

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

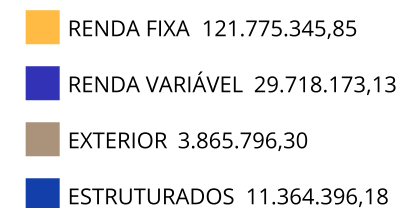
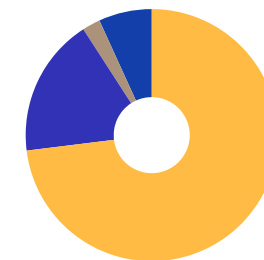
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.833.562,71	4,10%	665	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.847.839,64	5,31%	594	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.225.974,92	4,33%	1.127	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	3.637.280,69	2,18%	222	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	15/08/2028	9.927.631,64	5,95%	72	1,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	17/08/2026	5.031.649,23	3,02%	220	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP...	D+0	17/05/2027	5.014.623,90	3,01%	60	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	3.984.128,27	2,39%	151	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.917.671,90	1,75%	1.157	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.070,76	0,00%	1.037	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	12.023.694,39	7,21%	1.211	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.339.897,93	6,80%	556	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.158.734,62	8,49%	506	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.124.737,93	1,87%	519	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	23.854.171,37	14,31%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	1.836.397,62	1,10%	80	1,41%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	2.015.278,33	1,21%	721	0,73%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.640.869,94	2,18%	1.115	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.907.613,50	2,34%	2.327	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.456.131,40	3,27%	838	1,03%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	7.609.447,09	4,56%	195	0,96%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.705.646,53	1,02%	4.584	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
MAG BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.113.444,25	1,87%	1.378	1,06%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.001.327,33	1,20%	833	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	2.283.693,09	1,37%	3.581	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL...	D+2 du	Não há	916.374,27	0,55%	1.880	1,61%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.949.422,03	1,77%	441	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.604.813,24	1,56%	161	0,82%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.309.648,13	1,39%	97	0,52%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	6.449.934,81	3,87%	2.075	0,70%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			166.723.711,46				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	13,95%	21,80%	36.345.769,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	53.420.362,90	32,04%	6,98%	13,97%	100,00%	113.303.348,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	40.649.135,63	24,38%	6,98%	13,97%	27,93%	5.916.796,98
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	23.854.171,37	14,31%	0,00%	13,97%	20,00%	9.490.570,92
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,27%	5,00%	8.336.185,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	3.851.675,95	2,31%	0,00%	2,28%	5,00%	4.484.509,62
Total Renda Fixa	100,00%	121.775.345,85	73,04%	13,96%	58,41%	179,73%	



ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º & 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

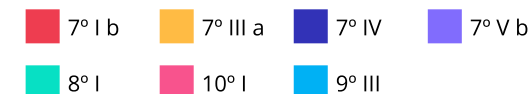
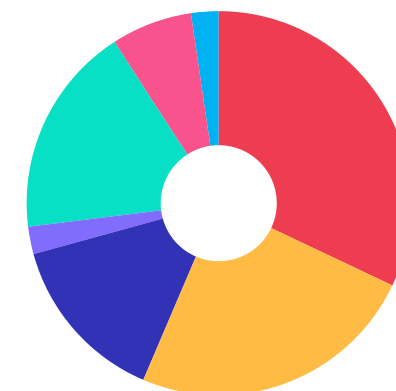


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	29.718.173,13	17,82%	0,00%	19,00%	35,00%	28.635.125,88
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	58.353.299,01
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	11.364.396,18	6,82%	0,00%	10,00%	10,00%	5.307.974,97
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.336.185,57
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,45%	5,00%	8.336.185,57
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	41.082.569,31	24,64%	0,00%	32,45%	90,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,57%	10,00%	16.672.371,15
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.865.796,30	2,32%	0,00%	3,57%	10,00%	12.806.574,85
Total Exterior	10,00%	3.865.796,30	2,32%	0,00%	7,14%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	16.672.371,15



