

# Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2023

**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)**

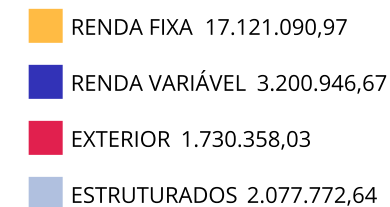
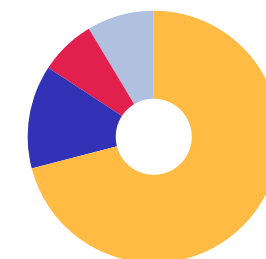
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			960.964,59	3,98%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	343.221,50	1,42%	890	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	325.448,56	1,35%	785	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	880.986,30	3,65%	640	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	610.421,41	2,53%	94	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	667.601,94	2,77%	1.139	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.313.762,39	5,44%	608	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.134.342,16	4,70%	308	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	842.741,09	3,49%	195	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	326.457,88	1,35%	121	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.812.358,34	7,51%	370	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.876.988,65	7,78%	1.722	1,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	673.616,34	2,79%	49	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.177.275,10	4,88%	57.197	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	115.059,31	0,48%	1.000	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	261.767,63	1,08%	249	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	492.600,22	2,04%	1.125	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	917.535,08	3,80%	231	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.185.785,05	4,91%	99	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	410.987,76	1,70%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV

**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	791.169,67	3,28%	42.580	0,06%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	165.091,34	0,68%	19.688	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	671.157,01	2,78%	1.361	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	476.353,61	1,97%	7.342	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	737.911,89	3,06%	19.220	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	581.857,66	2,41%	410	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	40.572,40	0,17%	197	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	410.740,48	1,70%	65	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	117.262,28	0,49%	9.470	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	936.728,81	3,88%	144	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	390.259,71	1,62%	16.413	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	403.369,51	1,67%	1.833	0,44%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	154.751,53	0,64%	90	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	505.551,33	2,10%	178	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.130.006,48	4,68%	42.619	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	287.463,30	1,19%	612	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>24.130.168,31</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>13.429,59</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>24.143.597,90</b>				

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

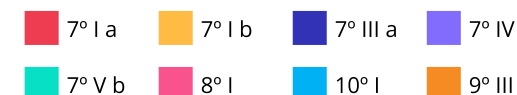
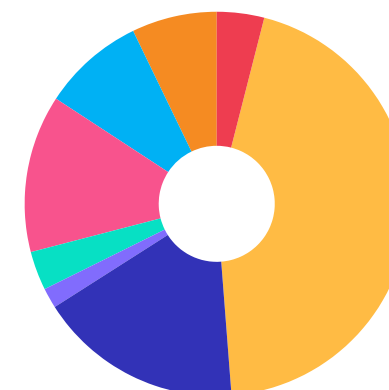
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	960.964,59	3,98%	0,00%	22,95%	81,95%	18.813.708,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	10.807.946,56	44,79%	20,48%	27,30%	81,95%	8.966.726,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	4.150.022,39	17,20%	12,00%	12,30%	60,00%	10.328.078,60
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	410.987,76	1,70%	0,00%	0,00%	20,00%	4.415.045,90
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	791.169,67	3,28%	0,00%	5,00%	5,00%	415.338,75
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>17.121.090,97</b>	<b>70,95%</b>	<b>32,48%</b>	<b>67,55%</b>	<b>248,90%</b>	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.200.946,67	13,27%	12,75%	18,25%	20,00%	1.625.086,99
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.077.772,64	8,61%	5,75%	8,20%	10,00%	335.244,19
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>5.278.719,31</b>	<b>21,88%</b>	<b>18,50%</b>	<b>26,45%</b>	<b>30,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.730.358,03	7,17%	0,00%	5,00%	10,00%	682.658,80
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>1.730.358,03</b>	<b>7,17%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	



**Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2023)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.471.855,54	64,12	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	4.036.344,44	16,73	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	3.250.015,98	13,47	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	960.964,59	3,98	-
BANCO DAYCOVAL	410.987,76	1,70	-

