

# RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS



## Fundoprev Consolidado

Instituto de Previdência do Estado do Rio Grande do Sul - RS



## RELATÓRIO GERENCIAL - Fundoprev Consolidado

Cenário Econômico do Mês	4
Parecer do Gestor de Recursos	6
Saldo, Liquidez e Custo das Aplicações	7
Distribuição da Carteira	10
Retorno da Carteira por Ativo	11
Retornos Históricos da Carteira	15
Rentabilidade da Carteira (em %)	16
Evolução do Patrimônio Líquido	17
Enquadramento da Carteira	18
Rentabilidade e Risco dos Ativos	22
Comparativo de Indicadores	26
Análise do Risco da Carteira	27
Gerenciamento de Riscos	29

## RELATÓRIO GERENCIAL - Fundoprev Militar

Saldo, Liquidez e Custo das Aplicações	31
Distribuição da Carteira	34
Retorno da Carteira por Ativo	35
Rentabilidade da Carteira (em %)	39
Movimentações	40

## RELATÓRIO GERENCIAL - Fundoprev Civil

Saldo, Liquidez e Custo das Aplicações	42
--	----

### Disclaimer

Este relatório é fornecido exclusivamente a título informativo e não constitui nem deve ser interpretado como oferta ou solicitação de compra ou venda de valores mobiliários, instrumento financeiro ou de participação em qualquer estratégia de negócios específica, qualquer que seja a jurisdição. Algumas das informações aqui contidas foram obtidas com base em dados de mercado, de fontes públicas consideradas confiáveis, ou ainda através de documentos fornecidos pelo próprio cliente. A emissora deste relatório não declara ou garante, de forma expressa ou implícita, a integridade, confiabilidade ou exatidão de tais informações e se exime de qualquer responsabilidade por quaisquer prejuízos, diretos ou indiretos, que venham a decorrer da utilização deste relatório e de seu conteúdo. As opiniões, estimativas e projeções expressas neste relatório refletem o atual julgamento do responsável pelo seu conteúdo na data de sua divulgação e estão, portanto, sujeitas a alterações sem aviso prévio. As projeções utilizam dados históricos e suposições, de forma que devem ser realizadas as seguintes advertências: (1) Não estão livres de erros; (2) Não é possível garantir que os cenários obtidos venham efetivamente a ocorrer; (3) Não configuram, em nenhuma hipótese, promessa ou garantia de retorno esperado, nem de exposição máxima de perda; (4) Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura; e (5) Não há qualquer tipo de garantia, implícita ou explícita, prestada pela emissora do relatório ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo Fundo Garantidor de Crédito - FGC.

Distribuição da Carteira	45
Retorno da Carteira por Ativo	46
Rentabilidade da Carteira (em %)	50
Movimentações	51

#### Disclaimer

Este relatório é fornecido exclusivamente a título informativo e não constitui nem deve ser interpretado como oferta ou solicitação de compra ou venda de valores mobiliários, instrumento financeiro ou de participação em qualquer estratégia de negócios específica, qualquer que seja a jurisdição. Algumas das informações aqui contidas foram obtidas com base em dados de mercado, de fontes públicas consideradas confiáveis, ou ainda através de documentos fornecidos pelo próprio cliente. A emissora deste relatório não declara ou garante, de forma expressa ou implícita, a integridade, confiabilidade ou exatidão de tais informações e se exime de qualquer responsabilidade por quaisquer prejuízos, diretos ou indiretos, que venham a decorrer da utilização deste relatório e de seu conteúdo. As opiniões, estimativas e projeções expressas neste relatório refletem o atual julgamento do responsável pelo seu conteúdo na data de sua divulgação e estão, portanto, sujeitas a alterações sem aviso prévio. As projeções utilizam dados históricos e suposições, de forma que devem ser realizadas as seguintes advertências: (1) Não estão livres de erros; (2) Não é possível garantir que os cenários obtidos venham efetivamente a ocorrer; (3) Não configuram, em nenhuma hipótese, promessa ou garantia de retorno esperado, nem de exposição máxima de perda; (4) Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura; e (5) Não há qualquer tipo de garantia, implícita ou explícita, prestada pela emissora do relatório ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo Fundo Garantidor de Crédito - FGC.

O mês de outubro apresentou a continuidade da aversão ao risco, proporcionando um declínio na rentabilidade dos ativos financeiros pelo mundo. Ademais, o conflito entre Israel e Hamas refletiu em mais volatilidade no preço do petróleo e, conseqüentemente, em novos riscos sobre a inflação, que, por sua vez, trouxe mais cautela na atuação dos principais bancos centrais do mundo.

Nos Estados Unidos, os indicadores de atividade econômica apresentaram um desempenho acima do esperado. A principal evidência dessa constatação foi a preliminar do Produto Interno Bruto (PIB) do terceiro trimestre que cresceu 4,9%. O impulso de crescimento entre os trimestres confirmou a expansão fiscal e reforça a resiliência do consumo e mercado de trabalho.

Sobre os dados do mercado de trabalho, os principais relatórios de criação de emprego consolidaram a necessidade de manter a taxa básica de juros americana elevada por mais tempo. O relatório Payroll trouxe bastante volatilidade no mercado após apresentar a geração de 336 mil empregos em setembro. Em consonância, o Índice de Preços ao Consumidor (CPI) subiu 0,4% e se manteve em 3,7% na taxa anual. O CPI de setembro é um lembrete de que a estabilidade dos preços exigirá mais tempo para ancoragem na meta de inflação, principal objetivo do Federal Reserve (Fed).

O campo fiscal americano foi um tema preocupante que alertou o mercado, após o presidente da Câmara dos Representantes ser destituído do cargo em meio às discussões sobre o orçamento governamental. Observou-se a elevação dos gastos do governo com a emissão de mais dívidas, que causou bastante volatilidade no prêmio deste ativo e deteriorou em margem os investimentos em mercado emergentes, principalmente no Brasil.

Neste contexto, o Fed reconheceu a resiliência econômica, mas também destacou a temporalidade dos efeitos do aperto monetário. Por essa razão, a taxa de juros ficou inalterada em sua última reunião.

Em contrapartida, os dados de atividade na Zona do Euro continuam indicando uma fragilidade em sua economia após a divulgação de queda de 0,1% na preliminar do PIB do terceiro trimestre. Por sua vez, a preliminar do CPI cresceu apenas 0,1% em outubro e acumula 2,9% em 12 meses. O núcleo da inflação permanece pressionado, uma vez que a queda expressiva do índice cheio advém da queda do preço de energia. Diante desse cenário, confirmou-se uma abordagem mais suave sobre os juros pelo Banco Central Europeu.

Em um ambiente de economia enfraquecida e inflação cheia apresentando sinais de arrefecimento, o BCE optou por manter a taxa de juros inalteradas em 4,5% ao ano. A presidente do BCE, Christine Lagarde, enfatizou que os próximos movimentos da estratégia da política monetária vão depender dos resultados futuros dos indicadores econômicos.

Por outro lado, a China apresentou dados positivos de uma forma geral, com

expansão dos indicadores tanto em indústria quanto em serviço. Os estímulos aplicados pelo governo devem permanecer como foco da recuperação da economia, dado que o rendimento disponível para as famílias está reduzido, além de outros riscos substanciais, como o mercado imobiliário.

Outro indicativo dos incentivos governamentais pode ser observado pelo PIB do terceiro trimestre que cresceu 4,9% em relação ao mesmo trimestre do ano anterior e 1,3% em relação ao segundo trimestre do mesmo ano. Por isso, há perspectiva de que o país consiga atingir a meta de crescimento de 5% neste ano.

No entanto, o indicador de inflação ficou inalterado em setembro em relação ao mesmo período do ano anterior. Dessa maneira, o mercado permaneceu orientado para maior prudência nos ativos de risco, dado todo o contexto interno da economia chinesa e externo.

A economia brasileira apresentou dados de atividade abaixo do esperado. A indústria do país denotou uma variação positiva de 0,4% em agosto, mas o crescimento ocorreu principalmente devido à fraca base de comparação entre os meses anteriores. O setor de serviços recuou 0,9%, após acumular um crescimento de 2,1% no período entre maio e julho. Por fim, o varejo teve queda de 0,2%, justificada por problemas financeiros e a redução no número de lojas.

De forma consolidada, o indicador IBC-Br de agosto reforça o processo de desaceleração da economia. Dado o contexto da temporalidade dos efeitos de uma política monetária, é um efeito saudável da normalização do cenário econômico.

No mercado de trabalho, a taxa de desocupação da população ficou em 7,7% no terceiro trimestre, resultado induzido pelo crescimento expressivo no número de pessoas trabalhando e pela retração de pessoas buscando trabalho. Corroborando para este resultado, o Novo Caged registrou a criação de mais de 211 mil novos empregos e menor variação salarial. Fica evidente que o Brasil apresenta uma economia aquecida, mas a perspectiva é que ocorra uma desaceleração do ritmo de crescimento neste ano.

O Comitê de Política Monetária (Copom) decidiu por unanimidade reduzir a taxa Selic em 0,50 ponto percentual, conforme esperado. Dessa forma, a taxa básica de juros passou para 12,25% e caso o cenário desinflacionário permaneça nos próximos meses, a autoridade monetária já considera a continuidade do ritmo de cortes de mesma magnitude nas próximas reuniões. O alerta do Copom está relacionado à perseguição das metas fiscais pelo governo, uma vez que as recentes incertezas com as contas públicas podem consolidar no mercado as expectativas por uma Selic terminal mais alta.

No campo fiscal, o mercado acompanhou a preocupação do governo em adquirir maneiras de elevar a arrecadação, com a finalidade de atingir a meta fiscal do novo arcabouço no próximo ano. Ademais, o principal ruído foi a declaração do presidente Lula no final do mês, em que ele afirmou que não buscará atingir a meta

fiscal de déficit zero no próximo ano. Ainda que o investidor considerasse a meta zero ambiciosa e projetasse déficit primário em torno de 0,70% do PIB, esperava-se um esforço da equipe econômica em perseguir a meta.

O comunicado do Ministro Haddad também contribuiu para deteriorar a perspectiva de mercado, após as tentativas de esquivar das perguntas comprometedoras a respeito dos compromissos orçamentários do próximo ano. Haddad apresenta uma preocupação com a queda de arrecadação e deve trabalhar para o atingimento da meta fiscal de déficit zero, alvo também defendido pelo presidente da Câmara e do Senado.

A aversão ao risco determinou a rentabilidade dos ativos de risco em outubro. Os ativos brasileiros acompanharam o movimento global, com o Ibovespa apresentando queda e os juros futuros denotando alta.

No mês de outubro, o cenário externo apresentou o índice de preços de gastos com consumo (PCE) dos Estados Unidos, medida de inflação preferida do Fed, com alta de 0,4% em setembro na comparação com agosto. Mercado previa avanço de 0,3%. Inflação da Zona do Euro recua para 2,9% em outubro, ou seja, a taxa caiu 1,4 pp em comparação a setembro. Na China a inflação em setembro foi zero em relação ao ano passado. Expectativa do mercado era que preços subissem 0,2% ao mês. A inflação na economia global está diminuindo, mas permanece acima das metas estabelecidas pelos bancos centrais, exceto China. Na maioria das economias, a prioridade continua sendo a desinflação sustentada, garantindo a estabilidade financeira. Entre os riscos negativos, destacam-se um estresse bancário mais generalizado e uma política monetária mais restritiva. A credibilidade dos bancos centrais continua a ser crucial para a estabilidade macroeconômica.

No ambiente interno o PIB registrou alta de 0,9% no 2º trimestre de 2023 em relação ao 1º trimestre. Na comparação com o 2º trimestre de 2022, o crescimento foi de 3,4%, conforme IBGE. No semestre, o crescimento acumulado foi de 3,7%. Segundo o Instituto, em setembro a indústria avançou apenas 0,1% se comparado com agosto 0,2% e o comércio cresceu 0,6% ante -0,1% em agosto. As expectativas são de um PIB resiliente neste segundo semestre, em um ambiente de juros ainda elevados, apesar dos cortes recentes da taxa básica pelo Banco Central. Segundo o boletim Focus, o PIB deve crescer cerca de 2,89% neste ano, resultado ligeiramente abaixo dos 2,92% registrados há 4 semanas, conforme divulgado pelo Banco Central do Brasil em 06 de novembro, e bem acima dos cerca de 0,85% projetados para 2023 no boletim divulgado em 06 de março. OIPCA subiu 0,24% em outubro, pequena desaceleração após alta de 0,26% em setembro. No ano, acumula alta de 3,75%. A projeção para o IPCA de 2024, foco da política monetária, sofreu piora no Focus de 06 de novembro, de 3,88% para 3,91%. A revisão para cima afasta um pouco mais a inflação do centro da meta do ano que vem, fixado em 3,00%.

A rentabilidade da carteira de investimentos apresentou -0,01%, para o Fundoprev Civil, em decorrência especialmente de Fato Relevante - FR do FIP Multisetorial que, segundo informações da administradora, reduziu o valor de sua cota após verificações de risco e controle. Para o Fundoprev Militar tivemos o resultado de 0,445%, sendo a meta de retorno estabelecida para o mês de 0,652%. No ano a rentabilidade do Fundoprev Civil e Militar são 9,1% e 9,7%, respectivamente, superior à meta anual da carteira Fundoprev de 8,1%.

ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO	CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE	CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE	
<b>TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO</b>		<b>28,64</b>	<b>1.334.292.966,58</b>	<b>1.321.305.443,29</b>					
LFT 01/03/2024 (Compra em 06/12/2022)	7, l, a	0,90	42.042.505,03	41.627.578,28	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (i)	7, l, a	0,90	42.042.505,02	41.627.578,29	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (ii)	7, l, a	1,20	56.056.673,37	55.503.437,71	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (iii)	7, l, a	0,30	14.014.168,34	13.875.859,43	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 23/08/2023)	7, l, a	1,50	70.070.841,70	69.378.117,71	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 28/08/2023)	7, l, a	1,50	70.070.841,70	69.378.117,71	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 29/08/2023)	7, l, a	1,50	70.070.841,70	69.378.117,71	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2026 (Compra em 26/09/2023)	7, l, a	0,90	42.012.528,72	41.598.813,85	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/09/2025 (Compra em 04/09/2023)	7, l, a	7,52	350.328.282,33	346.872.203,15	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/09/2026 (Compra em 27/09/2023)	7, l, a	12,01	559.416.450,72	554.035.323,24	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LTN 01/01/2025 (Compra em 24/08/2022)	7, l, a	0,19	8.845.029,24	8.791.421,59	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LTN 01/07/2024 (Compra em 25/08/2022)	7, l, a	0,20	9.322.298,71	9.238.874,62	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>		<b>20,41</b>	<b>950.561.258,21</b>	<b>838.471.034,55</b>					
LTN 01/01/2024 (Compra em 11/08/2022 Tx 12.9600)	7, l, a	0,21	9.803.682,50	9.704.626,99	D+0	D+0	01/01/2024	0,00	Não há
LTN 01/01/2024 (Compra em 26/08/2022 Tx 13.2200)	7, l, a	0,21	9.800.016,09	9.699.139,21	D+0	D+0	01/01/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 06/09/2023 Tx 5.6400)	7, l, a	0,46	21.463.092,05	21.313.707,67	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)	7, l, a	0,46	21.270.177,15 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 22/09/2023 Tx 5.5600)	7, l, a	0,46	21.486.593,43	21.338.396,17	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)	7, l, a	0,46	21.264.691,42 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)	7, l, a	0,46	21.279.569,39 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 25/09/2023 Tx 5.5280)	7, l, a	0,46	21.496.006,44	21.348.284,00	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.9502)	7, l, a	0,46	21.372.390,46	21.218.436,13	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 28/08/2023 Tx 5.5850)	7, l, a	0,46	21.479.237,56	21.330.664,16	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 30/08/2022 Tx 6.0300)	7, l, a	0,92	42.698.318,44	42.388.117,13	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 08/11/2022 Tx 5.6800)	7, l, a	0,46	21.564.557,32	21.413.871,28	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 11/11/2022 Tx 6.0600)	7, l, a	0,92	42.637.726,04	42.326.965,91	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 15/08/2022 Tx 5.6510)	7, l, a	0,93	43.159.992,65	42.859.209,53	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 18/04/2022 Tx 5.7400)	7, l, a	1,90	88.680.179,86	88.056.012,46	D+0	D+0	15/05/2055	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 03/02/2023 Tx 6.6300)	7, l, a	0,27	12.566.739,43	12.469.574,93	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 06/02/2023 Tx 6.7400)	7, l, a	0,27	12.556.752,91	12.458.592,59	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 10/08/2022 Tx 6.1600)	7, l, a	0,45	21.016.025,68	20.861.230,10	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 13/12/2022 Tx 6.7160)	7, l, a	0,45	20.931.537,11	20.768.321,71	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/08/2023 Tx 6.6110)	7, l, a	0,45	20.947.433,27	20.785.796,45	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/12/2022 Tx 6.9300)	7, l, a	0,45	20.899.225,32	20.732.791,82	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 18/08/2022 Tx 6.4750)	7, l, a	0,90	41.936.134,18	41.616.948,45	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há

ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO	CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE	CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE	
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>		<b>20,41</b>	<b>950.561.258,21</b>	<b>838.471.034,55</b>					
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4400)	7, I, a	0,45	20.973.386,59	20.814.319,87	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 05/10/2022 Tx 5.7350)	7, I, a	0,45	21.171.953,46	21.023.021,72	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)	7, I, a	0,45	21.080.690,83 ▲	-	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 28/09/2023 Tx 5.5750)	7, I, a	0,46	21.254.945,93	21.108.094,46	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/01/2023 Tx 6.1400)	7, I, a	0,27	12.579.905,19	12.487.484,98	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)	7, I, a	0,45	21.015.049,07 ▲	-	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 16/09/2022 Tx 5.8930)	7, I, a	0,46	21.202.000,31	21.050.239,19	D+0	D+0	15/08/2032	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/10/2022 Tx 5.7500)	7, I, a	0,46	21.400.463,28	21.249.675,08	D+0	D+0	15/08/2032	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 06/07/2022 Tx 6.1360)	7, I, a	0,89	41.446.200,15	41.141.668,76	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 08/06/2022 Tx 5.9000)	7, I, a	1,83	85.431.462,96	84.819.433,96	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 12/07/2022 Tx 6.3520)	7, I, a	0,87	40.335.006,98	40.031.867,42	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/06/2022 Tx 5.9650)	7, I, a	0,91	42.360.114,76	42.054.542,42	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>		<b>36,51</b>	<b>1.700.933.268,06</b>	<b>1.761.904.477,88</b>					
Austro FIC Ativo Renda Fixa IMA-B	7, III, a	0,06	2.769.778,26	3.834.889,37	D+1	D+4	Não há	0,30	Não há
Banrisul Absoluto	7, I, b	1,08	50.305.989,38 ▼	103.127.070,03	D+0	D+0	Não há	0,15	Não há
Banrisul Previdência IPCA 2024	7, I, b	0,04	1.810.970,00	1.797.510,00	D+0	D+0	15/08/2024	0,15	Não há
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	7, III, a	23,80	1.108.562.007,97 ▲	1.096.237.995,16	D+0	D+0	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário IRF-M 1+	7, I, b	0,15	6.896.994,21	6.891.934,21	D+1	D+1	Não há	0,30	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IDKa 2	7, I, b	1,65	76.762.673,45	77.016.627,28	D+1	D+1	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	7, I, b	0,68	31.765.252,80	31.653.414,97	D+1	D+1	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos X	7, I, b	0,21	9.745.381,87	9.703.380,09	D+1	D+1	15/08/2024	0,20	Não há
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	7, III, a	7,07	329.123.499,73 ▼	347.914.644,56	D+0	D+0	Não há	0,20	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	7, I, b	0,04	1.852.976,84	1.844.938,56	D+0	D+0	16/08/2024	0,20	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 IV	7, I, b	0,19	8.974.585,34	8.935.601,50	D+0	D+0	15/08/2024	0,20	Não há
It Now Fundo de Índice IMA-B IMAB11	7, III, b	1,55	72.181.231,20	72.759.606,45	D+0	D+0	Não há	0,25	Não há
VCM FIC Renda Fixa 1000 IMA-B	7, III, a	0,00	181.927,01	186.865,70	D+1000	D+1002	Não há	0,20	Não há
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>		<b>8,34</b>	<b>388.711.595,07</b>	<b>402.356.694,18</b>					
BB FIA Bolsa Americana	8, I	0,15	6.816.978,05	6.939.069,83	D+1	D+3	Não há	1,00	20% exc S&P 500
BB FIA Governança	8, I	1,37	63.837.826,86	66.231.760,72	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Consumo	8, I	0,26	11.938.573,07	13.103.040,32	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Exportação	8, I	0,47	21.759.171,67	22.501.000,89	D+1	D+3	Não há	2,00	Não há
BB FIC FIA Retorno Total	8, I	0,28	13.220.213,65	13.676.151,43	D+0	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Seleção Fatorial	8, I	2,07	96.269.133,65	99.147.107,16	D+1	D+3	Não há	1,00	20% exc Ibovespa
BB FIC FIA Siderurgia	8, I	0,15	7.019.486,85	7.478.888,52	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Valor	8, I	0,86	40.042.746,83	41.621.732,54	D+30	D+32	Não há	2,00	20% exc Ibovespa

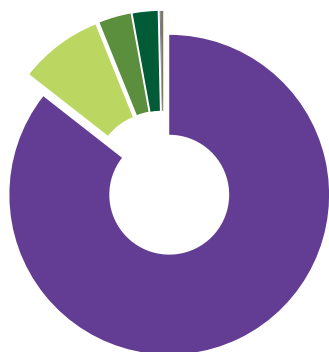


ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>		<b>8,34</b>	<b>388.711.595,07</b>	<b>402.356.694,18</b>
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	8, I	0,75	34.733.902,92	36.155.703,49
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11	8, II	0,48	22.179.545,52 ▼	24.175.067,28
Ishares Fundo de Índice Small Cap SMAL11	8, II	0,26	12.262.910,00	13.379.030,00
Ishares Fundo de Índice S&P 500 IVVB11	8, II	0,71	32.962.371,00	33.643.884,00
Trend ETF LBMA Ouro GOLD11	8, II	0,44	20.684.840,00	19.162.748,00
Trend ETF MSCI Europa	8, II	0,11	4.983.895,00	5.141.510,00
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>		<b>3,23</b>	<b>150.460.226,80</b>	<b>157.150.858,97</b>
BB FIA Nordea Global Climate and Environment IE	9, II	1,37	63.921.349,73	67.318.544,68
BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I	9, III	0,21	9.694.983,18 ▼	11.501.298,72
BB Global Select Equity IE Multimercado	9, II	1,18	54.961.800,35	55.904.091,75
BB Schroder Multimercado IE	9, II	0,47	21.882.093,54	22.426.923,82
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>		<b>1,75</b>	<b>81.530.509,20</b>	<b>82.952.683,31</b>
Caixa Bolsa Americana Multimercado	10, I	1,52	70.931.731,03	72.211.061,48
Caixa FIC Capital Protegido Bolsa de Valores IV Mult.	10, I	0,23	10.598.778,17	10.741.621,83
<b>FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES</b>		<b>0,81</b>	<b>37.934.974,36</b>	<b>48.420.761,49</b>
Austro FIP Multisetorial	-	0,05	2.527.545,92	12.291.457,23
BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11	10, II	0,62	28.955.521,05 ▼	29.673.446,85
FIP LSH Multiestratégia	10, II	0,14	6.347.935,67	6.351.781,67
RJI FIP Puma	10, II	0,00	103.971,72	104.075,74
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>		<b>0,24</b>	<b>11.286.419,67</b>	<b>11.325.862,42</b>
BRB FII SIA Corporate	11	0,23	10.487.219,67	10.510.262,42
Caixa FII Rio Bravo CXRI11	11	0,02	799.200,00 ▼	815.600,00
<b>VALORES MOBILIÁRIOS</b>		<b>0,04</b>	<b>1.919.306,05</b>	<b>1.919.306,05</b>
Ações Cais Mauá do Brasil S.A.	-	0,04	1.919.306,05	1.919.306,05
<b>CONTAS CORRENTES</b>		<b>0,02</b>	<b>807.248,46</b>	<b>600.030,69</b>
Banco do Brasil		0,00	-	-
Banrisul		0,02	807.248,33	600.030,56
BTG Pactual		0,00	-	-
Caixa Econômica Federal		0,00	-	-
XP Investimentos		0,00	0,13	0,13
<b>TOTAL DA CARTEIRA</b>		<b>100,0%</b>	<b>4.658.437.772,46</b>	<b>4.626.407.152,83</b>

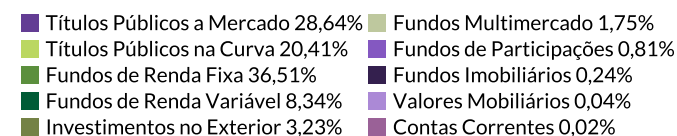
▲ Entrada de Recursos
▲ Nova Aplicação
▼ Saída de Recursos
▼ Resgate Total

CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE		CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE
D+21	D+23	Não há	1,72	Não há
D+0	D+2	Não há	0,10	Não há
D+0	D+3	Não há	0,50	Não há
D+0	D+0	Não há	0,23	Não há
D+0	D+2	Não há	0,00	Não há
D+0	D+0	Não há	0,30	Não há
D+1	D+5	Não há	0,30	Não há
D+0	D+2	Não há	0,85	Não há
D+1	D+5	Não há	0,08	Não há
D+1	D+5	Não há	0,08	Não há
D+0	D+1	Não há	0,80	Não há
D+0	D+2	761 dias	0,90	Não há
Vide regulamento	Vide regulamento	No vencimento	0,50	20% exc IPCA+8%aa
D+0	D+2	Não há	1,10	Não há
Vide regulamento	Vide regulamento	No vencimento	0,08	20% exc IPCA+8%aa
No vencimento	No vencimento	No vencimento	0,00	Não há
Vide regulamento	Vide regulamento	Não há	0,50	Não há
D+0	D+2	Não há	1,20	Não há
D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

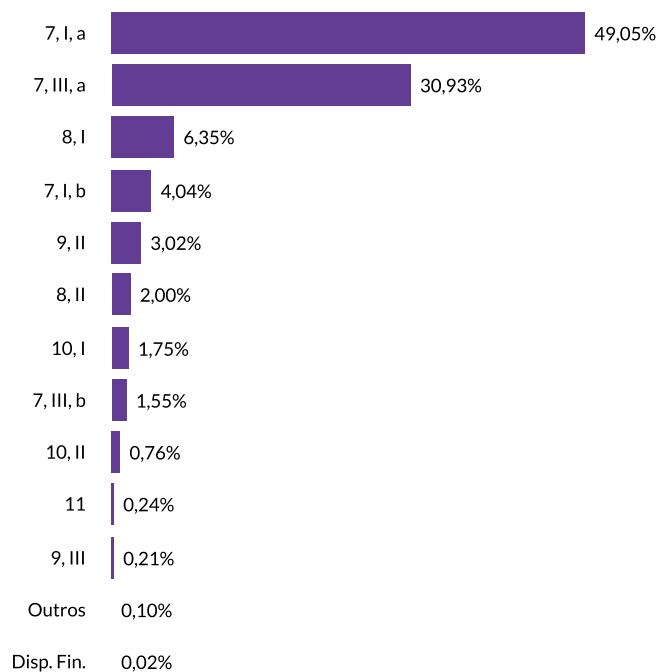
POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO 4.963



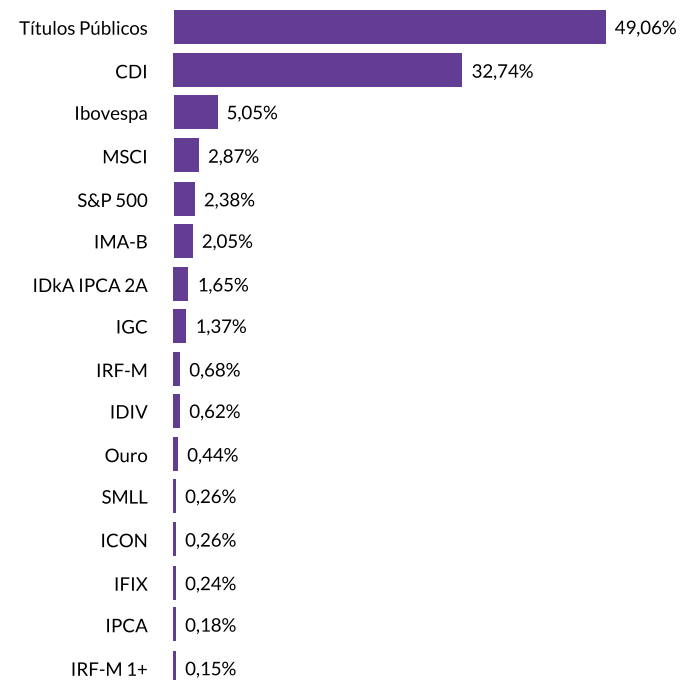
POR SEGMENTO



POR TIPO DE ATIVO



POR BENCHMARK



ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO</b>	<b>76.475.086,32</b>	<b>14.089.172,87</b>	<b>15.577.809,31</b>	<b>7.937.225,12</b>	<b>12.987.523,29</b>			<b>127.066.816,91</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 06/12/2022)	2.462.148,33	430.482,66	466.210,96	402.147,39	414.926,75			<b>4.175.916,09</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (i)	2.155.099,02	430.482,65	466.210,96	402.147,41	414.926,73			<b>3.868.866,77</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (ii)	2.873.465,36	573.976,88	621.614,60	536.196,54	553.235,66			<b>5.158.489,04</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (iii)	718.366,34	143.494,22	155.403,65	134.049,14	138.308,91			<b>1.289.622,26</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 23/08/2023)	-	-	210.428,23	673.944,59	692.723,99			<b>1.577.096,81</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 28/08/2023)	-	-	107.558,74	673.944,59	692.723,99			<b>1.474.227,32</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 29/08/2023)	-	-	74.401,51	673.944,59	692.723,99			<b>1.441.070,09</b>
LFT 01/03/2026 (Compra em 26/09/2023)	-	-	-	72.072,43	413.714,87			<b>485.787,30</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 01/02/2023)	2.688.337,08	576.342,27	621.559,01	27.064,21	-			<b>3.913.302,57</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 01/09/2022)	7.378.842,15	1.296.770,08	1.398.507,79	60.894,49	-			<b>10.135.014,51</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 03/02/2023)	1.977.827,06	432.256,69	466.169,27	20.298,15	-			<b>2.896.551,17</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 03/08/2022)	2.459.614,05	432.256,70	466.169,26	20.298,16	-			<b>3.378.338,17</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 09/08/2022)	3.279.485,40	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,89</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 12/08/2022)	3.279.485,40	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,89</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 14/11/2022)	3.279.485,39	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,88</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 16/08/2022)	3.279.485,40	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,89</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 17/10/2022)	3.279.485,39	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,88</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 20/10/2022)	2.049.678,38	360.213,91	388.474,39	16.915,12	-			<b>2.815.281,80</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 23/08/2022)	3.279.485,40	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,89</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 24/01/2023)	2.844.125,97	576.342,27	621.559,01	27.064,21	-			<b>4.069.091,46</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 25/10/2022)	3.279.485,39	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,88</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 26/09/2022)	6.558.970,80	1.152.684,51	1.243.118,04	54.128,44	-			<b>9.008.901,79</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 26/10/2022)	3.279.485,39	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,88</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 28/09/2022)	3.279.485,39	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,88</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 28/10/2022)	3.279.485,39	576.342,26	621.559,02	27.064,21	-			<b>4.504.450,88</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 30/01/2023) (i)	2.740.489,69	576.342,27	621.559,01	27.064,21	-			<b>3.965.455,18</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 30/01/2023) (ii)	2.740.489,69	576.342,27	621.559,01	27.064,21	-			<b>3.965.455,18</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 31/01/2023)	2.714.879,56	576.342,27	621.559,01	27.064,21	-			<b>3.939.845,05</b>
LFT 01/09/2025 (Compra em 04/09/2023)	-	-	-	3.010.567,58	3.456.079,18			<b>6.466.646,76</b>
LFT 01/09/2026 (Compra em 27/09/2023)	-	-	-	665.466,80	5.381.127,48			<b>6.046.594,28</b>
LTN 01/01/2025 (Compra em 24/08/2022)	692.842,21	93.171,50	88.470,54	40.660,56	53.607,65			<b>968.752,46</b>
LTN 01/07/2024 (Compra em 25/08/2022)	625.056,69	98.249,12	101.686,12	73.585,99	83.424,09			<b>982.002,01</b>
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>	<b>45.276.308,86</b>	<b>3.615.992,33</b>	<b>5.575.912,21</b>	<b>5.605.110,14</b>	<b>6.327.255,89</b>			<b>66.400.579,43</b>
LTN 01/01/2023 (Compra em 29/08/2022 Tx 13.7500)	10.222,22	-	-	-	-			<b>10.222,22</b>
LTN 01/01/2024 (Compra em 11/08/2022 Tx 12.9600)	547.616,69	96.036,75	106.308,20	93.407,93	99.055,51			<b>942.425,08</b>

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>	<b>45.276.308,86</b>	<b>3.615.992,33</b>	<b>5.575.912,21</b>	<b>5.605.110,14</b>	<b>6.327.255,89</b>			<b>66.400.579,43</b>
LTN 01/01/2024 (Compra em 26/08/2022 Tx 13.2200)	556.994,95	97.745,52	108.221,45	95.107,67	100.876,88			<b>958.946,47</b>
LTN 01/07/2023 (Compra em 19/08/2022 Tx 13.5950)	607.656,50	5.057,03	-	-	-			<b>612.713,53</b>
NTN-B 15/05/2023 (Compra em 29/07/2022 Tx 7.9900)	2.413.484,95	-	-	-	-			<b>2.413.484,95</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 06/09/2023 Tx 5.6400)	-	-	-	116.710,87	149.384,38			<b>266.095,25</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)	-	-	-	-	53.558,20			<b>53.558,20</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 22/09/2023 Tx 5.5600)	-	-	-	36.740,29	148.197,26			<b>184.937,55</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)	-	-	-	-	45.360,42			<b>45.360,42</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)	-	-	-	-	36.882,28			<b>36.882,28</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 25/09/2023 Tx 5.5280)	-	-	-	28.042,88	147.722,44			<b>175.765,32</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.9502)	1.264.720,36	101.122,09	157.633,67	149.391,12	153.954,33			<b>1.826.821,57</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 28/08/2023 Tx 5.5850)	-	-	30.687,02	144.396,12	148.573,40			<b>323.656,54</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 30/08/2022 Tx 6.0300)	2.540.905,11	204.594,47	317.753,22	300.977,45	310.201,31			<b>3.674.431,56</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 08/11/2022 Tx 5.6800)	1.251.023,13	97.559,18	154.094,63	146.401,12	150.686,04			<b>1.799.764,10</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 11/11/2022 Tx 6.0600)	2.542.673,94	205.294,00	318.358,33	301.487,74	310.760,13			<b>3.678.574,14</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 15/08/2022 Tx 5.6510)	2.499.484,38	194.459,16	307.559,34	292.218,46	300.783,12			<b>3.594.504,46</b>
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 18/04/2022 Tx 5.7400)	5.165.367,32	405.576,84	638.526,16	606.188,04	624.167,40			<b>7.439.825,76</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 03/02/2023 Tx 6.6300)	618.436,62	67.831,04	101.082,38	94.086,41	97.164,50			<b>978.600,95</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 06/02/2023 Tx 6.7400)	615.951,89	68.833,31	102.157,53	95.014,55	98.160,32			<b>980.117,60</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 10/08/2022 Tx 6.1600)	1.280.961,12	105.813,09	160.759,03	150.140,24	154.795,58			<b>1.852.469,06</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 13/12/2022 Tx 6.7160)	1.320.256,73	114.371,59	169.859,57	158.036,63	163.215,40			<b>1.925.739,92</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/08/2023 Tx 6.6110)	-	-	85.283,56	156.549,73	161.636,82			<b>403.470,11</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/12/2022 Tx 6.9300)	1.335.156,84	117.609,36	173.342,89	161.029,67	166.433,50			<b>1.953.572,26</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 18/08/2022 Tx 6.4750)	2.606.635,50	221.360,18	331.867,27	309.241,60	319.185,73			<b>3.788.290,28</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4400)	1.060.539,30	110.123,27	165.370,11	154.118,33	159.066,72			<b>1.649.217,73</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 05/10/2022 Tx 5.7350)	1.249.019,60	99.587,87	154.344,56	144.647,64	148.931,74			<b>1.796.531,41</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)	-	-	-	-	11.409,19			<b>11.409,19</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 28/09/2023 Tx 5.5750)	-	-	-	7.910,61	146.851,47			<b>154.762,08</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/01/2023 Tx 6.1400)	616.120,48	63.090,86	95.957,80	89.651,93	92.420,21			<b>957.241,28</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)	-	-	-	-	-			<b>-</b>
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 16/09/2022 Tx 5.8930)	1.262.029,62	102.311,86	157.390,94	147.320,44	151.761,12			<b>1.820.813,98</b>
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/10/2022 Tx 5.7500)	1.266.284,80	100.873,92	156.249,36	146.470,17	150.788,20			<b>1.820.666,45</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 06/07/2022 Tx 6.1360)	2.504.129,44	207.977,40	316.230,10	295.368,62	304.531,39			<b>3.628.236,95</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 08/06/2022 Tx 5.9000)	5.143.618,03	412.649,78	634.647,38	594.038,84	612.029,00			<b>7.396.983,03</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 12/07/2022 Tx 6.3520)	2.444.337,93	209.304,72	315.200,67	293.820,10	303.139,56			<b>3.565.802,98</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/06/2022 Tx 5.9650)	2.552.681,41	206.809,04	317.027,04	296.594,94	305.572,34			<b>3.678.684,77</b>

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>	<b>101.900.487,42</b>	<b>17.761.051,43</b>	<b>17.747.723,61</b>	<b>19.981.109,38</b>	<b>13.461.066,91</b>			<b>170.851.438,75</b>
Austro FIC Ativo Renda Fixa IMA-B	(520.570,95)	(91.151,44)	(76.281,15)	(84.016,07)	(1.065.111,11)			<b>(1.837.130,72)</b>
Banrisul Absoluto	22.291.720,07	4.503.677,92	5.409.164,84	2.183.745,29	904.314,20			<b>35.292.622,32</b>
Banrisul Foco IDKA 2	387.628,66	-	-	-	-			<b>387.628,66</b>
Banrisul Previdência IPCA 2024	111.401,47	9.430,00	14.163,52	13.730,00	13.460,00			<b>162.184,99</b>
Banrisul Soberano	-	-	-	5.552,51	-			<b>5.552,51</b>
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	11.544.370,98	-	-	-	-			<b>11.544.370,98</b>
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	33.726.571,72	8.389.103,62	9.235.937,72	14.611.184,06	10.833.348,68			<b>76.796.145,80</b>
BB FIC Previdenciário Fluxo	2.762,09	-	128,21	-	-			<b>2.890,30</b>
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	364,16	-	-	-	-			<b>364,16</b>
BB Previdenciário Crédito Privado IPCA III	1.170.557,48	-	-	-	-			<b>1.170.557,48</b>
BB Previdenciário IRF-M 1+	684.614,59	54.985,22	37.462,49	(13.608,36)	5.060,00			<b>768.513,94</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos IDkA 2	4.654.059,39	712.920,40	563.960,20	162.700,58	(253.953,83)			<b>5.839.686,74</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA	94.198,93	-	-	-	-			<b>94.198,93</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	2.687.018,64	242.791,57	227.284,95	44.141,99	111.837,83			<b>3.313.074,98</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos X	515.223,35	102.117,37	87.227,43	105.061,36	42.001,78			<b>851.631,29</b>
BRB Renda Fixa 2023	587.760,24	-	-	-	-			<b>587.760,24</b>
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	16.043.540,80	2.524.719,52	2.711.136,54	3.450.197,42	3.406.401,18			<b>28.135.995,46</b>
Caixa Brasil Referenciado	2.693,30	-	-	-	-			<b>2.693,30</b>
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	97.848,83	19.396,81	16.624,04	20.021,27	8.038,28			<b>161.929,23</b>
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 IV	474.676,26	94.077,40	80.616,85	97.056,90	38.983,84			<b>785.411,25</b>
It Now Fundo de Índice IMA-B IMAB11	7.364.644,85	1.203.020,52	(555.240,24)	(609.221,93)	(578.375,25)			<b>6.824.827,95</b>
VCM FIC Renda Fixa 1000 IMA-B	(20.597,44)	(4.037,48)	(4.461,79)	(5.435,64)	(4.938,69)			<b>(39.471,04)</b>
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>24.610.320,61</b>	<b>13.746.757,55</b>	<b>(16.402.422,15)</b>	<b>(1.685.661,51)</b>	<b>(12.307.968,68)</b>			<b>7.961.025,82</b>
BB FIA Bolsa Americana	998.707,97	233.188,27	(54.644,86)	(339.958,76)	(122.091,78)			<b>715.200,84</b>
BB FIA Governança	4.092.027,55	2.306.437,06	(3.599.930,39)	592.199,59	(2.393.933,86)			<b>996.799,95</b>
BB FIC FIA Consumo	1.062.724,78	311.350,32	(1.592.532,25)	(555.439,64)	(1.164.467,25)			<b>(1.938.364,04)</b>
BB FIC FIA Exportação	466.076,28	1.539.209,98	(730.419,57)	376.331,91	(741.829,22)			<b>909.369,38</b>
BB FIC FIA Retorno Total	363.807,01	616.132,52	(654.842,27)	117.826,23	(455.937,78)			<b>(13.014,29)</b>
BB FIC FIA Seleção Fatorial	4.906.000,79	3.268.646,38	(4.432.991,47)	464.201,22	(2.877.973,51)			<b>1.327.883,41</b>
BB FIC FIA Siderurgia	(416.650,55)	662.092,58	(522.700,10)	(84.590,93)	(459.401,67)			<b>(821.250,67)</b>
BB FIC FIA Valor	1.656.400,76	1.623.592,11	(2.562.772,01)	107.552,40	(1.578.985,71)			<b>(754.212,45)</b>
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	2.534.256,91	1.277.248,91	(1.957.350,38)	26.983,27	(1.421.800,57)			<b>459.338,14</b>
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11	1.773.434,33	559.520,03	(896.012,85)	41.037,20	(658.391,33)			<b>819.587,38</b>
Ishares Fundo de Índice S&P 500 IVVB11	2.177.550,00	656.132,00	1.061.072,00	(1.269.900,00)	(681.513,00)			<b>1.943.341,00</b>
Ishares Fundo de Índice Small Cap SMAL11	2.334.218,78	355.758,33	(1.016.560,00)	(404.790,00)	(1.116.120,00)			<b>152.507,11</b>

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>24.610.320,61</b>	<b>13.746.757,55</b>	<b>(16.402.422,15)</b>	<b>(1.685.661,51)</b>	<b>(12.307.968,68)</b>			<b>7.961.025,82</b>
It Now Fundo de Índice Dividendos DIVO11	2.171.567,00	(80.780,58)	-	-	-			<b>2.090.786,42</b>
It Now Fundo de Índice Ibovespa BOWV11	1.194.669,00	152.434,64	-	-	-			<b>1.347.103,64</b>
Trend ETF LBMA Ouro GOLD11	(780.560,00)	195.140,00	546.392,00	(604.934,00)	1.522.092,00			<b>878.130,00</b>
Trend ETF MSCI Europa	76.090,00	70.655,00	10.870,00	(152.180,00)	(157.615,00)			<b>(152.180,00)</b>
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>3.817.860,19</b>	<b>2.711.672,84</b>	<b>1.466.093,84</b>	<b>(4.163.401,79)</b>	<b>(5.199.968,04)</b>			<b>(1.367.742,96)</b>
BB FIA Nordea Global Climate and Environment IE	(1.294.900,10)	571.917,44	96.032,69	(2.145.036,61)	(3.397.194,95)			<b>(6.169.181,53)</b>
BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I	2.470.730,69	616.466,53	(708.395,26)	(516.568,82)	(315.651,41)			<b>1.546.581,73</b>
BB Global Select Equity IE Multimercado	2.238.744,05	1.111.497,91	1.458.252,11	(1.054.952,69)	(942.291,40)			<b>2.811.249,98</b>
BB Schroder Multimercado IE	403.285,55	411.790,96	620.204,30	(446.843,67)	(544.830,28)			<b>443.606,86</b>
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>	<b>12.949.429,95</b>	<b>2.914.305,65</b>	<b>(1.064.370,45)</b>	<b>(3.349.014,39)</b>	<b>(1.422.174,11)</b>			<b>10.028.176,65</b>
Caixa Bolsa Americana Multimercado	12.354.462,33	2.679.253,03	(699.332,19)	(3.369.856,35)	(1.279.330,45)			<b>9.685.196,37</b>
Caixa FIC Capital Protegido Bolsa de Valores IV Mult.	594.967,62	235.052,62	(365.038,26)	20.841,96	(142.843,66)			<b>342.980,28</b>
<b>FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES</b>	<b>5.240.233,47</b>	<b>2.722.149,07</b>	<b>554.528,61</b>	<b>931.899,54</b>	<b>(8.789.318,63)</b>			<b>659.492,06</b>
Austro FIP Multisetorial	(107.278,00)	(17.266,37)	(18.863,61)	(16.406,00)	(9.763.911,31)			<b>(9.923.725,29)</b>
BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11	5.373.193,65	2.743.365,21	577.352,80	952.248,57	978.542,70			<b>10.624.702,93</b>
FIP LSH Multiestratégia	(25.063,93)	(3.845,42)	(3.846,42)	(3.843,86)	(3.846,00)			<b>(40.445,63)</b>
RJI FIP Puma	(618,25)	(104,35)	(114,16)	(99,17)	(104,02)			<b>(1.039,95)</b>
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>125.347,27</b>	<b>593,90</b>	<b>19.624,20</b>	<b>(41.473,35)</b>	<b>(33.642,75)</b>			<b>70.449,27</b>
BRB FII SIA Corporate	(65.052,73)	(19.406,10)	(25.275,80)	(22.773,35)	(23.042,75)			<b>(155.550,73)</b>
Caixa FII Rio Bravo CXRI11	190.400,00	20.000,00	44.900,00	(18.700,00)	(10.600,00)			<b>226.000,00</b>
<b>VALORES MOBILIÁRIOS</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>			<b>-</b>
Ações Cais Mauá do Brasil S.A.	-	-	-	-	-			<b>-</b>
<b>TOTAL</b>	<b>270.395.074,09</b>	<b>57.561.695,64</b>	<b>23.474.899,18</b>	<b>25.215.793,14</b>	<b>5.022.773,88</b>			<b>381.670.235,93</b>

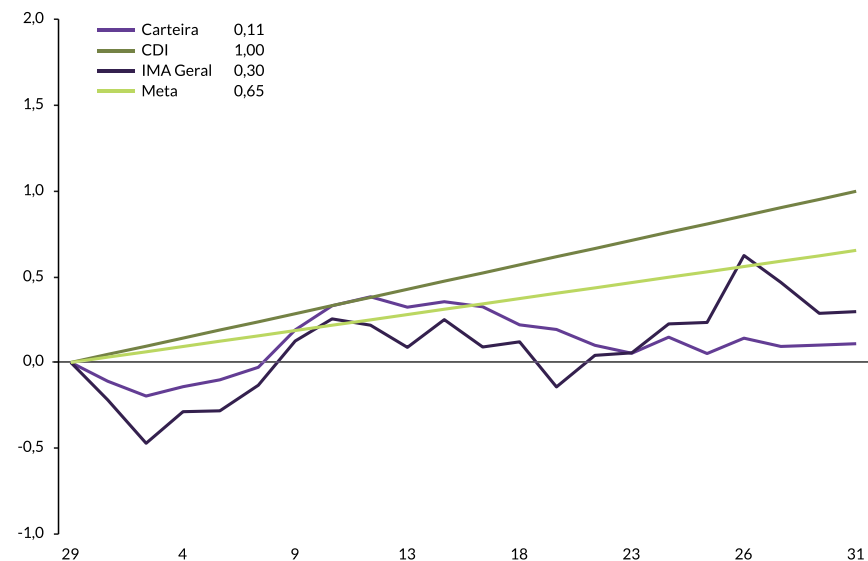
## RETORNOS HISTÓRICOS

ANO	CIVIL	MILITAR	TOTAL
2012	512.409,79	41.530,90	553.940,69
2013	(421.040,42)	(251.836,54)	(672.876,96)
2014	14.862.531,87	2.970.222,94	17.832.754,81
2015	27.067.942,83	4.767.241,51	31.835.184,34
2016	85.884.803,23	13.272.385,75	99.157.188,98
2017	105.451.486,62	15.958.571,26	121.410.057,88
2018	106.552.108,94	21.176.299,26	127.728.408,20
2019	291.835.548,15	53.963.254,59	345.798.802,74
2020	149.686.894,76	31.257.938,12	180.944.832,88
2021	3.341.948,51	2.494.202,40	5.836.150,91
2022	157.614.816,25	54.835.884,52	212.450.700,77
2023	282.675.076,33	98.995.159,60	381.670.235,93
<b>TOTAL</b>	<b>1.225.064.526,86</b>	<b>299.480.854,31</b>	<b>1.524.545.381,17</b>

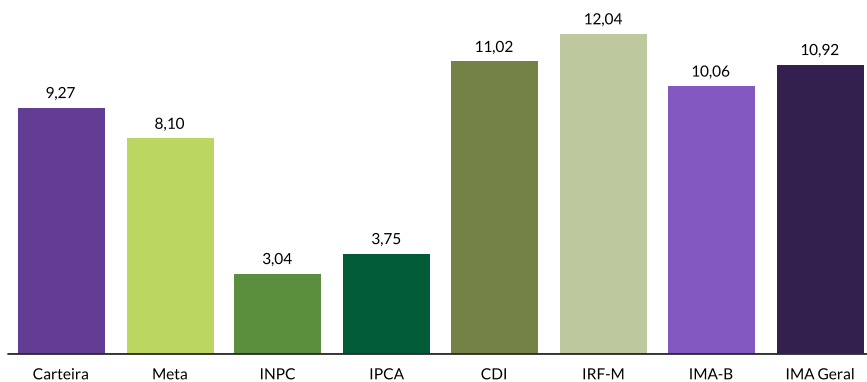
## RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META DE RENTABILIDADE (IPCA + 5.05%)