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	0,00	0,00	0,00	21,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	53.420.362,90	32,04	6,98	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	40.649.135,63	24,38	6,98	27,93
Artigo 7º, Inciso IV	23.854.171,37	14,31	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	3.851.675,95	2,31	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	29.718.173,13	17,82	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.865.796,30	2,32	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	11.364.396,18	6,82	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	69.351.067,17	41,60	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	49.640.094,06	29,77	-
ITAÚ UNIBANCO	23.854.171,37	14,31	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.339.897,93	6,80	-
SOMMA INVESTIMENTOS	5.128.722,58	3,08	-
SICREDI	3.124.737,93	1,87	-
GENIAL INVESTIMENTOS	2.283.693,09	1,37	-
OCCAM BRASIL	2.001.327,33	1,20	-

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 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,12%	-3,38%	-1,19%	-1,63%	0,28%	-	1,74%	5,27%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	0,50%	-	-	-	-	-	0,80%	-
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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,93%	7,95%	2,28%	4,87%	10,69%	23,42%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,39%	4,95%	2,02%	2,88%	8,14%	20,92%	0,90%	1,92%
IMA Geral (Benchmark)	0,34%	4,99%	2,51%	3,30%	8,98%	22,61%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	4,80%	2,44%	3,15%	8,76%	22,35%	0,79%	1,78%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,82%	7,18%	2,55%	4,60%	10,28%	25,21%	-	-
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%
IRF-M (Benchmark)	0,34%	3,90%	2,36%	2,19%	8,45%	23,17%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,27%	3,47%	2,11%	1,77%	7,96%	22,36%	1,41%	2,85%

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%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,89%	8,67%	2,82%	5,58%	11,94%	27,59%	0,02%	0,10%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,19%	2,38%	4,70%	9,96%	23,52%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	8,08%	2,70%	5,24%	11,26%	26,47%	0,03%	0,10%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,99%	9,45%	3,16%	5,69%	13,06%	26,41%	0,12%	0,54%
IPCA (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	0,32%	-	-	-	-	-	1,12%	-

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
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,49%	1,36%	2,27%	0,28%	6,43%	16,65%	2,22%	4,68%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,79%	6,78%	2,42%	4,35%	9,70%	23,63%	0,08%	0,40%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,50%	5,83%	2,97%	3,46%	9,67%	23,14%	0,35%	1,56%
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%	-	-
MAG BRASIL FI AÇÕES	-3,26%	-3,16%	5,87%	1,23%	10,13%	7,86%	5,53%	12,19%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,87%	-6,13%	2,84%	-2,02%	6,45%	16,68%	5,16%	12,22%
OCCAM FIC AÇÕES	-3,52%	-4,42%	3,61%	-0,29%	8,32%	8,91%	4,86%	11,57%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,70%	-3,95%	3,95%	0,33%	9,85%	9,84%	5,58%	12,70%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,05%	-0,39%	6,95%	-1,23%	13,96%	26,32%	6,56%	15,64%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,06%	-6,56%	3,12%	-3,79%	3,20%	4,83%	5,85%	13,69%
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%
SMLL (Benchmark)	-4,41%	-13,67%	1,39%	-9,99%	-3,75%	-6,59%	-	-