**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 '	960.964,59	3,98	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	10.807.946,56	44,79	20,48	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.150.022,39	17,20	12,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	791.169,67	3,28	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.200.946,67	13,27	12,75	20,00
Artigo 9º, Inciso III	1.730.358,03	7,17	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.077.772,64	8,61	5,75	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-0,41%	8,53%	0,64%	2,92%	9,03%	22,65%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33%	8,23%	0,62%	3,00%	8,84%	22,05%	1,32%	0,02%
<b>IMA Geral (Benchmark)</b>	0,30%	10,92%	1,11%	5,71%	11,71%	24,89%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,67%	9,84%	-2,01%	3,64%	8,72%	20,85%	3,00%	0,05%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	10,81%	1,06%	5,63%	11,72%	24,68%	1,34%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,96%	11,12%	3,06%	6,61%	13,48%	26,55%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	10,82%	2,97%	6,45%	13,13%	25,83%	0,12%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	-0,35%	8,24%	0,29%	2,96%	8,84%	21,92%	1,40%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,32%	8,40%	0,37%	2,99%	8,99%	22,58%	1,43%	0,02%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,66%	10,06%	-1,97%	3,75%	8,97%	21,40%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,68%	9,83%	-2,09%	3,68%	8,73%	20,76%	3,00%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	9,82%	-2,03%	3,63%	8,70%	20,76%	3,00%	0,05%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,37%	12,04%	1,31%	6,68%	12,95%	26,45%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	11,64%	1,22%	6,41%	12,46%	25,73%	1,77%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,14%	10,06%	3,61%	7,54%	12,59%	27,10%	0,09%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,81%	10,70%	2,65%	6,36%	12,85%	26,77%	0,17%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,70%	10,09%	1,79%	5,68%	11,89%	24,74%	0,40%	0,01%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,39%	11,86%	5,70%	8,07%	14,03%	-	1,88%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	10,95%	3,15%	6,60%	13,35%	26,71%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	10,10%	2,88%	6,02%	12,28%	23,94%	0,01%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	-	2,48%	-	-	-	0,48%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,84%	9,95%	-2,33%	3,37%	8,95%	-	3,18%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,04%	8,94%	-1,05%	2,26%	8,60%	-	2,21%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	9,29%	2,46%	4,50%	10,17%	-	0,48%	0,02%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,14%	10,06%	3,61%	7,54%	12,59%	27,10%	0,09%	0,01%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,78%	5,26%	-0,98%	1,84%	5,61%	17,09%	2,11%	0,02%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,26%	8,74%	1,03%	4,01%	10,26%	23,01%	1,15%	0,01%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,54%	9,85%	2,05%	5,38%	11,49%	24,89%	0,95%	0,01%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90%	1,40%	-6,64%	8,29%	-5,16%	2,67%	6,99%	0,19%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,79%	-1,85%	-9,15%	4,80%	-7,15%	-2,25%	7,84%	0,18%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-4,97%	-0,53%	-9,85%	5,78%	-6,03%	3,31%	8,44%	0,19%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-3,09%	-1,88%	-7,65%	6,19%	-8,26%	5,14%	7,06%	0,19%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-7,30%	-9,52%	-16,10%	-0,75%	-24,00%	-21,02%	11,06%	0,22%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-3,15%	7,18%	-4,65%	7,57%	6,28%	23,78%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,83%	5,60%	-6,56%	9,05%	1,98%	17,18%	6,91%	0,17%
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	-2,20%	9,23%	-8,61%	0,58%	8,31%	-8,94%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-1,76%	11,72%	-7,05%	2,34%	12,61%	1,39%	7,02%	0,15%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-1,75%	15,73%	-7,00%	4,28%	16,83%	7,04%	7,19%	0,16%