MÊS	CARTEIRA	META	CDI	IMA-G	% META	% CDI	% IMA-G
Janeiro	1,51	0,94	1,12	0,70	160	134	215
Fevereiro	0,10	1,25	0,92	1,03	8	10	9
Março	0,92	1,12	1,17	1,86	82	79	50
Abril	0,90	1,02	0,92	1,25	88	98	72
Maió	1,37	0,64	1,12	1,77	214	122	77
Junho	1,66	0,33	1,07	1,74	500	154	95
Julho	1,30	0,53	1,07	0,98	244	121	132
Agosto	0,52	0,64	1,14	0,63	81	45	82
Setembro	0,55	0,67	0,97	0,18	82	57	308
Outubro	0,11	0,65	1,00	0,30	17	11	37
Novembro							
Dezembro							
<b>TOTAL</b>	<b>9,27</b>	<b>8,10</b>	<b>11,02</b>	<b>10,92</b>	<b>115</b>	<b>84</b>	<b>85</b>

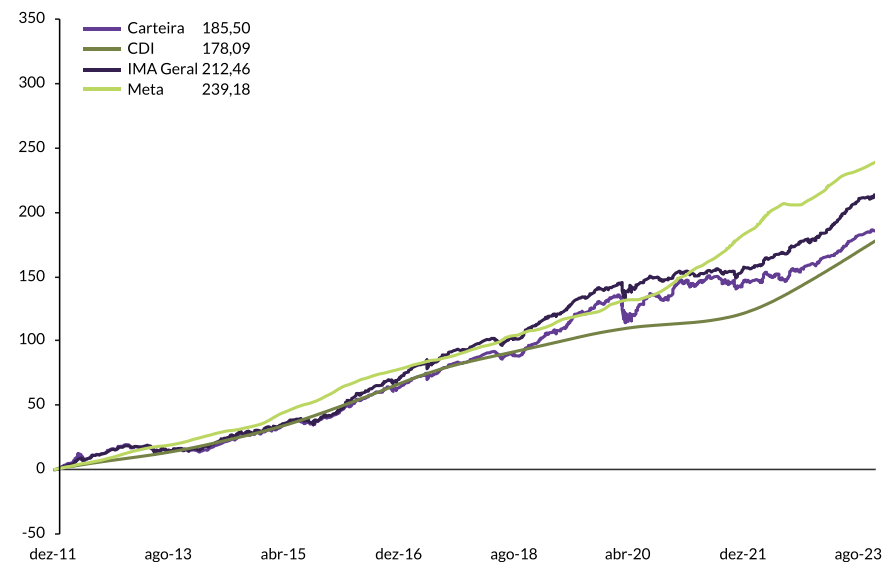
## RENTABILIDADE ACUMULADA NO MÊS



## CARTEIRA x INDICADORES 2023



## RENTABILIDADE ACUMULADA DESDE DEZEMBRO DE 2011

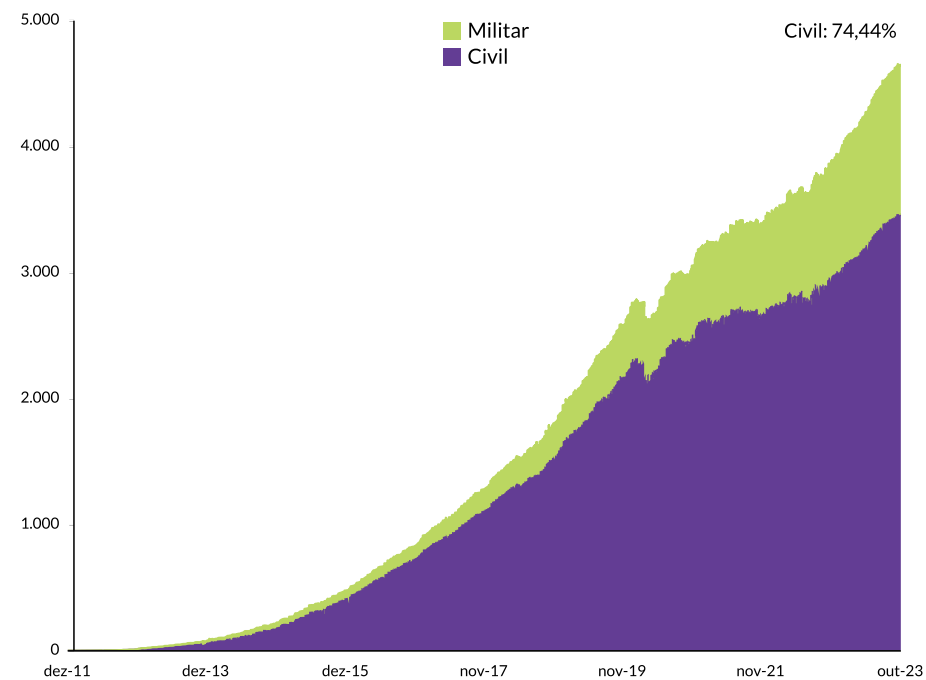




## POR PERÍODO

PERÍODO	CIVIL	MILITAR	TOTAL
dez/11	324.901,06	-	324.901,06
dez/12	14.502.903,15	2.679.913,75	17.182.816,90
dez/13	76.640.824,39	18.730.770,36	95.371.594,75
dez/14	212.665.048,61	39.649.295,75	252.314.344,36
dez/15	447.351.495,72	63.883.697,93	511.235.193,65
dez/16	779.107.970,34	108.089.378,06	887.197.348,40
dez/17	1.166.426.360,05	177.653.629,35	1.344.079.989,40
dez/18	1.612.163.949,34	268.461.510,03	1.880.625.459,37
dez/19	2.312.397.939,81	445.127.926,09	2.757.525.865,90
dez/20	2.643.581.366,99	598.407.866,04	3.241.989.233,03
dez/21	2.751.517.572,01	746.706.179,25	3.498.223.751,26
dez/22	3.045.985.599,28	967.932.188,49	4.013.917.787,77
jan/23	3.103.726.297,95	995.398.117,83	4.099.124.415,78
fev/23	3.118.793.378,11	1.009.120.654,75	4.127.914.032,86
mar/23	3.161.531.236,80	1.030.441.679,62	4.191.972.916,42
abr/23	3.204.966.338,10	1.051.959.540,31	4.256.925.878,41
mai/23	3.263.425.928,87	1.078.364.224,68	4.341.790.153,55
jun/23	3.332.348.955,94	1.107.873.149,75	4.440.222.105,69
jul/23	3.390.274.319,21	1.134.078.574,16	4.524.352.893,37
ago/23	3.421.884.275,86	1.152.995.298,62	4.574.879.574,48
set/23	3.453.506.576,59	1.172.900.576,24	4.626.407.152,83
out/23	3.468.042.129,24	1.190.395.643,22	4.658.437.772,46

## EVOLUÇÃO DIÁRIA DO PATRIMÔNIO (EM R\$ MILHÕES)



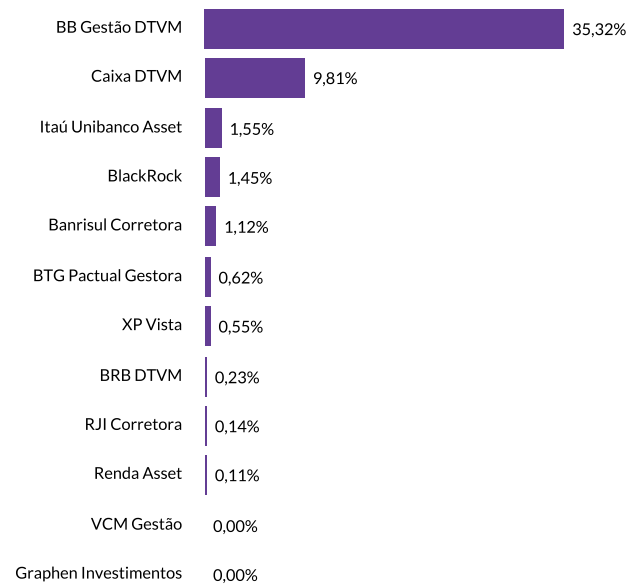
## PATRIMÔNIO DOS GESTORES DE RECURSOS

GESTOR	CNPJ	ART. 21	PATRIMÔNIO SOB GESTÃO	% PARTICIPAÇÃO	
Banrisul Corretora	93.026.847/0001-26	Sim	15.961.808.685,87	0,33	✓
BB Gestão DTVM	30.822.936/0001-69	Sim	14.941.342.014.779,10	0,01	✓
BlackRock	10.979.208/0001-58	Não	18.869.833.980,61	0,36	✓
BRB DTVM	33.850.686/0001-69	Sim	78.760.037,48	13,32	✗
BTG Pactual Gestora	09.631.542/0001-37	Não	330.540.052.127,22	0,01	✓
Caixa DTVM	42.040.639/0001-40	Não	501.666.967.532,41	0,09	✓
Graphen Investimentos	15.403.817/0001-88	Não	628.805.738,09	0,02	✓
Itaú Unibanco Asset	40.430.971/0001-96	Não	848.754.378.412,58	0,01	✓
Renda Asset	10.253.634/0001-00	Não	101.683.683,18	5,21	✗
RJI Corretora	42.066.258/0001-30	Não	528.751.468,42	1,20	✓
VCM Gestão	12.678.380/0001-05	Não	2.752.654.001,97	0,01	✓
XP Vista	16.789.525/0001-98	Não	163.955.483.854,51	0,02	✓

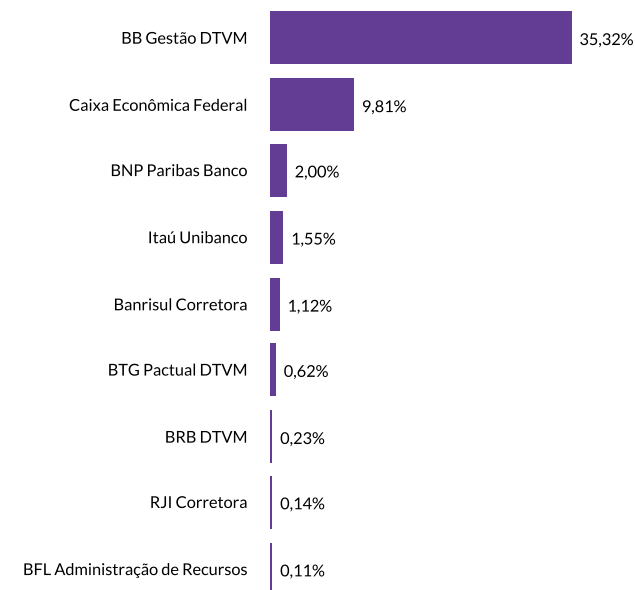
Obs.: Patrimônio em 29/09/2023, o mais recente divulgado pela Anbima na data de publicação desse relatório.

O % Participação denota o quanto o RPPS detém do PL do Gestor, sendo limitado a 5% pelo Art. 20. O Art. 21 indica se a instituição atende ao disposto no inciso I do parágrafo 2º, sendo necessário que ou o gestor ou o administrador do fundo respeite a regra.

## INVESTIMENTOS POR GESTOR DE RECURSOS



## INVESTIMENTOS POR ADMINISTRADOR DE RECURSOS



FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
<b>FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES</b>									
Austro FIP Multisetorial	12.231.743/0001-51	-	13.398.611,49	0,05	18,86	Não	10.253.634/0001-00	14.717.397/0001-41	✘
BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11	35.640.741/0001-11	10, II	1.115.048.648,88	0,62	2,60	Sim	09.631.542/0001-37	59.281.253/0001-23	✔
FIP LSH Multiestratégia	15.798.354/0001-09	10, II	108.004.134,58	0,14	5,88	Não	42.066.258/0001-30	42.066.258/0001-30	✔
RJI FIP Puma	16.617.536/0001-90	10, II	3.658.457,92	0,00	2,84	Não	15.403.817/0001-88	42.066.258/0001-30	✔
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>									
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	7, I, b	3.471.923.696,66	1,08	1,45	Sim	93.026.847/0001-26	93.026.847/0001-26	✔
Banrisul Previdência IPCA 2024	19.882.420/0001-77	7, I, b	159.691.547,65	0,04	1,13	Sim	93.026.847/0001-26	93.026.847/0001-26	✔
BB Previdenciário IRF-M 1+	32.161.826/0001-29	7, I, b	348.920.526,45	0,15	1,98	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB Previdenciário Títulos Públicos IDkA 2	13.322.205/0001-35	7, I, b	5.824.441.376,72	1,65	1,32	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	07.111.384/0001-69	7, I, b	3.620.971.555,98	0,68	0,88	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB Previdenciário Títulos Públicos X	20.734.931/0001-20	7, I, b	211.609.878,58	0,21	4,61	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	18.598.288/0001-03	7, I, b	490.730.076,47	0,04	0,38	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✔
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 IV	20.139.595/0001-78	7, I, b	3.808.125.905,80	0,19	0,24	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✔
Austro FIC Ativo Renda Fixa IMA-B	19.391.026/0001-36	7, III, a	17.521.319,67	0,06	15,81	Não	10.253.634/0001-00	14.717.397/0001-41	✘
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	7, III, a	15.296.039.303,73	23,80	7,25	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✘
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	23.215.008/0001-70	7, III, a	5.784.928.154,82	7,07	5,69	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✔
VCM FIC Renda Fixa 1000 IMA-B	12.402.646/0001-84	7, III, a	1.745.044,13	0,00	10,43	Não	12.678.380/0001-05	42.066.258/0001-30	✔
It Now Fundo de Índice IMA-B IMAB11	31.024.153/0001-00	7, III, b	2.022.470.985,60	1,55	3,57	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✔
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>									
BB FIA Bolsa Americana	36.178.569/0001-99	8, I	1.089.375.893,71	0,15	0,63	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB FIA Governança	10.418.335/0001-88	8, I	730.788.793,77	1,37	8,74	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB FIC FIA Consumo	08.973.942/0001-68	8, I	95.481.121,01	0,26	12,50	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB FIC FIA Exportação	05.100.213/0001-09	8, I	148.056.718,55	0,47	14,70	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB FIC FIA Retorno Total	09.005.805/0001-00	8, I	785.462.483,47	0,28	1,68	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB FIC FIA Seleção Fatorial	07.882.792/0001-14	8, I	1.302.352.358,50	2,07	7,39	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB FIC FIA Siderurgia	08.973.951/0001-59	8, I	149.200.415,49	0,15	4,70	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB FIC FIA Valor	29.258.294/0001-38	8, I	763.608.202,26	0,86	5,24	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	14.507.699/0001-95	8, I	636.425.761,76	0,75	5,46	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✔
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11	10.406.511/0001-61	8, II	11.124.540.821,63	0,48	0,20	Sim	10.979.208/0001-58	01.522.368/0001-82	✔
Ishares Fundo de Índice S&P 500 IVVB11	19.909.560/0001-91	8, II	2.665.967.220,21	0,71	1,24	Sim	10.979.208/0001-58	01.522.368/0001-82	✔
Ishares Fundo de Índice Small Cap SMAL11	10.406.600/0001-08	8, II	3.932.836.682,50	0,26	0,31	Sim	10.979.208/0001-58	01.522.368/0001-82	✔
Trend ETF LBMA Ouro GOLD11	37.985.763/0001-49	8, II	367.047.245,95	0,44	5,64	Sim	16.789.525/0001-98	01.522.368/0001-82	✔
Trend ETF MSCI Europa	38.595.988/0001-51	8, II	31.166.479,69	0,11	15,99	Sim	16.789.525/0001-98	01.522.368/0001-82	✘

FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>									
BB FIA Nordea Global Climate and Environment IE	28.578.936/0001-13	9, II	392.481.828,14	1,37	16,29	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✘
BB Global Select Equity IE Multimercado	17.413.636/0001-68	9, II	1.238.585.556,92	1,18	4,44	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB Schroder Multimercado IE	17.431.816/0001-72	9, II	461.603.768,88	0,47	4,74	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I	38.236.242/0001-51	9, III	69.908.270,35	0,21	13,87	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✔
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>									
Caixa Bolsa Americana Multimercado	30.036.235/0001-02	10, I	1.452.300.441,47	1,52	4,88	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✔
Caixa FIC Capital Protegido Bolsa de Valores IV Mult.	44.683.343/0001-73	10, I	114.510.305,81	0,23	9,26	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✔
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>									
BRB FII SIA Corporate	17.311.079/0001-74	11	78.587.363,63	0,23	13,34	Sim	33.850.686/0001-69	33.850.686/0001-69	✔
Caixa FII Rio Bravo CXRI11	17.098.794/0001-70	11	141.105.142,74	0,02	0,57	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✔

Art. 18 retrata o percentual do PL do RPPS que está aplicado no fundo, cujo limite é de 20%. Art. 19 denota o percentual do PL do fundo que o RPPS detém, sendo limitado a 5% em fundos enquadrados no Art. 7 V, e de 15% para os demais. Ambos os Art. 18 e 19 não se aplicam aos fundos enquadrados no Art. 7 I. Art. 21 aponta se o administrador ou o gestor atende às exigências, estando destacado o CNPJ da instituição caso ela não atenda.

## POR SEGMENTO

ENQUADRAMENTO	SALDO EM R\$	% CARTEIRA	% LIMITE RESOLUÇÃO	% LIMITE PI
7, I	2.472.969.048,68	53,10	100,0	100,0
7, I, a	2.284.854.224,79	49,06	100,0	80,0
7, I, b	188.114.823,89	4,04	100,0	40,0
7, I, c	-	0,00	100,0	50,0
7, II	-	0,00	5,0	5,0
7, III	1.512.818.444,17	32,48	65,0	65,0
7, III, a	1.440.637.212,97	30,93	65,0	60,0
7, III, b	72.181.231,20	1,55	65,0	50,0
7, IV	-	0,00	20,0	10,0
7, V	-	0,00	15,0	15,0
7, V, a	-	0,00	5,0	5,0
7, V, b	-	0,00	5,0	5,0
7, V, c	-	0,00	5,0	5,0
<b>ART. 7</b>	<b>3.985.787.492,85</b>	<b>85,58</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>
8, I	295.638.033,55	6,35	35,0	20,0
8, II	93.073.561,52	2,00	35,0	35,0
<b>ART. 8</b>	<b>388.711.595,07</b>	<b>8,35</b>	<b>35,0</b>	<b>35,0</b>
9, I	-	0,00	10,0	2,0
9, II	140.765.243,62	3,02	10,0	8,0
9, III	9.694.983,18	0,21	10,0	4,0
<b>ART. 9</b>	<b>150.460.226,80</b>	<b>3,23</b>	<b>10,0</b>	<b>10,0</b>
10, I	81.530.509,20	1,75	10,0	10,0
10, II	35.407.428,44	0,76	5,0	3,0
10, III	-	0,00	5,0	2,0
<b>ART. 10</b>	<b>116.937.937,64</b>	<b>2,51</b>	<b>15,0</b>	<b>15,0</b>
<b>ART. 11</b>	<b>11.286.419,67</b>	<b>0,24</b>	<b>5,0</b>	<b>5,0</b>
<b>ART. 12</b>	<b>-</b>	<b>0,00</b>	<b>10,0</b>	<b>0,0</b>
<b>ART. 8, 10 E 11</b>	<b>516.935.952,38</b>	<b>11,10</b>	<b>35,0</b>	<b>35,0</b>
<b>SEM ENQUADRAMENTO</b>	<b>4.446.851,97</b>			
<b>PATRIMÔNIO INVESTIDO</b>	<b>4.657.630.524,00</b>			

Obs.: Para fins de enquadramento, são desconsideradas as disponibilidades financeiras mantidas em conta corrente e poupança.

## PRÓ GESTÃO

O Fundoprev Consolidado comprovou adoção de melhores práticas de gestão previdenciária à Secretaria de Previdência, ao NÍVEL I de aderência na forma por ela estabelecidos.

### PARECER SOBRE ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA

- ✗ Desenquadrada em relação a Resolução CMN 4.963/2021.
- ✓ Enquadrada em relação à Política de Investimento vigente.
- ✗ Foi desobedecido o Art. 18 da Resolução CMN 4.963/2021, que estipula um limite de 20 % na concentração dos investimentos do RPPS em um único fundo.
- ✗ Foi infringido o Art. 19 da Resolução CMN 4.963/2021, que limita o percentual do patrimônio do fundo que o RPPS pode deter.
- ✗ Descumpriu-se o disposto no Art. 20 da Resolução CMN 4.963/2021, que impõe um limite de 5 % na concentração do patrimônio gerido pela instituição que atua como gestora dos fundos.
- ✓ O administrador e o gestor dos fundos devem atender ao disposto no parágrafo 2º do Art. 21 da Resolução CMN 4.963/2021. Entretanto, o parágrafo 9º do referido artigo estipula que tais requisitos devem ser observadas no momento da aplicação. Assim sendo, os fundos que estiverem irregulares, mas cujo aporte seja anterior a 03/01/2022, podem ser mantidos na carteira com status de enquadrados.

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
LFT 01/03/2024 (Compra em 06/12/2022)	IMA-S	1,00	153%	11,03	136%	13,42	135%	0,00	0,02	0,00	0,04	-14,90	-16,16	0,00	0,00
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (i)	IMA-S	1,00	153%	11,03	136%	13,42	135%	0,00	0,02	0,00	0,04	-14,90	-16,16	0,00	0,00
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (ii)	IMA-S	1,00	153%	11,03	136%	13,42	135%	0,00	0,02	0,00	0,04	-14,90	-16,16	0,00	0,00
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (iii)	IMA-S	1,00	153%	11,03	136%	13,42	135%	0,00	0,02	0,00	0,04	-14,90	-16,16	0,00	0,00
LFT 01/03/2025 (Compra em 23/08/2023)	IMA-S	1,00	153%	11,08	137%	13,52	136%	0,01	0,03	0,02	0,06	15,79	4,25	0,00	0,00
LFT 01/03/2025 (Compra em 28/08/2023)	IMA-S	1,00	153%	11,08	137%	13,52	136%	0,01	0,03	0,02	0,06	15,79	4,25	0,00	0,00
LFT 01/03/2025 (Compra em 29/08/2023)	IMA-S	1,00	153%	11,08	137%	13,52	136%	0,01	0,03	0,02	0,06	15,79	4,25	0,00	0,00
LFT 01/03/2026 (Compra em 26/09/2023)	IMA-S	0,99	152%	11,29	139%	13,70	138%	0,04	0,07	0,07	0,12	6,50	16,28	0,00	0,00
LFT 01/09/2025 (Compra em 04/09/2023)	IMA-S	1,00	153%	11,19	138%	13,62	137%	0,03	0,05	0,05	0,08	9,45	13,67	0,00	0,00
LFT 01/09/2026 (Compra em 27/09/2023)	IMA-S	0,97	149%	11,20	138%	13,61	137%	0,07	0,08	0,11	0,13	-21,49	8,38	0,00	0,00
LTN 01/01/2025 (Compra em 24/08/2022)	IRF-M	0,61	93%	12,30	152%	12,54	126%	2,00	3,84	3,29	6,32	-8,98	-0,89	-0,26	-3,53
LTN 01/07/2024 (Compra em 25/08/2022)	IRF-M	0,90	138%	11,77	145%	12,82	129%	0,63	2,41	1,04	3,96	-5,26	-0,93	-0,02	-2,41
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
LTN 01/01/2024 (Compra em 11/08/2022 Tx 12.9600)	IRF-M	1,02	156%	10,64	131%	12,91	130%	-	-	-	-	-	-	-	-
LTN 01/01/2024 (Compra em 26/08/2022 Tx 13.2200)	IRF-M	1,04	159%	10,85	134%	13,16	133%	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 06/09/2023 Tx 5.6400)	IPCA	0,70	107%	1,26	16%	-	-	0,19	-	0,31	-	-117,95	-	-0,02	-
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)	IPCA	0,25	39%	0,25	3%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 22/09/2023 Tx 5.5600)	IPCA	0,69	106%	0,87	11%	-	-	0,19	-	0,31	-	-120,50	-	-0,02	-
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)	IPCA	0,21	33%	0,21	3%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)	IPCA	0,17	27%	0,17	2%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 25/09/2023 Tx 5.5280)	IPCA	0,69	106%	0,82	10%	-	-	0,19	-	0,31	-	-121,56	-	-0,02	-
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.9502)	IPCA	0,73	111%	9,16	113%	11,30	114%	0,19	4,08	0,31	6,72	-108,03	-11,82	-0,01	-2,82
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 28/08/2023 Tx 5.5850)	IPCA	0,70	107%	1,48	18%	-	-	0,19	-	0,31	-	-119,70	-	-0,02	-
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 30/08/2022 Tx 6.0300)	IPCA	0,73	112%	9,23	114%	11,38	115%	0,19	4,09	0,31	6,73	-105,44	-11,70	-0,01	-2,82
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 08/11/2022 Tx 5.6800)	IPCA	0,70	108%	8,93	110%	-	-	0,19	-	0,31	-	-116,93	-	-0,02	-
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 11/11/2022 Tx 6.0600)	IPCA	0,73	113%	9,25	114%	-	-	0,19	-	0,31	-	-104,62	-	-0,01	-
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 15/08/2022 Tx 5.6510)	IPCA	0,70	108%	8,91	110%	11,01	111%	0,19	4,04	0,31	6,64	-117,64	-12,30	-0,02	-2,78
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 18/04/2022 Tx 5.7400)	IPCA	0,71	109%	8,98	111%	11,08	112%	0,19	3,94	0,31	6,48	-114,85	-12,24	-0,02	-2,71
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 03/02/2023 Tx 6.6300)	IPCA	0,78	119%	8,21	101%	-	-	0,19	-	0,31	-	-86,35	-	-0,01	-
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 06/02/2023 Tx 6.7400)	IPCA	0,79	121%	8,23	102%	-	-	0,19	-	0,31	-	-82,71	-	-0,01	-
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 10/08/2022 Tx 6.1600)	IPCA	0,74	114%	9,34	115%	11,54	116%	0,19	4,12	0,31	6,77	-101,34	-11,45	-0,01	-2,85
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 13/12/2022 Tx 6.7160)	IPCA	0,79	120%	9,79	121%	-	-	0,19	-	0,31	-	-83,65	-	-0,01	-

