

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

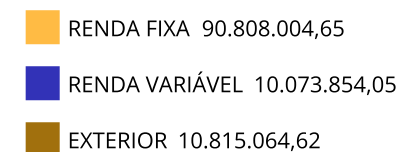
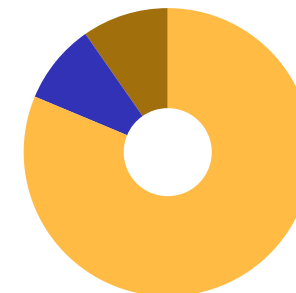
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			4.881.401,94	4,37%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	5.055.545,57	4,53%	665	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.453.154,48	2,20%	826	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.390.233,54	3,93%	594	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.969.820,72	2,66%	1.127	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA F...	D+0	15/05/2025	5.369.535,91	4,81%	203	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	10.678.017,44	9,56%	362	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	8.250.487,96	7,39%	222	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRASESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA...	D+0	15/08/2026	10.059.835,32	9,01%	49	1,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.324.191,74	4,77%	251	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.230.682,01	1,10%	270	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	17/08/2026	6.035.930,46	5,40%	220	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.813.145,24	1,62%	720	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.423.740,23	5,75%	713	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.198.487,64	1,07%	1.157	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	311.947,48	0,28%	1.211	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.399.806,68	3,04%	31	1,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.444.092,29	3,08%	556	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.829.299,11	4,32%	1.066	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRASESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIX...	D+5 du	Não há	2.688.648,89	2,41%	136	0,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.465.701,78	2,21%	2.327	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.293.680,63	1,16%	21.298	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.705.468,65	2,42%	2.274	1,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.040.516,13	2,72%	120	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	568.486,86	0,51%	45	0,76%	Artigo 8º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.548.878,74	3,18%	10.650	0,40%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	7.266.185,88	6,51%	441	0,28%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			111.696.923,32				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2024)

