

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			519.221.957,60	29,67%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	72.599.393,00	4,15%	691	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.921.009,77	0,74%	780	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	17.451.625,83	1,00%	624	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	34.871.909,30	1,99%	788	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	39.838.666,48	2,28%	918	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.912.940,71	0,85%	434	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	34.534.936,07	1,97%	27	7,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.625.114,21	0,66%	216	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.987.186,71	0,17%	1.743	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	78.030.485,74	4,46%	116	6,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	44.514.206,23	2,54%	106	9,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.667.289,86	0,84%	29	1,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.807.865,45	0,22%	3.807	2,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	16.490.820,49	0,94%	244	1,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	38.062.694,23	2,18%	148	4,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.230.699,41	1,33%	99	4,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.999.530,88	1,03%	226	1,43%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	16.299.235,50	0,93%	14	11,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	8.101.059,31	0,46%	31	3,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	36.439.808,49	2,08%	462	1,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	53.290,91	0,00%	34	4,29%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	13.208.723,10	0,75%	49.707	1,04%	Artigo 8º, Inciso I
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	37.384.882,79	2,14%	9	8,11%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.346.856,77	0,65%	3.238	4,51%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	43.748.911,01	2,50%	2.798	3,43%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	9.520.008,27	0,54%	38	0,75%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	9.888.133,73	0,57%	4.521	2,97%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	4.902.290,20	0,28%	6.289	1,98%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.884.587,51	0,11%	2.215	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	24.663.460,84	1,41%	207	3,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	17.149.356,19	0,98%	148	1,79%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	36.822.316,97	2,10%	118	5,48%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	16.771.504,42	0,96%	194	6,81%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	31.016.177,15	1,77%	14.426	1,90%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.327.758,92	0,42%	35	1,66%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	14.772.359,88	0,84%	1.157	1,83%	Artigo 8º, Inciso I
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+7 du	Não há	1.864.036,02	0,11%	3	11,96%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	25.968.278,88	1,48%	58	1,36%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2023)

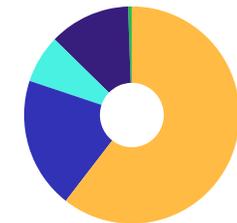
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.353.899,89	0,25%	32	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	17.816.366,59	1,02%	2.980	5,34%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	12.351.387,88	0,71%	1.759	6,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	21.560.385,90	1,23%	118	1,72%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	13.809.232,22	0,79%	2	1,10%	Artigo 9º, Inciso II
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+6 du	Não há	4.745.513,48	0,27%	198	0,00%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.358.849,08	0,25%	1.342	5,02%	Artigo 9º, Inciso II
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO ...	D+11 du	Não há	14.023.093,74	0,80%	2	83,63%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	15.481.491,18	0,88%	3.988	2,67%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	5.594.843,89	0,32%	189	1,86%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO ...	D+8 du	Não há	10.787.278,53	0,62%	1.430	5,49%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+8 du	Não há	9.651.994,68	0,55%	406	4,92%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	11.918.445,59	0,68%	3.290	8,10%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	13.683.561,64	0,78%	61.625	0,99%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	48.631.992,15	2,78%	2.370	9,82%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	14.813.213,30	0,85%	83	12,85%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	5.981.708,21	0,34%	583	3,07%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	8.661.015,62	0,49%	155	7,25%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	13.279.256,15	0,76%	25	14,09%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	22.760.424,01	1,30%	21	9,71%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.725.699,78	0,84%	22	10,31%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	15.851.732,54	0,91%	20	8,92%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	Não se ...	Não se aplica	579.053,34	0,03%	28	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	20.409.397,00	1,17%	103	0,70%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	87.002,02	0,00%	44	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	8.388.819,77	0,48%	41	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.007.351,82	0,11%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	22.398.872,95	1,28%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	706.953,52	0,04%	18	0,13%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	12.298.444,80	0,70%	46	17,79%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	D+0	Não há	1.175.747,74	0,07%	10	2,91%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	4.255.798,19	0,24%		3,49%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	5.700.000,00	0,33%		2,34%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.749.750.196,04				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			292.632,50				Artigo 6º
PL Total			1.750.042.828,54				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	519.221.957,60	29,67%	17,00%	32,00%	100,00%	1.230.528.238,44
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	382.762.629,36	21,88%	10,00%	20,00%	100,00%	1.366.987.566,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.749.750.196,04
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	87.487.509,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	156.623.848,31	8,95%	1,00%	7,00%	60,00%	893.226.269,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.049.850.117,62
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	349.950.039,21
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	53.290,92	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	87.434.218,88
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	87.487.509,80
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	87.487.509,80
Total Renda Fixa	100,00%	1.058.661.726,19	60,50%	28,00%	59,00%	460,00%	

