

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

RELATÓRIO MENSAL

Setembro/2023



ipremb.mg.gov.br



31 3595-7828
31 3594-5380



Praça José Lino da Silva, 114
Brasília | Betim MG | 32600-308



1. INTRODUÇÃO

A Divisão de Investimentos e Financeiro do IPREMB apresenta o relatório mensal da carteira de investimentos dos recursos deste RPPS correspondente ao posicionamento das aplicações no mês de Setembro/2023.

Em consonância com as legislações vigentes que regem as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, o presente relatório demonstra o resultado detalhado e a adequação das aplicações financeiras do IPREMB às essas normas, quais sejam:

- Resolução do Conselho Monetário Nacional - CMN nº 4.963/2021.
- Portaria da Secretaria de Previdência Social nº 1.467/2022.
- Política de Investimento do IPREMB.

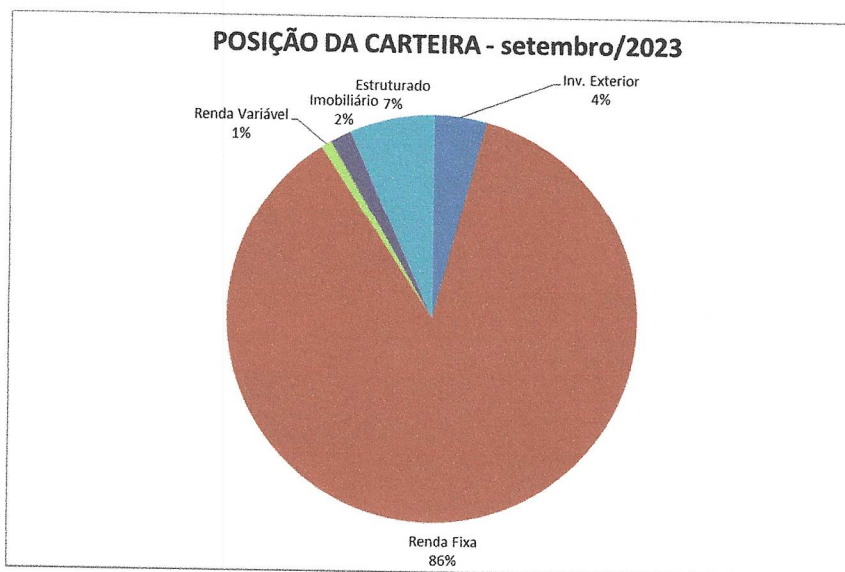


2. POSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

SETEMBRO 2023	
VALOR APLICADO	R\$ 1.509.004.771,60
VALOR EM CONTA	R\$ 10.024.574,72
TOTAL:	R\$ 1.519.029.346,32

2.1 POR TIPO DE INVESTIMENTO

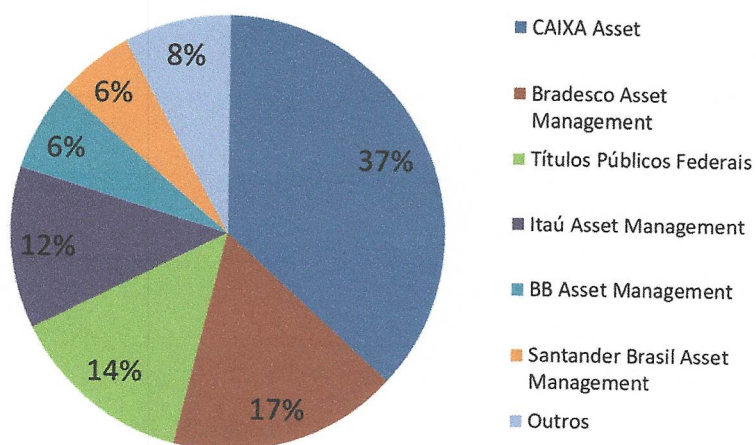
Investimento	Valor	%
Inv. Exterior	62.741.036,85	4,16%
Renda Fixa	1.307.435.820,77	86,64%
Renda Variável	12.943.265,47	0,86%
Imobiliário	25.309.021,23	1,68%
Estruturado	100.575.627,27	6,67%
Total Geral	1.509.004.771,60	100,00%



