

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,41%	8,53%	0,64%	2,92%	9,03%	22,65%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33%	8,23%	0,62%	3,00%	8,84%	22,05%	1,32%	0,02%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,98%	10,98%	-4,11%	3,97%	8,37%	19,37%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	10,64%	-4,17%	3,78%	7,96%	18,56%	4,60%	0,08%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	3,39%	-0,19%	1,79%	4,21%	10,47%	0,48%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	9,25%	2,44%	4,47%	10,11%	24,03%	0,47%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,32%	8,40%	0,37%	2,99%	8,99%	22,58%	1,43%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,66%	10,06%	-1,97%	3,75%	8,97%	21,40%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,72%	9,77%	-2,16%	3,63%	8,60%	20,73%	3,13%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,37%	12,04%	1,31%	6,68%	12,95%	26,45%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,22%	11,88%	1,11%	6,55%	12,59%	27,00%	1,92%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	10,95%	3,15%	6,60%	13,35%	26,71%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	12,67%	2,79%	7,46%	13,41%	26,00%	0,26%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,02%	10,57%	3,25%	6,77%	12,97%	26,43%	0,02%	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,96%	11,01%	3,15%	6,60%	13,36%	26,37%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	10,96%	3,07%	6,61%	13,28%	26,47%	0,02%	0,00%
CAIXA RUBI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,01%	11,12%	3,31%	6,88%	13,57%	26,93%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	-	2,48%	-	-	-	0,48%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,26%	10,64%	1,30%	6,24%	12,00%	24,61%	0,90%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	-	-0,41%	-	-	-	0,48%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,14%	7,91%	0,15%	6,53%	7,12%	22,57%	2,27%	0,05%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,54%	9,85%	2,05%	5,38%	11,49%	24,89%	0,95%	0,01%
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-8,89%	-13,97%	-21,72%	-1,39%	-30,41%	-41,71%	13,09%	0,27%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90%	1,40%	-6,64%	8,29%	-5,16%	2,67%	6,99%	0,19%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	-2,60%	1,96%	-8,11%	6,14%	-5,69%	11,53%	6,75%	0,18%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,74%	5,39%	-9,05%	8,04%	-1,21%	13,64%	9,24%	0,19%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	1,93%	-19,56%	2,20%	-2,79%	6,45%	7,50%	12,58%	0,30%
IBX-50 (Benchmark)	-2,99%	1,78%	-6,48%	8,57%	-2,99%	9,63%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-3,33%	0,25%	-8,14%	6,16%	-8,03%	3,74%	7,43%	0,19%
IDIV (Benchmark)	-3,15%	7,18%	-4,65%	7,57%	6,28%	23,78%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-6,28%	7,38%	-11,39%	5,29%	-0,93%	10,47%	8,83%	0,18%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,01%	6,52%	-5,85%	6,96%	0,57%	16,55%	6,05%	0,17%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-2,20%	9,23%	-8,61%	0,58%	8,31%	-8,94%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	-1,74%	16,17%	-6,94%	4,55%	17,28%	7,68%	7,21%	0,16%
SMLL (Benchmark)	-7,40%	-2,72%	-16,71%	5,49%	-16,24%	-16,19%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-8,56%	-2,77%	-18,23%	6,12%	-17,01%	-17,48%	13,57%	0,26%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-7,45%	-2,95%	-16,62%	4,98%	-16,39%	-17,11%	12,17%	0,25%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,85%	27,41%	-3,16%	16,51%	10,47%	-13,23%	8,85%	18,061%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	20,681%

MSCI WORLD (Benchmark)	-2,00%	3,11%	-3,63%	-1,26%	4,55%	-21,84%	-	-
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-2,43%	2,07%	-1,67%	1,82%	8,77%	-18,73%	6,16%	18,450%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