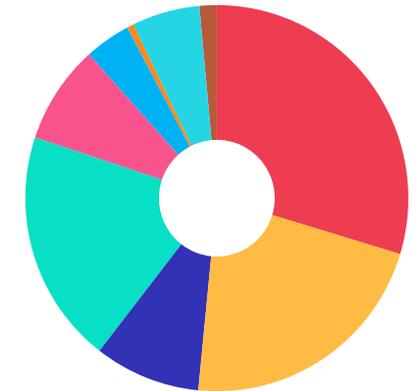


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

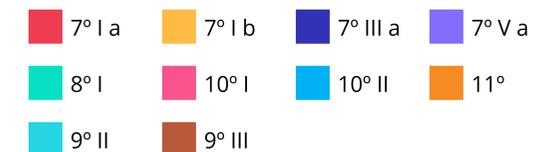


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	342.761.297,01	19,59%	6,00%	22,00%	35,00%	269.651.271,60
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	612.412.568,61
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	144.705.041,76	8,27%	1,00%	7,00%	10,00%	30.269.977,84
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	68.051.642,96	3,89%	1,00%	3,00%	5,00%	19.435.866,84
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	87.487.509,80
Artigo 11º	5,00%	9.955.798,19	0,57%	0,00%	0,00%	5,00%	77.531.711,61
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	565.473.779,92	32,32%	8,00%	32,00%	95,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	100.012.682,70	5,72%	1,00%	7,00%	10,00%	74.962.336,90
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	25.602.007,23	1,46%	1,00%	2,00%	10,00%	149.373.012,37
Total Exterior	10,00%	125.614.689,93	7,18%	2,00%	9,00%	20,00%	





CRÉDITO
& MERCADO

Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	519.221.957,60	29,67	-
CAIXA DTVM	215.714.118,50	12,33	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	189.133.281,50	10,81	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	164.720.600,94	9,41	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	93.625.280,90	5,35	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	71.331.241,37	4,08	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	64.615.776,05	3,69	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	61.293.393,64	3,50	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	50.516.579,66	2,89	-
ARX INVESTIMENTOS	37.384.882,79	2,14	-
ICATU VANGUARDA	34.534.936,07	1,97	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	30.167.754,47	1,72	-
XP ASSET MANAGEMENT	29.543.635,77	1,69	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	28.885.218,79	1,65	-
TARPON INVESTIMENTOS	25.968.278,88	1,48	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	23.105.826,47	1,32	-
VINCI PARTNERS	17.828.092,43	1,02	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	16.266.442,86	0,93	-
OCCAM BRASIL	14.772.359,88	0,84	-
WESTERN ASSET	13.683.561,64	0,78	-
ALASKA ASSET MANAGEMENT	13.208.723,10	0,75	-
ITAU DTVM	7.327.758,92	0,42	-
REAG GESTORA DE RECURSOS	5.700.000,00	0,33	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.594.843,89	0,32	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	4.902.290,20	0,28	-

