

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.138.850,47	7,20%	794	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.717.468,41	9,15%	638	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	826.159,33	2,78%	96	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.925.531,92	16,59%	794	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.408.481,79	14,84%	873	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.052.969,10	17,01%	933	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	4.006.394,26	13,49%	156	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.258,53	0,06%	721	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	5.604.906,35	18,87%	1.116	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			29.698.020,16				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			123.346,98				Artigo 6º
PL Total			29.821.367,14				

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%	20,23%	100,00%	29.698.020,16
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	24.093.113,81	81,13%	15,55%	20,23%	100,00%	5.604.906,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	5.604.906,35	18,87%	13,13%	17,50%	60,00%	12.213.905,75
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,50%	20,00%	5.939.604,03
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,20%	5,00%	1.484.901,01
Total Renda Fixa	100,00%	29.698.020,16	100,00%	28,68%	78,66%	285,00%	

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%	0,00	0,00%	9,10%	10,32%	20,00%	5.939.604,03
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,82%	20,00%	5.939.604,03
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	2,40%	3,20%	10,00%	2.969.802,02
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	0,00	0,00%	11,50%	15,34%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,75%	6,00%	10,00%	2.969.802,02
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	3,75%	6,00%	10,00%	

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	18.410.635,60	61,99	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.287.384,56	38,01	-

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
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%
IMA Geral (Benchmark)	0,18%	10,59%	1,80%	6,72%	12,50%	22,90%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	10,45%	1,66%	6,62%	12,55%	22,56%	1,01%	2,22%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	10,54%	1,67%	6,70%	12,49%	22,56%	1,03%	2,36%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	8,79%	1,67%	4,28%	11,46%	21,66%	0,98%	2,19%
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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	9,87%	3,22%	6,49%	13,40%	26,08%	0,01%	0,08%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	9,91%	3,16%	6,49%	13,34%	25,92%	0,03%	0,07%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	1,42%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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

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

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	25.851.963,58	753.468,01	530.000,00	26.342.720,57	267.288,98	267.288,98	1,03%	1,03%	0,93%	0,93%	109,76%	1,07%
Fevereiro	26.342.720,57	663.468,01	550.000,00	26.772.092,02	315.903,44	583.192,42	1,19%	2,23%	1,17%	2,12%	105,44%	1,03%
Março	26.772.092,02	713.468,01	600.000,00	27.305.478,70	419.918,67	1.003.111,09	1,56%	3,83%	1,13%	3,27%	116,95%	0,73%
Abril	27.305.478,70	713.468,01	600.000,00	27.703.897,56	284.950,85	1.288.061,94	1,04%	4,91%	0,94%	4,24%	115,61%	0,60%
Mai	27.703.897,56	713.468,01	520.000,00	28.252.817,54	355.451,97	1.643.513,91	1,27%	6,24%	0,63%	4,90%	127,32%	0,63%
Junho	28.252.817,54	713.468,01	580.000,00	28.805.143,90	418.858,35	2.062.372,26	1,48%	7,81%	0,30%	5,22%	149,58%	0,85%
Julho	28.805.143,90	613.468,01	600.000,00	29.086.396,57	267.784,66	2.330.156,92	0,93%	8,81%	0,50%	5,75%	153,21%	0,71%
Agosto	29.086.396,57	743.468,01	620.000,00	29.395.401,90	185.537,32	2.515.694,24	0,64%	9,50%	0,65%	6,44%	147,56%	0,75%
Setembro	29.395.401,90	713.468,01	550.000,00	29.636.041,79	77.171,88	2.592.866,12	0,26%	9,79%	0,63%	7,11%	137,75%	0,85%

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.095,51	0,00	0,00	17.258,53	163,02	0,95%	0,95%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.387.914,25	713.468,01	550.000,00	5.604.906,35	53.524,09	0,88%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.905.721,14	0,00	0,00	4.925.531,92	19.810,78	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.392.849,26	0,00	0,00	4.408.481,79	15.632,53	0,36%	0,36%	0,74%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	824.874,37	0,00	0,00	826.159,33	1.284,96	0,16%	0,16%	1,01%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	4.000.478,56	0,00	0,00	4.006.394,26	5.915,70	0,15%	0,15%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.047.320,53	0,00	0,00	5.052.969,10	5.648,57	0,11%	0,11%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.136.475,74	0,00	0,00	2.138.850,47	2.374,73	0,11%	0,11%	0,99%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.744.055,50	0,00	0,00	2.717.468,41	-26.587,09	-0,97%	-0,97%	2,52%
Total Renda Fixa	29.456.784,86	713.468,01	550.000,00	29.698.020,16				