



Ata nº 012/2023/CARMOPREV

ATA DE REUNIÃO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Ao vigésimo segundo dia do mês de novembro de 2023, atendendo a convocação; reuniram na sede do Carmoprev os membros do comitê. A reunião iniciou-se às dezesseis horas com a presença da diretora executiva Maria do Carmo Ramos Gomes, o senhor Rafael Horácio Macharete da Silva, Gerente de Finanças e o senhor Alcides de Jesus Gonçalves Neto, membro do comitê de investimento. A diretora executiva, iniciou a reunião, lendo a ata anterior, falando sobre as aplicações. Mostrou o relatório de Análises, rentabilidades e risco do **mês de setembro de 2023**, enviada pela empresa que presta Assessoria Financeira ao Carmoprev, a Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda. Um retorno no mês **0,29%**, uma meta no mês **0,49%**, meta acumulada de **6,60%**, um retorno acumulado de **8,93%**.

Assim eu Maria do Carmo Ramos Gomes, diretora executiva, membro deste conselho, lavrei a presente ata que segue assinada por mim e demais membros deste comitê.

Mercgomes



CRÉDITO
& MERCADO

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	1.806.607,50	3,70%	685	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.060.744,90	12,43%	794	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.549.099,74	7,28%	638	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.940.393,01	6,03%	1.132	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.589.500,33	11,46%	794	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC R...	D+0	Não há	6.141.082,20	12,59%	873	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	5.931.337,50	12,16%	1.116	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.103.163,92	10,46%	152	0,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	19.645,24	0,04%	58	0,29%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
PIATÁ FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVA...	D+1 ou ...	Não há	122.609,13	0,25%	23	0,56%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
SECURITY FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	330.521,40	0,68%	14	3,11%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.395.285,23	2,86%	1.399	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.362.779,27	2,79%	139	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.935.615,80	3,97%	1.003	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.585.606,88	3,25%	201	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	520.135,27	1,07%	2.194	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	347.659,48	0,71%	477	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.806.806,59	3,71%	5.373	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.217.152,99	4,55%	114	0,35%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			48.765.746,38				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	22,03%	83,22%	40.582.854,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	26.087.427,68	53,50%	18,85%	22,67%	83,22%	14.495.426,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	11.034.501,42	22,63%	15,08%	26,30%	60,00%	18.224.946,41
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.753.149,28
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	19.645,24	0,04%	0,00%	0,00%	0,00%	-19.645,24
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	453.130,53	0,93%	0,00%	3,00%	5,00%	1.985.156,79
Total Renda Fixa	100,00%	37.594.704,87	77,09%	33,93%	74,00%	251,44%	

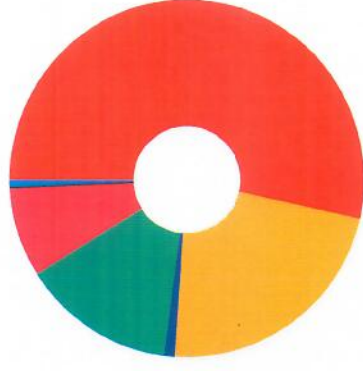


■ RENDA FIXA 37.594.704,87
■ RENDA VARIÁVEL 6.799.422,45
■ EXTERIOR 347.659,48
■ ESTRUTURADOS 4.023.959,58



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%	6.799.422,45	13,94%	1,21%	15,00%	25,00%	5.392.014,15
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.023.959,58	8,25%	3,75%	5,00%	10,00%	852.615,06
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.823.382,03	22,19%	4,96%	20,00%	35,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	347.659,48	0,71%	0,00%	5,00%	10,00%	4.528.915,16
Total Exterior	10,00%	347.659,48	0,71%	0,00%	5,00%	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	83,22
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	26.087.427,68	53,50	18,85	83,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	11.034.501,42	22,63	15,08	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	453.130,53	0,93	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	6.799.422,45	13,94	1,21	25,00
Artigo 9º, Inciso III	347.659,48	0,71	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	4.023.959,58	8,25	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	21.683.467,88	44,46	-
CAIXA DTVM	20.143.559,54	41,31	-
BRÁDESCO ASSET MANAGEMENT	6.465.943,19	13,26	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	330.521,40	0,68	2,08
GENIAL GESTÃO LTDA	142.254,37	0,29	-