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/08/2023 Tx 6.6110)	IPCA	0,78	119%	1,96	24%	-	-	0,19	-	0,31	-	-87,10	-	-0,01	-
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/12/2022 Tx 6.9300)	IPCA	0,80	123%	9,96	123%	-	-	0,19	-	0,31	-	-76,90	-	-0,01	-
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 18/08/2022 Tx 6.4750)	IPCA	0,77	118%	9,60	119%	11,85	119%	0,19	4,13	0,31	6,80	-91,21	-10,99	-0,01	-2,85
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4400)	IPCA	0,76	117%	8,29	102%	-	-	0,19	-	0,31	-	-92,53	-	-0,01	-
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 05/10/2022 Tx 5.7350)	IPCA	0,71	109%	8,98	111%	11,09	112%	0,19	4,08	0,31	6,72	-114,78	-12,09	-0,02	-2,82
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)	IPCA	0,07	11%	0,07	1%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 28/09/2023 Tx 5.5750)	IPCA	0,70	107%	0,73	9%	-	-	0,19	-	0,31	-	-120,17	-	-0,02	-
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/01/2023 Tx 6.1400)	IPCA	0,74	113%	7,98	99%	-	-	0,19	-	0,31	-	-101,97	-	-0,01	-
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)	IPCA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 16/09/2022 Tx 5.8930)	IPCA	0,72	111%	9,08	112%	11,23	113%	0,19	4,08	0,31	6,71	-109,85	-11,86	-0,02	-2,82
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/10/2022 Tx 5.7500)	IPCA	0,71	109%	8,99	111%	11,11	112%	0,19	4,04	0,31	6,65	-114,51	-12,10	-0,02	-2,80
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 06/07/2022 Tx 6.1360)	IPCA	0,74	113%	9,27	114%	11,46	115%	0,19	4,17	0,31	6,86	-102,17	-11,45	-0,01	-2,89
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 08/06/2022 Tx 5.9000)	IPCA	0,72	111%	9,16	113%	11,31	114%	0,19	4,05	0,31	6,67	-109,60	-11,87	-0,02	-2,80
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 12/07/2022 Tx 6.3520)	IPCA	0,76	116%	9,37	116%	11,60	117%	0,19	4,28	0,31	7,04	-95,32	-11,09	-0,01	-2,96
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/06/2022 Tx 5.9650)	IPCA	0,73	111%	9,19	114%	11,35	114%	0,19	4,08	0,31	6,72	-107,62	-11,75	-0,01	-2,82
FUNDOS DE RENDA FIXA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Austro FIC Ativo Renda Fixa IMA-B	IMA-B	-27,77	-4257%	-39,88	-493%	-45,36	-457%	91,02	27,79	148,53	45,65	-23,34	-15,49	-28,02	-45,37
Banrisul Absoluto	CDI	0,96	146%	10,99	136%	13,34	134%	0,05	0,05	0,08	0,08	-52,67	-17,45	0,00	0,00
Banrisul Previdência IPCA 2024	IPCA	0,75	115%	9,51	117%	11,74	118%	0,36	4,02	0,58	6,61	-50,89	-11,27	-0,06	-2,84
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	CDI	0,99	151%	10,95	135%	13,35	134%	0,02	0,08	0,04	0,13	-21,83	-10,24	0,00	-0,02
BB Previdenciário IRF-M 1+	IRF-M 1+	0,07	11%	12,54	155%	12,56	127%	5,42	4,97	8,92	8,17	-7,09	-0,55	-0,88	-3,84
BB Previdenciário Títulos Públicos IDkA 2	IDkA IPCA 2A	-0,33	-51%	8,23	102%	8,84	89%	2,80	2,38	4,60	3,92	-30,48	-10,17	-0,61	-1,60
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	IRF-M	0,35	54%	11,64	144%	12,46	126%	3,78	3,36	6,21	5,54	-7,09	-1,26	-0,58	-2,46
BB Previdenciário Títulos Públicos X	IPCA	0,43	66%	9,26	114%	10,12	102%	1,09	1,82	1,79	3,00	-29,68	-9,32	-0,21	-1,34
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	CDI	0,99	152%	11,24	139%	13,64	137%	0,07	0,09	0,11	0,14	0,76	8,99	0,00	0,00
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	IPCA	0,44	67%	9,27	114%	10,14	102%	1,09	4,18	1,79	6,87	-29,50	-12,24	-0,21	-2,90
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 IV	IPCA	0,44	67%	9,28	115%	10,15	102%	1,09	4,20	1,79	6,91	-29,44	-12,21	-0,21	-2,91
It Now Fundo de Índice IMA-B IMAB11	IMA-B	-1,06	-162%	10,15	125%	9,63	97%	7,32	8,09	12,04	13,30	-12,67	-1,94	-1,55	-4,95
VCM FIC Renda Fixa 1000 IMA-B	IMA-B	-2,64	-405%	-26,81	-331%	-28,45	-287%	1,61	9,66	2,65	15,88	-170,96	-29,76	-2,74	-28,45
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIA Bolsa Americana	SP 500	-1,76	-270%	11,72	145%	12,61	127%	14,44	14,90	23,73	24,52	-14,98	-0,36	-5,79	-8,98
BB FIA Governança	IGC	-3,61	-554%	1,59	20%	-4,91	-49%	15,29	18,93	25,12	31,13	-18,39	-4,86	-4,01	-18,25

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIC FIA Consumo	ICON	-8,89	-1362%	-13,97	-173%	-30,41	-306%	27,54	26,52	45,21	43,58	-22,82	-9,86	-10,46	-32,95
BB FIC FIA Exportação	IBOV	-3,30	-505%	3,33	41%	2,97	30%	12,81	17,35	21,06	28,55	-21,27	-2,84	-4,80	-13,72
BB FIC FIA Retorno Total	IBOV	-3,33	-511%	-0,10	-1%	-11,81	-119%	15,97	19,79	26,25	32,55	-15,80	-6,68	-3,90	-20,77
BB FIC FIA Seleção Fatorial	IBOV	-2,90	-445%	1,40	17%	-5,16	-52%	14,62	18,59	24,04	30,58	-15,95	-5,20	-3,48	-18,09
BB FIC FIA Siderurgia	IBOV	-6,14	-942%	-10,47	-129%	5,12	52%	18,41	24,82	30,23	40,83	-27,14	-1,11	-9,41	-24,03
BB FIC FIA Valor	IBOV	-3,79	-582%	-1,85	-23%	-7,15	-72%	16,44	18,49	27,02	30,40	-17,63	-6,09	-4,17	-17,08
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	IBOV	-3,93	-603%	1,34	17%	-8,21	-83%	16,20	19,36	26,62	31,84	-18,66	-5,65	-4,35	-20,67
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11 Méd.	IBOV	-3,12	-478%	3,46	43%	-2,26	-23%	16,58	19,54	27,25	32,14	-14,07	-4,46	-4,00	-17,04
Ishares Fundo de Índice Small Cap SMAL11 Méd.	SMLL	-7,32	-1122%	-2,40	-30%	-16,27	-164%	26,46	26,25	43,44	43,16	-21,42	-5,61	-8,45	-27,62
Ishares Fundo de Índice SP 500 IVVB11 Méd.	SP 500	-2,01	-307%	4,00	49%	6,25	63%	13,97	19,56	22,97	32,18	-16,92	-2,49	-7,18	-8,92
Trend ETF LBMA Ouro GOLD11 Méd.	Ouro	7,75	1188%	3,93	49%	18,10	182%	19,03	18,15	31,36	29,87	20,34	0,82	-1,59	-13,60
Trend ETF MSCI Europa EURP11 Méd.	MSCI Europe	-2,96	-454%	-3,58	-44%	11,15	112%	14,49	19,45	23,82	31,99	-20,76	-1,29	-7,34	-13,35
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIA Nordea Global Climate and Environment IE	MSCI World	-5,05	-774%	-8,80	-109%	-3,22	-32%	12,76	18,35	20,96	30,17	-28,99	-5,64	-5,82	-14,60
BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I	MSCI Europe	-2,53	-388%	6,70	83%	18,75	189%	14,62	15,44	24,03	25,41	-15,92	1,86	-5,27	-10,44
BB Global Select Equity IE Multimercado	MSCI World	-1,69	-258%	5,39	67%	12,32	124%	13,48	18,76	22,17	30,87	-10,74	-0,57	-5,58	-8,48
BB Schroder Multimercado IE	MSCI World	-2,43	-372%	2,07	26%	8,77	88%	13,26	18,45	21,81	30,35	-12,95	-1,50	-5,42	-8,17
FUNDOS MULTIMERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Caixa Bolsa Americana Multimercado	SP 500	-1,77	-272%	15,81	195%	16,80	169%	14,82	15,74	24,37	25,90	-14,49	1,38	-5,84	-8,82
Caixa FIC Capital Protegido Bolsa de Valores IV Mult.	IBOV	-1,33	-204%	3,34	41%	2,23	22%	6,68	7,38	10,98	12,13	-22,23	-8,67	-1,59	-4,79
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Austro FIP Multisetorial	IPCA	-79,44	-12176%	-79,70	-984%	-79,74	-803%	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG Pactual FIP Infra. Dividendos BDIV11 Méd.	IDIV	3,38	518%	44,86	554%	46,08	464%	13,36	14,08	21,97	23,16	-15,38	0,67	-5,73	-8,12
FIP LSH Multiestratégia	IPCA	-0,06	-9%	-0,63	-8%	-0,76	-8%	-	-	-	-	-	-	-	-
RJI FIP Puma	IPCA	-0,10	-15%	-0,99	-12%	-1,76	-18%	0,46	2,90	0,75	4,78	-195,51	-31,55	-0,20	-1,76
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BRB FII SIA Corporate	IFIX	-0,22	-34%	-1,46	-18%	-0,16	-2%	0,04	1,47	0,06	2,42	-2.365,92	-55,05	-0,23	-1,47
Caixa FII Rio Bravo CXRI11	IFIX	-1,31	-201%	37,65	465%	27,17	274%	10,23	22,62	16,82	37,23	-19,10	1,26	-2,67	-14,06
VALORES MOBILIÁRIOS	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Ações Cais Mauá do Brasil S.A.	IFIX	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

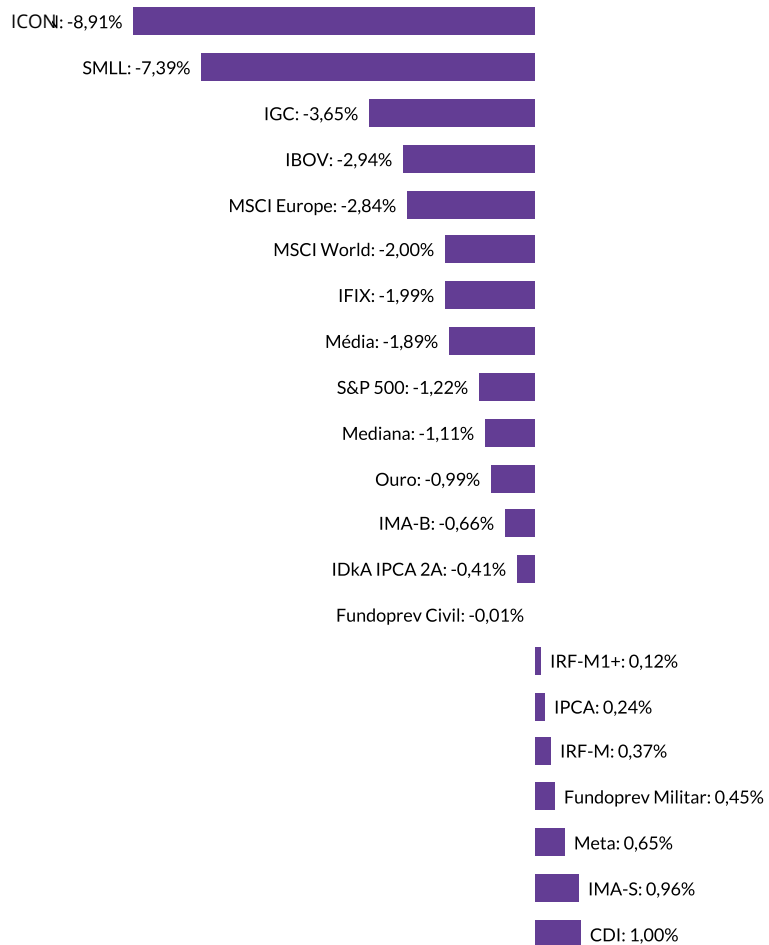


RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
	INDICADORES	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %
Carteira - Fundoprev	0,11	17%	9,27	115%	10,47	105%	1,40	1,75	2,30	2,87	-47,79	-9,48	-0,33	-0,89
Carteira - Fundoprev Civil	-0,01	-2%	9,12	113%	10,29	104%	1,45	1,80	2,39	2,97	-52,20	-9,76	-0,51	-0,95
Carteira - Fundoprev Militar	0,45	68%	9,69	120%	11,01	111%	1,20	1,58	1,98	2,60	-34,40	-8,54	-0,18	-0,72
Meta de Rentabilidade	0,65	-	8,10	-	9,93	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	1,00	153%	11,02	136%	13,42	135%	0,00	0,02	-	-	-	-	-	-
IBOV	-2,94	-449%	3,11	38%	-2,49	-25%	15,36	18,75	25,24	30,85	-19,08	-4,51	-3,86	-17,12
ICON	-8,91	-1364%	-8,91	-110%	-8,91	-90%	28,24	26,32	46,33	43,26	-26,73	-10,62	-10,00	-32,78
IDKa 2A	-0,41	-63%	8,53	105%	9,03	91%	2,95	2,54	4,85	4,18	-35,86	-9,75	-0,66	-1,77
IFIX	-1,99	-304%	-1,99	-25%	-1,99	-20%	4,14	5,34	6,81	8,79	-54,59	-8,42	-1,75	-8,59
IGC	-3,65	-559%	-3,65	-45%	-3,65	-37%	15,97	18,94	26,24	31,15	-21,82	-4,66	-4,10	-17,08
IMA-B	-0,66	-100%	10,06	124%	8,97	90%	6,34	5,19	10,42	8,53	-19,50	-4,71	-1,18	-3,56
IMA-B 5	-0,31	-48%	8,55	106%	9,21	93%	3,02	2,32	4,96	3,82	-32,61	-10,25	-0,59	-1,31
IMA-B 5+	-0,98	-150%	10,98	136%	8,37	84%	9,72	8,04	15,98	13,22	-15,07	-3,33	-1,77	-6,14
IMA Geral	0,30	45%	10,92	135%	11,71	118%	2,88	2,38	4,73	3,92	-18,23	-3,95	-0,40	-1,30
IMA-S	0,96	147%	0,96	12%	0,96	10%	0,05	0,07	0,09	0,11	-49,64	12,15	0,00	0,00
IPCA	0,24	37%	3,75	46%	4,82	49%	-	-	-	-	-	-	-	-
IRF-M	0,37	57%	12,04	149%	12,95	130%	3,74	3,36	6,16	5,52	-12,39	-0,67	-0,57	-2,43
IRF-M 1	0,96	146%	11,12	137%	13,48	136%	0,24	0,37	0,40	0,61	-13,02	1,02	0,00	-0,04
IRF-M 1+	0,12	18%	12,95	160%	13,15	132%	5,35	4,95	8,80	8,15	-12,21	-0,14	-0,88	-3,80
MSCI Europe	-2,84	-435%	-2,84	-35%	-2,84	-29%	15,93	18,05	26,18	29,69	-17,92	-1,03	-7,75	-13,99
MSCI World	-2,00	-306%	-2,00	-25%	-2,00	-20%	16,71	17,24	27,47	28,36	-13,12	-2,45	-8,49	-8,54
Ouro	-0,99	-151%	-0,99	-12%	-0,99	-10%	23,12	23,36	38,01	38,44	-5,80	-0,38	-6,29	-13,04
SMLL	-7,39	-1132%	-7,39	-91%	-7,39	-74%	25,76	24,58	42,28	40,41	-24,64	-7,03	-7,11	-27,19
S&P 500	-1,22	-187%	-1,22	-15%	-1,22	-12%	19,31	19,33	31,76	31,81	-8,13	-2,17	-9,05	-9,05

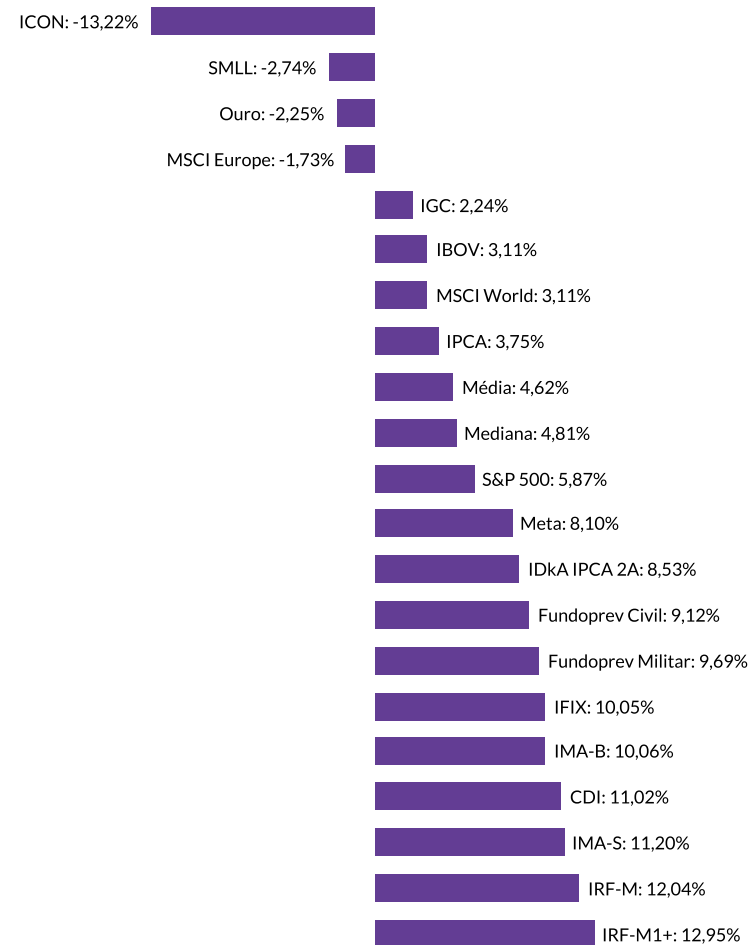
São apresentadas apenas as informações dos fundos que possuem histórico completo no período.

Limites de Volatilidade 12M estabelecidos: Segmento de Fundos Estruturados: 10,17. Segmento de Investimentos no Exterior: 23,89. Benchmark CDI: 0,57. Benchmark Ibovespa: 27,04. Benchmark IDKA 2A: 3,25. Benchmark IMA Geral: 3,31. Benchmark IMA-B: 7,48. Benchmark IMA-B 5: 3,25. Benchmark IMA-B 5+: 11,55. Benchmark IPCA: 6,61. Benchmark IRF-M: 4,01. Benchmark IRF-M 1: 0,57. Benchmark IRF-M 1+: 5,87.

## RENTABILIDADE NO MÊS



## RENTABILIDADE NO ANO



## NOTAS METODOLÓGICAS E EXPLICATIVAS

### Introdução

O risco está associado ao grau de incerteza sobre um investimento no futuro, havendo diversas formas de mensurá-lo. A tabela "Medidas de Risco da Carteira" traz algumas das métricas mais tradicionais de análise de risco, que serão brevemente explicadas a seguir.

### Volatilidade Anualizada

Volatilidade é o nome que se dá ao Desvio Padrão dos retornos de um ativo. Dessa forma, a Volatilidade mede o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período analisado. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio.

Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em 1,7407% do retorno diário médio dos últimos 12 meses. Como base para comparação, o IRF-M, que tende a ser menos volátil, apresentou um coeficiente de 3,35% no mesmo período. Já o IMA-B, que habitualmente manifesta alta volatilidade, ficou com 5,18% em 12 meses.

### Value at Risk - VaR (95%)

Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal.

Dado o desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de 2,8639%. No mesmo período, o IRF-M detém um VaR de 5,51%, e o IMA-B de 8,53%.

### Draw-Down

Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período.

Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, consequentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

Analisando os últimos 12 meses, percebe-se que a maior queda ocorrida na Carteira foi de 0,8930%. Já os índices IRF-M e IMA-B sofreram quedas de 2,43% e 3,56%, respectivamente.

### Beta

Avalia a sensibilidade da Carteira em relação ao risco do mercado como um todo, representado pelo Índice Ibovespa. Dessa forma, assume-se que o Ibovespa possui um Beta igual a 100%. Calculando o Beta da Carteira, tem-se uma estimativa da sua exposição ao total desse risco.

Ou seja, nos últimos 12 meses, estima-se que a carteira está exposta a 7,9353% do risco experimentado pelo mercado.

### Tracking Error

Mensura o quão aderente a Carteira é ao seu Benchmark, nesse caso, representado pela Meta do Instituto. Vistos os retornos dos últimos 12 meses, pode-se afirmar que há 66% de chance de que o retorno diário da Carteira fique entre 0,1118% e -0,1118% da Meta.

### Sharpe

Quantifica a relação entre a Volatilidade da Carteira e seu retorno excedente a um ativo livre de risco, nesse caso, o CDI. Assim, esse indicador aponta o percentual de rentabilidade que a Carteira teve acima do CDI devido à sua maior exposição ao risco. Logo, quanto maior o Sharpe, melhor o desempenho da Carteira, enquanto valores negativos significam que o CDI superou a rentabilidade da Carteira no período.

Em 12 meses, o indicador apontou que para cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs, houve uma rentabilidade 9,5052% menor que aquela realizada pelo CDI.

### Treynor

Similar ao Sharpe, porém, utiliza o risco do mercado (Beta) no cálculo em vez da Volatilidade da Carteira. Valores negativos indicam que a Carteira teve rentabilidade menor do que a alcançada pelo mercado.

Em 12 meses, cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs foram convertidos em uma rentabilidade 0,1313% menor que a do mercado.

### Alfa de Jensen

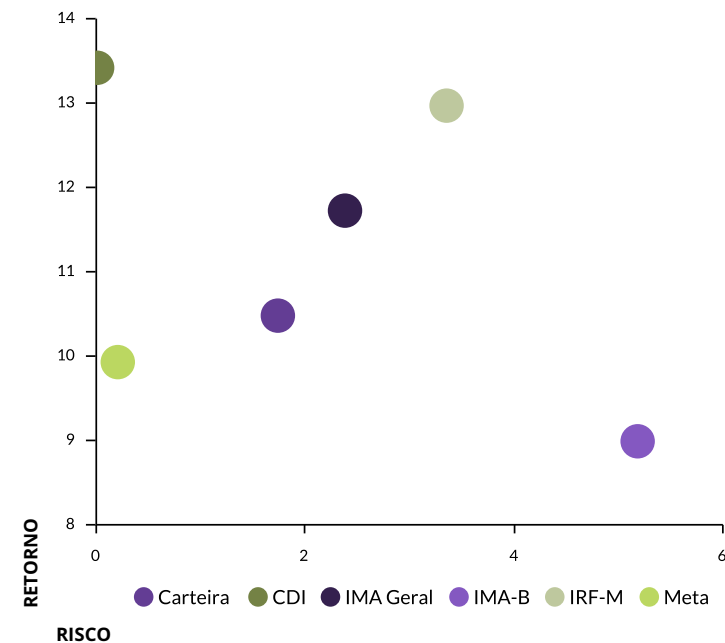
É uma medida do desempenho da Carteira, indicando uma boa performance caso o coeficiente seja significativamente positivo. Valores próximos de zero (tanto positivos quanto negativos) são neutros, devendo ser desconsiderados. Um coeficiente significativamente negativo aponta que o risco da Carteira não tem se convertido em maiores retornos.

## MEDIDAS DE RISCO E DESEMPENHO DA CARTEIRA (%)

MEDIDA	NO MÊS	3 MESES	12 MESES
Volatilidade Anualizada	1,3021	1,2484	1,7407
VaR (95%)	2,1418	2,0537	2,8639
Draw-Down	-0,3897	-0,3897	-0,8930
Beta	6,2962	7,1588	7,9353
Tracking Error	0,0820	0,0786	0,1118
Sharpe	-51,5266	-38,7379	-9,5052
Treynor	-0,6677	-0,4256	-0,1313
Alfa de Jensen	-0,0304	-0,0187	-0,0062

## RELAÇÃO RISCO X RETORNO EM 12 MESES (%)

Em geral, há uma forte relação entre o risco e o retorno de um ativo: quanto maior o risco, maior a probabilidade de um retorno (ou perda) mais elevado. O gráfico representa as métricas dessa correlação para a Carteira e para os principais índices. Pontos mais acima no gráfico representam um retorno mais elevado, enquanto pontos mais à direita indicam maior risco.



## METODOLOGIA DO STRESS TEST

O Stress Test é comumente utilizado para mensurar como situações de estresse no mercado podem vir a impactar uma Carteira de Investimentos. Por se tratar de uma medida de risco não estatística, esse teste é indicado como um complemento às métricas de risco mais usuais, como Volatilidade e VaR, por exemplo.