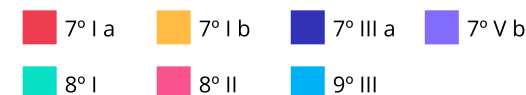
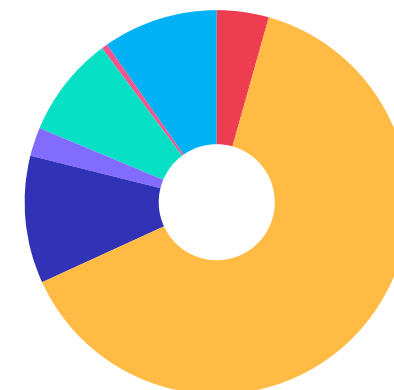
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	4.881.401,94	4,37%	0,00%	10,00%	20,00%	17.457.982,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	71.252.808,26	63,79%	15,00%	45,00%	95,00%	34.859.268,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	11.985.145,56	10,73%	10,00%	15,00%	55,00%	49.448.162,27
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	22.339.384,66
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.584.846,17
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	2.688.648,89	2,41%	0,00%	0,00%	5,00%	2.896.197,28
Total Renda Fixa	100,00%	90.808.004,65	81,30%	25,00%	75,00%	200,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	9.505.367,19	8,51%	5,00%	10,00%	30,00%	24.003.709,81
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	568.486,86	0,51%	0,50%	2,00%	30,00%	32.940.590,14
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	10,00%	11.169.692,33
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.584.846,17
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.584.846,17
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.073.854,05	9,02%	10,50%	20,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	10.815.064,62	9,68%	3,00%	5,00%	10,00%	354.627,71
Total Exterior	10,00%	10.815.064,62	9,68%	3,00%	5,00%	10,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	4.881.401,94	4,37	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	71.252.808,26	63,79	15,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	11.985.145,56	10,73	10,00	55,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	2.688.648,89	2,41	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	9.505.367,19	8,51	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	568.486,86	0,51	0,50	30,00
Artigo 9º, Inciso III	10.815.064,62	9,68	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	46.787.004,25	41,89	-
CAIXA DTVM	35.111.942,21	31,44	0,17
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	24.916.574,92	22,31	0,41
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	4.881.401,94	4,37	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	7,18%	2,04%	4,38%	9,65%	21,10%	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	0,50%	-	-	-	-	-	0,80%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,50%	-	1,81%	-	-	-	0,80%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	1,04%	-	2,72%	-	-	-	0,31%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	3,90%	1,89%	2,11%	7,25%	19,41%	1,13%	2,73%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,39%	5,01%	1,75%	2,72%	8,05%	20,40%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	5,06%	1,89%	2,95%	8,09%	20,22%	0,82%	1,82%
IMA Geral (Benchmark)	0,34%	4,99%	2,51%	3,30%	8,98%	22,61%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,30%	4,61%	2,42%	3,08%	8,30%	21,18%	0,77%	1,94%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,82%	7,18%	2,55%	4,60%	10,28%	25,21%	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,81%	7,06%	2,51%	4,50%	10,07%	24,73%	0,15%	0,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,81%	7,10%	2,50%	4,52%	10,13%	24,79%	0,14%	0,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	6,98%	2,47%	4,44%	9,98%	24,49%	0,14%	0,41%
IMA-B (Benchmark)	-0,67%	0,82%	1,94%	0,64%	5,61%	17,28%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69%	0,60%	1,84%	0,49%	5,34%	16,66%	1,86%	3,95%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,69%	0,63%	1,88%	0,50%	5,37%	16,71%	1,87%	3,95%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
BRADESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,50%	-	-	-	-	-	0,80%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	6,66%	2,71%	4,15%	9,77%	24,69%	0,18%	0,65%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,84%	8,11%	2,73%	5,33%	11,17%	26,08%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,86%	8,25%	2,74%	5,38%	11,42%	26,66%	0,02%	0,06%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,81%	7,80%	2,57%	5,10%	10,80%	25,40%	0,00%	0,04%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,89%	8,67%	2,82%	5,58%	11,94%	27,59%	0,02%	0,10%
IPCA (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,53%	4,59%	2,18%	2,74%	7,65%	21,45%	0,56%	1,34%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO...	0,92%	9,18%	2,95%	5,83%	12,70%	28,94%	0,05%	0,15%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	8,93%	15,69%

Ibovespa (Benchmark)	-3,08%	-1,77%	6,38%	2,90%	13,08%	19,79%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-1,74%	-6,42%	7,13%	0,67%	6,02%	2,69%	6,34%	13,17%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-2,53%	-1,67%	6,29%	2,90%	12,91%	19,47%	5,95%	12,46%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,17%	-3,36%	5,99%	0,22%	10,50%	11,68%	5,59%	13,08%