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
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,25%	12,79%	4,11%	8,31%	17,41%	34,76%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.504,61%	2.534,71%	3.397,10%	4.630,01%	2.706,76%	505,45%	-	-
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%	2,35%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
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%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
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%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
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%
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%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-3,51%	-3,26%	-2,45%	-2,55%	-46,85%	-79,76%	5,17%	40,74%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,63%	6,35%	2,10%	4,19%	8,44%	14,02%	0,08%	0,16%

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
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
BRADESCO 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%



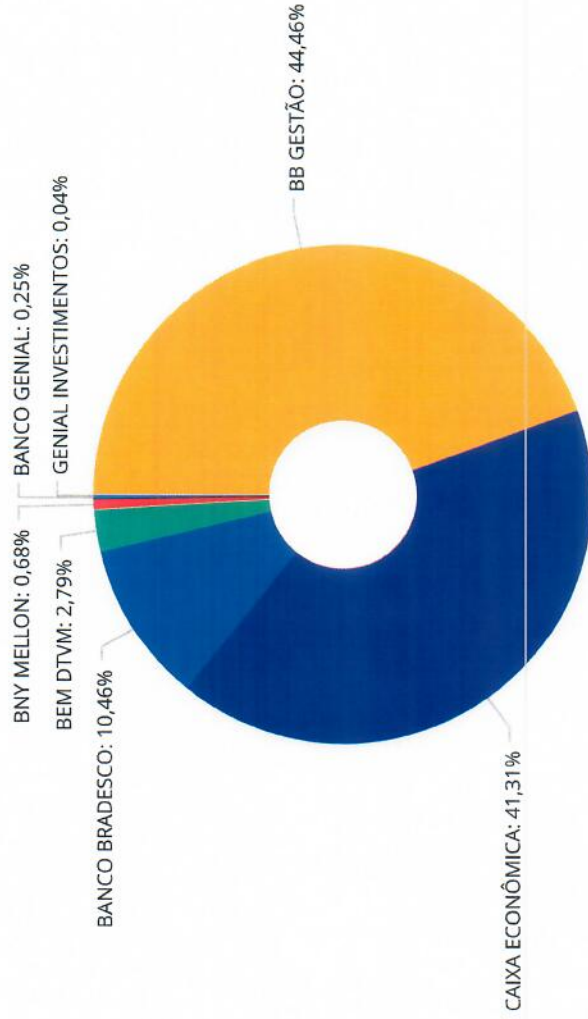
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,85%	7,39%	1,94%	6,31%	9,60%	23,26%	1,95%	3,86%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	8,36%	1,59%	6,08%	10,18%	21,24%	1,92%	4,35%
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-3,58%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	22,22%
Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,12%	11,80%	-1,69%	17,93%	10,85%	13,29%	8,45%	19,41%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01%	6,08%	-1,83%	14,99%	1,58%	-6,60%	7,55%	19,50%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-0,96%	0,53%	-4,77%	8,93%	-0,40%	-1,54%	8,76%	19,75%
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 DIVIDENDOS FIAÇÕES	1,25%	9,55%	1,01%	14,44%	12,73%	19,59%	6,11%	17,81%

