
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE
GUIA LOPES DA LAGUNA / MS

RELATÓRIO TRIMESTRAL
DE
INVESTIMENTOS

3º TRIMESTRE
2023

24 de outubro de 2023

ÍNDICE

| | |
|---|-----------|
| 1 – INTRODUÇÃO | 3 |
| 2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS | 4 |
| 3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO | 6 |
| 4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA | 10 |
| 5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS | 19 |
| 5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos | 21 |
| 5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos | 22 |
| 6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO | 23 |
| 7 – CONCLUSÃO | 24 |
| 7.1 - Rentabilidade da Carteira Trimestral | 24 |
| 7.2 - Meta Atuarial | 25 |
| 7.3 - Riscos | 25 |
| 7.3.1 - Risco de Mercado | 25 |
| 7.3.2 - Risco de Crédito | 27 |
| 7.3.2.1 - Fundo de Investimento | 27 |
| 7.3.2.2 - Instituição Financeira | 27 |
| 7.3.3 - Risco de Liquidez | 28 |
| 7.4 - Aderência ao PAI | 29 |
| 7.4.1 - Perfil de Risco (Mercado) | 29 |
| 7.4.2 - Risco de Crédito | 30 |
| 7.4.3 - Risco de Liquidez | 30 |
| 7.4.3.1 - Obrigações Previdenciárias - Curto Prazo | 30 |
| 7.4.3.2 - Obrigações Previdenciárias - Médio e Longo Prazo | 31 |

1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Trimestral dos investimentos, referente ao 3º TRIMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do IPSMGLL.

Este relatório vem atender o **Art. 136º da Portaria MTP 1.467/2022**, que exige a elaboração de **Relatórios Trimestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

Art. 136. A unidade gestora deverá elaborar, no mínimo, trimestralmente, relatórios detalhados sobre a rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do regime e a aderência à política de investimentos, que deverão ser submetidos para avaliação e adoção de providências pelos órgãos responsáveis, conforme atribuições estabelecidas na forma do § 2º do art. 86.

2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - IPSMGLL

| Nº | MESES | SALDO INICIAL | APORTES (Aplicação) | RESGATES | VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS | RENTABILIDADE | | | SALDO FINAL |
|----|-----------|---------------|------------------------|----------------|-------------------------------------|-----------------|-----------------|------------------------------|---------------|
| | | | | | | Positiva (a) | Negativa (b) | Consolidado c = (a) - (b) | |
| 1 | JANEIRO | 10.744.599,74 | 659.737,88 | (298.593,09) | - | 78.835,79 | (771,20) | 78.064,59 | 11.183.809,12 |
| 2 | FEVEREIRO | 11.183.809,12 | 208.024,65 | (383.021,91) | - | 124.500,51 | - | 124.500,51 | 11.133.312,37 |
| 3 | MARÇO | 11.133.312,37 | 202.046,15 | (355.012,91) | - | 203.121,80 | - | 203.121,80 | 11.183.467,41 |
| 4 | ABRIL | 11.183.467,41 | 604.397,22 | (339.907,28) | - | 142.875,65 | - | 142.875,65 | 11.590.833,00 |
| 5 | MAIO | 11.590.833,00 | 293.996,53 | (354.381,53) | - | 190.108,48 | - | 190.108,48 | 11.720.556,48 |
| 6 | JUNHO | 11.720.556,48 | 12.018,02 | (246.116,27) | - | 192.645,62 | - | 192.645,62 | 11.679.103,85 |
| 7 | JULHO | 11.679.103,85 | 2.035.321,86 | (1.333.913,93) | - | 103.586,77 | (1.107,51) | 102.479,26 | 12.482.991,04 |
| 8 | AGOSTO | 12.482.991,04 | 277.283,22 | (423.144,62) | - | 85.539,96 | (12.538,50) | 73.001,46 | 12.410.131,10 |
| 9 | SETEMBRO | 12.410.131,10 | 384.688,11 | (381.922,60) | - | 64.904,74 | (28.557,57) | 36.347,17 | 12.449.243,78 |
| 10 | OUTUBRO | 12.449.243,78 | - | - | - | - | - | - | 12.449.243,78 |
| 11 | NOVEMBRO | 12.449.243,78 | - | - | - | - | - | - | 12.449.243,78 |
| 12 | DEZEMBRO | 12.449.243,78 | - | - | - | - | - | - | 12.449.243,78 |
| 13 | ANO | 10.744.599,74 | 4.677.513,64 | (4.116.014,14) | - | 1.186.119,32 | (42.974,78) | 1.143.144,54 | 12.449.243,78 |

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023 - LIMITE DE SEGMENTO - IPSMGLL

| Nº | Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021 | Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021 | Limites do PAI | | | Carteira de Investimentos | | ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO |
|-----------------------------------|---|--|----------------|--------------------|--------|---------------------------|----------------------|---|
| | | | Mínimo | Estratégia Alvo | Máximo | Atualmente (%) | Atualmente (R\$) | |
| RENDA FIXA | | | | | | | | |
| 1 | Títulos Públicos Federal | Art. 7, I, a (100%) | 0,0% | 0,0% | 10,0% | 0,0% | - | - |
| 2 | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas | Art. 7, I, b (100%) | 0,0% | 53,3% | 73,0% | 70,1% | 8.724.960,68 | - |
| 3 | F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operação | Art. 7, I, c (100%) | 0,0% | 0,0% | 73,0% | 0,0% | - | - |
| 4 | Operações Compromissadas | Art. 7, II (5%) | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | - | - |
| 5 | F.I. de Renda Fixa | Art. 7, III, a (60%) | 0,0% | 46,7% | 60,0% | 29,9% | 3.724.283,10 | - |
| 6 | F.I. de Índice de Renda Fixa | Art. 7, III, b (60%) | 0,0% | 0,0% | 60,0% | 0,0% | - | - |
| 7 | Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F. | Art. 7, IV (20%) | 0,0% | 0,0% | 10,0% | 0,0% | - | - |
| 8 | FIDC - Classe Sênior | Art. 7, V, a (5%) | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | - | - |
| 9 | F.I. Renda Fixa de 'Crédito Privado' | Art. 7, V, b (5%) | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | - | - |
| 10 | F.I. em 85% de Debêntures | Art. 7, V, c (5%) | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | - | - |
| 11 | TOTAL - RENDA FIXA | | | | | 100,0% | 12.449.243,78 | |
| RENDA VARIÁVEL | | | | | | | | |
| 12 | F.I. Ações | Art. 8, I (30%) | 0,0% | 0,0% | 10,0% | 0,0% | - | - |
| 13 | F.I. Ações em Índices de Renda Variável | Art. 8, II (30%) | 0,0% | 0,0% | 10,0% | 0,0% | - | - |
| 14 | TOTAL - RENDA VARIÁVEL | | | | | 0,0% | - | |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | | | | | | | | |
| 15 | F.I. e F.I.C FI Multimercados | Art. 10, I (10%) | 0,0% | 0,0% | 10,0% | 0,0% | - | - |
| 16 | F.I. em Participações | Art. 10, II (5%) | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | - | - |
| 17 | F.I. Ações - Mercado de Acesso | Art. 10, III (5%) | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | - | - |
| 18 | TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | | | | | 0,0% | - | |
| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | | | | | | | | |
| 19 | F.I. Imobiliário | Art. 11 (5%) | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | - | - |
| 20 | TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS | | | | | 0,0% | - | |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | | | | | | | | |
| 21 | FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa | Art. 9º, I (10%) | 0,0% | 0,0% | 10,0% | 0,0% | - | - |
| 22 | FIC - Aberto - Investimento no Exterior | Art. 9º, II (10%) | 0,0% | 0,0% | 10,0% | 0,0% | - | - |
| 23 | Fundos de Ações - BDR Nível I | Art. 9º, III (10%) | 0,0% | 0,0% | 10,0% | 0,0% | - | - |
| 24 | TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR | | | | | 0,0% | - | |
| EMPRÉSTIMO CONSIGNADO | | | | | | | | |
| 25 | Empréstimo Consignado | Art. 12 (5%) | 0,0% | 0,0% | 5,0% | 0,0% | - | - |
| 26 | TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO | | | | | 0,0% | - | |
| 27 | DESENQUADRADO | - | | 100,0% | | 0,0% | - | - |
| 28 | DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | - | | | | 0,0% | - | |
| 29 | PATRIMÔNIO TOTAL | | | | | 100,0% | 12.449.243,78 | 5 |