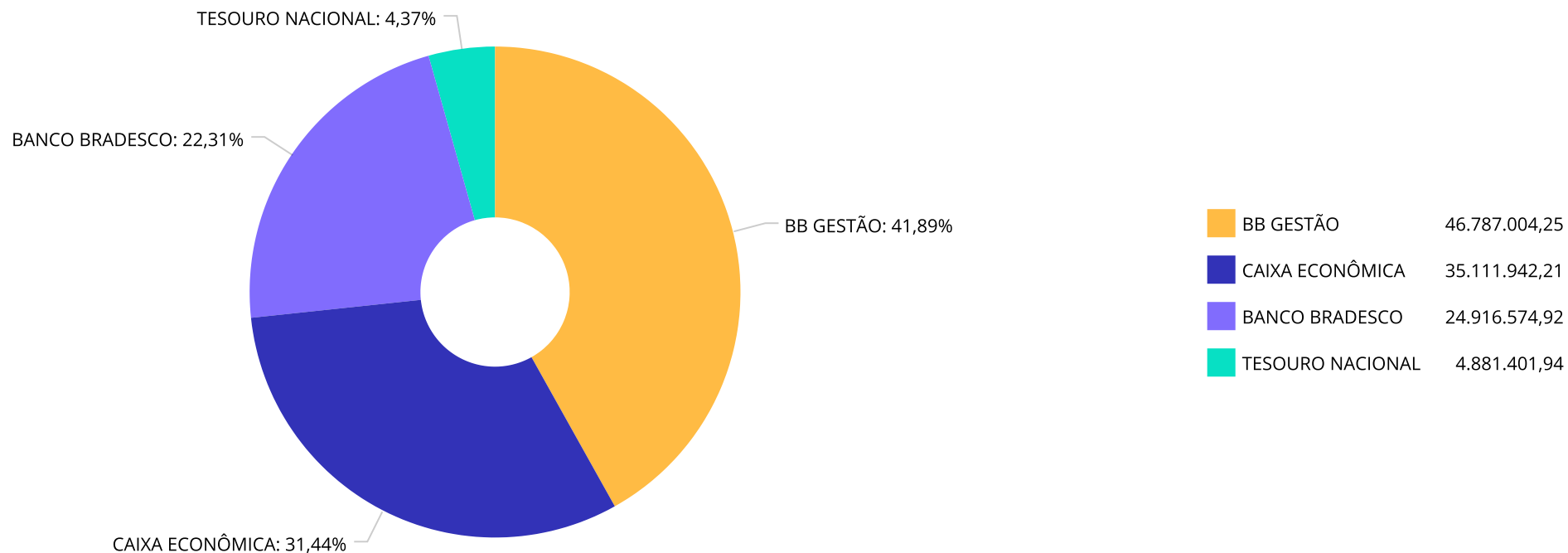
IDIV (Benchmark)	-0,72%	4,25%	7,93%	8,38%	19,48%	36,40%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,88%	0,54%	6,79%	-1,44%	12,01%	25,23%	5,13%	14,60%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,78%	3,31%	7,45%	7,59%	17,87%	32,87%	5,39%	11,38%

MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-1,61%	35,42%	3,76%	19,62%	46,09%	60,22%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,09%	30,58%	0,80%	14,89%	40,17%	60,67%	7,93%	15,47%

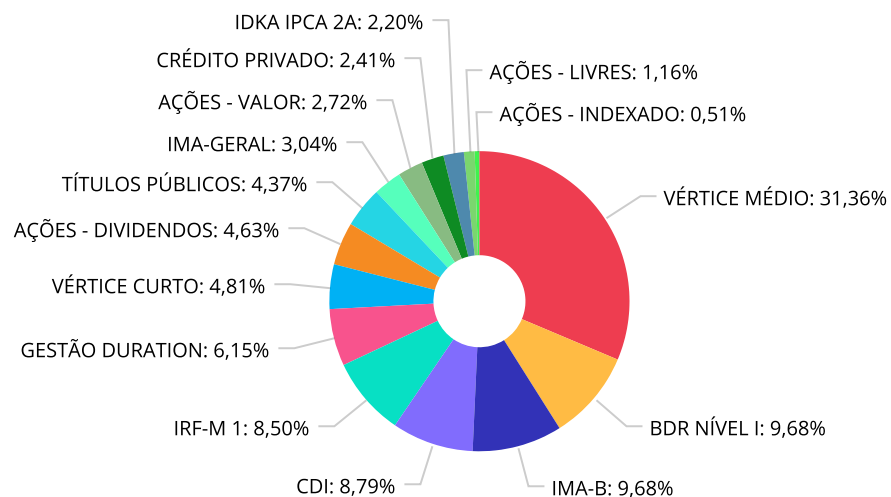
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-1,61%	35,42%	3,76%	19,62%	46,09%	60,22%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,09%	30,57%	0,80%	14,89%	40,17%	60,67%	7,93%	15,469%
Global BDRX (Benchmark)	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	8,93%	15,691%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2024)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2024)