2.2 POSIÇÃO POR INSTITUIÇÕES

Gestor	Valor	%
CAIXA Asset	554.898.415,64	36,77%
Bradesco Asset Management	258.868.358,90	17,15%
Títulos Públicos Federais	208.438.707,77	13,81%
Itaú Asset Management	182.543.723,25	12,10%
BB Asset Management	99.704.519,87	6,61%
Santander Brasil Asset Management	86.511.461,06	5,73%
Outros	120.304.017,93	7,97%
Total Geral	1.511.269.204,42	100,15%

Distribuição da carteira por gestor



3. RENTABILIDADE TOTAL POR GESTOR

GESTOR	TOTAL POR GESTOR	RENTABILIDADE	RENTABILIDADE (%)
CAIXA Asset	R\$ 554.898.415,64	R\$ 2.383.064,79	0,43%
Inv. Exterior	R\$ 44.955.631,35	-R\$ 1.666.694,68	-3,71%
Renda Fixa	R\$ 423.120.290,28	R\$ 3.548.394,37	0,84%
Renda Variável	R\$ 8.833.104,01	R\$ 385.983,58	4,37%
Imobiliário	R\$ 6.524.800,00	-R\$ 195.200,00	-2,99%
Estruturado	R\$ 71.464.590,00	R\$ 310.581,52	0,43%
Bradesco Asset Management	R\$ 258.868.358,90	R\$ 1.107.438,17	0,43%
Renda Fixa	R\$ 255.527.044,59	R\$ 1.191.055,48	0,47%
Renda Variável	R\$ 1.981.687,08	-R\$ 19.228,68	-0,97%
Estruturado	R\$ 1.359.627,22	-R\$ 64.388,63	-4,74%
Títulos Públicos Federais	R\$ 208.438.707,77	R\$ 1.405.724,69	0,67%
Renda Fixa	R\$ 208.438.707,77	R\$ 1.405.724,69	0,67%
Itaú Asset Management	R\$ 182.543.723,25	-R\$ 256.539,42	-0,14%
Renda Fixa	R\$ 181.086.480,16	-R\$ 253.578,04	-0,14%
Renda Variável	R\$ 1.457.243,09	-R\$ 2.961,38	-0,20%
BB Asset Management	R\$ 99.704.519,87	R\$ 6.792.424,57	6,81%
Inv. Exterior	R\$ 17.785.405,50	-R\$ 635.157,99	-3,57%
Renda Fixa	R\$ 81.919.114,37	R\$ 7.427.582,57	9,07%
Santander Brasil Asset Management	R\$ 86.511.461,06	R\$ 449.054,12	0,52%
Renda Fixa	R\$ 85.840.229,77	R\$ 447.222,82	0,52%
Renda Variável	R\$ 671.231,29	R\$ 1.831,30	0,27%
Sicredi	R\$ 60.117.471,38	R\$ 117.471,38	0,20%
Renda Fixa	R\$ 60.117.471,38	R\$ 117.471,38	0,20%
Queluz Asset Management	R\$ 38.588.053,91	-R\$ 41.174,87	-0,11%
Imobiliário	R\$ 8.724.492,25	-R\$ 11.792,97	-0,14%
Estruturado	R\$ 29.863.561,67	-R\$ 29.381,90	-0,10%
Graphen Investimentos	R\$ 11.258.891,70	-R\$ 30.815,01	-0,27%
Renda Fixa	R\$ 11.258.891,70	-R\$ 30.815,01	-0,27%
Macam Asset	R\$ 6.771.680,29	-R\$ 4.901,75	-0,07%
Imobiliário	R\$ 6.771.680,29	-R\$ 4.901,75	-0,07%
Veritas Capital Management	R\$ 2.638.438,77	R\$ 589,22	0,02%
Imobiliário	R\$ 2.638.438,77	R\$ 589,22	0,02%
RB Capital Asset Management	R\$ 649.609,92	R\$ 16.419,84	2,53%
Imobiliário	R\$ 649.609,92	R\$ 16.419,84	2,53%
BTG Pactual Gestora de Recursos	R\$ 152.281,20	-R\$ 3.522,43	-2,31%
Estruturado	R\$ 152.281,20	-R\$ 3.522,43	-2,31%
Genial Banco	R\$ 127.590,74	R\$ 119.639,24	93,77%
Renda Fixa	R\$ 127.590,74	R\$ 119.639,24	93,77%
Arena Capital	-R\$ 2.264.432,82	R\$ 5.535.744,63	0,38%