3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

| INFORMAÇÕES | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI | BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI |
|-----------------------|--|--|---|---|
| CNPJ | 13.077.415/0001-05 | 13.077.418/0001-49 | 11.328.882/0001-35 | 13.322.205/0001-35 |
| SEGMENTO | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa |
| CLASSIFICAÇÃO | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa |
| ÍNDICE | SELIC | CDI | IRF-M 1 | IDKA IPCA 2A |
| PÚBLICO ALVO | Público Geral | Público Geral | Público Geral | Público Geral |
| ADMINISTRADOR | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A |
| CNPJ | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 |
| GESTOR | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A |
| CNPJ | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 |
| CUSTODIANTE | BANCO DO BRASIL S.A. | BANCO DO BRASIL S.A. | BANCO DO BRASIL S.A. | BANCO DO BRASIL S.A. |
| CNPJ | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 |
| DISTRIBUIDOR | Banco do Brasil S.A. | Banco do Brasil S.A. | Banco do Brasil S.A. | Banco do Brasil S.A. |
| CNPJ | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 |
| AUDITORIA | PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA | PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA | PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA | PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA |
| DATA DE INÍCIO | 28/04/2011 | 28/04/2011 | 08/12/2009 | 28/04/2011 |
| TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | 1,00% a.a. | 0,20% a.a. | 0,10% a.a. | 0,20% a.a. |
| TAXA DE PERFORMANCE | Não Possui | Não Possui | Não Possui | Não Possui |
| APLICAÇÃO INICIAL | 1000 | 1000 | 1000 | 10000 |
| APLICAÇÕES ADICIONAIS | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0 |
| RESGATE MÍNIMO | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,00 |
| SALDO MÍNIMO | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0 |
| CARÊNCIA | Não possui | Não possui | Não possui | Não possui |
| CRÉDITO DO RESGATE | D+0 (No mesmo dia da solicitação) | D+0 (No mesmo dia da solicitação) | D+0 (No mesmo dia da solicitação) | D+1 (No dia seguinte a solicitação) |
| RISCO DE MERCADO* | 1 - Muito Baixo | 2 - Baixo | 2 - Baixo | 3 - Médio |
| ENQUADRAMENTO LEGAL | F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo) | F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) |

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

2

| INFORMAÇÕES | BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI |
|------------------------------|---|---|---|---|
| CNPJ | 03.543.447/0001-03 | 35.292.588/0001-89 | 07.111.384/0001-69 | 07.442.078/0001-05 |
| SEGMENTO | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa |
| CLASSIFICAÇÃO | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa |
| ÍNDICE | IMA - B 5 | IPCA | IRF-M | IMA-B |
| PÚBLICO ALVO | Público Geral | Público Geral | Público Geral | Público Geral |
| ADMINISTRADOR | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A |
| CNPJ | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 |
| GESTOR | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A |
| CNPJ | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 |
| CUSTODIANTE | BANCO DO BRASIL S.A. | BANCO DO BRASIL S.A. | BANCO DO BRASIL S.A. | BANCO DO BRASIL S.A. |
| CNPJ | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 |
| DISTRIBUIDOR | Banco do Brasil S.A. | Banco do Brasil S.A. | Banco do Brasil S.A. | Banco do Brasil S.A. |
| CNPJ | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 |
| AUDITORIA | PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA | KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA. | PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA | PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA |
| DATA DE INÍCIO | 17/12/1999 | 16/03/2020 | 08/12/2004 | 24/07/2005 |
| TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | 0,20% a.a. | 0,30% a.a. | 0,20% a.a. | 0,20% a.a. |
| TAXA DE PERFORMANCE | Não Possui | Não Possui | Não Possui | Não Possui |
| APLICAÇÃO INICIAL | 1000 | 10000 | 10000 | 10000 |
| APLICAÇÕES ADICIONAIS | 0,01 | 1000 | 0,01 | 0,01 |
| RESGATE MÍNIMO | 0,01 | 1.000,00 | 0,01 | 0,01 |
| SALDO MÍNIMO | 0,01 | 1000 | 0,01 | 0,01 |
| CARÊNCIA | Não possui | Não possui | Não possui | Não possui |
| CRÉDITO DO RESGATE | D+1 (No dia seguinte a solicitação) | D+3 (Três dias úteis após a solicitação) | D+1 (No dia seguinte a solicitação) | D+1 (No dia seguinte a solicitação) |
| RISCO DE MERCADO* | 3 - Médio | 3 - Médio | 3 - Médio | 4 - Alto |
| ENQUADRAMENTO LEGAL | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) |