■ VÉRTICE MÉDIO	35.024.271,18	■ BDR NÍVEL I	10.815.064,62	■ IMA-B	10.813.973,77	■ CDI	9.816.020,89
■ IRF-M 1	9.492.500,10	■ GESTÃO DURATION	6.868.690,81	■ VÉRTICE CURTO	5.369.535,91	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	5.171.170,43
■ TÍTULOS PÚBLICOS	4.881.401,94	■ IMA-GERAL	3.399.806,68	■ AÇÕES - VALOR	3.040.516,13	■ CRÉDITO PRIVADO	2.688.648,89
■ IDKA IPCA 2A	2.453.154,48	■ AÇÕES - LIVRES	1.293.680,63	■ AÇÕES - INDEXADO	568.486,86		

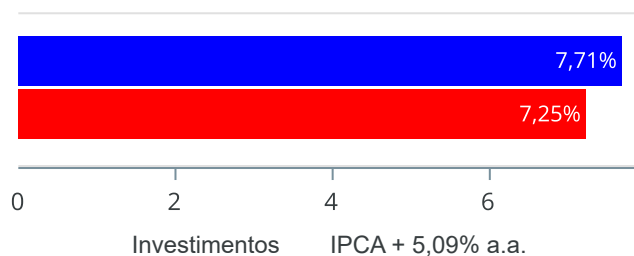
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	22/08/2024	1.142	4.377,581585	4.274,432518	4.999.198,17	4.881.401,94	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	92.141.841,35	1.415.755,11	1.130.000,00	93.002.168,15	574.571,69	574.571,69	0,62%	0,62%	0,86%	0,86%	72,61%	1,38%
Fevereiro	93.002.168,15	5.289.293,95	4.964.766,14	94.494.979,61	1.168.283,65	1.742.855,34	1,25%	1,88%	1,21%	2,07%	90,68%	1,74%
Março	94.494.979,61	2.844.614,81	4.362.646,00	93.720.327,82	743.379,40	2.486.234,74	0,79%	2,68%	0,56%	2,64%	101,56%	1,34%
Abril	93.720.327,82	3.483.875,07	3.220.346,26	93.703.726,53	-280.130,10	2.206.104,64	-0,30%	2,38%	0,82%	3,48%	68,31%	1,95%
Mai	93.703.726,53	15.864.331,82	14.988.285,16	95.605.978,94	1.026.205,75	3.232.310,39	1,09%	3,49%	0,88%	4,39%	79,51%	1,51%
Junho	95.605.978,94	6.079.538,32	1.167.851,36	102.178.811,83	1.661.145,93	4.893.456,32	1,65%	5,20%	0,61%	5,02%	103,57%	1,89%
Julho	102.178.811,83	3.583.826,49	1.145.600,00	105.780.561,34	1.163.523,02	6.056.979,34	1,11%	6,37%	0,84%	5,90%	108,00%	2,01%
Agosto	105.780.561,34	56.911.554,97	55.128.634,29	108.831.286,10	1.267.804,08	7.324.783,42	1,18%	7,62%	0,41%	6,33%	120,31%	2,54%
Setembro	108.831.286,10	1.491.550,86	1.141.100,00	109.267.753,67	86.016,71	7.410.800,13	0,08%	7,71%	0,86%	7,25%	106,36%	1,96%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