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

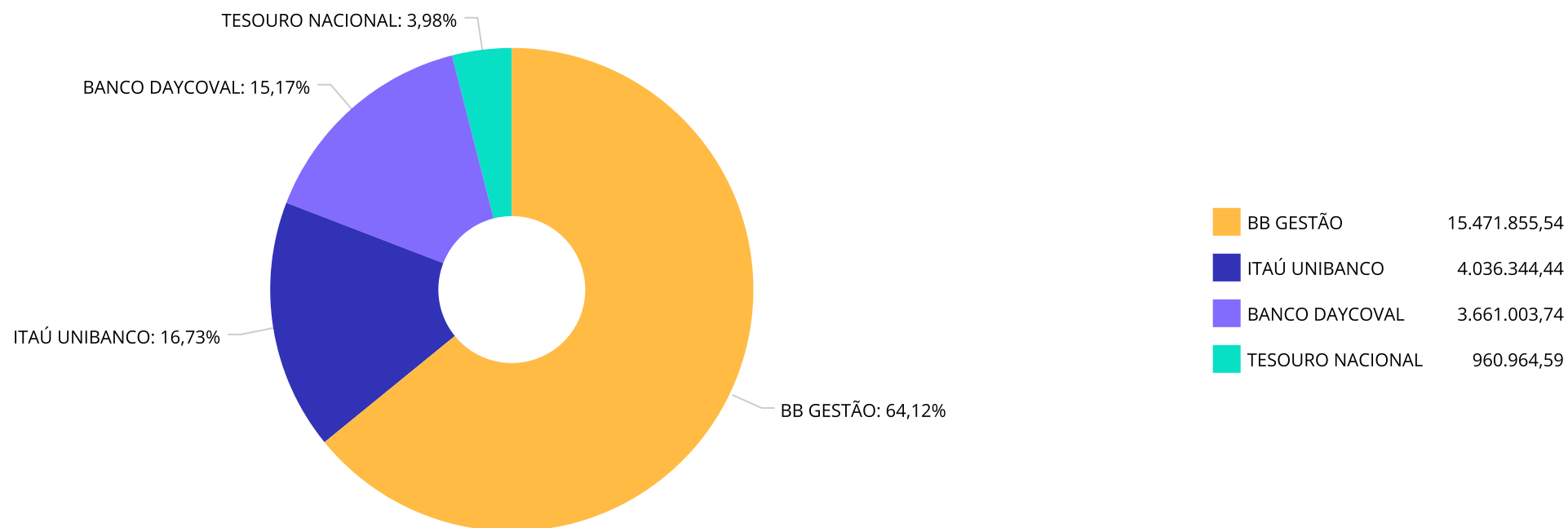
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-7,40%	-2,72%	-16,71%	5,49%	-16,24%	-16,19%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-7,69%	-4,20%	-16,15%	2,34%	-15,43%	-12,28%	11,33%	0,23%



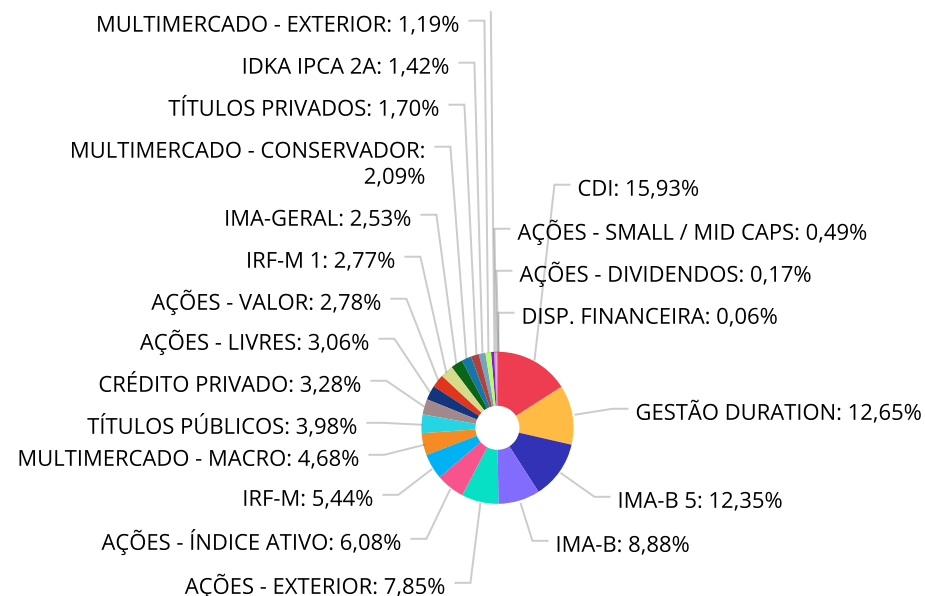
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,32%	1,37%	0,25%	2,48%	1,65%	-15,01%	6,94%	17,719%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,85%	27,41%	-3,16%	16,51%	10,47%	-13,23%	8,85%	18,061%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,58%	7,72%	-2,12%	4,68%	9,14%	-18,02%	7,88%	19,090%

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



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



■ CDI	3.845.321,82	■ GESTÃO DURATION	3.054.263,75	■ IMA-B 5	2.980.547,99
■ IMA-B	2.142.828,15	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.895.449,37	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.468.951,75
■ IRF-M	1.313.762,39	■ MULTIMERCADO - MACRO	1.130.006,48	■ TÍTULOS PÚBLICOS	960.964,59
■ CRÉDITO PRIVADO	791.169,67	■ AÇÕES - LIVRES	737.911,89	■ AÇÕES - VALOR	671.157,01
■ IRF-M 1	667.601,94	■ IMA-GERAL	610.421,41	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	505.551,33
■ TÍTULOS PRIVADOS	410.987,76	■ IDKA IPCA 2A	343.221,50	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	287.463,30
■ MULTIMERCADO - MODERADO	154.751,53	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	117.262,28	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	40.572,40
■ DISP. FINANCEIRA	13.429,59				