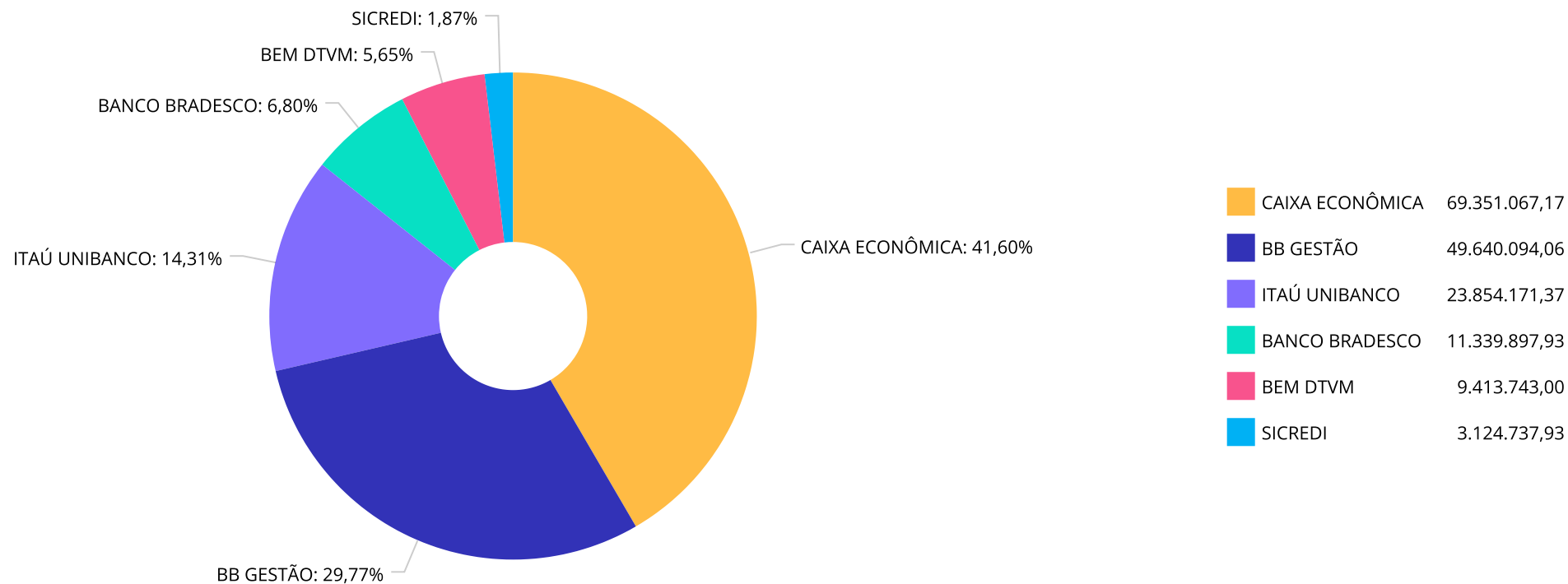
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-4,57%	-14,25%	1,02%	-10,43%	-4,77%	-7,85%	8,15%	19,37%

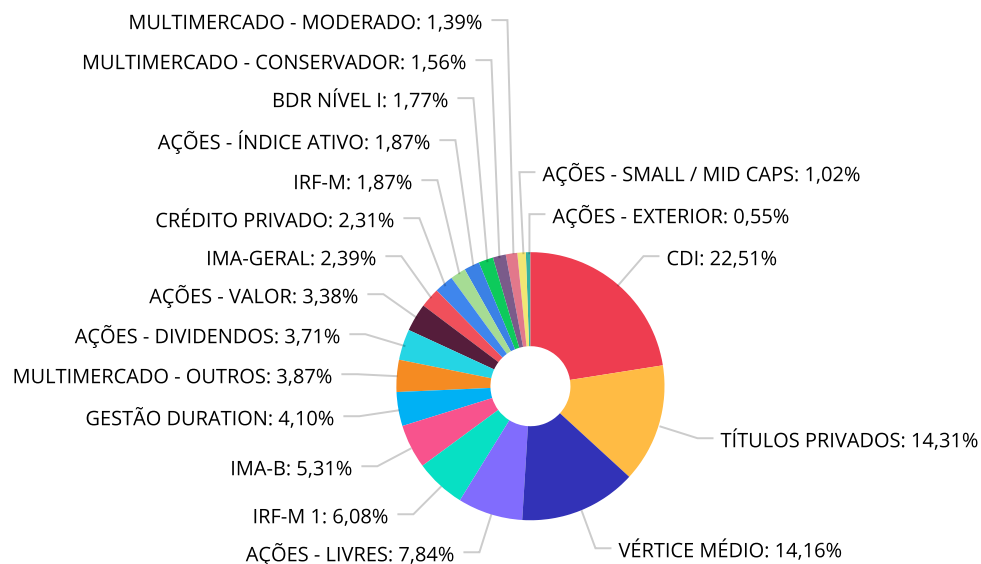
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI AC Asia ex Japan (Benchmark)	4,21%	33,73%	7,26%	27,38%	37,20%	37,69%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I FIC AÇÕES	6,85%	17,97%	7,98%	14,56%	24,31%	40,74%	10,83%	15,388%
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)