Em geral, o teste é formulado em duas etapas. A primeira consiste na elaboração de um cenário de estresse em que são aplicados choques exógenos aos fatores de risco que influenciam a Carteira. Na segunda etapa, analisa-se o impacto do cenário de estresse sobre os investimentos, como é apresentado na tabela "Stress Test" ao lado.

Contabilizamos os retornos mensais, dos últimos 24 meses, de todos os ativos presentes na Carteira. Dadas essas estatísticas, selecionamos a pior rentabilidade de cada ativo e, então, construímos um cenário hipotético no qual todos os ativos entregariam, juntos, as suas respectivas piores rentabilidades experimentadas ao longo do período.

Visando uma apresentação mais concisa, agrupamos os resultados por fatores de risco, que são os índices aos quais os ativos estão vinculados. A coluna Exposição denota o percentual do Patrimônio da Carteira que está atrelado a cada um desses fatores.

As duas colunas mais à direita mostram o impacto do cenário de estresse, em reais e em percentual do patrimônio, estimados para um intervalo de um mês a partir do período atual. Valores positivos indicam que, mesmo frente ao cenário projetado, os ativos atrelados ao respectivo fator de risco incorreriam em ganhos ao Instituto.

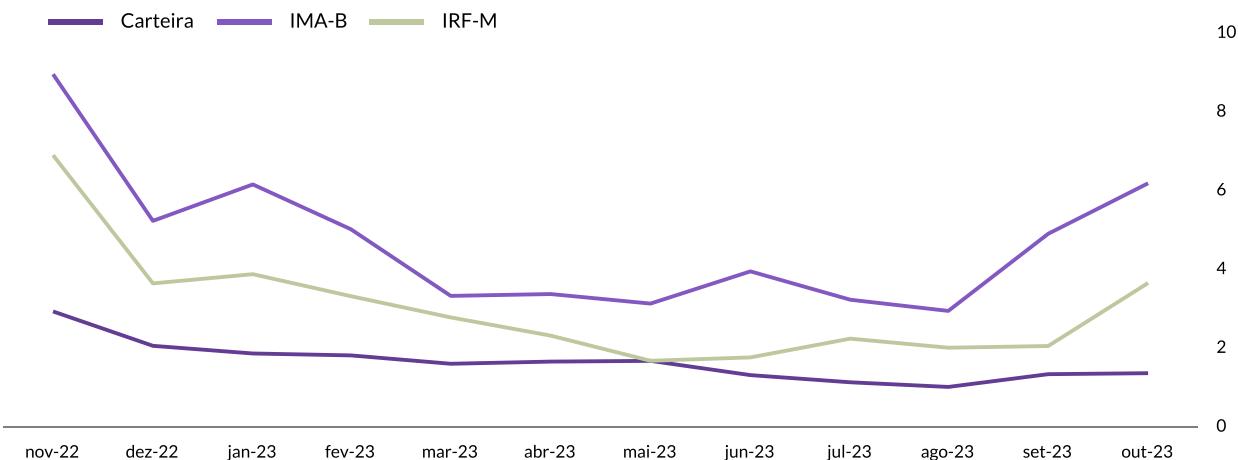
No mês atual, a maior exposição da Carteira é em IMA-B, com 38,33% de participação. Dado o cenário de estresse, haveria uma perda de R\$13.219.468,01 nos ativos atrelados a este índice.

No cenário como um todo, o Instituto perderia R\$76.972.585,40, equivalente a uma queda de 1,65% no patrimônio investido.

Já o gráfico abaixo ilustra a trajetória da Volatilidade Mensal Anualizada da Carteira, em comparação com dois índices do mercado: o IRF-M, mais conservador, e o IMA-B, que apresenta volatilidade mais elevada.

Devido à relação intrínseca entre o risco e o retorno dos ativos, ao mesmo tempo que estar exposto a uma maior volatilidade traz a possibilidade de retornos mais elevados, aumenta-se também a exposição ao risco. Daí a importância de se manter uma Carteira diversificada, conforme a conjuntura do mercado.

## VOLATILIDADE MENSAL ANUALIZADA (%)



## STRESS TEST (24 MESES)

FATORES DE RISCO	EXPOSIÇÃO	RESULTADOS DO CENÁRIO	
<b>IRF-M</b>	<b>13,65%</b>	<b>2.843.893,11</b>	<b>0,06%</b>
IRF-M	0,68%	-219.116,71	0,00%
IRF-M 1	0,00%	0,00	0,00%
IRF-M 1+	0,15%	-103.289,32	0,00%
Carência Pré	12,82%	3.166.299,14	0,07%
<b>IMA-B</b>	<b>38,33%</b>	<b>-13.219.468,01</b>	<b>-0,28%</b>
IMA-B	1,61%	-2.654.151,86	-0,06%
IMA-B 5	0,00%	0,00	0,00%
IMA-B 5+	0,00%	0,00	0,00%
Carência Pós	36,72%	-10.565.316,15	-0,23%
<b>IMA GERAL</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>IDKA</b>	<b>1,65%</b>	<b>-501.640,23</b>	<b>-0,01%</b>
IDKa 2 IPCA	1,65%	-501.640,23	-0,01%
IDKa 20 IPCA	0,00%	0,00	0,00%
Outros IDKa	0,00%	0,00	0,00%
<b>FIDC</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>0,24%</b>	<b>-103.282,27</b>	<b>0,00%</b>
<b>FUNDOS PARTICIPAÇÕES</b>	<b>0,81%</b>	<b>-3.763.561,51</b>	<b>-0,08%</b>
<b>FUNDOS DI</b>	<b>33,70%</b>	<b>2.693.803,58</b>	<b>0,06%</b>
F. Crédito Privado	0,00%	0,00	0,00%
Fundos RF e Ref. DI	32,17%	8.860.895,55	0,19%
Multimercado	1,52%	-6.167.091,97	-0,13%
<b>OUTROS RF</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>8,39%</b>	<b>-46.941.543,71</b>	<b>-1,01%</b>
Ibov., IBrX e IBrX-50	5,20%	-29.911.496,29	-0,64%
Governança Corp. (IGC)	0,00%	0,00	0,00%
Dividendos	0,00%	0,00	0,00%
Small Caps	0,26%	-2.022.194,57	-0,04%
Setorial	0,26%	-1.744.210,96	-0,04%
Outros RV	2,67%	-13.263.641,89	-0,28%
Valor	0,00%	0,00	0,00%
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>3,23%</b>	<b>-17.980.786,35</b>	<b>-0,39%</b>
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>-76.972.585,40</b>	<b>-1,65%</b>

Pode-se conceituar risco de um investimento como a probabilidade estatística da não realização do retorno esperado para ele, ou seja, é a chance de não ganhar no futuro aquilo que se esperava no momento em que se decidiu fazer a aplicação.

Os investimentos dos recursos do Fundoprev, como toda aplicação financeira, estão expostos a alguns riscos, mapeados e discriminados anualmente na PAI, como por exemplo: de crédito, de liquidez, de mercado, de terceirização, legal, e operacional. A gestão de investimentos tem como objetivos, entre outros, mapear, gerenciar e buscar dirimir esses riscos, a fim de tornar seus impactos mínimos aos resultados dos investimentos.

## De Crédito

O Risco de Crédito está relacionado à possibilidade de perda resultante da incerteza quanto ao recebimento de valores pactuados com tomadores de empréstimos, contrapartes de contratos ou emissões de títulos; é aquele em que há a possibilidade de o retorno de investimento não ser honrado pela instituição que emitiu determinado título, na data e nas condições negociadas e contratadas.

Pretende-se amenizar este risco por meio de análise dos documentos de credenciamento das instituições financeiras, dos administradores e gestores dos ativos investidos, a fim de analisar o histórico de capacidade de pagamento, dirimindo assim a probabilidade de default.

## De Liquidez

O Risco de Liquidez está relacionado à disponibilidade do ativo para conversão em dinheiro. Pode ser separado em dois tipos: risco de liquidez de fluxo de caixa e risco de liquidez de mercado.

No contexto previdenciário, poderia ser entendido como uma eventual dificuldade do Fundoprev fazer frente às suas obrigações previdenciárias, que é atenuada por meio de análise atuarial e observação recorrente da liquidez dos investimentos.

## De Fluxo de Caixa

O Risco de Liquidez de Fluxo de Caixa está relacionado à possibilidade de descasamento entre os ativos e passivos, no que tange ao seu diferimento de prazo.

Além disso, para atenuar o risco de descasamento entre os vencimentos de ativos e de passivos do Fundoprev, está sendo construído com a equipe da empresa que presta serviço de sistema e de consultoria de investimentos – a SMI Prime Consultoria de Investimentos LTDA –, um documento que aferirá no mínimo anualmente o Gerenciamento do Ciclo de Vida de Aplicações (também conhecida como ALM - Asset Liability Management).

## De Liquidez de Mercado

O Risco de Liquidez de Mercado ocorre quando um ativo está com baixo volume de negócios e apresenta grandes diferenças entre o preço que o comprador está disposto a pagar (oferta de compra) e o que o vendedor gostaria de vender (oferta de venda).

O Risco de Liquidez de Mercado é reduzido pela análise prévia dos ativos, cuidando para que a liquidez escolhida faça frente às eventuais necessidades do fundo.

O Risco de Mercado é mitigado pela diversificação dos tipos de investimentos, visando à redução do impacto dos investimentos pela volatilidade do mercado.

Cabe salientar que a Coordenação de Investimentos e Aplicações – CIA realiza acompanhamento periódico da carteira, visando à adequação da diversificação dos investimentos, assim como o acompanhamento de seus retornos, de suas volatilidades, de seus Valores em Risco (Value at Risk – VaR) – em que se verifica uma estimativa de perda máxima potencial de um ativo – e de seus Índices de Sharpe (IS) – em que se verifica a representatividade de retorno para um risco tomado.

## De Terceirização

O Risco de Terceirização está relacionado à possibilidade de má administração e/ou gestão dos investimentos em virtude da terceirização total ou parcial da gestão dos investimentos.

Apesar de atualmente o Instituto realizar gestão própria dos investimentos do Fundoprev, é impor-

tante esclarecer que essa gestão se trata da definição dos percentuais de cada benchmark pretendido. Então o risco de terceirização está presente, visto que a carteira é composta por fundos com gestores próprios.

Dessa forma, a mitigação deste risco é dada por meio da análise de documentos de administrador e gestor dos ativos no credenciamento, conforme as regulações e legislações pertinentes, e ainda por meio da verificação do desmembramento dos ativos encontrado no Relatório de Lastros. Esse relatório examina os ativos internos de cada fundo da carteira até que se encontre o ativo final, e verifica se o gestor está terceirizando a gestão do fundo conforme o regulamento adotado. É minorado também por meio do acompanhamento dos desempenhos individuais dos ativos em reuniões periódicas do CIA.

## Legal

O Risco Legal está relacionado à possibilidade de perdas decorrentes de multas, penalidades ou indenizações resultantes de ações de órgãos de supervisão e controle, bem como perdas decorrentes de decisão desfavorável em processos judiciais ou administrativos.

Esse risco pode ser diminuído pelo acompanhamento dos regulamentos dos fundos, bem como pelo acompanhamento das regulações das legislações dos investimentos dos RPPS.

## Operacional

O Risco Operacional está relacionado à possibilidade de haver erro humano ou falha de equipamentos, programas de informática ou sistema de telecomunicações imprescindíveis ao funcionamento de determinado sistema.

Esse risco é mitigado pelo mapeamento e manualização dos processos da Diretoria de Investimento, bem como pela constante e permanente capacitação dos servidores envolvidos na atividade de gestão de ativos, dos membros dos Comitês de Investimentos, dos Conselhos de Administração e Fiscal, além do emprego de sistemas eletrônicos de gerenciamento da carteira, que possibilitem um acompanhamento robusto e tempestivo das aplicações.

# RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS



## Fundoprev Militar



ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO	CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE	CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE	
<b>TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO</b>		<b>26,55</b>	<b>316.082.812,22</b>	<b>313.010.169,55</b>					
LFT 01/03/2024 (Compra em 06/12/2022)	7, l, a	0,82	9.809.917,84	9.713.101,60	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (i)	7, l, a	1,18	14.014.168,34	13.875.859,43	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (ii)	7, l, a	1,18	14.014.168,34	13.875.859,43	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 23/08/2023)	7, l, a	1,47	17.517.710,42	17.344.529,43	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 28/08/2023)	7, l, a	1,47	17.517.710,42	17.344.529,43	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 29/08/2023)	7, l, a	1,47	17.517.710,42	17.344.529,43	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2026 (Compra em 26/09/2023)	7, l, a	0,88	10.503.132,18	10.399.703,46	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/09/2025 (Compra em 04/09/2023)	7, l, a	5,89	70.065.656,47	69.374.440,63	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/09/2026 (Compra em 27/09/2023)	7, l, a	11,75	139.854.112,68	138.508.830,81	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LTN 01/01/2025 (Compra em 24/08/2022)	7, l, a	0,22	2.565.058,48	2.549.512,26	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LTN 01/07/2024 (Compra em 25/08/2022)	7, l, a	0,23	2.703.466,63	2.679.273,64	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>		<b>19,69</b>	<b>234.341.212,68</b>	<b>210.561.999,71</b>					
LTN 01/01/2024 (Compra em 11/08/2022 Tx 12.9600)	7, l, a	0,18	2.156.810,15	2.135.017,94	D+0	D+0	01/01/2024	0,00	Não há
LTN 01/01/2024 (Compra em 26/08/2022 Tx 13.2200)	7, l, a	0,24	2.842.004,67	2.812.750,37	D+0	D+0	01/01/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 06/09/2023 Tx 5.6400)	7, l, a	0,45	5.365.773,01	5.328.426,92	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)	7, l, a	0,36	4.254.035,43 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 22/09/2023 Tx 5.5600)	7, l, a	0,45	5.371.648,36	5.334.599,04	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)	7, l, a	0,36	4.252.938,28 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)	7, l, a	0,36	4.255.913,88 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 25/09/2023 Tx 5.5280)	7, l, a	0,45	5.374.001,61	5.337.071,00	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.9502)	7, l, a	0,43	5.129.373,71	5.092.424,67	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 28/08/2023 Tx 5.5850)	7, l, a	0,45	5.369.809,39	5.332.666,04	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 30/08/2022 Tx 6.0300)	7, l, a	0,79	9.393.630,06	9.325.385,77	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 08/11/2022 Tx 5.6800)	7, l, a	0,43	5.175.493,76	5.139.329,11	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 11/11/2022 Tx 6.0600)	7, l, a	0,86	10.233.054,25	10.158.471,82	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 15/08/2022 Tx 5.6510)	7, l, a	0,80	9.495.198,38	9.429.026,10	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 18/04/2022 Tx 5.7400)	7, l, a	3,72	44.340.089,93	44.028.006,23	D+0	D+0	15/05/2055	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 03/02/2023 Tx 6.6300)	7, l, a	0,18	2.094.456,57	2.078.262,49	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 06/02/2023 Tx 6.7400)	7, l, a	0,18	2.092.792,15	2.076.432,10	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 10/08/2022 Tx 6.1600)	7, l, a	0,39	4.623.525,65	4.589.470,62	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 13/12/2022 Tx 6.7160)	7, l, a	0,42	5.023.568,91	4.984.397,21	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/08/2023 Tx 6.6110)	7, l, a	0,44	5.236.858,32	5.196.449,11	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/12/2022 Tx 6.9300)	7, l, a	0,42	5.015.814,08	4.975.870,04	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 18/08/2022 Tx 6.4750)	7, l, a	0,78	9.225.949,52	9.155.728,66	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4400)	7, l, a	0,42	5.033.612,78	4.995.436,77	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há

ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO	CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE	CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE	
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>		<b>19,69</b>	<b>234.341.212,68</b>	<b>210.561.999,71</b>					
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 05/10/2022 Tx 5.7350)	7, I, a	0,43	5.081.268,83	5.045.525,21	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)	7, I, a	0,35	4.216.138,17 ▲	-	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 28/09/2023 Tx 5.5750)	7, I, a	0,36	4.250.989,19	4.221.618,89	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/01/2023 Tx 6.1400)	7, I, a	0,25	2.935.311,21	2.913.746,50	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)	7, I, a	0,44	5.253.762,27 ▲	-	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 16/09/2022 Tx 5.8930)	7, I, a	0,43	5.088.480,07	5.052.057,41	D+0	D+0	15/08/2032	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/10/2022 Tx 5.7500)	7, I, a	0,43	5.136.111,19	5.099.922,02	D+0	D+0	15/08/2032	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 06/07/2022 Tx 6.1360)	7, I, a	0,77	9.118.164,03	9.051.167,13	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 08/06/2022 Tx 5.9000)	7, I, a	1,58	18.794.921,85	18.660.275,47	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 12/07/2022 Tx 6.3520)	7, I, a	0,75	8.873.701,54	8.807.010,83	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/06/2022 Tx 5.9650)	7, I, a	0,36	4.236.011,48	4.205.454,24	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>		<b>41,99</b>	<b>499.843.047,15</b>	<b>504.513.285,57</b>					
Banrisul Absoluto	7, I, b	1,76	20.930.651,37 ▲	7.963.797,34	D+0	D+0	Não há	0,15	Não há
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	7, III, a	24,94	296.832.739,79 ▲	293.876.387,80	D+0	D+0	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário IRF-M 1+	7, I, b	0,08	932.932,62	932.248,17	D+1	D+1	Não há	0,30	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IDkA 2	7, I, b	1,46	17.327.434,51	17.384.758,84	D+1	D+1	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	7, I, b	0,05	652.132,73	649.836,73	D+1	D+1	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos X	7, I, b	0,16	1.914.360,19	1.906.109,46	D+1	D+1	15/08/2024	0,20	Não há
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	7, III, a	13,06	155.472.995,94 ▼	175.974.034,73	D+0	D+0	Não há	0,20	Não há
It Now Fundo de Índice IMA-B IMAB11	7, III, b	0,49	5.779.800,00	5.826.112,50	D+0	D+0	Não há	0,25	Não há
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>		<b>7,61</b>	<b>90.560.126,24</b>	<b>93.811.480,38</b>					
BB FIA Bolsa Americana	8, I	0,10	1.243.271,55	1.265.538,49	D+1	D+3	Não há	1,00	20% exc S&P 500
BB FIA Governança	8, I	1,08	12.851.407,34	13.333.338,21	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Consumo	8, I	0,20	2.403.679,61	2.638.130,26	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Exportação	8, I	0,40	4.726.149,88	4.887.277,16	D+1	D+3	Não há	2,00	Não há
BB FIC FIA Retorno Total	8, I	1,11	13.220.213,65	13.676.151,43	D+0	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Seleção Fatorial	8, I	1,54	18.318.334,24	18.865.962,32	D+1	D+3	Não há	1,00	20% exc Ibovespa
BB FIC FIA Siderurgia	8, I	0,12	1.437.389,95	1.531.462,26	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Valor	8, I	0,79	9.385.597,31	9.755.694,90	D+30	D+32	Não há	2,00	20% exc Ibovespa
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	8, I	0,54	6.434.125,51	6.697.500,55	D+21	D+23	Não há	1,72	Não há
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11	8, II	0,44	5.272.027,20 ▼	5.757.096,80	D+0	D+2	Não há	0,10	Não há
Ishares Fundo de Índice Small Cap SMAL11	8, II	0,26	3.089.130,00	3.370.290,00	D+0	D+3	Não há	0,50	Não há
Ishares Fundo de Índice S&P 500 IVVB11	8, II	0,58	6.891.495,00	7.033.980,00	D+0	D+0	Não há	0,23	Não há
Trend ETF LBMA Ouro GOLD11	8, II	0,36	4.329.040,00	4.010.488,00	D+0	D+2	Não há	0,00	Não há



ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>		<b>7,61</b>	<b>90.560.126,24</b>	<b>93.811.480,38</b>
Trend ETF MSCI Europa	8, II	0,08	958.265,00	988.570,00
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>		<b>2,47</b>	<b>29.453.818,96</b>	<b>30.506.588,18</b>
BB FIA Nordea Global Climate and Environment IE	9, II	1,02	12.188.418,32	12.836.189,89
BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I	9, III	0,20	2.425.791,17 ▼	2.543.218,87
BB Global Select Equity IE Multimercado	9, II	0,89	10.564.049,96	10.745.165,09
BB Schroder Multimercado IE	9, II	0,36	4.275.559,51	4.382.014,33
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>		<b>1,30</b>	<b>15.421.373,69</b>	<b>15.687.435,65</b>
Caixa Bolsa Americana Multimercado	10, I	1,07	12.771.679,15	13.002.030,19
Caixa FIC Capital Protegido Bolsa de Valores IV Mult.	10, I	0,22	2.649.694,54	2.685.405,46
<b>FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES</b>		<b>0,39</b>	<b>4.693.252,27</b>	<b>4.809.617,19</b>
BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11	10, II	0,39	4.693.252,27 ▼	4.809.617,19
<b>CONTAS CORRENTES</b>		<b>0,00</b>	<b>0,01</b>	<b>0,01</b>
Banco do Brasil		0,00	-	-
Banrisul		0,00	-	-
BTG Pactual		0,00	-	-
Caixa Econômica Federal		0,00	-	-
XP Investimentos		0,00	0,01	0,01
<b>TOTAL DA CARTEIRA</b>		<b>100,0%</b>	<b>1.190.395.643,22</b>	<b>1.172.900.576,24</b>

▲ Entrada de Recursos   
 ▲ Nova Aplicação   
 ▼ Saída de Recursos   
 ▼ Resgate Total

CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE	CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE
D+0	D+0	Não há	0,30
D+1	D+5	Não há	0,30
D+0	D+2	Não há	0,85
D+1	D+5	Não há	0,08
D+1	D+5	Não há	0,08
D+0	D+1	Não há	0,80
D+0	D+2	761 dias	0,90
D+0	D+2	Não há	1,10
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO 4.963



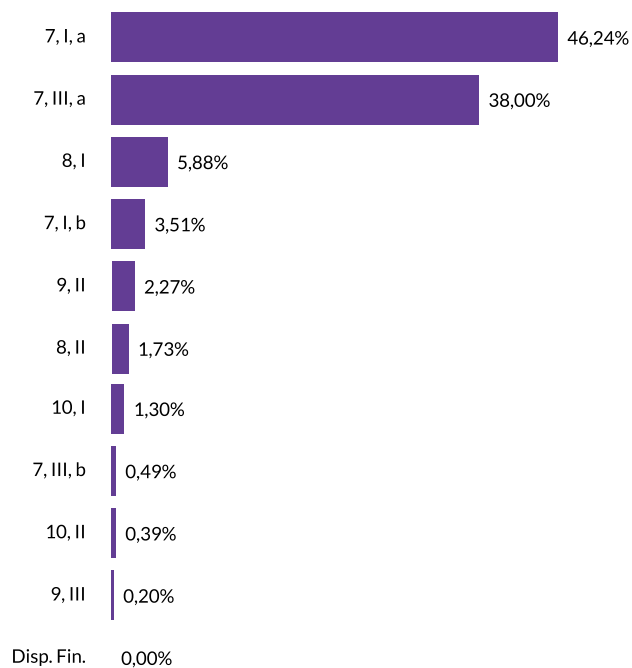
Art. 7	88,23%	Art. 10	1,69%
Art. 8	7,61%	Conta Corrente	0,00%
Art. 9	2,47%		

POR SEGMENTO

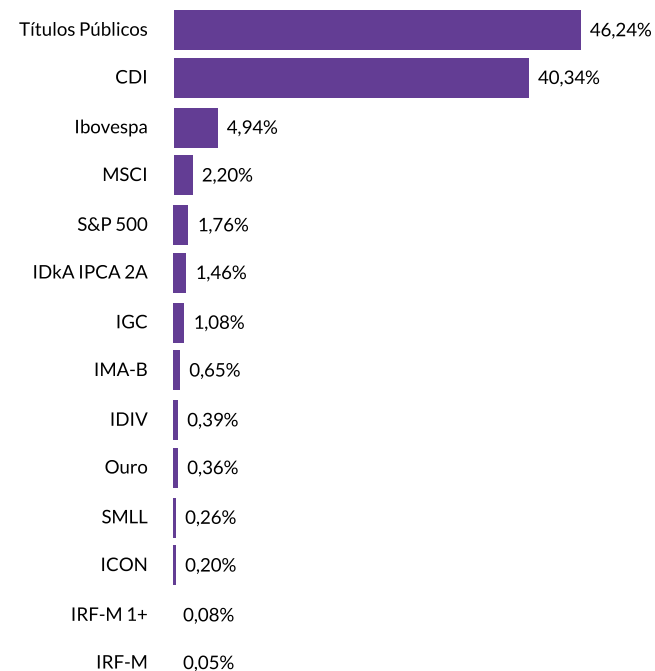


Títulos Públicos a Mercado	26,55%	Investimentos no Exterior	2,47%
Títulos Públicos na Curva	19,69%	Fundos Multimercado	1,30%
Fundos de Renda Fixa	41,99%	Fundos de Participações	0,39%
Fundos de Renda Variável	7,61%	Contas Correntes	0,00%