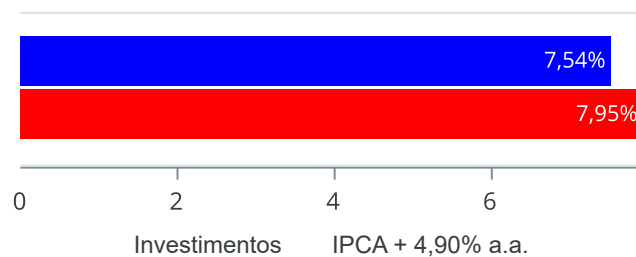
**Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2023)**

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2033	14/07/2023	115	4.382,736612	4.484,003958	504.014,71	515.660,45	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	14/07/2023	110	4.490,397247	4.471,478204	493.943,70	491.862,60	Curva

**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	19.046.548,36	506.461,88	178.155,44	19.714.622,82	339.768,02	339.768,02	1,75%	1,75%	0,95%	0,95%	184,46%	3,15%
Fevereiro	19.714.622,82	2.126.544,03	1.726.103,29	20.002.081,67	-112.981,89	226.786,13	-0,56%	1,18%	1,19%	2,15%	55,06%	2,70%
Março	20.002.081,67	1.030.935,18	659.324,17	20.511.734,49	138.041,81	364.827,94	0,68%	1,87%	1,15%	3,32%	56,21%	2,54%
Abril	20.511.734,49	537.945,01	165.092,45	21.062.683,46	178.096,41	542.924,35	0,85%	2,74%	0,95%	4,31%	63,51%	2,46%
Mai	21.062.683,46	1.556.634,18	1.190.288,26	21.785.393,40	356.364,02	899.288,37	1,66%	4,44%	0,65%	4,99%	89,15%	2,33%
Junho	21.785.393,40	4.561.209,90	4.210.954,31	22.644.988,30	509.339,31	1.408.627,68	2,30%	6,85%	0,32%	5,32%	128,70%	2,27%
Julho	22.644.988,30	1.856.910,35	1.576.121,65	23.267.347,03	341.570,03	1.750.197,71	1,49%	8,44%	0,52%	5,87%	143,82%	2,25%
Agosto	23.267.347,03	502.475,40	281.814,34	23.441.325,07	-46.683,02	1.703.514,69	-0,20%	8,22%	0,67%	6,58%	125,06%	2,36%
Setembro	23.441.325,07	751.942,04	186.852,82	23.996.372,15	-10.042,14	1.693.472,55	-0,04%	8,18%	0,64%	7,26%	112,66%	2,42%
Outubro	23.996.372,15	453.840,27	177.692,61	24.130.168,31	-142.351,50	1.551.121,05	-0,59%	7,54%	0,64%	7,95%	94,94%	2,81%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