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 '	519.221.957,60	29,67	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	382.762.629,36	21,88	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	156.623.848,31	8,95	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	53.290,92	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	342.761.297,01	19,59	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	100.012.682,70	5,72	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	25.602.007,23	1,46	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	144.705.041,76	8,27	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	68.051.642,96	3,89	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	9.955.798,19	0,57	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,19%	15,60%	3,81%	8,18%	17,27%	35,90%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-11,74%	-55,46%	-5,58%	-23,03%	-31,32%	444,94%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,80%	10,51%	1,62%	4,32%	11,55%	22,27%	-	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	1,80%	10,32%	1,60%	4,23%	11,37%	21,49%	0,74%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,79%	10,38%	1,57%	4,22%	11,39%	21,98%	0,73%	0,02%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,78%	10,26%	1,55%	4,17%	11,28%	21,43%	0,73%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,79%	10,34%	1,57%	4,19%	11,35%	21,76%	0,73%	0,02%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,78%	10,27%	1,56%	4,20%	11,29%	21,75%	0,73%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,62%	12,95%	0,99%	3,85%	12,73%	20,41%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3,16%	10,62%	0,85%	3,27%	10,47%	17,53%	2,32%	0,05%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,61%	12,70%	0,93%	3,73%	12,45%	19,83%	1,90%	0,05%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,64%	12,81%	0,93%	3,74%	12,57%	19,77%	1,92%	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,67%	12,85%	0,92%	3,81%	12,56%	19,91%	1,96%	0,05%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,48%	12,76%	0,76%	3,57%	12,46%	19,67%	1,91%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,60%	12,68%	0,91%	3,64%	12,41%	19,75%	1,90%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	2,47%	14,81%	3,03%	6,96%	16,50%	27,30%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,48%	14,57%	2,98%	6,84%	16,24%	26,56%	1,09%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,47%	14,64%	2,97%	6,84%	16,30%	26,98%	1,09%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,46%	14,39%	2,97%	6,71%	16,03%	26,54%	1,09%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,92%	12,04%	2,92%	6,33%	13,30%	26,87%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94%	12,28%	3,00%	6,77%	13,56%	27,76%	0,03%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	13,91%	2,85%	6,63%	14,78%	25,45%	0,18%	0,02%
IPCA (Benchmark)	0,28%	4,04%	0,78%	1,05%	4,68%	10,86%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	-1,14%	-	-0,68%	1,05%	-	-	11,26%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,60%	14,00%	2,08%	5,68%	13,58%	23,99%	1,40%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,44%	12,23%	2,11%	5,85%	13,51%	25,27%	0,43%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	2,38%	-	0,72%	2,13%	-	-	5,20%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,64%	13,37%	3,55%	7,54%	15,05%	-	1,03%	0,02%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1,23%	-5,91%	-1,67%	-5,20%	-	-	4,04%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	-4,52%	-	-8,16%	-7,16%	-	-	5,04%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	0,23%	-0,21%	1,93%	-2,57%	0,64%	-59,65%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,68%	-5,54%	1,33%	-0,66%	-6,88%	-	-	-
CDI (Benchmark)	0,92%	12,04%	2,92%	6,33%	13,30%	26,87%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	1,44%	11,30%	3,05%	6,33%	12,14%	25,52%	0,38%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	12,54%	16,04%	10,01%	17,53%	13,20%	24,94%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	8,43%	21,49%	7,27%	14,65%	24,66%	-	4,44%	0,07%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	7,51%	11,11%	6,29%	9,47%	9,99%	-	4,55%	0,08%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	6,96%	10,16%	7,95%	7,94%	9,57%	-	3,69%	0,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	6,07%	-	5,24%	7,89%	-	-	3,06%	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	8,07%	41,43%	9,31%	24,77%	34,69%	77,11%	8,53%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	13,79%	19,92%	7,14%	15,76%	16,95%	29,99%	7,67%	0,18%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,53%	10,72%	5,72%	9,08%	10,59%	-	3,94%	0,07%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,94%	10,48%	8,29%	13,31%	7,10%	4,60%	8,13%	0,18%
OCCAM FIC AÇÕES	10,66%	10,35%	8,89%	16,25%	7,41%	19,37%	6,12%	0,16%
BB AGRO FIC AÇÕES	9,80%	6,35%	5,26%	11,97%	3,55%	12,26%	9,19%	0,16%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11,48%	13,02%	7,45%	13,87%	10,62%	20,57%	6,96%	0,17%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10,85%	10,56%	6,36%	14,89%	6,35%	12,59%	7,75%	0,17%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	13,20%	3,81%	8,13%	11,02%	5,68%	10,23%	8,27%	0,16%
XP INVESTOR FI AÇÕES	12,52%	19,95%	10,59%	15,55%	18,05%	36,04%	7,97%	0,17%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14,72%	11,58%	11,29%	18,04%	8,80%	13,06%	7,57%	0,18%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	12,42%	13,93%	8,08%	14,97%	9,98%	19,44%	7,33%	0,18%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	12,58%	18,90%	8,96%	14,00%	17,19%	37,92%	7,96%	0,16%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	16,21%	28,89%	10,13%	19,68%	24,17%	44,66%	9,84%	0,19%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	12,82%	17,67%	6,65%	16,61%	11,91%	12,44%	7,81%	0,19%
IDIV (Benchmark)	10,70%	18,65%	8,63%	18,08%	16,73%	35,80%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	9,68%	16,83%	6,95%	14,67%	13,99%	26,34%	6,37%	0,15%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	11,13%	17,35%	7,10%	16,69%	14,63%	28,94%	7,15%	0,16%
IFIX (Benchmark)	0,66%	10,79%	-1,13%	5,41%	10,79%	23,20%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-2,69%	3,17%	6,51%	3,76%	6,89%	-9,06%	3,94%	0,27%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	8,92%	18,97%	1,33%	9,28%	11,95%	0,02%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9,35%	27,13%	2,78%	13,07%	20,94%	23,37%	6,23%	0,14%
SMLL (Benchmark)	12,46%	9,41%	1,19%	4,49%	6,11%	-3,54%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	11,05%	7,43%	-0,28%	3,23%	4,16%	-0,63%	10,49%	0,21%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,45%	9,31%	2,39%	8,70%	7,33%	2,80%	9,05%	0,16%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10,45%	9,55%	2,40%	8,92%	7,58%	2,34%	9,05%	0,16%
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,40%	18,13%	4,37%	8,37%	20,39%	46,61%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-2,44%	-40,20%	-6,93%	-20,38%	-40,77%	-95,36%	0,01%	0,18%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,74%	9,70%	2,26%	4,04%	10,96%	24,56%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	1,00%	-6,05%	-0,86%	0,33%	-7,26%	-4,07%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,19%	8,76%	-0,60%	-2,19%	7,83%	14,40%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,17%	15,90%	0,01%	-0,61%	15,78%	82,25%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,82%	10,64%	2,50%	4,53%	12,01%	26,92%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-1,66%	-4,98%	9,62%	22,63%	21,54%	68,64%	12,19%	0,56%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,89%	11,58%	2,74%	5,02%	13,06%	29,31%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	0,87%	-3,26%	0,53%	0,51%	2,53%	20,91%	-	-
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,00%	12,98%	3,09%	5,75%	14,63%	32,92%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,04%	47,66%	-0,09%	-2,82%	47,59%	20,44%	0,02%	0,47%