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

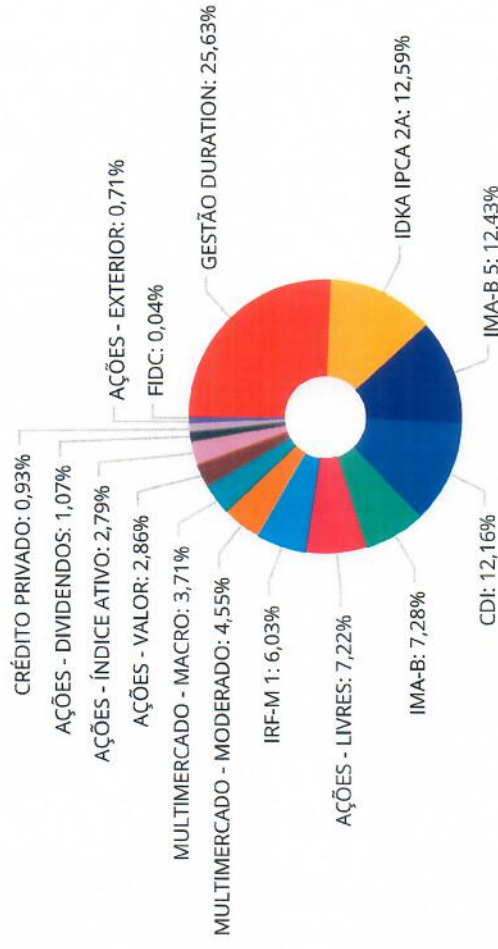
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-3,57%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	22,223%

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



Administrador	Valor
BB GESTÃO	21.683.467,88
CAIXA ECONÔMICA	20.143.559,54
BANCO BRADESCO	5.103.163,92
BEM DTVM	1.362.779,27
BNY MELLON	330.521,40
BANCO GENIAL	122.609,13
GENIAL INVESTIMENTOS	19.645,24

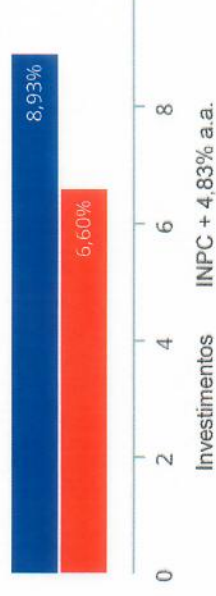
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2023)



■	GESTÃO DURATION	12.499.271,75	■	IDKA IPCA 2A	6.141.082,20	■	IMA-B 5	6.060.744,90	■	CDI	5.931.337,50
■	IMA-B	3.549.099,74	■	CRÉDITO PRIVADO - LIVRES	3.521.222,68	■	IRF-M 1	2.940.393,01	■	MULTIMERCADO - MODERADO	2.217.152,99
■	MULTIMERCADO - MACRO	1.806.806,59	■	CRÉDITO PRIVADO - VALOR	1.395.285,23	■	CRÉDITO PRIVADO - ÍNDICE ATIVO	1.362.779,27	■	CRÉDITO PRIVADO - DIVIDENDOS	520.135,27
■	CRÉDITO PRIVADO	453.130,53	■	CRÉDITO PRIVADO - EXTERIOR	347.659,48	■	FIDC	19.645,24			