POR TIPO DE ATIVO



POR BENCHMARK



ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO</b>	<b>17.904.744,05</b>	<b>3.307.367,45</b>	<b>3.661.980,71</b>	<b>1.821.532,50</b>	<b>3.072.642,67</b>			<b>29.768.267,38</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 06/12/2022)	574.501,28	100.445,95	108.782,56	93.834,39	96.816,24			<b>974.380,42</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (i)	718.366,34	143.494,22	155.403,65	134.049,14	138.308,91			<b>1.289.622,26</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (ii)	718.366,34	143.494,22	155.403,65	134.049,14	138.308,91			<b>1.289.622,26</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 23/08/2023)	-	-	52.607,06	168.486,15	173.180,99			<b>394.274,20</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 28/08/2023)	-	-	26.889,69	168.486,15	173.180,99			<b>368.556,83</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 29/08/2023)	-	-	18.600,38	168.486,15	173.180,99			<b>360.267,52</b>
LFT 01/03/2026 (Compra em 26/09/2023)	-	-	-	18.020,58	103.428,72			<b>121.449,30</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 01/02/2023)	672.084,27	144.085,57	155.389,75	6.766,05	-			<b>978.325,64</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 01/09/2022)	1.639.742,70	288.171,13	310.779,51	13.532,11	-			<b>2.252.225,45</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 03/02/2023)	494.456,77	108.064,17	116.542,32	5.074,53	-			<b>724.137,79</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 03/08/2022)	541.115,09	95.096,48	102.557,23	4.465,60	-			<b>743.234,40</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 09/08/2022)	721.486,79	126.795,30	136.742,98	5.954,13	-			<b>990.979,20</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 12/08/2022)	721.486,79	126.795,30	136.742,98	5.954,13	-			<b>990.979,20</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 14/11/2022)	737.884,21	129.677,01	139.850,78	6.089,44	-			<b>1.013.501,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 16/08/2022)	721.486,79	126.795,30	136.742,98	5.954,13	-			<b>990.979,20</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 17/10/2022)	737.884,21	129.677,01	139.850,78	6.089,44	-			<b>1.013.501,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 20/10/2022)	450.929,24	79.247,06	85.464,37	3.721,32	-			<b>619.361,99</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 23/08/2022)	721.486,79	126.795,30	136.742,98	5.954,13	-			<b>990.979,20</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 24/01/2023)	711.031,49	144.085,57	155.389,75	6.766,05	-			<b>1.017.272,86</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 25/10/2022)	737.884,21	129.677,01	139.850,78	6.089,44	-			<b>1.013.501,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 26/09/2022)	1.639.742,70	288.171,13	310.779,51	13.532,11	-			<b>2.252.225,45</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 26/10/2022)	737.884,21	129.677,01	139.850,78	6.089,44	-			<b>1.013.501,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 28/09/2022)	737.884,21	129.677,01	139.850,78	6.089,44	-			<b>1.013.501,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 28/10/2022)	737.884,21	129.677,01	139.850,78	6.089,44	-			<b>1.013.501,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 30/01/2023) (i)	685.122,42	144.085,57	155.389,75	6.766,05	-			<b>991.363,79</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 30/01/2023) (ii)	685.122,42	144.085,57	155.389,75	6.766,05	-			<b>991.363,79</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 31/01/2023)	678.719,89	144.085,57	155.389,75	6.766,05	-			<b>984.961,26</b>
LFT 01/09/2025 (Compra em 04/09/2023)	-	-	-	602.113,52	691.215,84			<b>1.293.329,36</b>
LFT 01/09/2026 (Compra em 27/09/2023)	-	-	-	166.366,70	1.345.281,87			<b>1.511.648,57</b>
LTN 01/01/2025 (Compra em 24/08/2022)	200.924,24	27.019,73	25.656,46	11.791,56	15.546,22			<b>280.938,21</b>
LTN 01/07/2024 (Compra em 25/08/2022)	181.266,44	28.492,25	29.488,97	21.339,94	24.192,99			<b>284.780,59</b>
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>	<b>11.334.834,81</b>	<b>905.634,45</b>	<b>1.401.072,23</b>	<b>1.409.526,04</b>	<b>1.575.866,96</b>			<b>16.626.934,49</b>
LTN 01/01/2023 (Compra em 29/08/2022 Tx 13.7500)	2.351,11	-	-	-	-			<b>2.351,11</b>
LTN 01/01/2024 (Compra em 11/08/2022 Tx 12.9600)	120.475,67	21.128,09	23.387,80	20.549,75	21.792,21			<b>207.333,52</b>
LTN 01/01/2024 (Compra em 26/08/2022 Tx 13.2200)	161.528,54	28.346,20	31.384,22	27.581,22	29.254,30			<b>278.094,48</b>

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>	<b>11.334.834,81</b>	<b>905.634,45</b>	<b>1.401.072,23</b>	<b>1.409.526,04</b>	<b>1.575.866,96</b>			<b>16.626.934,49</b>
LTN 01/07/2023 (Compra em 19/08/2022 Tx 13.5950)	133.684,43	1.112,55	-	-	-			<b>134.796,98</b>
NTN-B 15/05/2023 (Compra em 29/07/2022 Tx 7.9900)	530.966,68	-	-	-	-			<b>530.966,68</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 06/09/2023 Tx 5.6400)	-	-	-	29.177,72	37.346,09			<b>66.523,81</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)	-	-	-	-	10.711,64			<b>10.711,64</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 22/09/2023 Tx 5.5600)	-	-	-	9.185,07	37.049,32			<b>46.234,39</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)	-	-	-	-	9.072,08			<b>9.072,08</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)	-	-	-	-	7.376,46			<b>7.376,46</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 25/09/2023 Tx 5.5280)	-	-	-	7.010,72	36.930,61			<b>43.941,33</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.9502)	303.532,88	24.269,30	37.832,08	35.853,87	36.949,04			<b>438.437,17</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 28/08/2023 Tx 5.5850)	-	-	7.671,75	36.099,03	37.143,35			<b>80.914,13</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 30/08/2022 Tx 6.0300)	558.999,13	45.010,78	69.905,71	66.215,04	68.244,29			<b>808.374,95</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 08/11/2022 Tx 5.6800)	300.245,54	23.414,21	36.982,71	35.136,27	36.164,65			<b>431.943,38</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 11/11/2022 Tx 6.0600)	610.241,75	49.270,56	76.406,00	72.357,06	74.582,43			<b>882.857,80</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 15/08/2022 Tx 5.6510)	549.886,57	42.781,01	67.663,06	64.288,06	66.172,28			<b>790.790,98</b>
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 18/04/2022 Tx 5.7400)	2.582.683,66	202.788,42	319.263,08	303.094,02	312.083,70			<b>3.719.912,88</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 03/02/2023 Tx 6.6300)	103.077,37	11.305,18	16.847,05	15.681,07	16.194,08			<b>163.104,75</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 06/02/2023 Tx 6.7400)	102.663,24	11.472,22	17.026,25	15.835,76	16.360,05			<b>163.357,52</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 10/08/2022 Tx 6.1600)	281.820,96	23.278,88	35.366,99	33.030,85	34.055,03			<b>407.552,71</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 13/12/2022 Tx 6.7160)	316.871,66	27.449,18	40.766,30	37.928,79	39.171,70			<b>462.187,63</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/08/2023 Tx 6.6110)	-	-	21.320,89	39.137,43	40.409,21			<b>100.867,53</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/12/2022 Tx 6.9300)	320.447,65	28.226,25	41.602,30	38.647,12	39.944,04			<b>468.867,36</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 18/08/2022 Tx 6.4750)	573.478,77	48.699,24	73.010,80	68.033,15	70.220,86			<b>833.442,82</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4400)	254.539,51	26.429,58	39.688,83	36.988,40	38.176,01			<b>395.822,33</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 05/10/2022 Tx 5.7350)	299.764,70	23.901,09	37.042,69	34.715,43	35.743,62			<b>431.167,53</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)	-	-	-	-	2.281,84			<b>2.281,84</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 28/09/2023 Tx 5.5750)	-	-	-	1.582,12	29.370,30			<b>30.952,42</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/01/2023 Tx 6.1400)	143.761,44	14.721,20	22.390,15	20.918,79	21.564,71			<b>223.356,29</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)	-	-	-	-	-			<b>-</b>
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 16/09/2022 Tx 5.8930)	302.887,10	24.554,85	37.773,82	35.356,91	36.422,66			<b>436.995,34</b>
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/10/2022 Tx 5.7500)	303.908,35	24.209,74	37.499,85	35.152,84	36.189,17			<b>436.959,95</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 06/07/2022 Tx 6.1360)	551.234,75	45.755,03	69.570,62	64.981,10	66.996,90			<b>798.538,40</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 08/06/2022 Tx 5.9000)	1.132.268,42	90.782,95	139.622,43	130.688,54	134.646,38			<b>1.628.008,72</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 12/07/2022 Tx 6.3520)	538.071,91	46.047,03	69.344,15	64.640,42	66.690,71			<b>784.794,22</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/06/2022 Tx 5.9650)	255.443,02	20.680,91	31.702,70	29.659,49	30.557,24			<b>368.043,36</b>

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>	<b>26.599.301,51</b>	<b>4.943.246,49</b>	<b>5.394.482,21</b>	<b>5.925.758,13</b>	<b>4.621.559,72</b>			<b>47.484.348,06</b>
Banrisul Absoluto	13.024.644,74	2.548.313,43	2.982.364,59	1.376.015,17	107.484,61			<b>20.038.822,54</b>
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	1.788.089,95	-	-	-	-			<b>1.788.089,95</b>
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	5.813.011,72	1.483.674,65	1.634.970,82	2.822.261,09	2.904.173,54			<b>14.658.091,82</b>
BB FIC Previdenciário Fluxo	480,12	-	25,19	-	-			<b>505,31</b>
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	68,12	-	-	-	-			<b>68,12</b>
BB Previdenciário Crédito Privado IPCA III	257.652,03	-	-	-	-			<b>257.652,03</b>
BB Previdenciário IRF-M 1+	92.605,46	7.437,66	5.067,42	(1.840,76)	684,45			<b>103.954,23</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos IDkA 2	1.050.548,47	160.925,63	127.301,24	36.725,97	(57.324,33)			<b>1.318.176,98</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA	94.198,93	-	-	-	-			<b>94.198,93</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	55.163,82	4.984,45	4.666,10	906,23	2.296,00			<b>68.016,60</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos X	101.209,28	20.059,70	17.134,75	20.638,01	8.250,73			<b>167.292,47</b>
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	3.731.147,86	621.520,97	667.412,10	1.719.834,92	1.702.307,22			<b>8.442.223,07</b>
Caixa Brasil Referenciado	768,51	-	-	-	-			<b>768,51</b>
It Now Fundo de Índice IMA-B IMAB11	589.712,50	96.330,00	(44.460,00)	(48.782,50)	(46.312,50)			<b>546.487,50</b>
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>5.522.431,89</b>	<b>3.341.345,42</b>	<b>(3.911.733,05)</b>	<b>(266.952,62)</b>	<b>(2.922.724,99)</b>			<b>1.762.366,65</b>
BB FIA Bolsa Americana	182.143,06	42.528,57	(9.966,06)	(62.001,23)	(22.266,94)			<b>130.437,40</b>
BB FIA Governança	823.779,81	464.316,59	(724.714,08)	119.217,69	(481.930,87)			<b>200.669,14</b>
BB FIC FIA Consumo	213.966,10	62.686,42	(320.636,08)	(111.830,70)	(234.450,65)			<b>(390.264,91)</b>
BB FIC FIA Exportação	101.233,03	334.320,56	(158.649,10)	81.740,29	(161.127,28)			<b>197.517,50</b>
BB FIC FIA Retorno Total	363.807,01	616.132,52	(654.842,27)	117.826,23	(455.937,78)			<b>(13.014,29)</b>
BB FIC FIA Seleção Fatorial	933.526,24	621.966,30	(843.520,83)	88.329,38	(547.628,08)			<b>252.673,01</b>
BB FIC FIA Siderurgia	(85.318,11)	135.577,61	(107.034,02)	(17.321,80)	(94.072,31)			<b>(168.168,63)</b>
BB FIC FIA Valor	388.242,86	380.552,86	(600.686,72)	25.209,15	(370.097,59)			<b>(176.779,44)</b>
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	469.447,02	236.598,23	(362.580,57)	4.998,39	(263.375,04)			<b>85.088,03</b>
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11	421.794,62	132.564,30	(211.305,32)	10.213,98	(156.440,45)			<b>196.827,13</b>
Ishares Fundo de Índice S&P 500 IVVB11	454.950,00	137.117,02	221.840,00	(265.500,00)	(142.485,00)			<b>405.922,02</b>
Ishares Fundo de Índice Small Cap SMAL11	564.453,25	91.255,06	(256.080,00)	(101.970,00)	(281.160,00)			<b>16.498,31</b>
It Now Fundo de Índice Dividendos DIVO11	475.228,00	(16.408,00)	-	-	-			<b>458.820,00</b>
It Now Fundo de Índice Ibovespa BOV11	363.909,00	47.712,38	-	-	-			<b>411.621,38</b>
Trend ETF LBMA Ouro GOLD11	(163.360,00)	40.840,00	114.352,00	(126.604,00)	318.552,00			<b>183.780,00</b>
Trend ETF MSCI Europa	14.630,00	13.585,00	2.090,00	(29.260,00)	(30.305,00)			<b>(29.260,00)</b>
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>808.530,63</b>	<b>539.466,14</b>	<b>263.136,44</b>	<b>(813.316,66)</b>	<b>(1.000.590,77)</b>			<b>(202.774,22)</b>
BB FIA Nordea Global Climate and Environment IE	(246.909,43)	109.052,28	18.311,36	(409.012,07)	(647.771,57)			<b>(1.176.329,43)</b>
BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I	546.339,21	136.315,88	(156.643,59)	(114.226,02)	(65.249,25)			<b>346.536,23</b>
BB Global Select Equity IE Multimercado	430.302,57	213.637,82	280.286,46	(202.769,43)	(181.115,13)			<b>540.342,29</b>

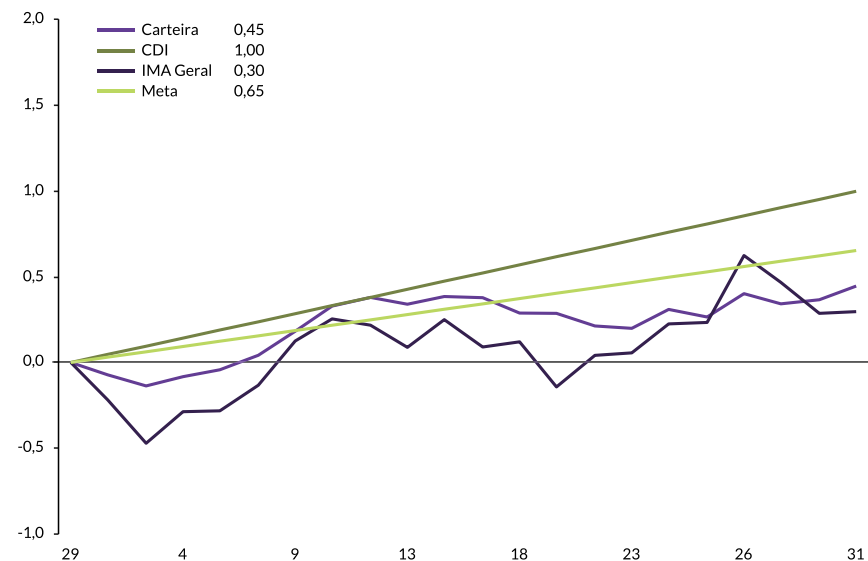
## RETORNO DA CARTEIRA POR ATIVO (R\$)

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>808.530,63</b>	<b>539.466,14</b>	<b>263.136,44</b>	<b>(813.316,66)</b>	<b>(1.000.590,77)</b>			<b>(202.774,22)</b>
BB Schroder Multimercado IE	78.798,28	80.460,16	121.182,21	(87.309,14)	(106.454,82)			<b>86.676,69</b>
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>	<b>2.373.236,18</b>	<b>541.178,55</b>	<b>(217.178,47)</b>	<b>(601.552,15)</b>	<b>(266.061,96)</b>			<b>1.829.622,15</b>
Caixa Bolsa Americana Multimercado	2.224.494,27	482.415,40	(125.918,91)	(606.762,64)	(230.351,04)			<b>1.743.877,08</b>
Caixa FIC Capital Protegido Bolsa de Valores IV Mult.	148.741,91	58.763,15	(91.259,56)	5.210,49	(35.710,92)			<b>85.745,07</b>
<b>FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES</b>	<b>873.279,55</b>	<b>445.866,07</b>	<b>94.306,00</b>	<b>154.336,49</b>	<b>158.606,98</b>			<b>1.726.395,09</b>
BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11	873.279,55	445.866,07	94.306,00	154.336,49	158.606,98			<b>1.726.395,09</b>
<b>TOTAL</b>	<b>65.416.358,62</b>	<b>14.024.104,57</b>	<b>6.686.066,07</b>	<b>7.629.331,73</b>	<b>5.239.298,61</b>			<b>98.995.159,60</b>

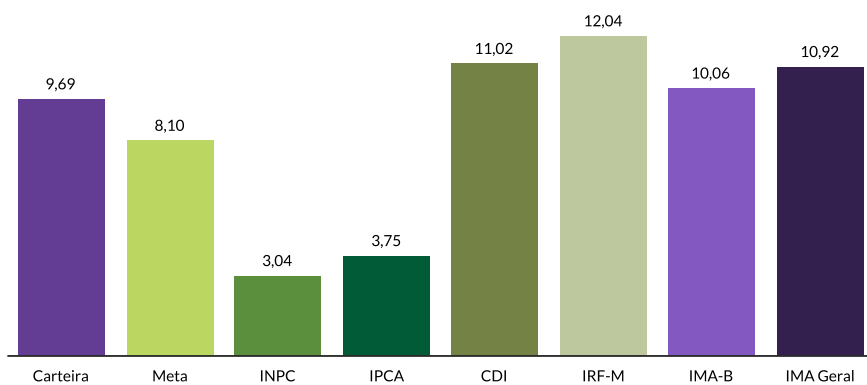
## RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META DE RENTABILIDADE (IPCA + 5.05%)

MÊS	CARTEIRA	META	CDI	IMA-G	% META	% CDI	% IMA-G
Janeiro	1,53	0,94	1,12	0,70	163	137	220
Fevereiro	0,11	1,25	0,92	1,03	9	12	11
Março	0,88	1,12	1,17	1,86	78	75	47
Abril	0,89	1,02	0,92	1,25	87	97	72
Mai	1,34	0,64	1,12	1,77	208	119	75
Junho	1,60	0,33	1,07	1,74	483	149	92
Julho	1,26	0,53	1,07	0,98	237	118	129
Agosto	0,59	0,64	1,14	0,63	91	52	93
Setembro	0,66	0,67	0,97	0,18	98	68	369
Outubro	0,45	0,65	1,00	0,30	68	45	150
Novembro							
Dezembro							
<b>TOTAL</b>	<b>9,69</b>	<b>8,10</b>	<b>11,02</b>	<b>10,92</b>	<b>120</b>	<b>88</b>	<b>89</b>

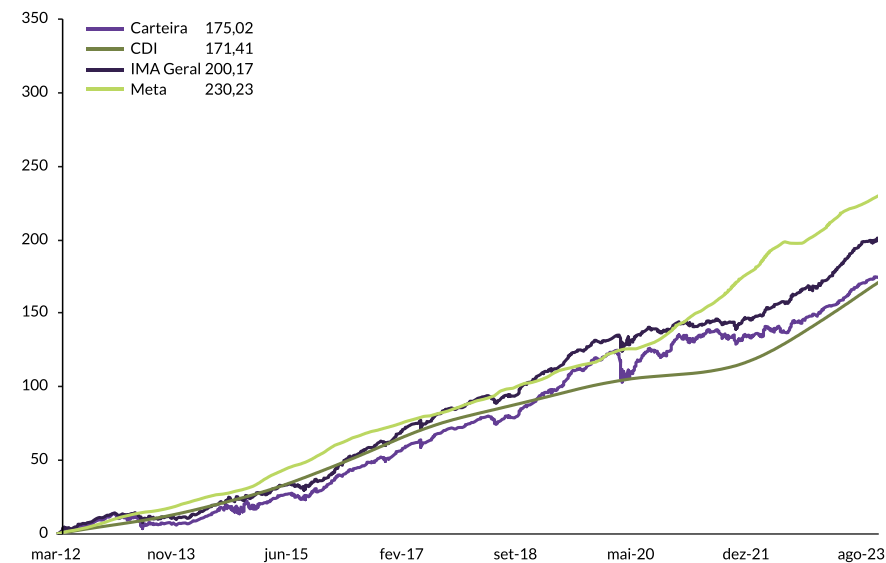
## RENTABILIDADE ACUMULADA NO MÊS



## CARTEIRA x INDICADORES 2023



## RENTABILIDADE ACUMULADA DESDE DEZEMBRO DE 2011



## ENTRADAS

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
16/10/2023	6.329.937,44	Aplicação	Banrisul Absoluto
20/10/2023	4.243.323,79	Aplicação	NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)
23/10/2023	4.243.866,20	Aplicação	NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)
24/10/2023	4.248.537,42	Aplicação	NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)
27/10/2023	4.213.856,33	Aplicação	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)
27/10/2023	445.160,33	Aplicação	Banrisul Absoluto
31/10/2023	5.253.762,27	Aplicação	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)
31/10/2023	52.178,45	Aplicação	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
31/10/2023	6.084.271,65	Aplicação	Banrisul Absoluto

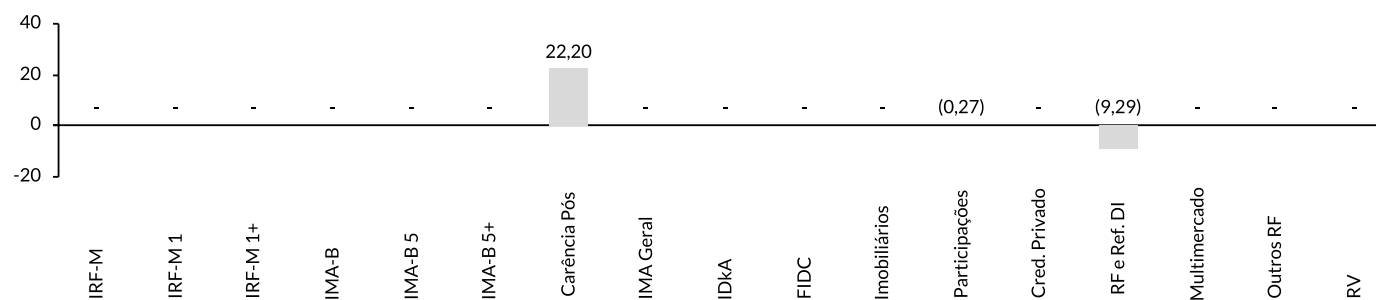
## SAÍDAS

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
03/10/2023	158.440,72	Resgate	Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11
11/10/2023	170.188,43	Resgate	Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11
20/10/2023	4.243.323,79	Resgate	Caixa Brasil Matriz Renda Fixa
23/10/2023	4.243.866,20	Resgate	Caixa Brasil Matriz Renda Fixa
24/10/2023	4.248.537,42	Resgate	Caixa Brasil Matriz Renda Fixa
26/10/2023	274.971,90	Dividendos	BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11
27/10/2023	4.213.856,33	Resgate	Caixa Brasil Matriz Renda Fixa
27/10/2023	52.178,45	Resgate	BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I
31/10/2023	5.253.762,27	Resgate	Caixa Brasil Matriz Renda Fixa

### TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

<b>Aplicações</b>	<b>35.114.893,88</b>
<b>Resgates</b>	<b>22.859.125,51</b>
<b>Saldo</b>	<b>12.255.768,37</b>

### MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS POR ÍNDICES (DURANTE O MÊS, EM R\$ MILHÕES)





# RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS



## Fundoprev Civil



ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO	CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE	CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE	
<b>TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO</b>		<b>29,36</b>	<b>1.018.210.154,36</b>	<b>1.008.295.273,74</b>					
LFT 01/03/2024 (Compra em 06/12/2022)	7, l, a	0,93	32.232.587,19	31.914.476,68	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (i)	7, l, a	0,81	28.028.336,68	27.751.718,86	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (ii)	7, l, a	1,21	42.042.505,03	41.627.578,28	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (iii)	7, l, a	0,40	14.014.168,34	13.875.859,43	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 23/08/2023)	7, l, a	1,52	52.553.131,28	52.033.588,28	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 28/08/2023)	7, l, a	1,52	52.553.131,28	52.033.588,28	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2025 (Compra em 29/08/2023)	7, l, a	1,52	52.553.131,28	52.033.588,28	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/03/2026 (Compra em 26/09/2023)	7, l, a	0,91	31.509.396,54	31.199.110,39	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/09/2025 (Compra em 04/09/2023)	7, l, a	8,08	280.262.625,86	277.497.762,52	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LFT 01/09/2026 (Compra em 27/09/2023)	7, l, a	12,10	419.562.338,04	415.526.492,43	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LTN 01/01/2025 (Compra em 24/08/2022)	7, l, a	0,18	6.279.970,76	6.241.909,33	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
LTN 01/07/2024 (Compra em 25/08/2022)	7, l, a	0,19	6.618.832,08	6.559.600,98	D+0	D+0	Não há	0,00	Não há
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>		<b>20,65</b>	<b>716.220.045,53</b>	<b>627.909.034,84</b>					
LTN 01/01/2024 (Compra em 11/08/2022 Tx 12.9600)	7, l, a	0,22	7.646.872,35	7.569.609,05	D+0	D+0	01/01/2024	0,00	Não há
LTN 01/01/2024 (Compra em 26/08/2022 Tx 13.2200)	7, l, a	0,20	6.958.011,42	6.886.388,84	D+0	D+0	01/01/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 06/09/2023 Tx 5.6400)	7, l, a	0,46	16.097.319,04	15.985.280,75	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)	7, l, a	0,49	17.016.141,72 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 22/09/2023 Tx 5.5600)	7, l, a	0,46	16.114.945,07	16.003.797,13	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)	7, l, a	0,49	17.011.753,14 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)	7, l, a	0,49	17.023.655,51 ▲	-	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 25/09/2023 Tx 5.5280)	7, l, a	0,46	16.122.004,83	16.011.213,00	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.9502)	7, l, a	0,47	16.243.016,75	16.126.011,46	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 28/08/2023 Tx 5.5850)	7, l, a	0,46	16.109.428,17	15.997.998,12	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 30/08/2022 Tx 6.0300)	7, l, a	0,96	33.304.688,38	33.062.731,36	D+0	D+0	15/05/2025	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 08/11/2022 Tx 5.6800)	7, l, a	0,47	16.389.063,56	16.274.542,17	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 11/11/2022 Tx 6.0600)	7, l, a	0,93	32.404.671,79	32.168.494,09	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 15/08/2022 Tx 5.6510)	7, l, a	0,97	33.664.794,27	33.430.183,43	D+0	D+0	15/05/2027	0,00	Não há
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 18/04/2022 Tx 5.7400)	7, l, a	1,28	44.340.089,93	44.028.006,23	D+0	D+0	15/05/2055	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 03/02/2023 Tx 6.6300)	7, l, a	0,30	10.472.282,86	10.391.312,44	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 06/02/2023 Tx 6.7400)	7, l, a	0,30	10.463.960,76	10.382.160,49	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 10/08/2022 Tx 6.1600)	7, l, a	0,47	16.392.500,03	16.271.759,48	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 13/12/2022 Tx 6.7160)	7, l, a	0,46	15.907.968,20	15.783.924,50	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/08/2023 Tx 6.6110)	7, l, a	0,45	15.710.574,95	15.589.347,34	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/12/2022 Tx 6.9300)	7, l, a	0,46	15.883.411,24	15.756.921,78	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 18/08/2022 Tx 6.4750)	7, l, a	0,94	32.710.184,66	32.461.219,79	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há