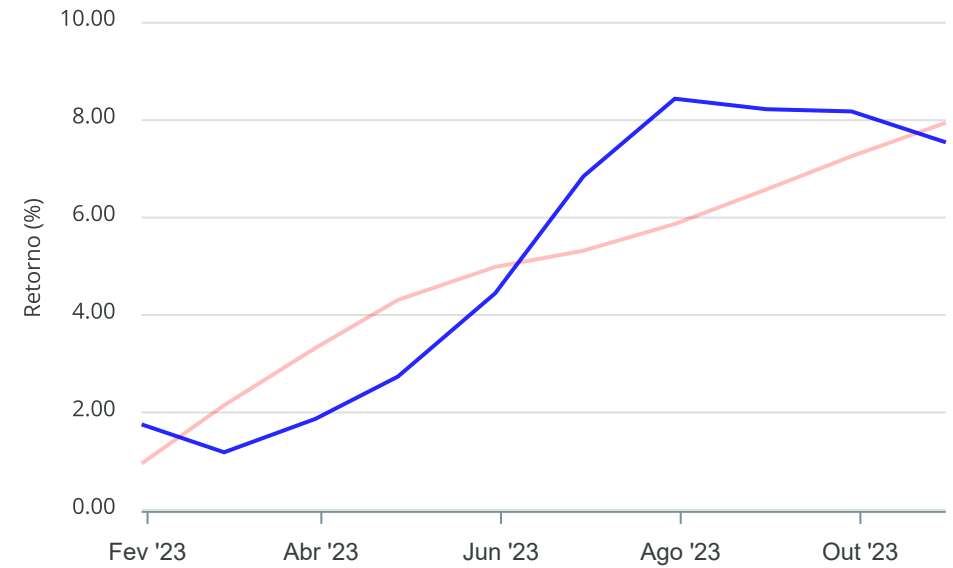
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Outubro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.161.185,46	0,00	0,00	1.177.275,10	16.089,64	1,39%	1,39%	1,88%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	782.289,02	0,00	0,00	791.169,67	8.880,65	1,14%	1,14%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	661.488,64	0,00	0,00	667.601,94	6.113,30	0,92%	0,92%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	109.362,72	5.366,63	656,55	115.059,31	986,51	0,86%	0,90%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	221.822,76	442.340,52	177.036,06	492.600,22	5.473,00	0,82%	0,99%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.176.247,34	0,00	0,00	1.185.785,05	9.537,71	0,81%	0,81%	0,17%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	407.790,09	0,00	0,00	410.987,76	3.197,67	0,78%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	911.140,31	0,00	0,00	917.535,08	6.394,77	0,70%	0,70%	0,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.129.328,18	0,00	0,00	1.134.342,16	5.013,98	0,44%	0,44%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.804.490,69	0,00	0,00	1.812.358,34	7.867,65	0,44%	0,44%	0,48%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.303.012,95	6.133,12	0,00	1.313.762,39	4.616,32	0,35%	0,35%	1,77%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	608.465,36	0,00	0,00	610.421,41	1.956,05	0,32%	0,32%	1,34%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	326.506,39	0,00	0,00	325.448,56	-1.057,83	-0,32%	-0,32%	1,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	344.356,98	0,00	0,00	343.221,50	-1.135,48	-0,33%	-0,33%	1,32%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.883.624,76	0,00	0,00	1.876.988,65	-6.636,11	-0,35%	-0,35%	1,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	678.170,94	0,00	0,00	673.616,34	-4.554,60	-0,67%	-0,67%	3,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	886.963,64	0,00	0,00	880.986,30	-5.977,34	-0,67%	-0,67%	3,00%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	263.555,45	0,00	0,00	261.767,63	-1.787,82	-0,68%	-0,68%	3,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	329.232,94	0,00	0,00	326.457,88	-2.775,06	-0,84%	-0,84%	3,18%
TÍTULOS PÚBLICOS	969.292,22	0,00	0,00	960.964,59	-8.327,63	-0,86%	-	-



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	851.608,29	0,00	0,00	842.741,09	-8.867,20	-1,04%	-1,04%	2,21%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>16.809.935,13</b>	<b>453.840,27</b>	<b>177.692,61</b>	<b>17.121.090,97</b>	<b>35.008,18</b>	<b>0,20%</b>		<b>1,23%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	502.819,61	0,00	0,00	505.551,33	2.731,72	0,54%	0,54%	0,95%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	154.354,39	0,00	0,00	154.751,53	397,14	0,26%	0,26%	1,15%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.138.919,88	0,00	0,00	1.130.006,48	-8.913,40	-0,78%	-0,78%	2,11%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	292.575,79	0,00	0,00	287.463,30	-5.112,49	-1,75%	-1,75%	7,19%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	168.048,12	0,00	0,00	165.091,34	-2.956,78	-1,76%	-1,76%	7,02%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	759.971,82	0,00	0,00	737.911,89	-22.059,93	-2,90%	-2,90%	6,99%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	600.429,97	0,00	0,00	581.857,66	-18.572,31	-3,09%	-3,09%	7,06%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	697.622,41	0,00	0,00	671.157,01	-26.465,40	-3,79%	-3,79%	7,84%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	42.188,07	0,00	0,00	40.572,40	-1.615,67	-3,83%	-3,83%	6,91%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	501.284,80	0,00	0,00	476.353,61	-24.931,19	-4,97%	-4,97%	8,44%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	443.071,13	0,00	0,00	410.740,48	-32.330,65	-7,30%	-7,30%	11,06%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	127.028,85	0,00	0,00	117.262,28	-9.766,57	-7,69%	-7,69%	11,33%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>5.428.314,84</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>5.278.719,31</b>	<b>-149.595,53</b>	<b>-2,76%</b>		<b>5,87%</b>



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	408.751,08	0,00	0,00	403.369,51	-5.381,57	-1,32%	-1,32%	6,94%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	951.736,18	0,00	0,00	936.728,81	-15.007,37	-1,58%	-1,58%	7,88%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	397.634,92	0,00	0,00	390.259,71	-7.375,21	-1,85%	-1,85%	8,85%
<b>Total Exterior</b>	<b>1.758.122,18</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.730.358,03</b>	<b>-27.764,15</b>	<b>-1,58%</b>		<b>7,88%</b>

## 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.