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

7

3

| INFORMAÇÕES | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP |
|------------------------------|--|---|---|---|
| CNPJ | 07.861.554/0001-22 | 49.964.484/0001-88 | 05.164.356/0001-84 | 11.061.217/0001-28 |
| SEGMENTO | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa |
| CLASSIFICAÇÃO | Fundo de Renda Fixa | Renda Fixa Duração Livre Soberano | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa |
| ÍNDICE | IMA-B | IPCA + 5,00% a.a. | CDI | IMA-GERAL |
| PÚBLICO ALVO | Público Geral | Investidor Qualificado | Público Geral | Público Geral |
| ADMINISTRADOR | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL |
| CNPJ | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 00.360.305/0001-04 | 00.360.305/0001-04 |
| GESTOR | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES | CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES |
| CNPJ | 30.822.936/0001-69 | 30.822.936/0001-69 | 42.040.639/0001-40 | 42.040.639/0001-40 |
| CUSTODIANTE | BANCO DO BRASIL S.A. | BANCO DO BRASIL S.A. | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL |
| CNPJ | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.360.305/0001-04 | 00.360.305/0001-04 |
| DISTRIBUIDOR | Banco do Brasil S.A. | Banco do Brasil S.A. | Caixa Econômica Federal | Caixa Econômica Federal |
| CNPJ | 00.000.000/0001-91 | 00.000.000/0001-91 | 00.360.305/0001-04 | 00.360.305/0001-04 |
| AUDITORIA | PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA | DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA | KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA. | KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA. |
| DATA DE INÍCIO | 09/03/2006 | 16/05/2023 | 10/02/2006 | 08/07/2010 |
| TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | 0,30% a.a. | 0,10% a.a. | 0,20% a.a. | 0,20% a.a. |
| TAXA DE PERFORMANCE | Não Possui | Não possui | Não Possui | Não Possui |
| APLICAÇÃO INICIAL | 10000 | 100000 | 0,01 | 1000 |
| APLICAÇÕES ADICIONAIS | 0,01 | 100000 | 0,01 | 0 |
| RESGATE MÍNIMO | 0,01 | 100.000,00 | 0,01 | 0,00 |
| SALDO MÍNIMO | 0,01 | 100000 | 0,01 | 0 |
| CARÊNCIA | Não possui | Até o dia 15/08/2024 | Não possui | Não possui |
| CRÉDITO DO RESGATE | D+1 (No dia seguinte a solicitação) | D+0 (No mesmo dia da solicitação) | D+0 (No mesmo dia da solicitação) | D+0 (No mesmo dia da solicitação) |
| RISCO DE MERCADO* | 4 - Alto | 3 - Médio | 2 - Baixo | 3 - Médio |
| ENQUADRAMENTO LEGAL | F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) |

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

4

| INFORMAÇÕES | FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B 5 | BRADESCO FIC FI RF IMA GERAL | |
|------------------------------|---|--|--|--|
| CNPJ | 10.740.658/0001-93 | 20.216.216/0001-04 | 08.246.318/0001-69 | |
| SEGMENTO | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa | |
| CLASSIFICAÇÃO | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa | Fundo de Renda Fixa | |
| ÍNDICE | IMA-B | IMA - B 5 | IMA - GERAL | |
| PÚBLICO ALVO | Público Geral | Público Geral | Público Geral | |
| ADMINISTRADOR | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | BANCO BRADESCO S.A. | BANCO BRADESCO S.A. | |
| CNPJ | 00.360.305/0001-04 | 60.746.948/0001-12 | 60.746.948/0001-12 | |
| GESTOR | CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. | |
| CNPJ | 42.040.639/0001-40 | 62.375.134/0001-44 | 62.375.134/0001-44 | |
| CUSTODIANTE | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | BANCO BRADESCO S.A. | BANCO BRADESCO S.A. | |
| CNPJ | 00.360.305/0001-04 | 60.746.948/0001-12 | 60.746.948/0001-12 | |
| DISTRIBUIDOR | Caixa Econômica Federal | Banco Bradesco S.A. | Bradesco S.A. | |
| CNPJ | 00.360.305/0001-04 | 60.746.948/0001-12 | 60.746.948/0001-12 | |
| AUDITORIA | KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA. | ERNST & YOUNG AUDITORES INDEPENDENTES S/S | ERNST & YOUNG AUDITORES INDEPENDENTES S/S | |
| DATA DE INÍCIO | 08/03/2010 | 08/08/2014 | 30/04/2007 | |
| TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | 0,20% a.a. | 0,20% a.a. | 0,25% a.a. | |
| TAXA DE PERFORMANCE | Não Possui | Não Possui | Não Possui | |
| APLICAÇÃO INICIAL | 1000 | 50000 | 50000 | |
| APLICAÇÕES ADICIONAIS | 0 | 5000 | 0 | |
| RESGATE MÍNIMO | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| SALDO MÍNIMO | 0 | 5000 | 0 | |
| CARÊNCIA | Não possui | Não possui | Não possui | |
| CRÉDITO DO RESGATE | D+0 (No mesmo dia da solicitação) | D+1 (No dia seguinte a solicitação) | D+1 (No dia seguinte a solicitação) | |
| RISCO DE MERCADO* | 3 - Médio | 2 - Baixo | 3 - Médio | |
| ENQUADRAMENTO LEGAL | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo) | F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo) | |

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

4.1 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

| FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP | | | | | | | |
|----------------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|--|
| 1 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 290.429,41 | - | 289.379,33 | 1.050,08 | - | -0,362% | |
| AGOSTO | - | - | - | - | - | - | |
| SETEMBRO | - | - | - | - | - | - | |

| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP | | | | | | | |
|------------------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|--|
| 2 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 96.068,04 | - | 96.024,74 | 43,30 | - | -0,045% | |
| AGOSTO | - | - | - | - | - | - | |
| SETEMBRO | - | - | - | - | - | - | |

| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP | | | | | | | |
|------------------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|--|
| 3 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 31.349,67 | - | 31.335,54 | 14,13 | - | -0,045% | |
| AGOSTO | - | - | - | - | - | - | |
| SETEMBRO | - | - | - | - | - | - | |

| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | | | | | | |
|--|------------------------|------------------|-------------------|------------------------|----------------------|--------------------|--------|
| 4 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 55.706,31 | - | - | 55.786,14 | 79,83 | - | 0,143% |
| AGOSTO | - | - | - | - | - | - | - |
| SETEMBRO | - | - | - | - | - | - | - |

