,00         | 2.039.200,44  | -13.787,88 | -0,67% ▼  | 3,00%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP                  | 2.384.628,09   | 0,00         | 0,00         | 2.403.964,07  | 19.335,98  | 0,81% ▲   | 0,17%       |
| LF BRADESCO 09/09/2024 IPCA + 6,79%                           | 5.580.065,15   | 0,00         | 0,00         | 5.625.355,06  | 45.289,91  | 0,81% ▲   | -           |
| LF ITAU UNIBANCO 02/09/2024 IPCA + 7,09%                      | 5.604.312,29   | 0,00         | 0,00         | 5.652.768,09  | 48.455,80  | 0,86% ▲   | -           |
| LF SANTANDER 05/09/2024 IPCA + 6,79%                          | 5.575.882,48   | 0,00         | 0,00         | 5.619.389,49  | 43.507,01  | 0,78% ▲   | -           |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA                                   | 810.908,60     | 0,00         | 0,00         | 811.052,67    | 144,07     | 0,02% ▲   | 0,61%       |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1                     | 66.542,83      | 0,00         | 0,00         | 66.244,97     | -297,86    | -0,45% ▼  | 0,14%       |
| PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI           | 4.316.352,97   | 0,00         | 0,00         | 4.357.508,18  | 41.155,21  | 0,95% ▲   | 0,02%       |



| RENDA FIXA   | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual    | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|--------------|--------------|----------------|------------|-----------|-------------|
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                                 | 1.285.754,52   | 0,00         | 0,00         | 1.291.043,19   | 5.288,67   | 0,41% ▲   | 1,49%       |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.922.214,29   | 0,00         | 0,00         | 1.941.666,29   | 19.452,00  | 1,01% ▲   | 0,02%       |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI     | 1.268.142,67   | 0,00         | 0,00         | 1.280.364,47   | 12.221,80  | 0,96% ▲   | 0,02%       |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA                                 | 647.815,33     | 0,00         | 0,00         | 644.766,52     | -3.048,81  | -0,47% ▼  | 0,16%       |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA                                    | 600.622,98     | 0,00         | 0,00         | 599.979,84     | -643,14    | -0,11% ▼  | 0,08%       |
|  | 141.897.955,54 | 3.010.227,93 | 2.165.086,10 | 143.436.811,01 | 693.713,64 | 0,49%     | 0,63%       |

| RENDA VARIÁVEL                                   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$  | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|---------------|-------------|-----------|-------------|
| BB GOVERNANÇA IS FIC AÇÕES                       | 1.583.179,82   | 0,00       | 0,00     | 1.525.956,10  | -57.223,72  | -3,61% ▼  | 7,29%       |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                    | 2.252.317,42   | 0,00       | 0,00     | 2.186.938,71  | -65.378,71  | -2,90% ▼  | 6,99%       |
| BRANCO MID SMALL CAPS FIC AÇÕES                  | 2.798.376,31   | 0,00       | 0,00     | 2.583.899,14  | -214.477,17 | -7,66% ▼  | 12,20%      |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES          | 2.430.191,28   | 0,00       | 0,00     | 2.334.625,53  | -95.565,75  | -3,93% ▼  | 7,73%       |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES                  | 5.750.360,45   | 0,00       | 0,00     | 5.453.094,11  | -297.266,34 | -5,17% ▼  | 9,64%       |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES           | 1.147.041,61   | 0,00       | 0,00     | 1.112.246,14  | -34.795,47  | -3,03% ▼  | 7,70%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES             | 1.006.424,10   | 0,00       | 0,00     | 932.972,54    | -73.451,56  | -7,30% ▼  | 11,08%      |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 2.240.053,51   | 0,00       | 0,00     | 2.164.448,95  | -75.604,56  | -3,38% ▼  | 7,52%       |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES              | 1.239.544,07   | 0,00       | 0,00     | 1.164.658,65  | -74.885,42  | -6,04% ▼  | 9,41%       |
| -  | 20.447.488,57  | 0,00       | 0,00     | 19.458.839,87 | -988.648,70 | -4,84%    | 8,98%       |