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

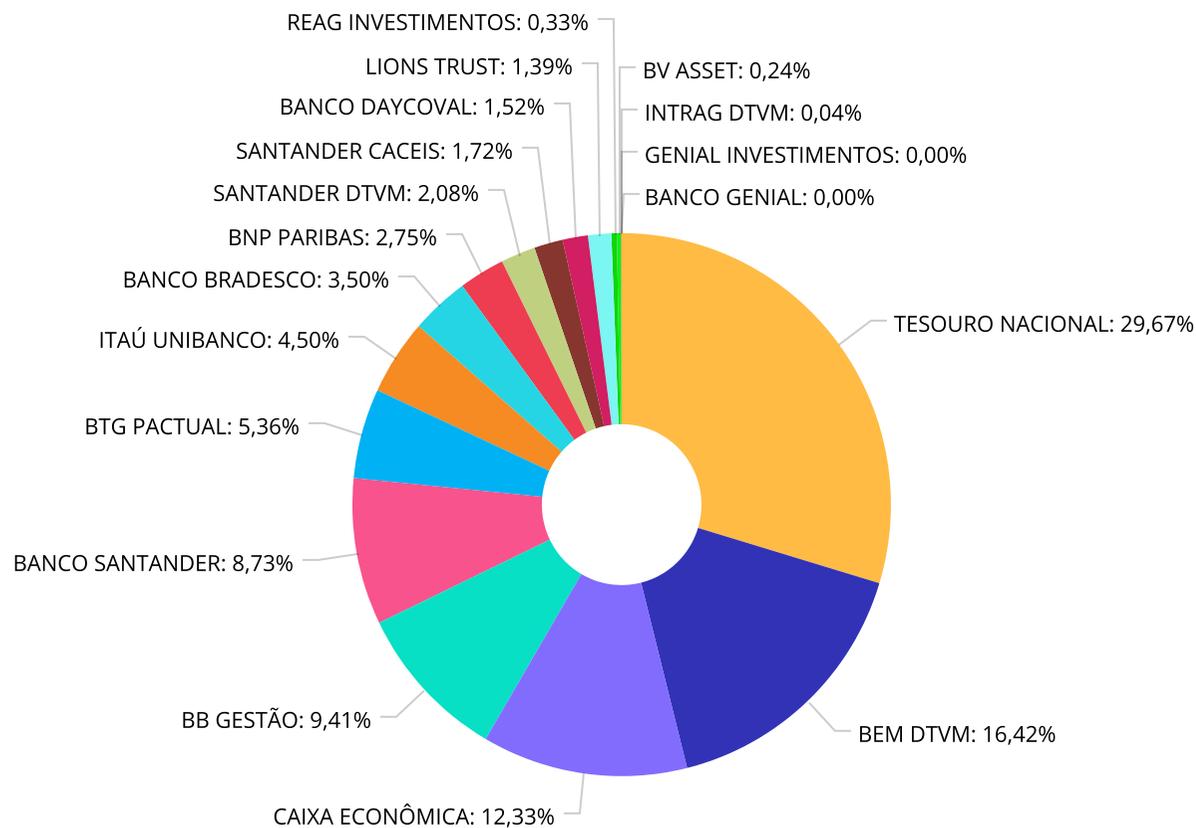
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,46%	22,84%	1,17%	7,21%	17,66%	-10,11%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,83%	28,93%	3,56%	8,30%	24,08%	-19,46%	4,54%	17,696%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	5,31%	7,70%	3,06%	6,78%	3,69%	-6,58%	4,26%	14,301%
MSCI WORLD (Benchmark)	6,58%	9,89%	1,54%	4,57%	3,60%	-14,39%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	6,53%	5,13%	0,15%	3,26%	2,88%	-21,04%	4,52%	12,872%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	6,19%	11,92%	2,47%	5,81%	10,96%	-6,02%	4,42%	16,269%
MSCI ACWI (Benchmark)	6,44%	8,50%	1,48%	4,05%	2,60%	-16,06%	-	-
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	6,17%	4,12%	0,22%	3,16%	0,16%	-15,40%	4,58%	14,140%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	8,80%	7,58%	1,40%	1,90%	7,79%	-14,99%	6,73%	17,178%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	4,26%	-5,62%	-4,87%	-8,10%	-7,35%	8,29%	6,49%	11,853%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	-8,57%	-17,03%	0,15%	-5,07%	-15,73%	0,64%	12,93%	18,796%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULT...	-6,02%	-6,25%	1,98%	0,79%	-5,62%	32,82%	8,92%	14,257%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIM...	6,04%	11,01%	2,27%	5,39%	-	-	4,35%	-
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	5,59%	-1,13%	-4,35%	-5,65%	-5,88%	-	6,78%	15,672%