4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

| BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI | | | | | | |
|---------------------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 5 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 601.093,30 | - | - | 5.711,25 | 606.804,55 | 0,950% |
| AGOSTO | 606.804,55 | - | - | 3.524,81 | 610.329,36 | 0,581% |
| SETEMBRO | 610.329,36 | - | - | 678,39 | 611.007,75 | 0,111% |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI | | | | | | |
|---------------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 6 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 1.235.820,72 | - | - | 9.518,98 | 1.245.339,70 | 0,770% |
| AGOSTO | 1.245.339,70 | - | - | 5.656,49 | 1.239.683,21 | -0,454% |
| SETEMBRO | 1.239.683,21 | - | - | 12.069,29 | 1.227.613,92 | -0,974% |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI | | | | | | |
|------------------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 7 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 431.559,40 | - | - | 3.364,86 | 434.924,26 | 0,780% |
| AGOSTO | 434.924,26 | - | - | 3.149,95 | 438.074,21 | 0,724% |
| SETEMBRO | 438.074,21 | - | - | 611,77 | 438.685,98 | 0,140% |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI | | | | | | |
|---|-------------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 8 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 1.645.977,37 | - | - | 12.070,21 | 1.658.047,58 | 0,733% |
| AGOSTO | 1.658.047,58 | - | - | 6.653,32 | 1.651.394,26 | -0,401% |
| SETEMBRO | 1.651.394,26 | - | - | 16.000,32 | 1.635.393,94 | -0,969% |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI | | | | | | |
|---|-------------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 9 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 644.000,13 | 2.396,84 | 519.529,36 | 2.277,14 | 129.144,75 | 1,795% |
| AGOSTO | 129.144,75 | - | - | 1.440,98 | 130.585,73 | 1,116% |
| SETEMBRO | 130.585,73 | 1.631,48 | 9.254,12 | 1.180,67 | 124.143,76 | 0,960% |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI | | | | | | |
|--|-------------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 10 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 850.433,79 | - | - | 8.022,17 | 858.455,96 | 0,943% |
| AGOSTO | 858.455,96 | - | - | 6.345,98 | 864.801,94 | 0,739% |
| SETEMBRO | 864.801,94 | - | - | 1.830,80 | 866.632,74 | 0,212% |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | | | | | | |
|---|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|
| 11 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 1.448.485,75 | - | - | 15.419,60 | 1.463.905,35 | 1,065% |
| AGOSTO | 1.463.905,35 | 267.663,34 | - 350.446,46 | 17.331,92 | 1.398.454,15 | 1,255% |
| SETEMBRO | 1.398.454,15 | 358.396,56 | - 350.446,46 | 14.369,08 | 1.420.773,33 | 1,027% |

| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | | | | | | |
|---|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|
| 12 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 2.504.459,91 | - | - | 19.699,32 | 2.524.159,23 | 0,787% |
| AGOSTO | 2.524.159,23 | - | - | 26.227,40 | 2.550.386,63 | 1,039% |
| SETEMBRO | 2.550.386,63 | - | - | 22.400,85 | 2.572.787,48 | 0,878% |

| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI | | | | | | |
|--|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|
| 13 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 25.193,20 | 71.123,13 | - 17.330,59 | 584,50 | 79.570,24 | 2,320% |
| AGOSTO | 79.570,24 | 9.619,88 | - 15.785,34 | 821,27 | 74.226,05 | 1,119% |
| SETEMBRO | 74.226,05 | 9.125,66 | - 22.222,02 | 625,37 | 61.755,06 | 1,023% |

| BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI | | | | | | | |
|--|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|---------------|
| 14 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 124.744,22 | - | - | 125.780,21 | 1.035,99 | - | 0,830% |
| AGOSTO | - | - | - | - | - | - | - |
| SETEMBRO | - | - | - | - | - | - | - |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI | | | | | | | |
|--|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|--|
| 15 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 49.964,23 | - | - | 384,85 | 50.349,08 | 0,770% | |
| AGOSTO | 50.349,08 | - | - | 228,69 | 50.120,39 | -0,454% | |
| SETEMBRO | 50.120,39 | - | - | 487,96 | 49.632,43 | -0,974% | |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI | | | | | | | |
|---|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|--|
| 16 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 232.413,58 | - | - | 1.812,13 | 234.225,71 | 0,780% | |
| AGOSTO | 234.225,71 | - | - | 1.696,38 | 235.922,09 | 0,724% | |
| SETEMBRO | 235.922,09 | 15.534,41 | - | 344,69 | 251.801,19 | 0,146% | |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI | | | | | | | |
|---|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|---------------|
| 17 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 140.729,14 | - | - | 142.080,88 | 1.351,74 | - | 0,961% |
| AGOSTO | - | - | - | - | - | - | - |
| SETEMBRO | - | - | - | - | - | - | - |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI | | | | | | | |
|--|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|--|
| 18 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 265.201,99 | - | - | 2.501,66 | 267.703,65 | 0,943% | |
| AGOSTO | 267.703,65 | - | - | 1.978,95 | 269.682,60 | 0,739% | |
| SETEMBRO | 269.682,60 | - | - | 570,92 | 270.253,52 | 0,212% | |

| BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | | | | | | | |
|---|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|---------------|
| 19 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno | |
| JULHO | 56.127,77 | - | - | 56.667,14 | 539,37 | - | 0,961% |
| AGOSTO | - | - | - | - | - | - | - |
| SETEMBRO | - | - | - | - | - | - | - |

| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | | | | | | |
|--|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|
| 20 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | - | 1.553.909,66 | - | 10.013,80 | 1.563.923,46 | 0,644% |
| AGOSTO | 1.563.923,46 | - | - 45.136,09 | 14.118,55 | 1.532.905,92 | 0,930% |
| SETEMBRO | 1.532.905,92 | - | - | 16.962,89 | 1.549.868,81 | 1,107% |

| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | | | | | | |
|--|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|
| 21 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | - | 407.892,23 | - | 160,36 | 408.052,59 | 0,039% |
| AGOSTO | 408.052,59 | - | - 11.776,73 | 3.683,76 | 399.959,62 | 0,930% |
| SETEMBRO | 399.959,62 | - | - | 4.425,89 | 404.385,51 | 1,107% |

4.3 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BRADESCO

| BRADESCO FIC FI RF IMA GERAL | | | | | | |
|-------------------------------------|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|
| 22 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 318.105,03 | - | - | 3.055,93 | 321.160,96 | 0,961% |
| AGOSTO | 321.160,96 | - | - | 1.532,11 | 322.693,07 | 0,477% |
| SETEMBRO | 322.693,07 | - | - | 259,66 | 322.952,73 | 0,080% |