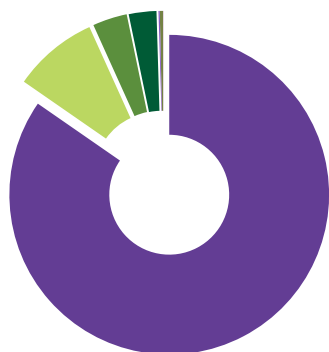
ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO	CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE	CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE	
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>		<b>20,65</b>	<b>716.220.045,53</b>	<b>627.909.034,84</b>					
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4400)	7, I, a	0,46	15.939.773,81	15.818.883,10	D+0	D+0	15/08/2024	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 05/10/2022 Tx 5.7350)	7, I, a	0,46	16.090.684,63	15.977.496,51	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)	7, I, a	0,49	16.864.552,66 ▲	-	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 28/09/2023 Tx 5.5750)	7, I, a	0,49	17.003.956,74	16.886.475,57	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/01/2023 Tx 6.1400)	7, I, a	0,28	9.644.593,98	9.573.738,48	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)	7, I, a	0,45	15.761.286,80 ▲	-	D+0	D+0	15/08/2026	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 16/09/2022 Tx 5.8930)	7, I, a	0,46	16.113.520,24	15.998.181,78	D+0	D+0	15/08/2032	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/10/2022 Tx 5.7500)	7, I, a	0,47	16.264.352,09	16.149.753,06	D+0	D+0	15/08/2032	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 06/07/2022 Tx 6.1360)	7, I, a	0,93	32.328.036,12	32.090.501,63	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 08/06/2022 Tx 5.9000)	7, I, a	1,92	66.636.541,11	66.159.158,49	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 12/07/2022 Tx 6.3520)	7, I, a	0,91	31.461.305,44	31.224.856,59	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/06/2022 Tx 5.9650)	7, I, a	1,10	38.124.103,28	37.849.088,18	D+0	D+0	15/08/2050	0,00	Não há
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>		<b>34,63</b>	<b>1.201.090.220,91</b>	<b>1.257.391.192,31</b>					
Austro FIC Ativo Renda Fixa IMA-B	7, III, a	0,08	2.769.778,26	3.834.889,37	D+1	D+4	Não há	0,30	Não há
Banrisul Absoluto	7, I, b	0,85	29.375.338,01 ▼	95.163.272,69	D+0	D+0	Não há	0,15	Não há
Banrisul Previdência IPCA 2024	7, I, b	0,05	1.810.970,00	1.797.510,00	D+0	D+0	15/08/2024	0,15	Não há
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	7, III, a	23,41	811.729.268,18 ▲	802.361.607,36	D+0	D+0	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário IRF-M 1+	7, I, b	0,17	5.964.061,59	5.959.686,04	D+1	D+1	Não há	0,30	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IDKa 2	7, I, b	1,71	59.435.238,94	59.631.868,44	D+1	D+1	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	7, I, b	0,90	31.113.120,07	31.003.578,24	D+1	D+1	Não há	0,20	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos X	7, I, b	0,23	7.831.021,68	7.797.270,63	D+1	D+1	15/08/2024	0,20	Não há
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	7, III, a	5,01	173.650.503,79 ▲	171.940.609,83	D+0	D+0	Não há	0,20	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	7, I, b	0,05	1.852.976,84	1.844.938,56	D+0	D+0	16/08/2024	0,20	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 IV	7, I, b	0,26	8.974.585,34	8.935.601,50	D+0	D+0	15/08/2024	0,20	Não há
It Now Fundo de Índice IMA-B IMAB11	7, III, b	1,91	66.401.431,20	66.933.493,95	D+0	D+0	Não há	0,25	Não há
VCM FIC Renda Fixa 1000 IMA-B	7, III, a	0,01	181.927,01	186.865,70	D+1000	D+1002	Não há	0,20	Não há
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>		<b>8,60</b>	<b>298.151.468,83</b>	<b>308.545.213,80</b>					
BB FIA Bolsa Americana	8, I	0,16	5.573.706,50	5.673.531,34	D+1	D+3	Não há	1,00	20% exc S&P 500
BB FIA Governança	8, I	1,47	50.986.419,52	52.898.422,51	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Consumo	8, I	0,27	9.534.893,46	10.464.910,06	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Exportação	8, I	0,49	17.033.021,79	17.613.723,73	D+1	D+3	Não há	2,00	Não há
BB FIC FIA Seleção Fatorial	8, I	2,25	77.950.799,41	80.281.144,84	D+1	D+3	Não há	1,00	20% exc Ibovespa
BB FIC FIA Siderurgia	8, I	0,16	5.582.096,90	5.947.426,26	D+1	D+3	Não há	1,00	Não há
BB FIC FIA Valor	8, I	0,88	30.657.149,52	31.866.037,64	D+30	D+32	Não há	2,00	20% exc Ibovespa
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	8, I	0,82	28.299.777,41	29.458.202,94	D+21	D+23	Não há	1,72	Não há

ATIVOS	ENQ.	%	OUTUBRO	SETEMBRO
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>		<b>8,60</b>	<b>298.151.468,83</b>	<b>308.545.213,80</b>
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11	8, II	0,49	16.907.518,32 ▼	18.417.970,48
Ishares Fundo de Índice Small Cap SMAL11	8, II	0,26	9.173.780,00	10.008.740,00
Ishares Fundo de Índice S&P 500 IVVB11	8, II	0,75	26.070.876,00	26.609.904,00
Trend ETF LBMA Ouro GOLD11	8, II	0,47	16.355.800,00	15.152.260,00
Trend ETF MSCI Europa	8, II	0,12	4.025.630,00	4.152.940,00
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>		<b>3,49</b>	<b>121.006.407,84</b>	<b>126.644.270,79</b>
BB FIA Nordea Global Climate and Environment IE	9, II	1,49	51.732.931,41	54.482.354,79
BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I	9, III	0,21	7.269.192,01 ▼	8.958.079,85
BB Global Select Equity IE Multimercado	9, II	1,28	44.397.750,39	45.158.926,66
BB Schroder Multimercado IE	9, II	0,51	17.606.534,03	18.044.909,49
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>		<b>1,91</b>	<b>66.109.135,51</b>	<b>67.265.247,66</b>
Caixa Bolsa Americana Multimercado	10, I	1,68	58.160.051,88	59.209.031,29
Caixa FIC Capital Protegido Bolsa de Valores IV Mult.	10, I	0,23	7.949.083,63	8.056.216,37
<b>FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES</b>		<b>0,96</b>	<b>33.241.722,09</b>	<b>43.611.144,30</b>
Austro FIP Multisetorial	-	0,07	2.527.545,92	12.291.457,23
BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11	10, II	0,70	24.262.268,78 ▼	24.863.829,66
FIP LSH Multiestratégia	10, II	0,18	6.347.935,67	6.351.781,67
RJI FIP Puma	10, II	0,00	103.971,72	104.075,74
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>		<b>0,33</b>	<b>11.286.419,67</b>	<b>11.325.862,42</b>
BRB FII SIA Corporate	11	0,30	10.487.219,67	10.510.262,42
Caixa FII Rio Bravo CXRI11	11	0,02	799.200,00 ▼	815.600,00
<b>VALORES MOBILIÁRIOS</b>		<b>0,06</b>	<b>1.919.306,05</b>	<b>1.919.306,05</b>
Ações Cais Mauá do Brasil S.A.	-	0,06	1.919.306,05	1.919.306,05
<b>CONTAS CORRENTES</b>		<b>0,02</b>	<b>807.248,45</b>	<b>600.030,68</b>
Banco do Brasil		0,00	-	-
Banrisul		0,02	807.248,33	600.030,56
BTG Pactual		0,00	-	-
Caixa Econômica Federal		0,00	-	-
XP Investimentos		0,00	0,12	0,12
<b>TOTAL DA CARTEIRA</b>		<b>100,0%</b>	<b>3.468.042.129,24</b>	<b>3.453.506.576,59</b>

▲ Entrada de Recursos   
 ▲ Nova Aplicação   
 ▼ Saída de Recursos   
 ▼ Resgate Total

CONVERSÃO E LIQUIDEZ NO RESGATE	CARÊNCIA	TAXA ADM	TAXA PERFORMANCE
D+0	D+2	Não há	0,10
D+0	D+3	Não há	0,50
D+0	D+0	Não há	0,23
D+0	D+2	Não há	0,00
D+0	D+0	Não há	0,30
D+1	D+5	Não há	0,30
D+0	D+2	Não há	0,85
D+1	D+5	Não há	0,08
D+1	D+5	Não há	0,08
D+0	D+1	Não há	0,80
D+0	D+2	761 dias	0,90
Vide regulamento	Vide regulamento	No vencimento	0,50
D+0	D+2	Não há	1,10
Vide regulamento	Vide regulamento	No vencimento	0,08
No vencimento	No vencimento	No vencimento	0,00
Vide regulamento	Vide regulamento	Não há	0,50
D+0	D+2	Não há	1,20
D+0	D+0	Não há	0,00
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO 4.963



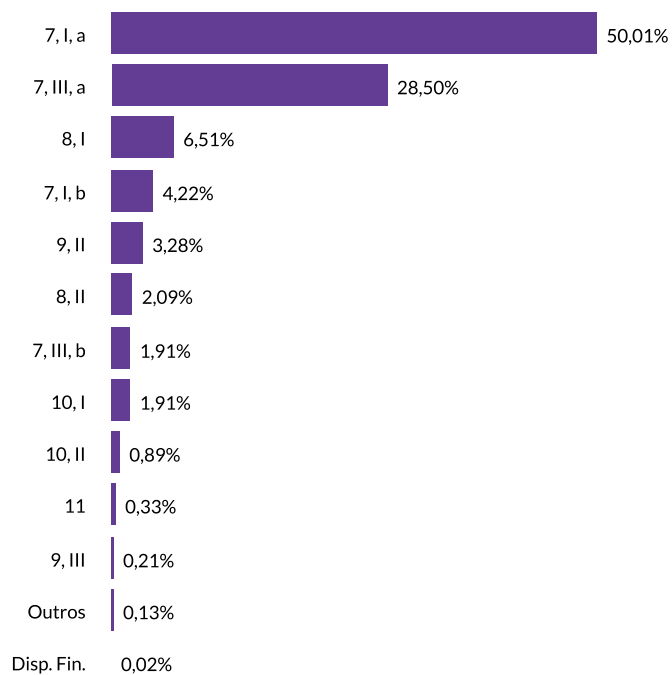
- Art. 7 84,64%
- Art. 8 8,60%
- Art. 9 3,49%
- Art. 10 2,79%
- Sem enquadramento 0,13%
- Art. 11 0,33%
- Conta Corrente 0,02%

POR SEGMENTO

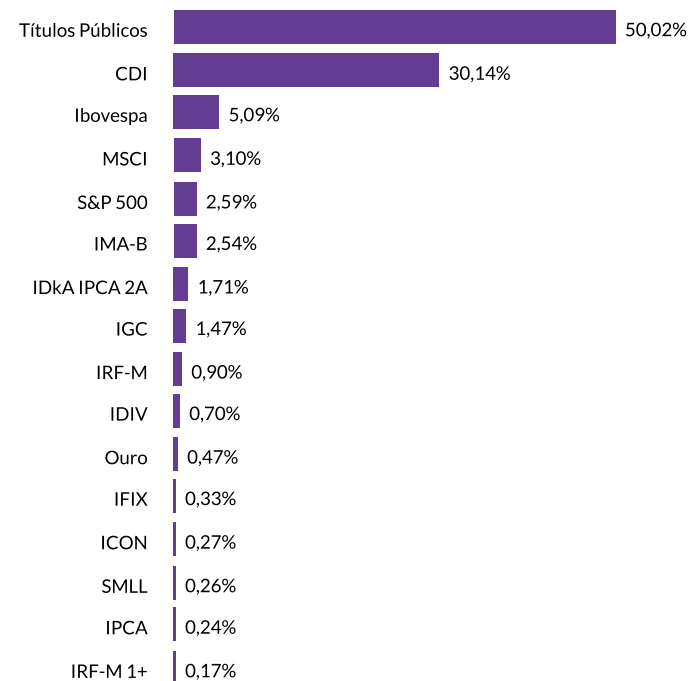


- Títulos Públicos a Mercado 29,36%
- Títulos Públicos na Curva 20,65%
- Fundos de Renda Fixa 34,63%
- Fundos de Renda Variável 8,60%
- Investimentos no Exterior 3,49%
- Fundos Multimercado 1,91%
- Fundos de Participações 0,96%
- Fundos Imobiliários 0,33%
- Valores Mobiliários 0,06%
- Contas Correntes 0,02%

POR TIPO DE ATIVO



POR BENCHMARK



ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO</b>	<b>58.570.342,27</b>	<b>10.781.805,42</b>	<b>11.915.828,60</b>	<b>6.115.692,62</b>	<b>9.914.880,62</b>			<b>97.298.549,53</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 06/12/2022)	1.887.647,05	330.036,71	357.428,40	308.313,00	318.110,51			<b>3.201.535,67</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (i)	1.436.732,68	286.988,43	310.807,31	268.098,27	276.617,82			<b>2.579.244,51</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (ii)	2.155.099,02	430.482,66	466.210,95	402.147,40	414.926,75			<b>3.868.866,78</b>
LFT 01/03/2024 (Compra em 23/01/2023) (iii)	718.366,34	143.494,22	155.403,65	134.049,14	138.308,91			<b>1.289.622,26</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 23/08/2023)	-	-	157.821,17	505.458,44	519.543,00			<b>1.182.822,61</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 28/08/2023)	-	-	80.669,05	505.458,44	519.543,00			<b>1.105.670,49</b>
LFT 01/03/2025 (Compra em 29/08/2023)	-	-	55.801,13	505.458,44	519.543,00			<b>1.080.802,57</b>
LFT 01/03/2026 (Compra em 26/09/2023)	-	-	-	54.051,85	310.286,15			<b>364.338,00</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 01/02/2023)	2.016.252,81	432.256,70	466.169,26	20.298,16	-			<b>2.934.976,93</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 01/09/2022)	5.739.099,45	1.008.598,95	1.087.728,28	47.362,38	-			<b>7.882.789,06</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 03/02/2023)	1.483.370,29	324.192,52	349.626,95	15.223,62	-			<b>2.172.413,38</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 03/08/2022)	1.918.498,96	337.160,22	363.612,03	15.832,56	-			<b>2.635.103,77</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 09/08/2022)	2.557.998,61	449.546,96	484.816,04	21.110,08	-			<b>3.513.471,69</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 12/08/2022)	2.557.998,61	449.546,96	484.816,04	21.110,08	-			<b>3.513.471,69</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 14/11/2022)	2.541.601,18	446.665,25	481.708,24	20.974,77	-			<b>3.490.949,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 16/08/2022)	2.557.998,61	449.546,96	484.816,04	21.110,08	-			<b>3.513.471,69</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 17/10/2022)	2.541.601,18	446.665,25	481.708,24	20.974,77	-			<b>3.490.949,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 20/10/2022)	1.598.749,14	280.966,85	303.010,02	13.193,80	-			<b>2.195.919,81</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 23/08/2022)	2.557.998,61	449.546,96	484.816,04	21.110,08	-			<b>3.513.471,69</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 24/01/2023)	2.133.094,48	432.256,70	466.169,26	20.298,16	-			<b>3.051.818,60</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 25/10/2022)	2.541.601,18	446.665,25	481.708,24	20.974,77	-			<b>3.490.949,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 26/09/2022)	4.919.228,10	864.513,38	932.338,53	40.596,33	-			<b>6.756.676,34</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 26/10/2022)	2.541.601,18	446.665,25	481.708,24	20.974,77	-			<b>3.490.949,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 28/09/2022)	2.541.601,18	446.665,25	481.708,24	20.974,77	-			<b>3.490.949,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 28/10/2022)	2.541.601,18	446.665,25	481.708,24	20.974,77	-			<b>3.490.949,44</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 30/01/2023) (i)	2.055.367,27	432.256,70	466.169,26	20.298,16	-			<b>2.974.091,39</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 30/01/2023) (ii)	2.055.367,27	432.256,70	466.169,26	20.298,16	-			<b>2.974.091,39</b>
LFT 01/09/2023 (Compra em 31/01/2023)	2.036.159,67	432.256,70	466.169,26	20.298,16	-			<b>2.954.883,79</b>
LFT 01/09/2025 (Compra em 04/09/2023)	-	-	-	2.408.454,06	2.764.863,34			<b>5.173.317,40</b>
LFT 01/09/2026 (Compra em 27/09/2023)	-	-	-	499.100,10	4.035.845,61			<b>4.534.945,71</b>
LTN 01/01/2025 (Compra em 24/08/2022)	491.917,97	66.151,77	62.814,08	28.869,00	38.061,43			<b>687.814,25</b>
LTN 01/07/2024 (Compra em 25/08/2022)	443.790,25	69.756,87	72.197,15	52.246,05	59.231,10			<b>697.221,42</b>
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>	<b>33.941.474,05</b>	<b>2.710.357,88</b>	<b>4.174.839,98</b>	<b>4.195.584,10</b>	<b>4.751.388,93</b>			<b>49.773.644,94</b>
LTN 01/01/2023 (Compra em 29/08/2022 Tx 13.7500)	7.871,11	-	-	-	-			<b>7.871,11</b>
LTN 01/01/2024 (Compra em 11/08/2022 Tx 12.9600)	427.141,02	74.908,66	82.920,40	72.858,18	77.263,30			<b>735.091,56</b>

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA</b>	<b>33.941.474,05</b>	<b>2.710.357,88</b>	<b>4.174.839,98</b>	<b>4.195.584,10</b>	<b>4.751.388,93</b>			<b>49.773.644,94</b>
LTN 01/01/2024 (Compra em 26/08/2022 Tx 13.2200)	395.466,41	69.399,32	76.837,23	67.526,45	71.622,58			<b>680.851,99</b>
LTN 01/07/2023 (Compra em 19/08/2022 Tx 13.5950)	473.972,07	3.944,48	-	-	-			<b>477.916,55</b>
NTN-B 15/05/2023 (Compra em 29/07/2022 Tx 7.9900)	1.882.518,27	-	-	-	-			<b>1.882.518,27</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 06/09/2023 Tx 5.6400)	-	-	-	87.533,15	112.038,29			<b>199.571,44</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)	-	-	-	-	42.846,56			<b>42.846,56</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 22/09/2023 Tx 5.5600)	-	-	-	27.555,22	111.147,94			<b>138.703,16</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)	-	-	-	-	36.288,34			<b>36.288,34</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)	-	-	-	-	29.505,82			<b>29.505,82</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 25/09/2023 Tx 5.5280)	-	-	-	21.032,16	110.791,83			<b>131.823,99</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.9502)	961.187,48	76.852,79	119.801,59	113.537,25	117.005,29			<b>1.388.384,40</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 28/08/2023 Tx 5.5850)	-	-	23.015,27	108.297,09	111.430,05			<b>242.742,41</b>
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 30/08/2022 Tx 6.0300)	1.981.905,98	159.583,69	247.847,51	234.762,41	241.957,02			<b>2.866.056,61</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 08/11/2022 Tx 5.6800)	950.777,59	74.144,97	117.111,92	111.264,85	114.521,39			<b>1.367.820,72</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 11/11/2022 Tx 6.0600)	1.932.432,19	156.023,44	241.952,33	229.130,68	236.177,70			<b>2.795.716,34</b>
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 15/08/2022 Tx 5.6510)	1.949.597,81	151.678,15	239.896,28	227.930,40	234.610,84			<b>2.803.713,48</b>
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 18/04/2022 Tx 5.7400)	2.582.683,66	202.788,42	319.263,08	303.094,02	312.083,70			<b>3.719.912,88</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 03/02/2023 Tx 6.6300)	515.359,25	56.525,86	84.235,33	78.405,34	80.970,42			<b>815.496,20</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 06/02/2023 Tx 6.7400)	513.288,65	57.361,09	85.131,28	79.178,79	81.800,27			<b>816.760,08</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 10/08/2022 Tx 6.1600)	999.140,16	82.534,21	125.392,04	117.109,39	120.740,55			<b>1.444.916,35</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 13/12/2022 Tx 6.7160)	1.003.385,07	86.922,41	129.093,27	120.107,84	124.043,70			<b>1.463.552,29</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/08/2023 Tx 6.6110)	-	-	63.962,67	117.412,30	121.227,61			<b>302.602,58</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/12/2022 Tx 6.9300)	1.014.709,19	89.383,11	131.740,59	122.382,55	126.489,46			<b>1.484.704,90</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 18/08/2022 Tx 6.4750)	2.033.156,73	172.660,94	258.856,47	241.208,45	248.964,87			<b>2.954.847,46</b>
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4400)	805.999,79	83.693,69	125.681,28	117.129,93	120.890,71			<b>1.253.395,40</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 05/10/2022 Tx 5.7350)	949.254,90	75.686,78	117.301,87	109.932,21	113.188,12			<b>1.365.363,88</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)	-	-	-	-	9.127,35			<b>9.127,35</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 28/09/2023 Tx 5.5750)	-	-	-	6.328,49	117.481,17			<b>123.809,66</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/01/2023 Tx 6.1400)	472.359,04	48.369,66	73.567,65	68.733,14	70.855,50			<b>733.884,99</b>
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)	-	-	-	-	-			<b>-</b>
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 16/09/2022 Tx 5.8930)	959.142,52	77.757,01	119.617,12	111.963,53	115.338,46			<b>1.383.818,64</b>
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/10/2022 Tx 5.7500)	962.376,45	76.664,18	118.749,51	111.317,33	114.599,03			<b>1.383.706,50</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 06/07/2022 Tx 6.1360)	1.952.894,69	162.222,37	246.659,48	230.387,52	237.534,49			<b>2.829.698,55</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 08/06/2022 Tx 5.9000)	4.011.349,61	321.866,83	495.024,95	463.350,30	477.382,62			<b>5.768.974,31</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 12/07/2022 Tx 6.3520)	1.906.266,02	163.257,69	245.856,52	229.179,68	236.448,85			<b>2.781.008,76</b>
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/06/2022 Tx 5.9650)	2.297.238,39	186.128,13	285.324,34	266.935,45	275.015,10			<b>3.310.641,41</b>