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

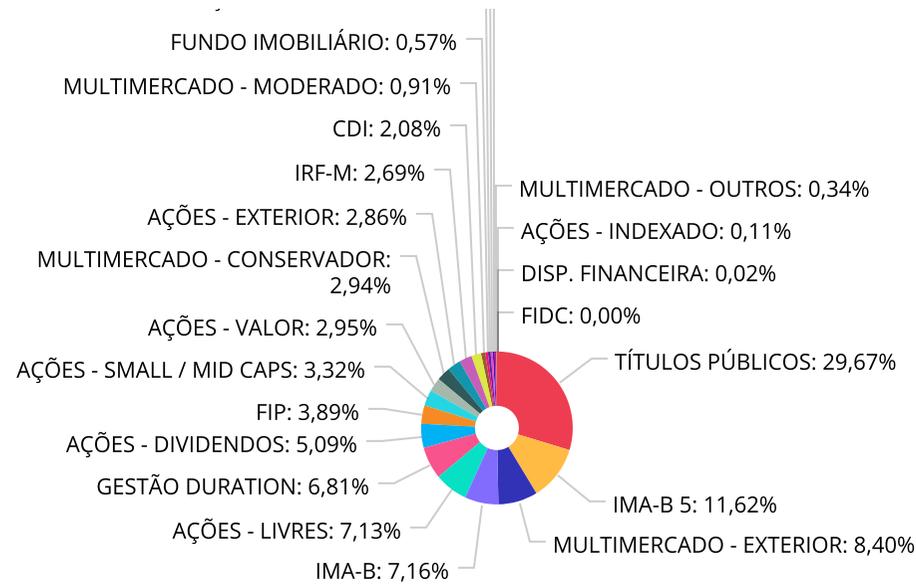
Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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



TESOURO NACIONAL	519.221.957,60
BEM DTVM	287.254.732,58
CAIXA ECONÔMICA	215.714.118,50
BB GESTÃO	164.720.600,94
BANCO SANTANDER	152.693.473,01
BTG PACTUAL	93.786.269,29
ITAÚ UNIBANCO	78.659.000,29
BANCO BRADESCO	61.293.393,64
BNP PARIBAS	48.129.487,61
SANTANDER DTVM	36.439.808,49
SANTANDER CACEIS	30.167.754,47
BANCO DAYCOVAL	26.547.332,22
LIONS TRUST	24.406.224,77
REAG INVESTIMENTOS	5.700.000,00
BV ASSET	4.255.798,19
INTRAG DTVM	706.953,52
GENIAL INVESTIMENTOS	53.290,91
BANCO GENIAL	0,01

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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	519.221.957,60	■ IMA-B 5	203.387.792,29	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	147.041.647,75
■ IMA-B	125.329.544,67	■ AÇÕES - LIVRES	124.793.372,02	■ GESTÃO DURATION	119.096.416,51
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	89.122.109,99	■ FIP	68.051.642,96	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	58.171.209,48
■ AÇÕES - VALOR	51.594.676,85	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	51.479.184,85	■ AÇÕES - EXTERIOR	49.965.458,34
■ IRF-M	47.031.856,40	■ CDI	36.439.808,49	■ MULTIMERCADO - MODERADO	15.851.732,54
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	9.955.798,19	■ AÇÕES - SETORIAIS	9.888.133,73	■ IDKA IPCA 2A	8.101.059,31
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.327.758,92	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.981.708,21	■ AÇÕES - INDEXADO	1.864.036,02
■ DISP. FINANCEIRA	292.632,50	■ FIDC	53.290,92		