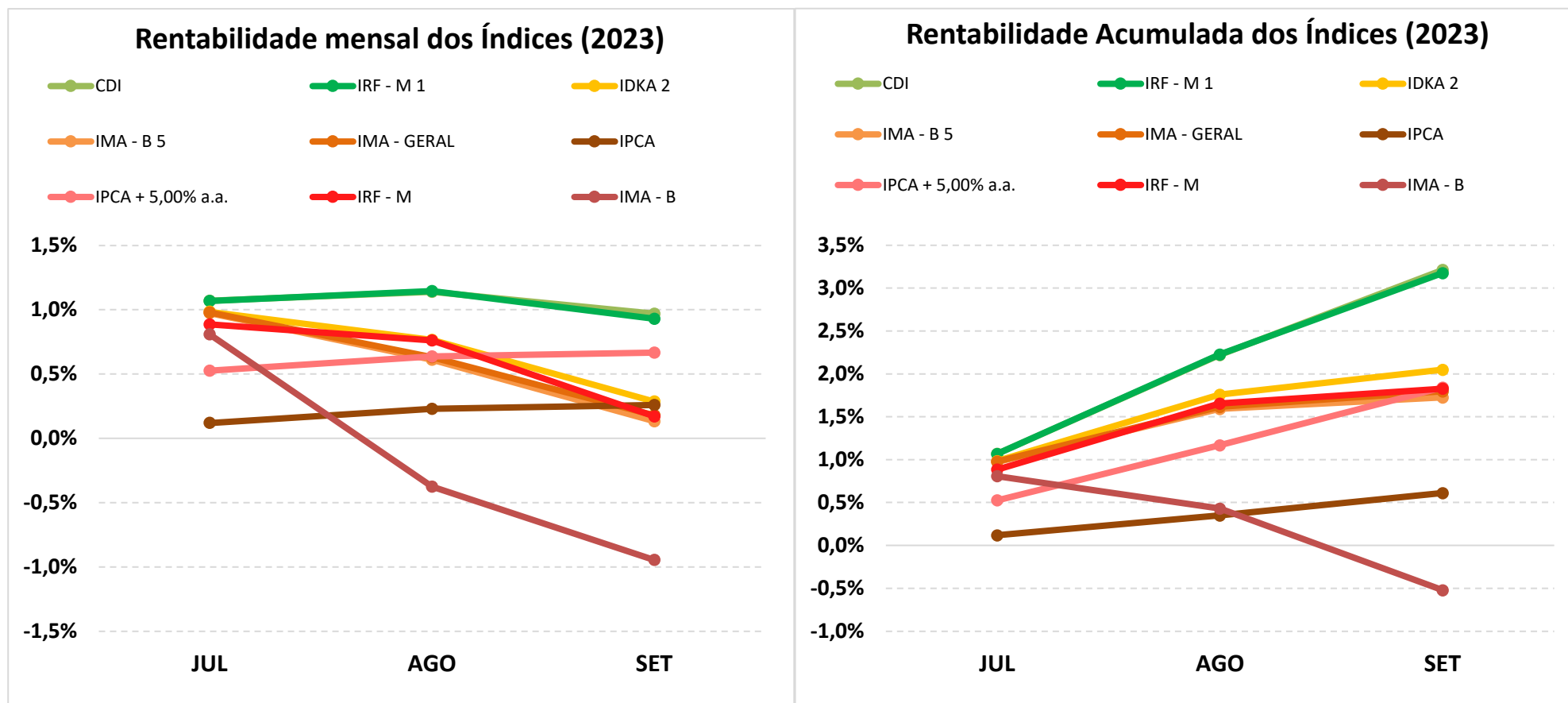
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B 5 | | | | | | |
|---|----------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|
| 23 | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO | 631.240,89 | - | - | 5.983,08 | 637.223,97 | 0,948% |
| AGOSTO | 637.223,97 | - | - | 3.687,90 | 640.911,87 | 0,579% |
| SETEMBRO | 640.911,87 | - | - | 643,76 | 641.555,63 | 0,100% |

5-TABELA DE RENTABILIDADE

| INVESTIMENTOS | JUL | AGO | SET | ACUMULADO |
|--|--------------|---------------|---------------|---------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI | 0,98% | 1,05% | 0,90% | 2,96% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1,06% | 1,16% | 0,97% | 3,22% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI | 1,06% | 1,12% | 0,90% | 3,11% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI | 0,94% | 0,74% | 0,21% | 1,90% |
| BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI | 0,97% | 0,58% | 0,11% | 1,67% |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 0,79% | 1,04% | 0,88% | 2,73% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI | 0,78% | 0,72% | 0,14% | 1,65% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI | 0,73% | -0,40% | -0,97% | -0,64% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI | 0,77% | -0,45% | -0,97% | -0,66% |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | 1,07% | 0,91% | 1,11% | 3,12% |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,05% | * | * | 1,05% |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP | 0,93% | * | * | 0,93% |
| FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP | 0,80% | * | * | 0,80% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B 5 | 0,95% | 0,58% | 0,10% | 1,64% |
| BRADESCO FIC FI RF IMA GERAL | 0,96% | 0,48% | 0,08% | 1,53% |
| CDI | 1,07% | 1,14% | 0,97% | 3,21% |
| IRF - M 1 | 1,07% | 1,15% | 0,93% | 3,18% |
| IDKA 2 | 0,98% | 0,77% | 0,29% | 2,05% |
| IMA - B 5 | 0,97% | 0,61% | 0,13% | 1,73% |
| IMA - GERAL | 0,98% | 0,63% | 0,18% | 1,80% |
| IPCA | 0,12% | 0,23% | 0,26% | 0,61% |
| IPCA + 5,00% a.a. | 0,53% | 0,64% | 0,67% | 1,84% |
| IRF - M | 0,89% | 0,76% | 0,17% | 1,83% |
| IMA - B | 0,81% | -0,38% | -0,95% | -0,52% |

* O RPPS resgatou os recursos aplicados no fundo em julho/2023, por conta disso, não há rentabilidade nos respectivos meses.

GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES



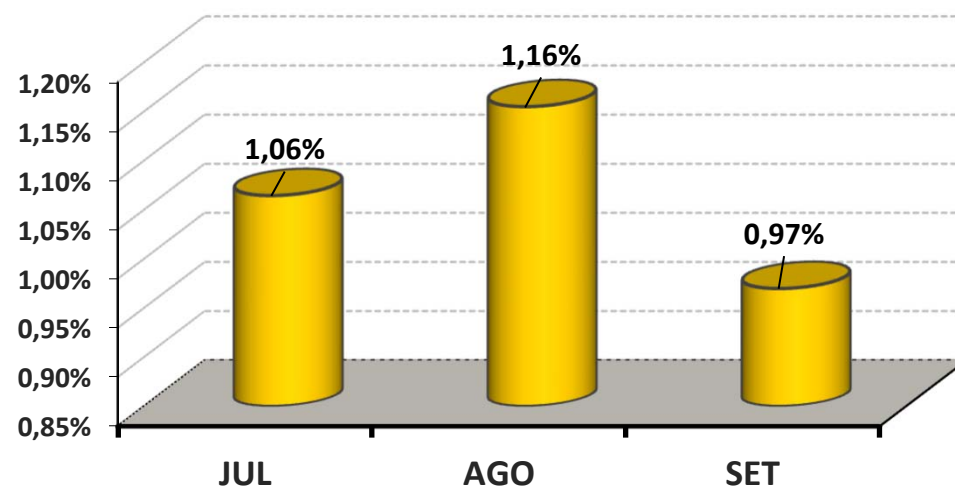
5.1-MELHOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

| FUNDO DE INVESTIMENTO | JUL | AGO | SET |
|---|-------|-------|-------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1,06% | 1,16% | 0,97% |