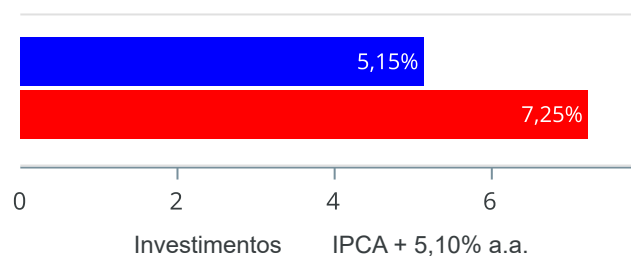


CDI	37.524.397,70	TÍTULOS PRIVADOS	23.854.171,37	VÉRTICE MÉDIO	23.611.185,46	AÇÕES - LIVRES	13.065.578,49
IRF-M 1	10.143.646,82	IMA-B	8.847.839,64	GESTÃO DURATION	6.833.562,71	MULTIMERCADO - OUTROS	6.449.934,81
AÇÕES - DIVIDENDOS	6.191.306,59	AÇÕES - VALOR	5.642.197,27	IMA-GERAL	3.984.128,27	CRÉDITO PRIVADO	3.851.675,95
IRF-M	3.124.737,93	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.113.444,25	BDR NÍVEL I	2.949.422,03	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.604.813,24
MULTIMERCADO - MODERADO	2.309.648,13	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.705.646,53	AÇÕES - EXTERIOR	916.374,27		

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	156.677.116,96	7.439.614,90	5.717.501,31	158.413.249,35	14.018,80	14.018,80	0,01%	0,01%	0,86%	0,86%	1,03%	1,93%
Fevereiro	158.413.249,35	2.178.393,53	2.080.870,21	160.152.420,30	1.641.647,63	1.655.666,43	1,04%	1,04%	1,21%	2,08%	50,31%	2,44%
Março	160.152.420,30	1.723.986,25	1.405.972,51	161.734.958,76	1.264.524,72	2.920.191,15	0,79%	1,84%	0,56%	2,64%	69,62%	1,56%
Abril	161.734.958,76	20.891.694,90	20.650.891,79	160.785.306,87	-1.190.455,00	1.729.736,15	-0,73%	1,09%	0,82%	3,48%	31,37%	2,41%
Mai	160.785.306,87	7.390.495,36	8.257.353,23	160.595.943,87	677.494,87	2.407.231,02	0,42%	1,52%	0,88%	4,39%	34,58%	1,94%
Junho	160.595.943,87	3.317.758,34	2.694.983,55	162.783.965,31	1.565.246,65	3.972.477,67	0,97%	2,50%	0,61%	5,02%	49,85%	2,37%
Julho	162.783.965,31	1.574.017,13	1.340.528,91	164.920.833,43	1.903.379,90	5.875.857,57	1,17%	3,70%	0,84%	5,90%	62,70%	2,26%
Agosto	164.920.833,43	22.139.866,17	22.316.266,51	167.408.799,37	2.664.366,28	8.540.223,85	1,62%	5,38%	0,42%	6,34%	84,77%	2,56%
Setembro	167.408.799,37	1.309.392,14	1.636.963,43	166.723.711,46	-357.516,62	8.182.707,23	-0,21%	5,15%	0,86%	7,25%	71,02%	1,95%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