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

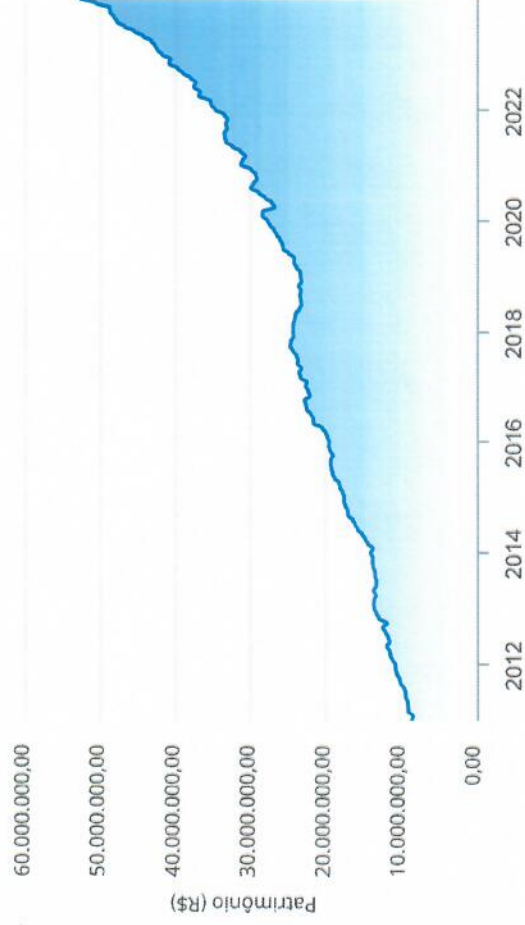
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum.	Retorno Mês	Retorno Acum.	Meta Mês	Meta Acum.	Gap Acum.	VaR
Janeiro	40.686.343,68	143.673,81	112.031,55	41.300.093,14	582.107,20	582.107,20	1,43%	1,43%	0,87%	0,87%	163,47%	2,47%
Fevereiro	41.300.093,14	414.047,87	0,00	41.605.793,33	-108.347,68	473.759,52	-0,26%	1,17%	1,11%	1,99%	58,47%	2,07%
Março	41.605.793,33	147.183,59	0,00	42.075.251,68	322.274,76	796.034,28	0,77%	1,95%	1,07%	3,09%	63,01%	1,81%
Abril	42.075.251,68	624.569,78	0,00	43.137.116,62	437.295,16	1.233.329,44	1,02%	2,99%	0,87%	3,99%	75,04%	1,77%
Mai	43.137.116,62	372.507,51	0,00	44.317.712,10	808.087,97	2.041.417,41	1,86%	4,90%	0,77%	4,79%	102,35%	1,70%
Junho	44.317.712,10	143.412,00	0,00	45.567.552,00	1.106.427,90	3.147.845,31	2,49%	7,51%	0,29%	5,10%	147,38%	1,85%
Julho	45.567.552,00	427.708,86	0,00	46.570.483,30	575.222,44	3.723.067,75	1,25%	8,86%	0,30%	5,42%	163,52%	1,74%
Agosto	46.570.483,30	514.267,42	0,00	46.977.076,26	-107.674,46	3.615.393,29	-0,23%	8,61%	0,63%	6,08%	141,52%	1,61%
Setembro	46.977.076,26	365.516,11	3.904,13	47.477.493,72	138.605,48	3.754.198,77	0,29%	8,93%	0,49%	6,60%	135,30%	1,90%

Investimentos x Meta de Rentabilidade




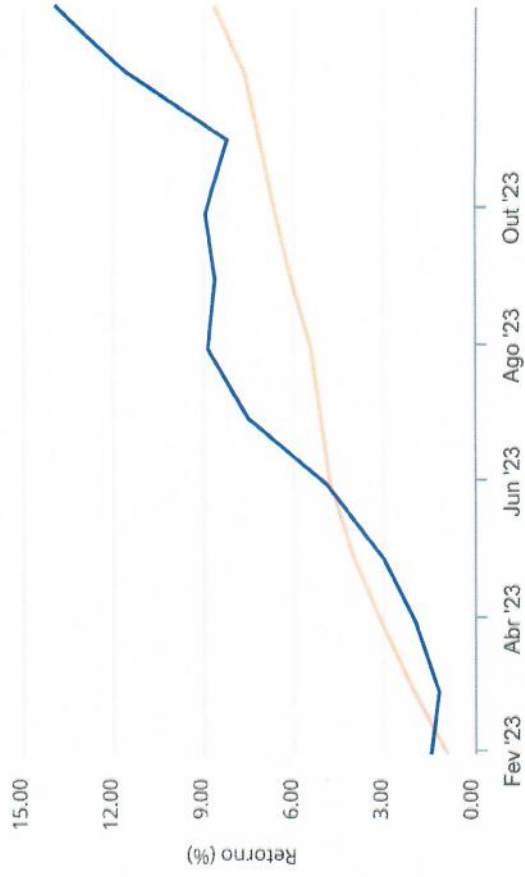
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.224,30	0,00	0,00	19.645,24	18.420,94	1.504,61%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.874.357,29	0,00	0,00	5.931.337,50	56.980,21	0,97%	0,97%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.914.046,06	0,00	0,00	2.940.393,01	26.346,95	0,90%	0,90%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.790.877,66	0,00	0,00	1.806.607,50	15.729,84	0,88%	0,88%	0,14%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	328.445,02	0,00	0,00	330.521,40	2.076,38	0,63%	0,63%	0,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.567.019,02	0,00	0,00	5.589.500,33	22.481,31	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.119.305,83	0,00	0,00	6.141.082,20	21.776,37	0,36%	0,36%	0,74%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.096.138,23	0,00	0,00	5.103.163,92	7.025,69	0,14%	0,14%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.054.015,77	0,00	0,00	6.060.744,90	6.729,13	0,11%	0,11%	0,99%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	127.064,18	0,00	3.904,13	122.609,13	-550,92	-0,43%	-3,51%	5,17%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.362.183,74	219.492,12	0,00	3.549.099,74	-32.576,12	-0,91%	-0,97%	2,52%
Total Renda Fixa	37.234.677,10	219.492,12	3.904,13	37.594.704,87	144.439,78	0,39%		0,77%