Comportamento MENSAL no Trimestre

■ BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI

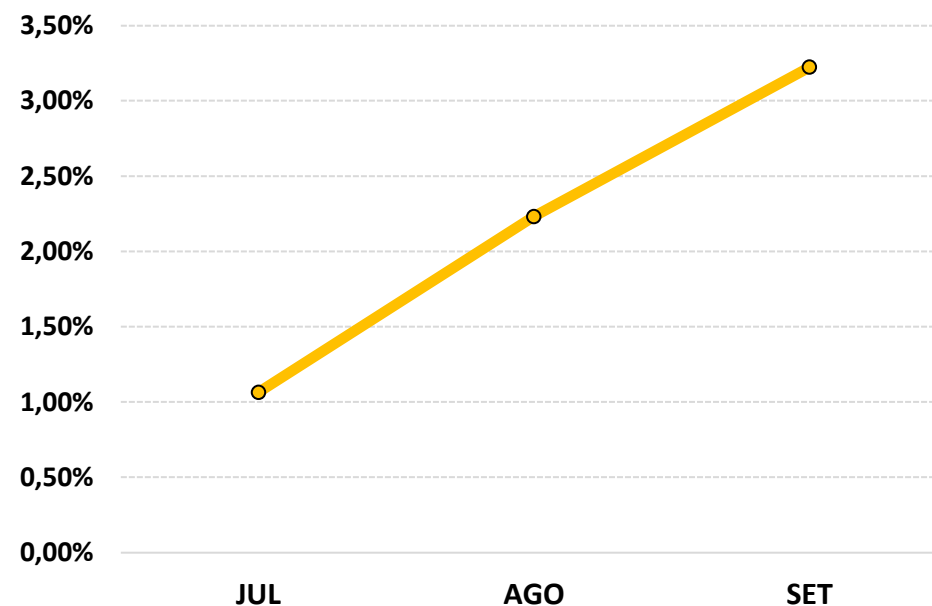


COMPORTAMENTO ACUMULADO

| FUNDO DE INVESTIMENTO | JUL | AGO | SET |
|---|-------|-------|-------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1,06% | 2,23% | 3,22% |

Comportamento ACUMULADO no Trimestre

● BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI

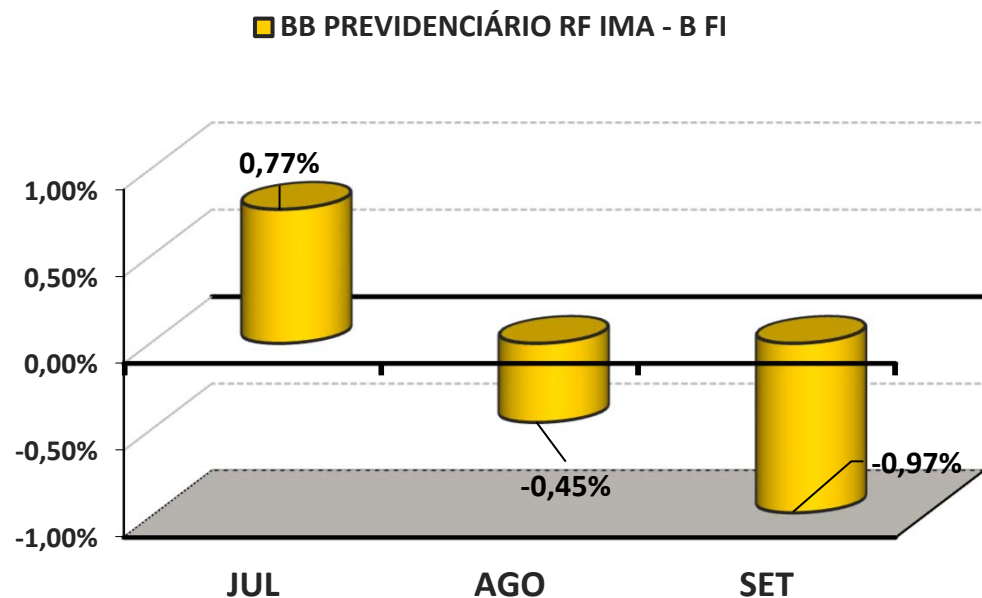


5.2-PIOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

| FUNDO DE INVESTIMENTO | JUL | AGO | SET |
|---------------------------------|-------|--------|--------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI | 0,77% | -0,45% | -0,97% |

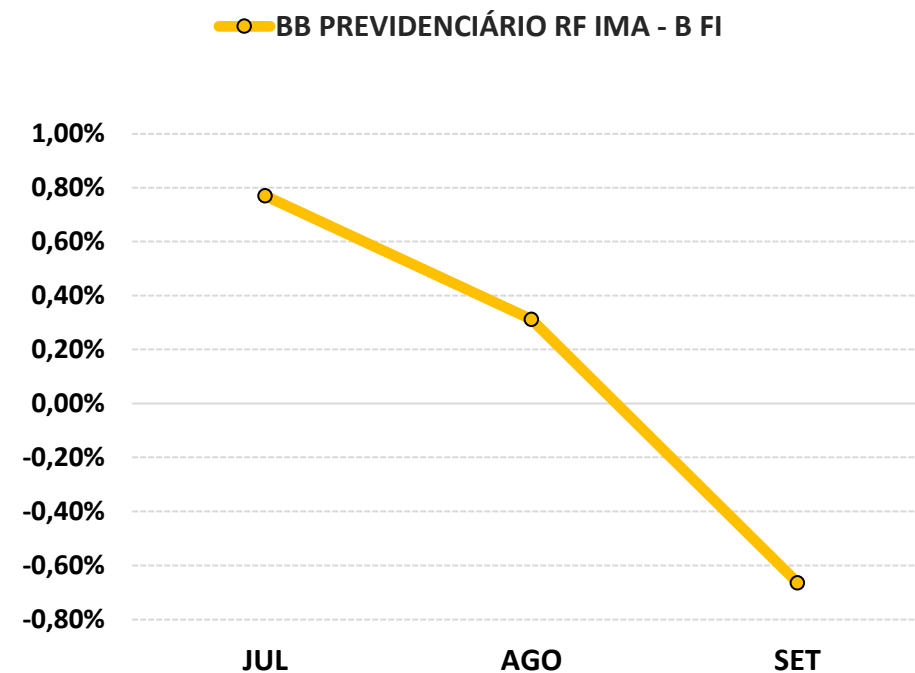
Comportamento MENSAL no Trimestre



COMPORTAMENTO ACUMULADO

| FUNDO DE INVESTIMENTO | JUL | AGO | SET |
|---------------------------------|-------|-------|--------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI | 0,77% | 0,31% | -0,66% |

Comportamento ACUMULADO no Trimestre



6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 3º TRIMESTRE - 2023

| | JUL | AGO | SET |
|----------------------|-------|--------|-------|
| MENSAL | 0,88% | 0,59% | 0,29% |
| CDI | 1,07% | 1,14% | 0,97% |
| IBOVESPA | 3,26% | -5,09% | 0,71% |
| META ATUARIAL | 0,53% | 0,64% | 0,67% |

| | JUL | AGO | SET |
|-------------------------------|-------|--------|--------|
| ACUMULADO DO TRIMESTRE | 0,88% | 1,47% | 1,77% |
| CDI | 1,07% | 2,22% | 3,21% |
| IBOVESPA | 3,26% | -2,00% | -1,30% |
| META ATUARIAL | 0,53% | 1,17% | 1,84% |