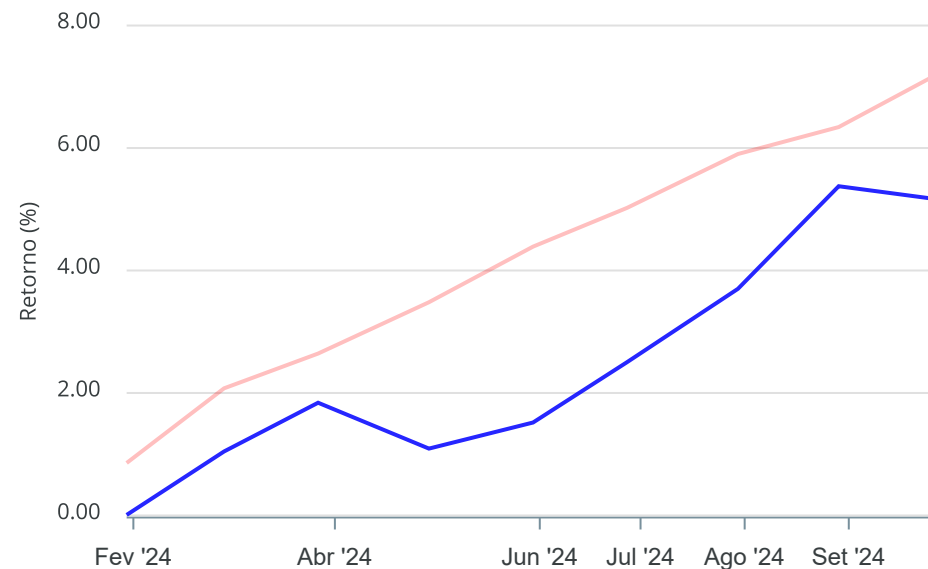
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1.995.547,74	0,00	0,00	2.015.278,33	19.730,59	0,99%	0,99%	0,12%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.240.420,32	0,00	0,00	11.339.897,93	99.477,61	0,88%	0,88%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	14.695.923,63	109.131,81	771.539,69	14.158.734,62	125.218,87	0,85%	0,85%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	11.923.328,94	0,00	0,00	12.023.694,39	100.365,45	0,84%	0,84%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.894.324,63	0,00	0,00	2.917.671,90	23.347,27	0,81%	0,81%	0,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.834.313,11	335.179,89	0,00	7.225.974,92	56.481,92	0,79%	0,80%	0,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.785.601,54	0,00	0,00	6.833.562,71	47.961,17	0,71%	0,71%	0,18%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	23.733.012,72	0,00	0,00	23.854.171,37	121.158,65	0,51%	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	5.006.626,41	0,00	0,00	5.031.649,23	25.022,82	0,50%	0,50%	0,80%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.829.182,75	0,00	0,00	1.836.397,62	7.214,87	0,39%	0,39%	0,90%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	0,00	529.928,63	532.000,65	0,00	2.072,02	0,39%	0,75%	0,00%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP L...	4.998.796,27	0,00	0,00	5.014.623,90	15.827,63	0,32%	0,32%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	3.972.014,78	0,00	0,00	3.984.128,27	12.113,49	0,30%	0,30%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.626.281,29	0,00	0,00	3.637.280,69	10.999,40	0,30%	0,30%	1,13%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	3.116.247,37	0,00	0,00	3.124.737,93	8.490,56	0,27%	0,27%	1,41%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	335.151,81	333.423,09	2.070,76	342,04	0,10%	0,75%	0,01%
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.939.245,73	0,00	0,00	9.927.631,64	-11.614,09	-0,12%	-0,12%	1,74%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.908.929,90	0,00	0,00	8.847.839,64	-61.090,26	-0,69%	-0,69%	1,86%
Total Renda Fixa	121.499.797,13	1.309.392,14	1.636.963,43	121.775.345,85	603.120,01	0,50%		0,62%

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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	6.399.610,55	0,00	0,00	6.449.934,81	50.324,26	0,79%	0,79%	0,08%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.591.766,33	0,00	0,00	2.604.813,24	13.046,91	0,50%	0,50%	0,35%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.320.994,36	0,00	0,00	2.309.648,13	-11.346,23	-0,49%	-0,49%	2,22%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.982.435,72	0,00	0,00	3.907.613,50	-74.822,22	-1,88%	-1,88%	5,13%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	7.848.842,51	0,00	0,00	7.609.447,09	-239.395,42	-3,05%	-3,05%	6,56%
MAG BRASIL FI AÇÕES	3.218.286,05	0,00	0,00	3.113.444,25	-104.841,80	-3,26%	-3,26%	5,53%
OCCAM FIC AÇÕES	2.074.383,19	0,00	0,00	2.001.327,33	-73.055,86	-3,52%	-3,52%	4,86%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.780.634,11	0,00	0,00	3.640.869,94	-139.764,17	-3,70%	-3,70%	5,58%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5.687.276,69	0,00	0,00	5.456.131,40	-231.145,29	-4,06%	-4,06%	5,85%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.787.398,73	0,00	0,00	1.705.646,53	-81.752,20	-4,57%	-4,57%	8,15%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.400.698,27	0,00	0,00	2.283.693,09	-117.005,18	-4,87%	-4,87%	5,16%
Total Renda Variável	42.092.326,51	0,00	0,00	41.082.569,31	-1.009.757,20	-2,40%		4,42%