4. ENQUADRAMENTO DAS APLICAÇÕES: POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023

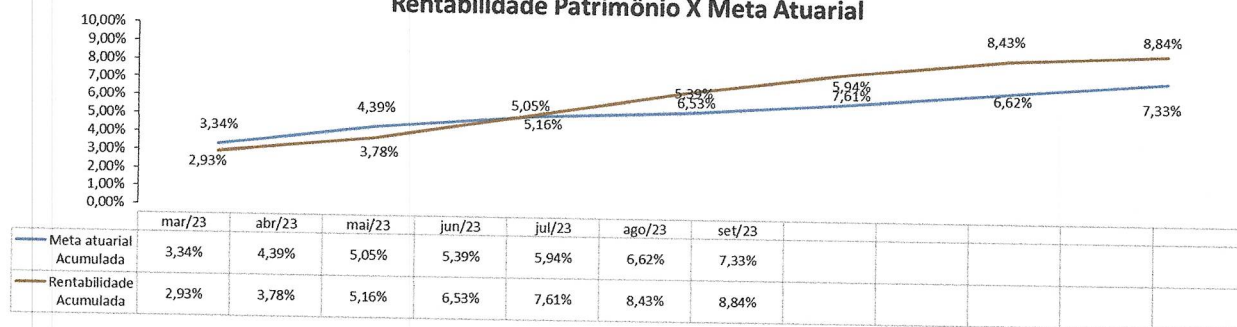
Lig.	Descrição	Limite Resolução CMN	Limite Política de Investimento	Posição carteira do IPREMB em setembro/2023
Renda fixa		100%	100%	86,64%
7º I A	Títulos Públicos - Art. 7º, I, a	100%	100%	13,81%
7º I B	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b	100%	100%	28,23%
7º I C	Fundos de índices carteira 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c	100%	100%	-
7º II	Operações compromissadas - Art. 7º, II	5%	5%	-
7º III A	Fundos referenciados em indicadores RF* - Art. 7º, III, a	60%	60%	42,65%
7º III B	Fundos de índices (ETF) em indicadores títulos - Art. 7º, III, b	60%	60%	-
7º III A	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	60%	60%	42,65%
7º III B	FI Renda Fixa (ETF) - quaisquer indicadores - Art. 7º, IV, b	60%	60%	-
7º IV	Letra Imobiliária Garantida - LIIG - Art. 7º, V, b	20%	20%	-
7º IV	CDB nos limites garantidos pelo FGC - Art. 7º, VI, a	15%	15%	-
26	Poupança nos limites garantidos pelo FGC - Art. 7º, VI, b	15%	15%	-
7º V A	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a	5%	5%	0,75%
7º V B	FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, b	5%	5%	1,19%
7º V C	FI Renda Fixa de debêntures de infraestrutura - Art. 7º, VII, c	5%	5%	-
Renda variável		30%	30%	0,86%
8º I	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, a	30%	30%	0,86%
8º II	ETF de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, b	30%	30%	-
8º I	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	30%	30%	0,86%
8º II	ETF de Ações - Geral - Art. 8º, II, b	30%	30%	-
Estruturado		10%	10%	6,67%
10 I	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	10%	10%	6,30%
10 II	FI em Participações - Art. 8º, IV, a	5%	5%	0,37%
10 III	FI Ações - Mercado de Acesso	5%	5%	-
Imobiliário		30%	30%	1,68%
11	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, b	5%	5%	1,20%
Inv. exterior		10%	10%	4,16%
9º I	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	10%	10%	-
9º II	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	10%	10%	-
9º III	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	10%	10%	4,16%
Empréstimos Consignados		5%	10%	0,00%
12 I	Empréstimos Consignados - Art. 12, I	5%	5%	
12 II	Empréstimos Consignados - Art. 12, II	10%		
				100,00%