RENTABILIDADE ACUMULADA DO TRIMESTRE DO IPSMGLL: R\$ **211.827,89**

META ATUARIAL ACUMULADA DO TRIMESTRE: R\$ **223.991,92**

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ **(12.164,03)**

7-CONCLUSÃO

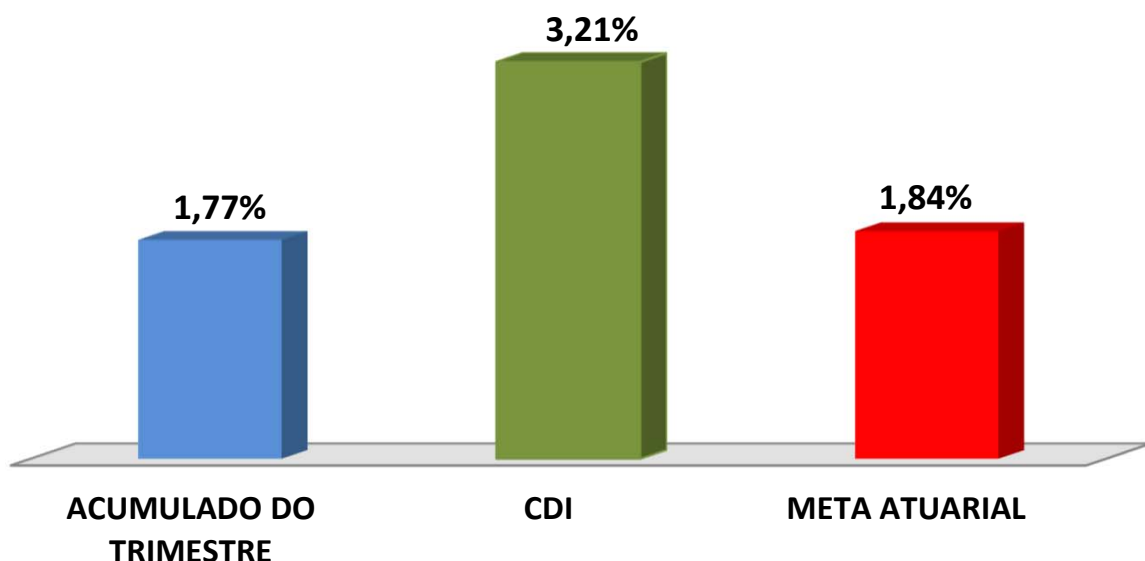
Atendendo o Art. 136º da Portaria MTP 1.467/2022, detalhado na página 3 deste relatório, segue abaixo uma análise da Carteira de Investimento IPSMGLL, no 3º Trimestre/2023, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2023.

7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA TRIMESTRAL

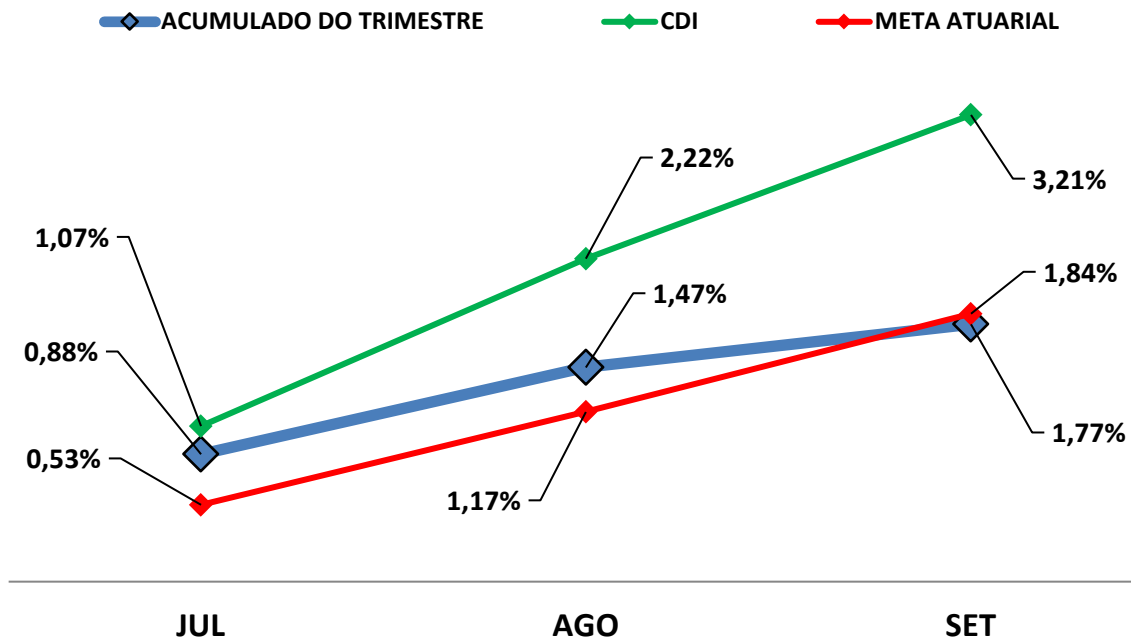
A Carteira de Investimentos do IPSMGLL, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no trimestre de 1,77% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no trimestre de 3,21% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 55,12% sobre o índice de referência do mercado.

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

Rentabilidade Acumulada no Trimestre



Rentabilidade Acumulada no Trimestre



7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no trimestre do IPSMGLL é de 1,77% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 1,84%, representando 96,10% sobre a Meta Atuarial.

7.3-RISCOS

7.3.1-RISCO DE MERCADO

É o risco de oscilações de preços dos ativos conforme o cenário macroeconômico. Este risco é voltado para a volatilidade dos papéis, sobretudo de Renda Fixa (Títulos Públicos e fundos atrelados à inflação) e Renda Variável (ações, dólar e etc..)."

Conforme a tabela abaixo, o IPSMGLL aplica em alguns Fundos de Investimentos sensíveis às oscilações de mercado, conforme a classificação de Risco de Mercado, disponibilizado nas Lâminas de Informações Essenciais dos Fundos de Investimentos.

| Nº | FUNDOS DE INVESTIMENTO | RISCO DE MERCADO* |
|-----------|--|--------------------------|
| 1 | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI | 1 - Muito Baixo |
| 2 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2 - Baixo |
| 3 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI | 2 - Baixo |
| 4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI | 3 - Médio |
| 5 | BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI | 3 - Médio |
| 6 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 3 - Médio |
| 7 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI | 3 - Médio |
| 8 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI | 4 - Alto |
| 9 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI | 4 - Alto |
| 10 | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | 3 - Médio |
| 11 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2 - Baixo |
| 12 | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP | 3 - Médio |
| 13 | FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP | 3 - Médio |
| 14 | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B 5 | 2 - Baixo |
| 15 | BRADESCO FIC FI RF IMA GERAL | 3 - Médio |

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

7.3.2-RISCO DE CRÉDITO

É a possibilidade do devedor não honrar seus compromissos. Nesse caso, investimentos que possuem risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating.