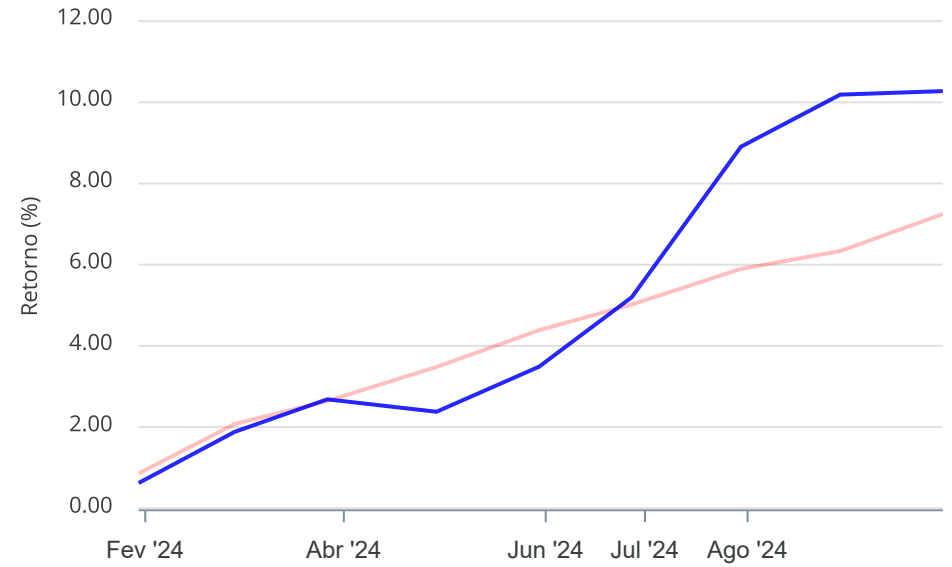
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	5.314.421,13	0,00	0,00	5.369.535,91	55.114,78	1,04%	1,04%	0,31%
BRDESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA ...	2.664.179,80	0,00	0,00	2.688.648,89	24.469,09	0,92%	0,92%	0,05%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.413.879,49	0,00	0,00	3.444.092,29	30.212,80	0,88%	0,88%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.788.347,35	0,00	0,00	4.829.299,11	40.951,76	0,86%	0,86%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	309.343,56	0,00	0,00	311.947,48	2.603,92	0,84%	0,84%	0,01%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.281.310,66	0,00	0,00	5.324.191,74	42.881,08	0,81%	0,81%	0,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.188.897,31	0,00	0,00	1.198.487,64	9.590,33	0,81%	0,81%	0,14%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.291.352,29	0,00	71.000,00	1.230.682,01	10.329,72	0,80%	0,81%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	5.020.063,36	0,00	0,00	5.055.545,57	35.482,21	0,71%	0,71%	0,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.594.639,40	1.491.550,86	1.141.100,00	2.969.820,72	24.730,46	0,61%	0,80%	0,14%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.803.684,01	0,00	0,00	1.813.145,24	9.461,23	0,52%	0,52%	0,56%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	6.005.913,26	0,00	0,00	6.035.930,46	30.017,20	0,50%	0,50%	0,80%
BRDESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA F...	10.010.012,72	0,00	0,00	10.059.835,32	49.822,60	0,50%	0,50%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	10.625.230,74	0,00	0,00	10.678.017,44	52.786,70	0,50%	0,50%	0,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.441.496,08	0,00	0,00	2.453.154,48	11.658,40	0,48%	0,48%	0,82%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.389.496,11	0,00	0,00	3.399.806,68	10.310,57	0,30%	0,30%	0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	8.225.537,88	0,00	0,00	8.250.487,96	24.950,08	0,30%	0,30%	1,13%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.420.546,08	0,00	0,00	4.390.233,54	-30.312,54	-0,69%	-0,69%	1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.468.243,69	0,00	0,00	6.423.740,23	-44.503,46	-0,69%	-0,69%	1,87%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.939.910,79	0,00	0,00	4.881.401,94	-58.508,85	-1,18%	-	-