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>	<b>75.301.185,91</b>	<b>12.817.804,94</b>	<b>12.353.241,40</b>	<b>14.055.351,25</b>	<b>8.839.507,19</b>			<b>123.367.090,69</b>
Austro FIC Ativo Renda Fixa IMA-B	(520.570,95)	(91.151,44)	(76.281,15)	(84.016,07)	(1.065.111,11)			<b>(1.837.130,72)</b>
Banrisul Absoluto	9.267.075,33	1.955.364,49	2.426.800,25	807.730,12	796.829,59			<b>15.253.799,78</b>
Banrisul Foco IDKA 2	387.628,66	-	-	-	-			<b>387.628,66</b>
Banrisul Previdência IPCA 2024	111.401,47	9.430,00	14.163,52	13.730,00	13.460,00			<b>162.184,99</b>
Banrisul Soberano	-	-	-	5.552,51	-			<b>5.552,51</b>
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	9.756.281,03	-	-	-	-			<b>9.756.281,03</b>
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	27.913.560,00	6.905.428,97	7.600.966,90	11.788.922,97	7.929.175,14			<b>62.138.053,98</b>
BB FIC Previdenciário Fluxo	2.281,97	-	103,02	-	-			<b>2.384,99</b>
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	296,04	-	-	-	-			<b>296,04</b>
BB Previdenciário Crédito Privado IPCA III	912.905,45	-	-	-	-			<b>912.905,45</b>
BB Previdenciário IRF-M 1+	592.009,13	47.547,56	32.395,07	(11.767,60)	4.375,55			<b>664.559,71</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos IDkA 2	3.603.510,92	551.994,77	436.658,96	125.974,61	(196.629,50)			<b>4.521.509,76</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	2.631.854,82	237.807,12	222.618,85	43.235,76	109.541,83			<b>3.245.058,38</b>
BB Previdenciário Títulos Públicos X	414.014,07	82.057,67	70.092,68	84.423,35	33.751,05			<b>684.338,82</b>
BRB Renda Fixa 2023	587.760,24	-	-	-	-			<b>587.760,24</b>
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	12.312.392,94	1.903.198,55	2.043.724,44	1.730.362,50	1.704.093,96			<b>19.693.772,39</b>
Caixa Brasil Referenciado	1.924,79	-	-	-	-			<b>1.924,79</b>
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	97.848,83	19.396,81	16.624,04	20.021,27	8.038,28			<b>161.929,23</b>
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 IV	474.676,26	94.077,40	80.616,85	97.056,90	38.983,84			<b>785.411,25</b>
It Now Fundo de Índice IMA-B IMAB11	6.774.932,35	1.106.690,52	(510.780,24)	(560.439,43)	(532.062,75)			<b>6.278.340,45</b>
VCM FIC Renda Fixa 1000 IMA-B	(20.597,44)	(4.037,48)	(4.461,79)	(5.435,64)	(4.938,69)			<b>(39.471,04)</b>
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>19.087.888,72</b>	<b>10.405.412,13</b>	<b>(12.490.689,10)</b>	<b>(1.418.708,89)</b>	<b>(9.385.243,69)</b>			<b>6.198.659,17</b>
BB FIA Bolsa Americana	816.564,91	190.659,70	(44.678,80)	(277.957,53)	(99.824,84)			<b>584.763,44</b>
BB FIA Governança	3.268.247,74	1.842.120,47	(2.875.216,31)	472.981,90	(1.912.002,99)			<b>796.130,81</b>
BB FIC FIA Consumo	848.758,68	248.663,90	(1.271.896,17)	(443.608,94)	(930.016,60)			<b>(1.548.099,13)</b>
BB FIC FIA Exportação	364.843,25	1.204.889,42	(571.770,47)	294.591,62	(580.701,94)			<b>711.851,88</b>
BB FIC FIA Seleção Fatorial	3.972.474,55	2.646.680,08	(3.589.470,64)	375.871,84	(2.330.345,43)			<b>1.075.210,40</b>
BB FIC FIA Siderurgia	(331.332,44)	526.514,97	(415.666,08)	(67.269,13)	(365.329,36)			<b>(653.082,04)</b>
BB FIC FIA Valor	1.268.157,90	1.243.039,25	(1.962.085,29)	82.343,25	(1.208.888,12)			<b>(577.433,01)</b>
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	2.064.809,89	1.040.650,68	(1.594.769,81)	21.984,88	(1.158.425,53)			<b>374.250,11</b>
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11	1.351.639,71	426.955,73	(684.707,53)	30.823,22	(501.950,88)			<b>622.760,25</b>
Ishares Fundo de Índice S&P 500 IVVB11	1.722.600,00	519.014,98	839.232,00	(1.004.400,00)	(539.028,00)			<b>1.537.418,98</b>
Ishares Fundo de Índice Small Cap SMAL11	1.769.765,53	264.503,27	(760.480,00)	(302.820,00)	(834.960,00)			<b>136.008,80</b>
It Now Fundo de Índice Dividendos DIVO11	1.696.339,00	(64.372,58)	-	-	-			<b>1.631.966,42</b>
It Now Fundo de Índice Ibovespa BOVV11	830.760,00	104.722,26	-	-	-			<b>935.482,26</b>

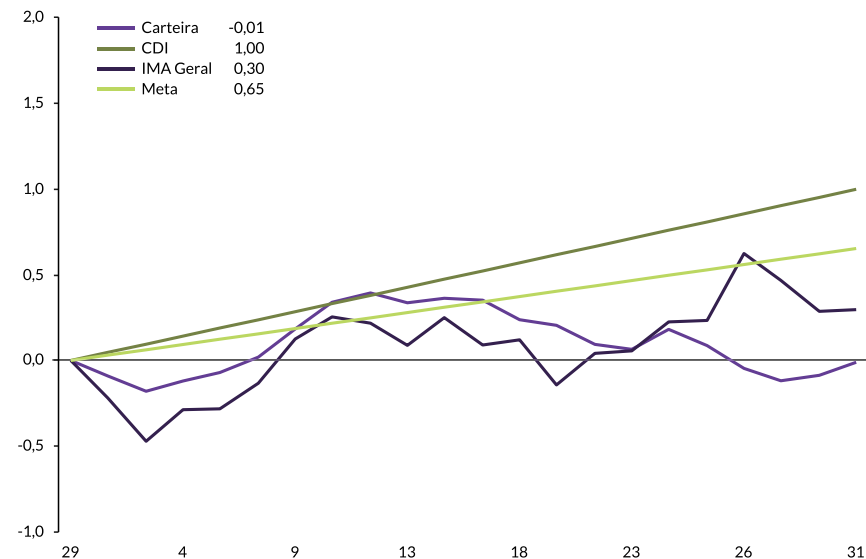


ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>19.087.888,72</b>	<b>10.405.412,13</b>	<b>(12.490.689,10)</b>	<b>(1.418.708,89)</b>	<b>(9.385.243,69)</b>			<b>6.198.659,17</b>
Trend ETF LBMA Ouro GOLD11	(617.200,00)	154.300,00	432.040,00	(478.330,00)	1.203.540,00			<b>694.350,00</b>
Trend ETF MSCI Europa	61.460,00	57.070,00	8.780,00	(122.920,00)	(127.310,00)			<b>(122.920,00)</b>
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>3.009.329,56</b>	<b>2.172.206,70</b>	<b>1.202.957,40</b>	<b>(3.350.085,13)</b>	<b>(4.199.377,27)</b>			<b>(1.164.968,74)</b>
BB FIA Nordea Global Climate and Environment IE	(1.047.990,67)	462.865,16	77.721,33	(1.736.024,54)	(2.749.423,38)			<b>(4.992.852,10)</b>
BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I	1.924.391,48	480.150,65	(551.751,67)	(402.342,80)	(250.402,16)			<b>1.200.045,50</b>
BB Global Select Equity IE Multimercado	1.808.441,48	897.860,09	1.177.965,65	(852.183,26)	(761.176,27)			<b>2.270.907,69</b>
BB Schroder Multimercado IE	324.487,27	331.330,80	499.022,09	(359.534,53)	(438.375,46)			<b>356.930,17</b>
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>	<b>10.576.193,77</b>	<b>2.373.127,10</b>	<b>(847.191,98)</b>	<b>(2.747.462,24)</b>	<b>(1.156.112,15)</b>			<b>8.198.554,50</b>
Caixa Bolsa Americana Multimercado	10.129.968,06	2.196.837,63	(573.413,28)	(2.763.093,71)	(1.048.979,41)			<b>7.941.319,29</b>
Caixa FIC Capital Protegido Bolsa de Valores IV Mult.	446.225,71	176.289,47	(273.778,70)	15.631,47	(107.132,74)			<b>257.235,21</b>
<b>FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES</b>	<b>4.366.953,92</b>	<b>2.276.283,00</b>	<b>460.222,61</b>	<b>777.563,05</b>	<b>(8.947.925,61)</b>			<b>(1.066.903,03)</b>
Austro FIP Multisetorial	(107.278,00)	(17.266,37)	(18.863,61)	(16.406,00)	(9.763.911,31)			<b>(9.923.725,29)</b>
BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11	4.499.914,10	2.297.499,14	483.046,80	797.912,08	819.935,72			<b>8.898.307,84</b>
FIP LSH Multiestratégia	(25.063,93)	(3.845,42)	(3.846,42)	(3.843,86)	(3.846,00)			<b>(40.445,63)</b>
RJI FIP Puma	(618,25)	(104,35)	(114,16)	(99,17)	(104,02)			<b>(1.039,95)</b>
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>125.347,27</b>	<b>593,90</b>	<b>19.624,20</b>	<b>(41.473,35)</b>	<b>(33.642,75)</b>			<b>70.449,27</b>
BRB FII SIA Corporate	(65.052,73)	(19.406,10)	(25.275,80)	(22.773,35)	(23.042,75)			<b>(155.550,73)</b>
Caixa FII Rio Bravo CXRI11	190.400,00	20.000,00	44.900,00	(18.700,00)	(10.600,00)			<b>226.000,00</b>
<b>VALORES MOBILIÁRIOS</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>			<b>-</b>
Ações Cais Mauá do Brasil S.A.	-	-	-	-	-			<b>-</b>
<b>TOTAL</b>	<b>204.978.715,47</b>	<b>43.537.591,07</b>	<b>16.788.833,11</b>	<b>17.586.461,41</b>	<b>(216.524,73)</b>			<b>282.675.076,33</b>

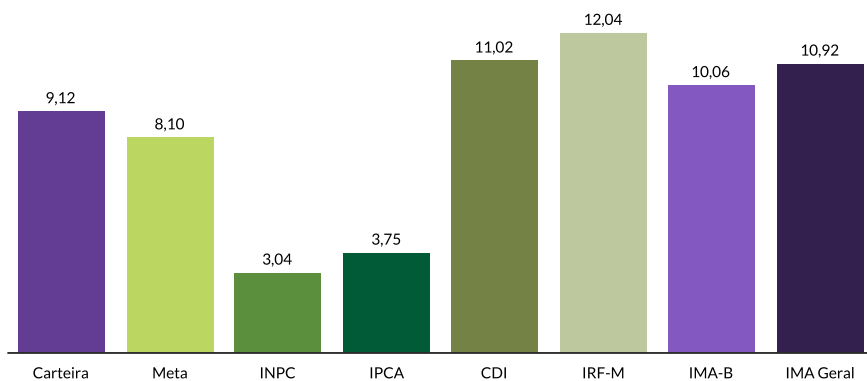
## RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META DE RENTABILIDADE (IPCA + 5.05%)

MÊS	CARTEIRA	META	CDI	IMA-G	% META	% CDI	% IMA-G
Janeiro	1,50	0,94	1,12	0,70	159	133	214
Fevereiro	0,09	1,25	0,92	1,03	7	10	9
Março	0,94	1,12	1,17	1,86	83	80	50
Abril	0,90	1,02	0,92	1,25	88	98	72
Maió	1,38	0,64	1,12	1,77	215	123	78
Junho	1,67	0,33	1,07	1,74	505	156	96
Julho	1,31	0,53	1,07	0,98	246	122	133
Agosto	0,49	0,64	1,14	0,63	77	43	78
Setembro	0,51	0,67	0,97	0,18	76	53	287
Outubro	(0,01)	0,65	1,00	0,30	-2	-1	-4
Novembro							
Dezembro							
<b>TOTAL</b>	<b>9,12</b>	<b>8,10</b>	<b>11,02</b>	<b>10,92</b>	<b>113</b>	<b>83</b>	<b>84</b>

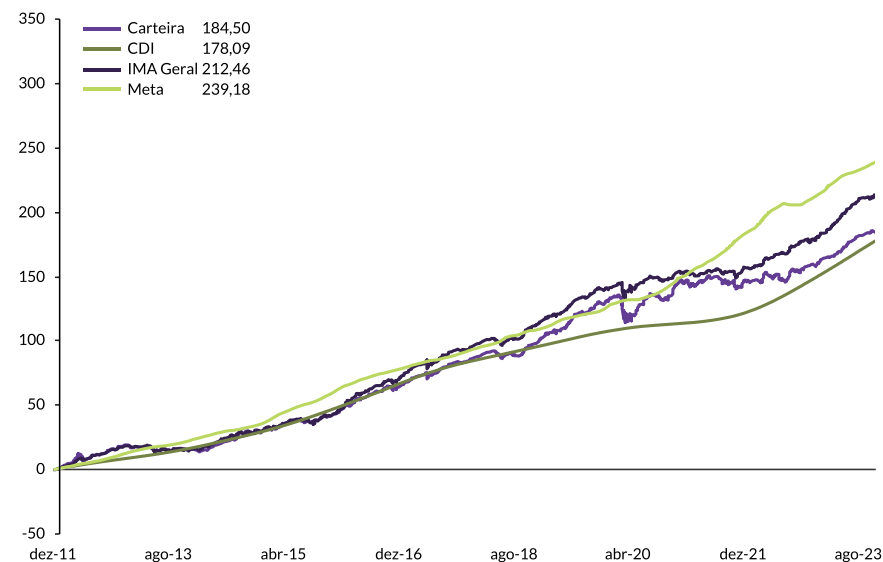
## RENTABILIDADE ACUMULADA NO MÊS



## CARTEIRA x INDICADORES 2023



## RENTABILIDADE ACUMULADA DESDE DEZEMBRO DE 2011



## ENTRADAS

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
16/10/2023	7.900.000,00	Aplicação	Banrisul Absoluto
20/10/2023	16.973.295,16	Aplicação	NTN-B 15/05/2025 (Compra em 20/10/2023 Tx 6.3025)
23/10/2023	16.975.464,80	Aplicação	NTN-B 15/05/2025 (Compra em 23/10/2023 Tx 6.3215)
24/10/2023	16.994.149,69	Aplicação	NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/10/2023 Tx 6.2700)
27/10/2023	16.855.425,31	Aplicação	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2023 Tx 5.9120)
31/10/2023	15.761.286,80	Aplicação	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 31/10/2023 Tx 6.0400)
31/10/2023	5.800,00	Aplicação	Caixa Brasil Matriz Renda Fixa
31/10/2023	1.438.485,68	Aplicação	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa

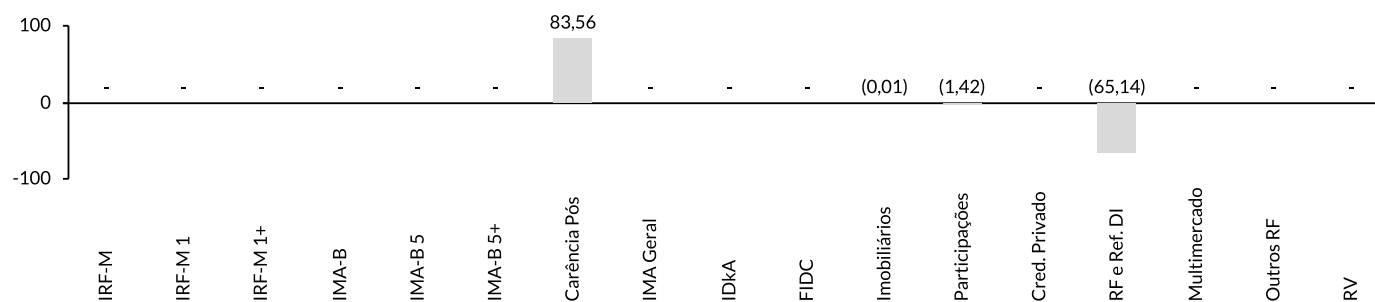
## SAÍDAS

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
03/10/2023	497.925,93	Resgate	Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11
11/10/2023	510.575,35	Resgate	Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11
11/10/2023	5.800,00	Proventos	Caixa FII Rio Bravo CXRI11
20/10/2023	16.423.295,16	Resgate	Banrisul Absoluto
23/10/2023	16.975.464,80	Resgate	Banrisul Absoluto
24/10/2023	16.994.149,69	Resgate	Banrisul Absoluto
26/10/2023	1.421.496,60	Dividendos	BTG Pactual FIP Infraestrutura Dividendos BDIV11
27/10/2023	1.438.485,68	Resgate	BB FIC FIA Bolsas Europeias BDR ETF Nível I
27/10/2023	14.455.425,31	Resgate	Banrisul Absoluto
31/10/2023	9.636.429,31	Resgate	Banrisul Absoluto

## TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	92.903.907,44
Resgates	78.359.047,83
Saldo	14.544.859,61

## MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS POR ÍNDICES (DURANTE O MÊS, EM R\$ MILHÕES)



Esta comparação tem o objetivo de verificar a rentabilidade obtida nos investimentos realizados no Instituto de Previdência do Estado do Rio Grande do Sul – IPE Prev ante o resultado auferido por outros Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS. A intenção é provocar-nos a avaliar alternativas de métodos e práticas, ainda que sempre se respeitando as idiossincrasias de cada instituição previdenciária.

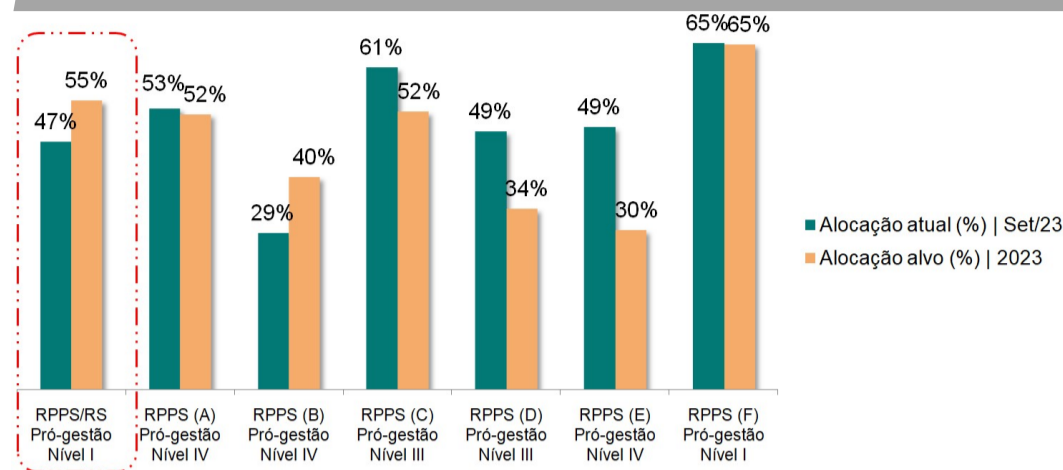
Importante destacar que particularidade nos passivos atuariais, bem como o volume dos fundos previdenciários, entre outras peculiaridades, fazem efeito nas possibilidades de alocação dos recursos e, portanto, no resultado possível. Assim sendo, não deve ser entendido como uma análise comparativa, mas como ferramenta de *benchmarking*.

Outrossim, considerando que os relatórios mensais de investimentos dos RPPS são publicizados em datas heterogêneas e com a pretensão de não comprometer a coleta de dados, este comparativo terá como premissa verificar os resultados auferidos no mês imediatamente anterior ao mês de referência deste relatório.

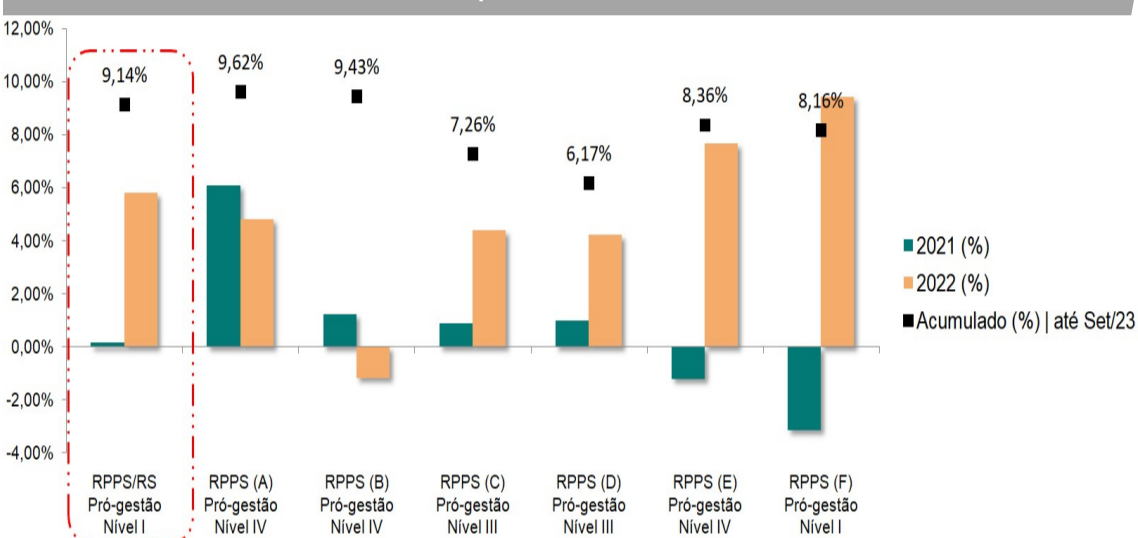
## Características dos RPPS

RPPS	Modelo de Gestão	Nível Pró-Gestão	Meta atuarial   2023	PL (em bilhões   R\$)   Set/23
RPPS/RS	Própria	I	IPCA + 5,05% a.a.	4,626
RPPS (A)	Própria	IV	IPCA + 4,86% a.a.	2,518
RPPS (B)	Própria	IV	IPCA + 4,94% a.a.	1,482
RPPS (C)	Própria	III	IPCA + 5,10% a.a.	3,096
RPPS (D)	Própria	III	IPCA + 5,12% a.a.	7,756
RPPS (E)	Própria	IV	INPC + 4,97% a.a.	4,692
RPPS (F)	Própria	I	IPCA + 4,80% a.a.	3,996

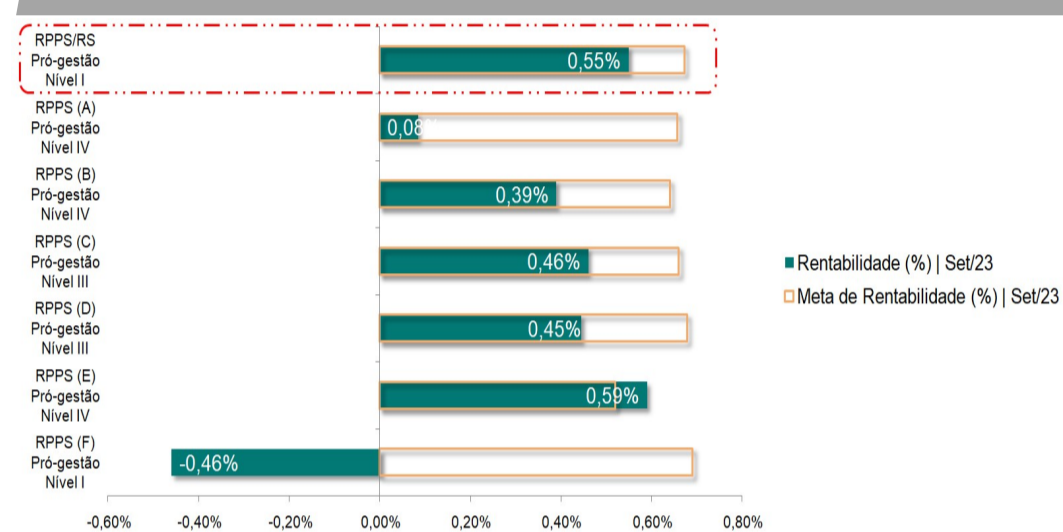
## Representatividade de Títulos Públicos Federais em Carteira | Set/23



## Rentabilidade anual | 2021-2022 e acumulado de 2023



## Rentabilidade mensal | Set/23





**DIRETORIA EXECUTIVA**  
**Comitês de Investimentos do Fundoprev**

---

**PARECER SOBRE RELATÓRIO MENSAL**

Os Comitês de Investimentos do Fundoprev aprovam, na reunião ordinária de 21/11/2023, o Relatório de Investimentos do mês de outubro/2023, que segue em anexo.

Desta forma, encaminhe-se o Relatório de Investimentos aprovado para conhecimento e deliberação do Conselho Fiscal, conforme competência atribuída ao órgão colegiado pelo inciso III do art. 18 da Lei Complementar Estadual nº 15.143/2018, inciso IV do art. 2º do Decreto Estadual nº 57.099/2023, bem como pelo no Manual Pró-Gestão RPPS 3.1, no nível I do item 3.2.6.

Porto Alegre, 21 de novembro de 2023.

**GUSTAVO MAGALHÃES RORIZ**  
Vice-Presidente dos Comitês de Investimentos



**CONSELHO FISCAL- IPE Prev**  
**R E S O L U Ç Ã O CF-IPE Prev Nº. 01/2024**

**O CONSELHO FISCAL DO IPE Prev**, no uso da competência que lhe é conferida, pelo art. 18, inciso I a VI, da Lei Complementar Estadual nº 15.143, de 5 de abril de 2018, reunido em sessão ordinária realizada nesta data,

**R E S O L V E:**

**APROVAR**, à unanimidade dos Conselheiros presentes à sessão ordinária, o parecer e voto do Conselheiro Sandro Loureiro Marones, no Processo nº 23/1440-0018881-0, Processo nº 23/1440-0021171-4 e Processo nº 24/1440-0000964-3, Ata CF-IPE Prev nº 03/2024, que opinou pela aprovação do Relatório Gerencial do FUNDOPREV, competência de outubro, novembro e dezembro/2023.

Porto Alegre, 14 de março de 2024.

**Rodrigo de Castro Silveira**  
Presidente





23144000188810

**Nome do documento:** Resolucao CF 01 2024 Relatorio FUNDOPREV.docx

**Documento assinado por**

**Órgão/Grupo/Matrícula**

**Data**

Rodrigo Castro Silveira

IPEPREV / IPECON.FIS / 2864711

25/03/2024 15:02:56