5. QUADRO COMPARATIVO: META ATUARIAL

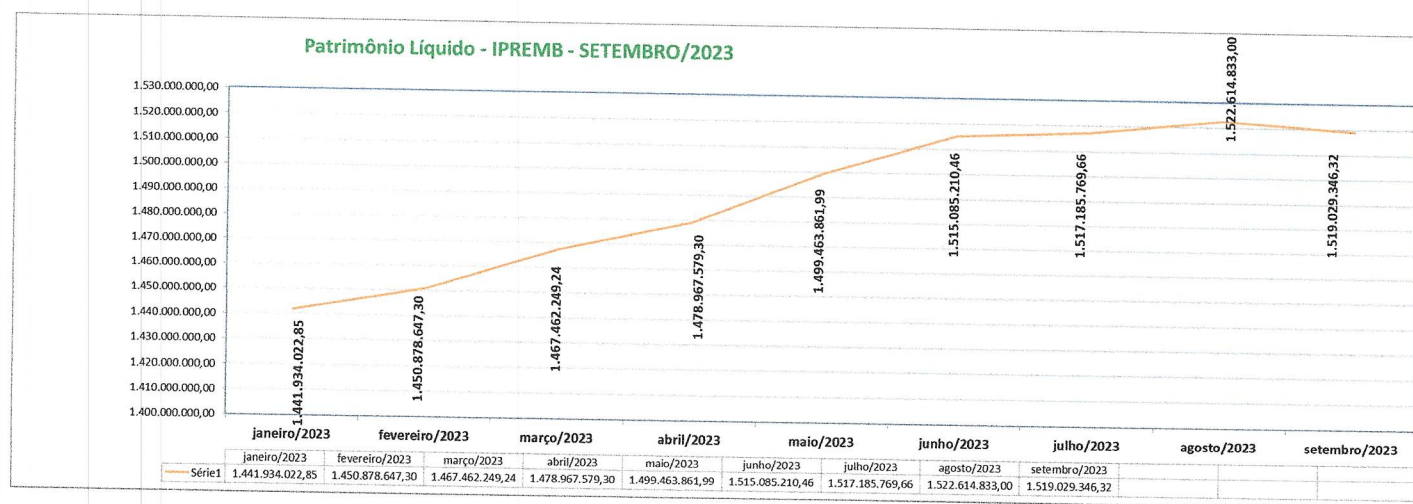
	IPCA (%)	Meta atuarial (%)	Rentabilidade média da carteira (%)	% atingido da meta	Meta atuarial Acumulada	Rentabilidade Acumulada	Patrimônio Líquido (R\$)	Evolução Patrimonial (%)
jan/23	0,53%	0,94%	0,91%	-3,08%	0,94%	0,91%	R\$ 1.441.934.022,85	0,00%
fev/23	0,84%	1,25%	0,69%	-44,95%	2,20%	1,60%	R\$ 1.450.878.647,30	0,62%
mar/23	0,71%	1,12%	1,31%	17,49%	3,34%	2,93%	R\$ 1.467.462.249,24	1,77%
abr/23	0,61%	1,02%	0,82%	-19,35%	4,39%	3,78%	R\$ 1.478.967.579,30	2,57%
mai/23	0,23%	0,64%	1,33%	109,80%	5,05%	5,16%	R\$ 1.499.463.861,99	3,99%
jun/23	-0,08%	0,32%	1,30%	301,36%	5,39%	6,53%	R\$ 1.515.085.210,46	5,07%
jul/23	0,12%	0,52%	1,02%	94,20%	5,94%	7,61%	R\$ 1.517.185.769,66	5,22%
ago/23	0,23%	0,64%	0,76%	20,12%	6,62%	8,43%	R\$ 1.522.614.833,00	5,60%
set/23	0,26%	0,67%	0,38%	-43,11%	7,33%	8,84%	R\$ 1.519.029.346,32	5,35%