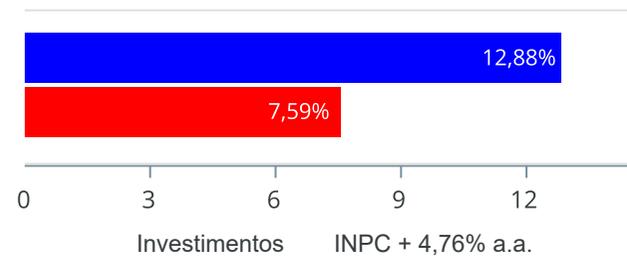
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Novembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.286,887320	10.048.181,87	14.575.416,89	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	13/12/2022	12.000	3959,170000	4.234,705393	47.510.040,00	50.816.464,72	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.311,357752	14.651.394,86	14.874.184,24	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.311,357752	7.520.551,00	13.796.344,81	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.311,357752	13.087.396,08	17.245.431,01	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.311,357752	25.480.686,71	25.868.146,51	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.311,357752	36.097.639,50	36.646.540,89	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.311,357752	55.208.154,53	56.047.650,78	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.373,883581	24.699.419,65	26.243.301,49	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.373,883581	20.000.340,99	21.541.376,64	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.373,883581	20.609.488,43	22.197.459,17	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.373,883581	25.008.464,96	27.118.078,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.327,600553	25.347.747,49	25.965.603,32	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.327,600553	41.512.279,91	43.276.005,53	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.327,600553	25.038.468,13	27.263.883,48	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/04/2022	12.000	4159,261023	4.327,600553	49.911.132,28	51.931.206,64	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	16/05/2023	10.000	428.739,166800	4.381,486329	4.287.391.668,00	43.814.863,29	Mercado

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	1.521.923.415,51	19.745.851,98	15.034.568,84	1.539.330.940,80	12.696.242,15	12.696.242,15	0,83%	0,83%	0,87%	0,87%	95,74%	5,49%
Fevereiro	1.539.330.940,80	164.546.755,80	162.749.949,62	1.532.011.715,31	-9.116.031,67	3.580.210,48	-0,59%	0,24%	1,11%	1,98%	11,86%	4,56%
Março	1.532.011.715,31	42.891.324,38	37.407.841,36	1.558.225.520,96	20.730.322,63	24.310.533,11	1,35%	1,59%	1,07%	3,07%	51,64%	4,33%
Abril	1.558.225.520,96	42.954.742,00	43.288.697,99	1.584.077.622,79	26.186.057,82	50.496.590,93	1,68%	3,29%	0,86%	3,96%	83,10%	3,89%
Mai	1.584.077.622,79	143.992.950,33	149.974.636,62	1.622.403.232,64	44.307.296,14	94.803.887,07	2,80%	6,18%	0,77%	4,76%	129,83%	3,88%
Junho	1.622.403.232,64	20.114.029,88	12.907.496,29	1.682.737.151,27	53.127.385,04	147.931.272,11	3,26%	9,64%	0,29%	5,06%	190,45%	4,10%
Julho	1.682.737.151,27	14.500.000,00	12.269.261,90	1.708.274.197,17	23.306.307,80	171.237.579,91	1,38%	11,16%	0,30%	5,38%	207,57%	3,74%
Agosto	1.708.274.197,17	29.708.078,12	26.370.545,70	1.694.898.716,53	-16.713.013,06	154.524.566,85	-0,98%	10,08%	0,63%	6,04%	166,90%	3,72%
Setembro	1.694.898.716,53	26.170.006,11	22.905.532,73	1.688.785.129,19	-9.378.060,72	145.146.506,13	-0,55%	9,47%	0,48%	6,55%	144,64%	3,91%
Outubro	1.688.785.129,19	13.240.000,00	9.150.905,24	1.670.557.853,51	-22.316.370,44	122.830.135,69	-1,32%	8,02%	0,51%	7,09%	113,22%	4,56%
Novembro	1.670.557.853,51	35.180.898,59	31.274.469,21	1.749.750.196,04	75.285.913,15	198.116.048,84	4,50%	12,88%	0,47%	7,59%	169,69%	4,09%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