7.3.2.1-FUNDO DE INVESTIMENTO

Os Fundos de Investimentos em Renda Fixa que o IPSMGLL aplica, não necessitam de Análise de Rating.

| Nº | FUNDO DE INVESTIMENTO | CLASSIFICAÇÃO DE RATING | |
|----|--|--------------------------------------|--------|
| | | AGÊNCIA | RATING |
| 1 | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 2 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 3 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI | Moodys América Latina | MQ1 |
| 5 | BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI | Moodys América Latina | MQ1 |
| 6 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 7 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 8 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 9 | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 10 | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 11 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 12 | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP | Fitch Rating | Forte |
| 13 | FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP | Fitch Rating | Forte |
| 14 | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B 5 | Não Disponibilizado pela Instituição | - |
| 15 | BRADESCO FIC FI RF IMA GERAL | Não Disponibilizado pela Instituição | - |

7.3.2.2-*INSTITUIÇÃO FINANCEIRA*

Todos os envolvidos na gestão do Fundo de Investimento, incluindo as Instituições Financeiras, o Administrador, o Gestor e o Distribuidor necessitam de Análise de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating dos envolvidos na gestão e distribuição dos Fundos de Investimentos.

| Nº | INSTITUIÇÃO FINANCEIRA / ADMINISTRADOR / GESTOR / DISTRIBUIDOR | CLASSIFICAÇÃO DE RATING | |
|----|---|-------------------------|--------|
| | | AGÊNCIA | RATING |
| 1 | BB Gestão de Recursos DTVM S.A. | Fitch Ratings | AA |
| 2 | BRAM - Bradesco Asset Management S.A. DTVM | Fitch Ratings | AAA |

7.3.3-*RISCO DE LIQUIDEZ*

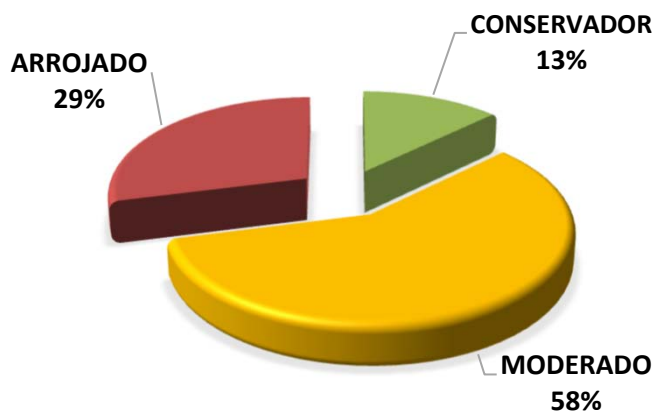
É o risco de o investidor não conseguir dar liquidez ao ativo financeiro (vender) ou conseguir liquidez abaixo do preço de mercado ou abaixo do preço de aquisição (compra).

O IPSMGLL possui Fundos de Investimento Aberto com Carência. Nesse caso, só poderá resgatar as cotas, após o termino do prazo de carência. Investimentos que possuem prazo para resgate, necessitam estar aderentes as obrigações financeiras do investidor.

7.4-ADERÊNCIA AO PAI

7.4.1-PERFIL DE RISCO (MERCADO)

PERFIL DOS INVESTIMENTOS



PERFIL 6
MODERADO COM
TENDÊNCIA
ARROJADA

Descrição do Perfil de Investidor

Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados, mas busca investir um pouco em ativos arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é o perfil mais indicado.

Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo é o perfil mais indicado, pois os investimentos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil é o mais equilibrado, entre cumprir a Meta Atuarial e se proteger um pouco das oscilações de mercado.

Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

| | | |
|--------------------|----|-------------------------------------|
| CONSERVADOR | 1 | EXTREMAMENTE CONSERVADOR |
| | 2 | CONSERVADOR |
| | 3 | CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA |
| MODERADO | 4 | MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA |
| | 5 | MODERADO |
| | 6 | MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA |
| ARROJADO | 7 | ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA |
| | 8 | ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA |
| | 9 | ARROJADO |
| | 10 | EXTREMAMENTE ARROJADO |

O atual perfil de risco do IPSMGLL (PERFIL 6 - MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA), se encontra aderente ao Perfil de Risco proposto na Política Anual de Investimentos/2023.

7.4.2-RISCO DE CRÉDITO

A Política Anual de Investimentos/2023 do IPSMGLL, determina que fundos de investimentos e Instituições Financeiras que necessitem de Análise de Rating, só receberão recursos do IPSMGLL, caso sejam classificados, no mínimo, como BAIXO RISCO DE CRÉDITO (BBB).

As Análises de Ratings encontradas dos Fundos de Investimentos, assim como das Instituições Financeiras, dos Administradores, dos Gestores e dos Distribuidores dos fundos, se encontram aderentes à Política Anual de Investimentos/2023 do IPSMGLL.

7.4.3-RISCO DE LIQUIDEZ

7.4.3.1-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - CURTO PRAZO

Para resguardar o IPSMGLL e minimizar o risco de liquidez no Curto Prazo foi definido na Política de Investimentos/2023, uma Separação de Recursos Financeiros, no intuito de formalizar uma Provisão de Caixa.

Na Política Anual de Investimentos/2023 do IPSMGLL foi definido um valor de Provisão de Caixa de R\$ 3.577.822,99 Milhões de reais. Atualmente, a necessidade de Provisão de Caixa do IPSMGLL é de R\$ 1.100.868,61 e o Saldo financeiro da Provisão de Caixa do IPSMGLL está em R\$ 1.606.672,15 Milhões de reais.

7.4.3.2-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - MÉDIO e LONGO PRAZO

O IPSMGLL não possui Fundos de Investimento Aberto com Carência e Fundos de Investimentos de Condomínio Fechados na sua carteira de investimento, possuindo liquidez à qualquer momento de seus recursos financeiros.

De acordo com o Estudo de Duration do Fluxo de Caixa do Plano Previdenciário, informado na Política Anual de Investimentos/2023, o RPPS irá começar a consumir os seus recursos, à partir do ano de 2026.

As Obrigações Previdenciárias a Médio e Longo Prazo do IPSMGLL estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2023 e a sua capacidade e necessidade financeira a Médio e Longo prazo.

As análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Relatório.



Igor França Garcia

Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA

Consultor de Investimentos credenciado pela CVM