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	90.196.505,71	1.491.550,86	1.212.100,00	90.808.004,65	332.048,08	0,37%		0,71%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.726.819,67	0,00	0,00	2.705.468,65	-21.351,02	-0,78%	-0,78%	5,39%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.316.518,67	0,00	0,00	1.293.680,63	-22.838,04	-1,73%	-1,73%	6,34%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.512.914,56	0,00	0,00	2.465.701,78	-47.212,78	-1,88%	-1,88%	5,13%
CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA FI AÇÕES	583.231,66	0,00	0,00	568.486,86	-14.744,80	-2,53%	-2,53%	5,95%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.139.918,78	0,00	0,00	3.040.516,13	-99.402,65	-3,17%	-3,17%	5,59%
Total Renda Variável	10.279.403,34	0,00	0,00	10.073.854,05	-205.549,29	-2,00%		5,54%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Setembro / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.545.795,70	0,00	0,00	3.548.878,74	3.083,04	0,09%	0,09%	7,93%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.289.830,95	0,00	0,00	7.266.185,88	-23.645,07	-0,32%	-0,32%	8,93%
Total Exterior	10.835.626,65	0,00	0,00	10.815.064,62	-20.562,03	-0,19%		8,60%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	15.562.971,69	0,00	15.799.189,82	0,00	236.218,13	1,52%	2,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	10.256.290,02	0,00	10.413.398,52	0,00	157.108,50	1,53%	2,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	5.860.993,78	2.244.826,49	0,00	8.250.487,96	144.667,69	1,78%	1,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	5.227.429,86	0,00	0,00	5.369.535,91	142.106,05	2,72%	2,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.921.997,82	0,00	0,00	5.055.545,57	133.547,75	2,71%	2,71%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.194.035,15	0,00	0,00	5.324.191,74	130.156,59	2,51%	2,51%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.700.741,26	0,00	0,00	4.829.299,11	128.557,85	2,73%	2,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	4.695.360,51	6.000.000,00	137.646,21	10.678.017,44	120.303,14	1,12%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.305.401,91	0,00	0,00	6.423.740,23	118.338,32	1,88%	1,88%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.541.547,70	29.780.909,58	30.459.983,88	2.969.820,72	107.347,32	0,32%	2,47%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.019.363,52	1.339.000,00	0,00	3.444.092,29	85.728,77	2,55%	2,82%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.319.433,68	0,00	0,00	3.399.806,68	80.373,00	2,42%	2,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.310.771,48	0,00	0,00	4.390.233,54	79.462,06	1,84%	1,84%
BRDESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA F...	0,00	10.000.000,00	0,00	10.059.835,32	59.835,32	0,60%	-
BRDESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA ...	1.009.476,50	1.622.998,08	0,00	2.688.648,89	56.174,31	2,13%	2,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.407.694,91	0,00	0,00	2.453.154,48	45.459,57	1,89%	1,89%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.774.452,69	0,00	0,00	1.813.145,24	38.692,55	2,18%	2,18%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	0,00	6.000.000,00	0,00	6.035.930,46	35.930,46	0,60%	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.404.227,71	0,00	207.275,78	1.230.682,01	33.730,08	2,40%	2,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.169.206,85	0,00	0,00	1.198.487,64	29.280,79	2,50%	2,50%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	596.395,27	0,00	605.115,86	0,00	8.720,59	1,46%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	303.657,11	0,00	0,00	311.947,48	8.290,37	2,73%	2,73%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	4.999.198,17	0,00	4.881.401,94	-117.796,23	-2,36%	-
Total Renda Fixa	84.581.449,42	61.986.932,32	57.622.610,07	90.808.004,65	1.862.232,98	2,09%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.517.834,97	0,00	0,00	2.705.468,65	187.633,68	7,45%	7,45%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.868.713,59	0,00	0,00	3.040.516,13	171.802,54	5,99%	5,99%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.309.009,41	0,00	0,00	2.465.701,78	156.692,37	6,79%	6,79%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.207.596,90	0,00	0,00	1.293.680,63	86.083,73	7,13%	7,13%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	534.835,62	0,00	0,00	568.486,86	33.651,24	6,29%	6,29%
Total Renda Variável	9.437.990,49	0,00	0,00	10.073.854,05	635.863,56	6,74%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2024

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.212.203,20	0,00	0,00	7.266.185,88	53.982,68	0,75%	0,75%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.520.603,28	0,00	0,00	3.548.878,74	28.275,46	0,80%	0,80%
Total Exterior	10.732.806,48	0,00	0,00	10.815.064,62	82.258,14	0,77%	

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 & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