Rentabilidade Patrimônio X Meta Atuarial



6. PATRIMÔNIO LÍQUIDO

Patrimônio líquido - 2023		Evolução Patrimonial
janeiro/2023	1.441.934.022,85	0,0000%
fevereiro/2023	1.450.878.647,30	0,6203%
março/2023	1.467.462.249,24	1,7704%
abril/2023	1.478.967.579,30	2,5683%
maio/2023	1.499.463.861,99	3,9898%
junho/2023	1.515.085.210,46	5,0731%
julho/2023	1.517.185.769,66	5,2188%
agosto/2023	1.522.614.833,00	5,5953%
setembro/2023	1.519.029.346,32	5,3467%



7. RANKING DOS FUNDOS

RANKING DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - setembro/2023					
META ATUARIAL NO MÊS: 0,67%					
META ATUARIAL NO ANO: 7,33%					
Gestão	Fundo	% Mês	% Meta	Fundo	
Genial Banco	MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1504,61%	226163,86%	119.639,24	
CAIXA Asset	CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	4,57%	686,85%	385.983,58	
RB Capital Asset Management	RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	2,59%	389,79%	16.419,84	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,21%	182,59%	56.960,03	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,21%	181,73%	0,00	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	164,73%	354.690,00	
BB Asset Management	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	164,54%	153.991,45	
Bradesco Asset Management	BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	157,74%	1.451.452,24	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03%	154,26%	720.586,35	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03%	154,26%	83.996,81	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03%	154,26%	3.351,07	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02%	153,31%	220.731,75	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	153,09%	525,51	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	153,09%	199.739,54	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	153,09%	1.609.148,40	
Itaú Asset Management	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,97%	146,55%	497,09	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,97%	145,50%	155.184,58	
BB Asset Management	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	143,25%	160.908,76	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	0,92%	138,23%	55.094,09	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	136,67%	126.478,62	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	136,67%	152.170,88	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	136,67%	79.478,50	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	136,67%	2.894,96	
BB Asset Management	BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	134,69%	6.805.400,00	
BB Asset Management	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	132,03%	243.599,11	
CAIXA Asset	CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,86%	128,64%	93.226,66	
CAIXA Asset	CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,86%	128,64%	93.226,66	
BB Asset Management	BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,56%	84,19%	63.683,25	
Itaú Asset Management	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,42%	62,83%	346.253,45	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	60,70%	60.492,48	
Veritas Capital Management	CAM THRONE FII	0,38%	57,02%	1.879,43	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	53,49%	79,60	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	53,49%	115.324,28	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	53,49%	14.657,22	
Sicredi	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,34%	50,80%	101.380,71	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,27%	41,12%	1.831,30	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,19%	28,05%	21.466,02	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	21,95%	51,14	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	20,73%	8.861,59	
Arena Capital	CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,13%	19,50%	(2.933,37)	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,11%	17,11%	2.176,23	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	16,82%	27.562,18	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	16,82%	25,85	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	0,10%	15,73%	6.376,18	
Bradesco Asset Management	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,10%	15,10%	77.066,58	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,07%	11,11%	6.328,13	
Sicredi	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,05%	8,06%	16.090,67	
QLZ Asset Management	BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,03%	-4,63%	(2.359,43)	
Veritas Capital Management	SÃO DOMINGOS FII - FISD11	-0,06%	-9,05%	(1.290,21)	
Macam Asset	MACAM SHOPPING FII	-0,07%	-10,87%	(4.901,75)	
QLZ Asset Management	SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,12%	-18,26%	(27.022,47)	
QLZ Asset Management	ÁQUILA FII - AQLL11	-0,13%	-20,29%	(11.792,97)	
Itaú Asset Management	ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20%	-30,48%	(2.961,38)	
Graphen Investimentos	GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,26%	-38,55%	(26.589,58)	
Itaú Asset Management	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,30%	-44,98%	(190.628,59)	
Itaú Asset Management	ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	-0,40%	-60,80%	(409.699,99)	
Graphen Investimentos	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,46%	-68,98%	(4.225,43)	
CAIXA Asset	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,81%	-122,00%	(132.326,60)	
Bradesco Asset Management	BRADERCO H NÍLO FI RENDA FIXA	-0,86%	-129,08%	(337.463,34)	
CAIXA Asset	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	-143,86%	(9.177,14)	
Bradesco Asset Management	BRADERCO SELECTION FIC AÇÕES	-0,96%	-144,45%	(19.228,68)	
Santander Brasil Asset Management	SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,96%	-144,88%	(79.627,65)	
BTG Pactual Gestora de Recursos	BTG PACTUAL II FICHP INFRAESTRUTURA	-2,26%	-339,83%	(3.522,43)	
CAIXA Asset	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,90%	-436,63%	(195.200,00)	
BB Asset Management	BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	-505,48%	(439.567,13)	
CAIXA Asset	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,57%	-537,35%	(1.666.694,68)	
BB Asset Management	BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,66%	-549,61%	(195.590,87)	
CAIXA Asset	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,46%	-670,19%	(22.224,62)	
Bradesco Asset Management	BRADERCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	-4,52%	-679,66%	(64.388,63)	