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 (%)	(%) Insttit	Var - Mês
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.198.455,68	0,00	0,00	2.217.152,99	18.697,31	0,85%	0,85%	1,95%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	371.309,58	146.023,99	0,00	520.135,27	2.801,70	0,54%	1,25%	6,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.797.833,81	0,00	0,00	1.806.806,59	8.972,78	0,50%	0,50%	1,92%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.391.679,76	0,00	0,00	1.395.285,23	3.605,47	0,26%	0,26%	7,72%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.935.749,41	0,00	0,00	1.935.615,80	-133,61	-0,01%	-0,01%	7,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.587.529,13	0,00	0,00	1.585.606,88	-1.922,25	-0,12%	-0,12%	8,45%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.376.002,57	0,00	0,00	1.362.779,27	-13.223,30	-0,96%	-0,96%	8,76%
Total Renda Variável	10.658.559,94	146.023,99	0,00	10.823.382,03	18.798,10	0,17%		5,70%

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 NIVEL I	360.548,69	0,00	0,00	347.659,48	-12.889,21	-3,57%	-3,57%	4,97%
Total Exterior	360.548,69	0,00	0,00	347.659,48	-12.889,21	-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 (%)	(%) Institt
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.746.109,22	0,00	0,00	5.931.337,50	185.228,28	3,22%	3,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA ZA TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.875.179,00	144.574,62	0,00	6.141.082,20	121.328,58	2,02%	2,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.483.161,07	0,00	0,00	5.589.500,33	106.339,26	1,94%	1,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.962.400,93	0,00	0,00	6.060.744,90	98.343,97	1,65%	1,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.851.704,25	0,00	0,00	2.940.393,01	88.688,76	3,11%	3,11%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.023.903,88	0,00	0,00	5.103.163,92	79.260,04	1,58%	1,58%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.758.627,99	0,00	0,00	1.806.607,50	47.979,51	2,73%	2,73%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	561,76	0,00	0,00	19.645,24	19.083,48	3.397,09%	3.397,10%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	323.723,56	0,00	0,00	330.521,40	6.797,84	2,10%	2,10%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	125.687,28	0,00	3.904,13	122.609,13	825,98	0,66%	-2,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.700.391,03	872.908,85	0,00	3.549.099,74	-24.200,14	-0,68%	-0,64%
Total Renda Fixa	35.851.449,97	1.017.483,47	3.904,13	37.594.704,87	729.675,56	1,98%	



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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.175.023,16	0,00	0,00	2.217.152,99	42.129,83	1,94%	1,94%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.778.536,15	0,00	0,00	1.806.806,59	28.270,44	1,59%	1,59%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	372.213,76	146.023,99	0,00	520.135,27	1.897,52	0,37%	1,01%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.423.163,88	0,00	0,00	1.395.285,23	-27.878,65	-1,96%	-1,96%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.470.609,88	143.984,93	0,00	1.585.606,88	-28.987,93	-1,80%	-1,69%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.971.761,16	0,00	0,00	1.935.615,80	-36.145,36	-1,83%	-1,83%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.431.074,89	0,00	0,00	1.362.779,27	-68.295,62	-4,77%	-4,77%
Total Renda Variável	10.622.382,88	290.008,92	0,00	10.823.382,03	-89.009,77	-0,82%	

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 FIAÇÕES BDR NIVEL I	343.115,26	0,00	0,00	347.659,48	4.544,22	1,32%	1,32%
Total Exterior	343.115,26	0,00	0,00	347.659,48	4.544,22	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.