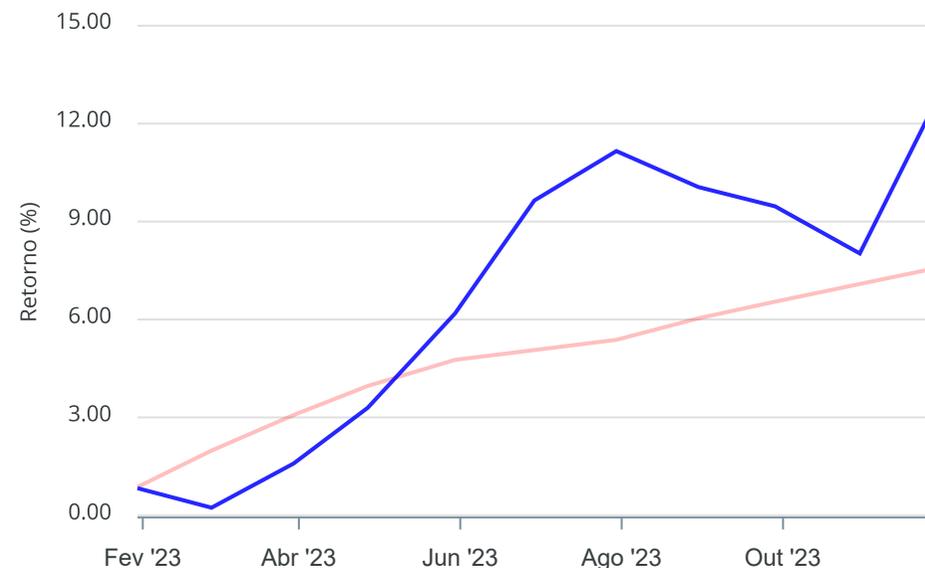
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Novembro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	60.379,93	0,00	16.432,66	53.290,91	9.343,64	15,47%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.691.351,03	0,00	0,00	3.807.865,45	116.514,42	3,16%	3,16%	2,32%
TÍTULOS PÚBLICOS	513.773.156,70	0,00	10.385.717,65	519.221.957,60	15.834.518,55	3,08%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	17.531.723,60	0,00	0,00	17.999.530,88	467.807,28	2,67%	2,67%	1,96%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.910.348,17	0,00	0,00	2.987.186,71	76.838,54	2,64%	2,64%	1,92%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	43.382.568,74	0,00	0,00	44.514.206,23	1.131.637,49	2,61%	2,61%	1,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.330.570,92	0,00	0,00	11.625.114,21	294.543,29	2,60%	2,60%	1,40%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.073.511,68	0,00	0,00	16.490.820,49	417.308,81	2,60%	2,60%	1,90%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	22.668.003,58	0,00	0,00	23.230.699,41	562.695,83	2,48%	2,48%	1,91%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.313.065,44	0,00	0,00	14.667.289,86	354.224,42	2,47%	2,47%	1,09%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.553.592,30	0,00	0,00	14.912.940,71	359.348,41	2,47%	2,47%	1,09%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	17.032.127,72	0,00	0,00	17.451.625,83	419.498,11	2,46%	2,46%	1,09%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	15.920.409,00	0,00	0,00	16.299.235,50	378.826,50	2,38%	2,38%	5,20%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	33.925.552,89	0,00	0,00	34.534.936,07	609.383,18	1,80%	1,80%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	39.139.189,27	0,00	0,00	39.838.666,48	699.477,21	1,79%	1,79%	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.694.168,46	0,00	0,00	12.921.009,77	226.841,31	1,79%	1,79%	0,73%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	76.663.631,09	0,00	0,00	78.030.485,74	1.366.854,65	1,78%	1,78%	0,73%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	37.397.088,53	0,00	0,00	38.062.694,23	665.605,70	1,78%	1,78%	0,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	34.378.626,27	0,00	0,00	34.871.909,30	493.283,03	1,43%	1,43%	0,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	71.814.230,66	0,00	0,00	72.599.393,00	785.162,34	1,09%	1,09%	0,18%