8. RETORNO X RISCO

a. Renda Fixa

Fundo	CNPJ	Retorno	Volatilidade	Beta
NTN-B 760199 20240815	2110	0,60%	0,61%	(10,19)
NTN-B 760199 20240815	3055	0,60%	0,61%	(10,19)
NTN-B 760199 20240815	3405	0,60%	0,61%	(10,19)
NTN-B 760199 20240815	7612 - XP	0,75%	0,61%	(10,19)
NTN-B 760199 20240815	750 - XP	0,76%	0,61%	(10,19)
NTN-B 760199 20250515	7423 - XP	0,71%	0,90%	(39,20)
NTN-B 760199 20250515	504 - XP	0,73%	0,90%	(39,20)
NTN-B 760199 20280815	7457 - XP	0,69%	2,85%	(134,88)
NTN-B 760199 20250515	3339 - XP	0,70%	0,90%	(39,20)
NTN-B 760199 20260515	6840 - XP	#N/D	#N/D	#N/D
NTN-B 760199 20280815	6950 - XP	0,65%	2,85%	(134,88)
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.523.305/0001-06	0,95%	0,01%	0,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.303.795/0001-35	1,09%	0,61%	(10,14)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	82-5 10.740.670/0001-06	0,91%	0,12%	(6,15)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	0,91%	0,12%	(6,15)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Sede 10.740.670/0001-06	0,91%	0,12%	(6,15)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	711098-R 10.740.670/0001-06	0,91%	0,12%	(6,15)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	-0,96%	3,99%	(151,21)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	0,11%	1,53%	(84,50)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	23.215.097/0001-55	0,40%	0,92%	(56,49)
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.768.682/0001-05	1,10%	0,61%	(10,16)
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	13.455.117/0001-01	0,11%	1,53%	(84,07)
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	18.599.673/0001-75	0,10%	1,54%	(84,28)
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	14.504.578/0001-90	-0,96%	4,00%	(151,17)
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.455.197/0001-03	0,14%	2,30%	(148,11)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	0,36%	1,39%	(75,60)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	82-5 14.386.926/0001-71	0,36%	1,39%	(75,60)
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	10.979.025/0001-32	0,92%	0,13%	(6,57)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.838.150/0001-49	-0,30%	2,95%	(162,69)
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.292.588/0001-89	0,88%	0,37%	(22,56)
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	09.577.447/0001-00	0,97%	0,02%	(0,70)
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	26.507.132/0001-06	0,19%	1,80%	(132,40)
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	14.508.643/0001-55	1,21%	0,01%	(0,02)
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	50.302.776/0001-34	-0,40%	9,92%	(258,05)
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	06.175.696/0001-73	0,97%	0,02%	(0,53)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	711098 - F 11.060.913/0001-10	0,11%	1,53%	(84,50)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	711098 - F 14.386.926/0001-71	0,36%	1,39%	(75,60)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	711098 - F 14.508.605/0001-00	0,15%	2,30%	(148,22)
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	32955-7 24.634.187/0001-43	0,05%	0,03%	(1,31)
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	13.077.415/0001-05	0,90%	0,02%	(1,03)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	85-0 03.737.206/0001-97	1,03%	0,05%	(1,80)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	29-9 03.737.206/0001-97	1,03%	0,05%	(1,80)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	20.216.216/0001-04	0,10%	1,53%	(84,03)
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	32.972.942/0001-28	0,42%	0,52%	(16,51)
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	02.224.354/0001-45	1,02%	0,06%	0,07
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	1,05%	0,07%	(5,23)
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	29-9 23.215.008/0001-70	1,02%	0,08%	(5,85)
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	82-5 23.215.008/0001-70	1,02%	0,08%	(5,85)
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	711098 - F 23.215.008/0001-70	1,02%	0,08%	(5,85)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	711098 - F 03.737.206/0001-97	1,03%	0,05%	(1,80)
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	15.259.071/0001-80	-0,86%	3,99%	(191,58)
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	32955-7 13.081.159/0001-20	0,34%	2,46%	(160,51)
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	17.013.985/0001-92	-0,26%	0,41%	28,93
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	12.138.813/0001-21	1504,61%		
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	06.018.364/0001-85	-0,46%	15,78%	(139,83)
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	14.091.645/0001-91	0,56%	0,96%	(50,55)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	21.918.896/0001-62	0,07%	1,77%	(95,40)
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	17.138.474/0001-05	1,21%	0,53%	1,91