| ESTRUTURADOS  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$  | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|-------------|-----------|-------------|
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                | 812.742,64     | 0,00       | 0,00     | 809.435,20    | -3.307,44   | -0,41% ▼  | 2,40%       |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 3.356.132,43   | 0,00       | 0,00     | 3.253.199,52  | -102.932,91 | -3,07% ▼  | 5,29%       |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO                     | 4.038.490,37   | 0,00       | 0,00     | 3.968.332,12  | -70.158,25  | -1,74% ▼  | 7,16%       |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA                                  | 2.619.597,57   | 0,00       | 0,00     | 2.615.765,02  | -3.832,55   | -0,15% ▼  | -           |
| -   | 10.826.963,01  | 0,00       | 0,00     | 10.646.731,86 | -180.231,15 | -1,66%    | 5,92%       |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---------------------|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| HAZ FII - ATCR11    | 1.091.764,71   | 0,00       | 1.219,90 | 1.092.675,86 | 2.131,05   | 0,20% ▲   | -           |
| -                   | 1.091.764,71   | 0,00       | 1.219,90 | 1.092.675,86 | 2.131,05   | 0,20%     | 0,00%       |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR  | Saldo Anterior      | Aplicações  | Resgates    | Saldo Atual         | Retorno \$         | Retorno %     | Risco - VaR  |
|--|---------------------|-------------|-------------|---------------------|--------------------|---------------|--------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                                       | 3.859.237,25        | 0,00        | 0,00        | 3.805.240,66        | -53.996,59         | -1,40% ▼      | 7,82%        |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                     | 894.771,19          | 0,00        | 0,00        | 870.949,71          | -23.821,48         | -2,66% ▼      | 5,89%        |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                         | 411.269,83          | 0,00        | 0,00        | 371.024,01          | -40.245,82         | -9,79% ▼      | 14,32%       |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIME... | 1.312.320,30        | 0,00        | 0,00        | 1.269.120,95        | -43.199,35         | -3,29% ▼      | 5,14%        |
|  | <b>6.477.598,57</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>6.316.335,33</b> | <b>-161.263,24</b> | <b>-2,49%</b> | <b>6,36%</b> |

## Cenário Econômico

Assim como nos dois últimos meses, o mês de outubro foi mais um de resultados ruins para as carteiras de investimentos. No segmento de renda fixa, resultados mistos. Mais uma vez os fundos atrelados a inflação tiveram desempenho fraco com a continuação da abertura da curva de juros, por outro lado continuaram fazendo um bom trabalho de defesa os fundos atrelados ao CDI que fecharam no positivo. Já no segmento de renda variável, a realidade não foi boa para todos os índices de referência no mercado que fecharam em forte baixa no mês. Em resumo, a grande maioria das carteiras de investimentos experimentaram mais um mês de resultados ruins, mas aquelas que possuem uma boa diversificação ainda conseguem um resultado superior a meta atuarial no ano, com a gordura acumulada no primeiro semestre de 2023.

## Análise da Carteira de Investimentos

### Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

### Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 ainda não foram integralmente atingidos.

### Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

### Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

### Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

### Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

### Retorno da Carteira de Investimentos

Nos segmentos de renda fixa e investimentos estruturados, destacamos mais uma vez os fundos atrelados a inflação que tiveram desempenho fraco com a continuação da abertura da curva de juros, por outro lado continuaram fazendo um bom trabalho de defesa os fundos atrelados ao CDI que fecharam no positivo. Já nos segmentos de renda variável e investimentos no exterior, a realidade não foi boa para a maioria dos índices de referência no mercado que fecharam em baixa no mês.

### Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 09 de novembro de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

## Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **IPREM - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE FERNADÓPOLIS - SP** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Outubro/2023**, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.



## Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **IPREM - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE FERNADÓPOLIS - SP** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Outubro/2023** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **IPREM - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE FERNADÓPOLIS - SP** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