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	11.527.058,12	0,00	11.595.326,93	0,00	68.268,81	0,59%	2,25%	1,97%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	10.580.683,16	34.820.603,79	9.210.294,75	36.439.808,49	248.816,29	0,55%	0,94%	0,03%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNI...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	8.194.548,41	0,00	0,00	8.101.059,31	-93.489,10	-1,14%	-1,14%	11,26%
Total Renda Fixa	1.029.555.585,68	34.820.603,79	31.207.771,99	1.058.661.726,19	25.493.308,71	2,47%		1,17%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	11.366.073,10	0,00	0,00	13.208.723,10	1.842.650,00	16,21%	16,21%	9,84%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	32.589.064,51	0,00	0,00	37.384.882,79	4.795.818,28	14,72%	14,72%	7,57%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	21.674.345,61	0,00	0,00	24.663.460,84	2.989.115,23	13,79%	13,79%	7,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	27.398.719,28	0,00	0,00	31.016.177,15	3.617.457,87	13,20%	13,20%	8,27%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.859.021,88	0,00	0,00	4.353.899,89	494.878,01	12,82%	12,82%	7,81%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.826.042,01	0,00	0,00	17.816.366,59	1.990.324,58	12,58%	12,58%	7,96%
XP INVESTOR FI AÇÕES	10.977.454,99	0,00	0,00	12.351.387,88	1.373.932,89	12,52%	12,52%	7,97%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	32.754.551,47	0,00	0,00	36.822.316,97	4.067.765,50	12,42%	12,42%	7,33%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.683.612,67	0,00	0,00	1.884.587,51	200.974,84	11,94%	11,94%	8,13%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.573.173,27	0,00	0,00	7.327.758,92	754.585,65	11,48%	11,48%	6,96%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.091.600,60	0,00	0,00	16.771.504,42	1.679.903,82	11,13%	11,13%	7,15%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	4.414.564,45	0,00	0,00	4.902.290,20	487.725,75	11,05%	11,05%	10,49%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.236.527,02	0,00	0,00	11.346.856,77	1.110.329,75	10,85%	10,85%	7,75%
OCCAM FIC AÇÕES	13.349.959,64	0,00	0,00	14.772.359,88	1.422.400,24	10,65%	10,65%	6,12%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	39.609.815,79	0,00	0,00	43.748.911,01	4.139.095,22	10,45%	10,45%	9,05%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.619.526,72	0,00	0,00	9.520.008,27	900.481,55	10,45%	10,45%	9,05%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.005.622,82	0,00	0,00	9.888.133,73	882.510,91	9,80%	9,80%	9,19%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.635.620,51	0,00	0,00	17.149.356,19	1.513.735,68	9,68%	9,68%	6,37%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	44.475.783,11	0,00	0,00	48.631.992,15	4.156.209,04	9,34%	9,34%	6,23%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.516.564,81	0,00	0,00	5.981.708,21	465.143,40	8,43%	8,43%	4,44%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	24.029.957,80	0,00	0,00	25.968.278,88	1.938.321,08	8,07%	8,07%	8,53%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	13.778.411,62	0,00	0,00	14.813.213,30	1.034.801,68	7,51%	7,51%	4,55%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.820.942,16	0,00	0,00	15.851.732,54	1.030.790,38	6,95%	6,95%	3,69%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13.823.755,56	0,00	0,00	14.725.699,78	901.944,22	6,52%	6,52%	3,94%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	8.165.091,12	0,00	0,00	8.661.015,62	495.924,50	6,07%	6,07%	3,06%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	22.175.365,70	0,00	0,00	22.760.424,01	585.058,31	2,64%	2,64%	1,03%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	13.091.400,76	0,00	0,00	13.279.256,15	187.855,39	1,43%	1,43%	0,38%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.841.477,61	0,00	0,00	1.864.036,02	22.558,41	1,23%	1,23%	4,04%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.177.939,18	0,00	0,00	22.398.872,95	220.933,77	1,00%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.002.815,17	0,00	0,00	2.007.351,82	4.536,65	0,23%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	579.260,70	0,00	0,00	579.053,34	-207,36	-0,04%	-0,04%	0,02%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.443.176,01	0,00	0,00	20.409.397,00	-33.779,01	-0,17%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	8.404.765,32	0,00	0,00	8.388.819,77	-15.945,55	-0,19%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	12.349.276,93	0,00	0,00	12.298.444,80	-50.832,13	-0,41%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	711.786,93	0,00	0,00	706.953,52	-4.833,41	-0,68%	-	-
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	826.181,21	360.294,80	0,00	1.175.747,74	-10.728,27	-0,90%	-4,52%	5,04%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	5.796.000,00	0,00	30.000,00	5.700.000,00	-66.000,00	-1,14%	-1,14%	12,19%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.373.445,16	0,00	36.697,22	4.255.798,19	-80.949,75	-1,85%	-1,87%	3,94%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	89.177,65	0,00	0,00	87.002,02	-2.175,63	-2,44%	-2,44%	0,01%
Total Renda Variável	520.137.870,85	360.294,80	66.697,22	565.473.779,92	45.042.311,49	8,65%		6,79%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.572.974,41	0,00	0,00	13.683.561,64	1.110.587,23	8,83%	8,83%	4,54%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.142.473,99	0,00	0,00	5.594.843,89	452.369,90	8,80%	8,80%	6,73%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.532.095,40	0,00	0,00	15.481.491,18	949.395,78	6,53%	6,53%	4,52%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	20.303.336,53	0,00	0,00	21.560.385,90	1.257.049,37	6,19%	6,19%	4,42%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.105.572,74	0,00	0,00	4.358.849,08	253.276,34	6,17%	6,17%	4,58%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	13.023.040,17	0,00	0,00	13.809.232,22	786.192,05	6,04%	6,04%	4,35%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	13.281.234,08	0,00	0,00	14.023.093,74	741.859,66	5,59%	5,59%	6,78%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	11.317.537,31	0,00	0,00	11.918.445,59	600.908,28	5,31%	5,31%	4,26%
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	4.551.700,30	0,00	0,00	4.745.513,48	193.813,18	4,26%	4,26%	6,49%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	11.478.042,70	0,00	0,00	10.787.278,53	-690.764,17	-6,02%	-6,02%	8,92%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	10.556.389,35	0,00	0,00	9.651.994,68	-904.394,67	-8,57%	-8,57%	12,93%
Total Exterior	120.864.396,98	0,00	0,00	125.614.689,93	4.750.292,95	3,93%		5,91%

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.