b. Renda Variável

Fundo		CNPJ	Retorno	Volatilidade	Beta
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES		01.699.688/0001-02	0,27%	15,02%	(1.087,01)
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES		03.660.879/0001-96	-0,96%	13,91%	(922,45)
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES		24.571.992/0001-75	-0,20%	17,42%	(1.180,23)
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES		45.443.475/0001-90	4,57%	26,75%	(1.317,38)
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I		39.255.695/0001-98	-3,66%	25,17%	(980,11)
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I		17.502.937/0001-68	-3,57%	9,85%	(263,40)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I		22.632.237/0001-28	-3,36%	9,16%	(215,65)
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO		14.655.180/0001-54	-0,12%	0,16%	(0,49)
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		30.036.235/0001-02	-4,46%	13,19%	(926,22)
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO		18.959.094/0001-96	-4,52%	13,23%	(929,44)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP		42.229.068/0001-97	-0,81%	6,28%	(203,84)
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	29-9	14.120.520/0001-42	0,86%	0,15%	(3,82)
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	82-5	14.120.520/0001-42	0,86%	0,15%	(3,82)
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP		12.312.767/0001-35	-0,03%		
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA		14.584.094/0001-06	-2,26%	0,03%	(0,74)
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11		10.625.626/0001-47	0,13%		
MACAM SHOPPING FII		16.685.929/0001-31	-0,07%		
CAM THRONE FII		21.862.783/0001-92	0,38%		
SÃO DOMINGOS FII - FID11		16.543.270/0001-89	-0,06%	0,00%	1,00
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11		09.006.914/0001-34	2,59%	8,31%	(41,84)
ÁQUILA FII - AQL11		13.555.918/0001-49	-0,13%	0,00%	1,00
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11		17.098.794/0001-70	-2,90%	16,60%	522,88



9. EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS SETEMBRO 2023

Tipos de Aplicação	Valor mensal Agosto
Aplicações Gerais	R\$ 1.507.847.457,75
Consignados - Fundo Garantidor	R\$ 37.417,10
Consignados - Fundo Osc. Riscos	R\$ 33.104,38
Consignados - Rendimento Consig.	R\$ 469.363,86

Resumo dos empréstimos consignados até 29/09/2023	
Valor Total Emprestado	R\$ 14.216.760,21
Rendimentos Consignados	R\$ 462.671,54