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 BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I...	857.655,91	0,00	0,00	916.374,27	58.718,36	6,85%	6,85%	10,83%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.959.019,82	0,00	0,00	2.949.422,03	-9.597,79	-0,32%	-0,32%	8,93%
Total Exterior	3.816.675,73	0,00	0,00	3.865.796,30	49.120,57	1,29%		9,38%

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
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	23.362.105,28	0,00	0,00	23.854.171,37	492.066,09	2,11%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	11.292.353,78	5.882.695,44	3.363.403,26	14.158.734,62	347.088,66	2,02%	2,70%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.028.756,01	0,00	0,00	11.339.897,93	311.141,92	2,82%	2,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	9.412.752,58	2.316.438,36	0,00	12.023.694,39	294.503,45	2,51%	2,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.653.046,71	0,00	0,00	6.833.562,71	180.516,00	2,71%	2,71%
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.046.779,36	0,00	287.618,57	9.927.631,64	168.470,85	1,68%	-1,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.687.696,08	0,00	0,00	8.847.839,64	160.143,56	1,84%	1,84%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.163.384,60	0,00	9.303.548,53	0,00	140.163,93	1,53%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.251.697,92	2.835.179,89	0,00	7.225.974,92	139.097,11	1,96%	2,47%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	3.889.274,56	0,00	0,00	3.984.128,27	94.853,71	2,44%	2,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.569.715,15	0,00	0,00	3.637.280,69	67.565,54	1,89%	1,89%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	3.060.247,86	0,00	0,00	3.124.737,93	64.490,07	2,11%	2,11%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1.953.641,29	0,00	0,00	2.015.278,33	61.637,04	3,15%	3,15%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.245.655,47	0,00	3.294.877,24	0,00	49.221,77	1,52%	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.800.021,58	0,00	0,00	1.836.397,62	36.376,04	2,02%	2,02%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.031.649,23	31.649,23	0,63%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	2.886.044,36	0,00	2.917.671,90	31.627,54	1,10%	2,50%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP L...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.014.623,90	14.623,90	0,29%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	0,00	529.928,63	532.000,65	0,00	2.072,02	0,39%	2,36%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.328,60	572.988,76	574.706,23	2.070,76	459,63	0,08%	2,38%

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
Total Renda Fixa	111.420.456,83	25.023.275,44	17.356.154,48	121.775.345,85	2.687.768,06	2,26%	

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 BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	7.115.276,76	0,00	0,00	7.609.447,09	494.170,33	6,95%	6,95%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.659.289,38	0,00	0,00	3.907.613,50	248.324,12	6,79%	6,79%
MAG BRASIL FI AÇÕES	2.940.894,68	0,00	0,00	3.113.444,25	172.549,57	5,87%	5,87%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5.291.140,12	0,00	0,00	5.456.131,40	164.991,28	3,12%	3,12%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	6.297.687,87	0,00	0,00	6.449.934,81	152.246,94	2,42%	2,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.502.483,21	0,00	0,00	3.640.869,94	138.386,73	3,95%	3,95%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.991.804,37	0,00	2.500.000,00	2.604.813,24	113.008,87	2,26%	2,97%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.707.470,73	0,00	1.500.000,00	2.309.648,13	102.177,40	2,76%	2,27%
OCCAM FIC AÇÕES	1.931.518,35	0,00	0,00	2.001.327,33	69.808,98	3,61%	3,61%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.220.706,64	0,00	0,00	2.283.693,09	62.986,45	2,84%	2,84%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.688.489,03	0,00	0,00	1.705.646,53	17.157,50	1,02%	1,02%
Total Renda Variável	43.346.761,14	0,00	4.000.000,00	41.082.569,31	1.735.808,17	4,00%	

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
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I...	848.684,76	0,00	0,00	916.374,27	67.689,51	7,98%	7,98%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.927.509,89	0,00	0,00	2.949.422,03	21.912,14	0,75%	0,75%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.644.068,68	0,00	1.518.152,98	0,00	-125.915,70	-7,66%	0,80%
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.596.484,01	0,00	2.419.451,39	0,00	-177.032,62	-6,82%	-1,76%
Total Exterior	8.016.747,34	0,00	3.937.604,37	3.865.796,30	-213.346,67	-2,66%	

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.

