

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 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	6.884.695,76	4,08%	657	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.788.471,01	5,21%	566	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.284.994,14	4,32%	1.131	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	3.661.342,72	2,17%	222	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	15/08/2028	9.962.224,64	5,90%	73	1,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	17/08/2026	5.076.440,93	3,01%	227	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP...	D+0	17/05/2027	5.048.517,29	2,99%	61	1,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	3.997.909,02	2,37%	144	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.941.756,30	1,74%	1.158	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.127,92	0,00%	1.030	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	12.468.312,33	7,39%	1.235	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.445.089,87	6,78%	584	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.242.043,47	9,03%	516	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.129.957,25	1,85%	480	0,59%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	24.056.948,58	14,25%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	1.849.895,86	1,10%	76	1,52%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	2.032.411,35	1,20%	739	0,71%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.588.095,12	2,13%	1.098	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.855.601,98	2,28%	2.275	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.373.654,98	3,18%	822	1,04%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 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	7.691.490,90	4,56%	194	0,96%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.679.782,61	1,00%	4.452	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
MAG BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.061.474,83	1,81%	1.342	1,06%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.970.491,28	1,17%	790	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	2.242.958,33	1,33%	3.511	0,51%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL...	D+2 du	Não há	891.282,07	0,53%	2.011	1,60%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.123.978,58	1,85%	442	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.616.550,85	1,55%	160	0,82%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.303.264,56	1,36%	95	0,56%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	6.507.955,82	3,86%	2.006	0,71%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			168.778.720,35				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 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%	36.793.761,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	53.646.351,81	31,79%	6,98%	13,97%	100,00%	115.132.368,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	42.286.530,84	25,05%	6,98%	13,97%	27,93%	4.853.365,75
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	24.056.948,58	14,25%	0,00%	13,97%	20,00%	9.698.795,49
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,27%	5,00%	8.438.936,02
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	3.882.307,21	2,30%	0,00%	2,28%	5,00%	4.556.628,81
Total Renda Fixa	100,00%	123.872.138,44	73,39%	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 (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 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%	29.463.550,03	17,46%	0,00%	19,00%	35,00%	29.609.002,09
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	59.072.552,12
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	11.427.771,23	6,77%	0,00%	10,00%	10,00%	5.450.100,81
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.438.936,02
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,45%	5,00%	8.438.936,02
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	40.891.321,26	24,23%	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%	16.877.872,04
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.015.260,65	2,38%	0,00%	3,57%	10,00%	12.862.611,39
Total Exterior	10,00%	4.015.260,65	2,38%	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%	16.877.872,04

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	53.646.351,81	31,79	6,98	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	42.286.530,84	25,05	6,98	27,93
Artigo 7º, Inciso IV	24.056.948,58	14,25	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	3.882.307,21	2,30	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	29.463.550,03	17,46	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	4.015.260,65	2,38	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	11.427.771,23	6,77	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 (Outubro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	70.798.914,96	41,95	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	50.040.473,90	29,65	-
ITAÚ UNIBANCO	24.056.948,58	14,25	-
BANCO BRADESCO	11.445.089,87	6,78	-
SOMMA INVESTIMENTOS	5.093.886,18	3,02	-
SICREDI	3.129.957,25	1,85	-
GENIAL INVESTIMENTOS	2.242.958,33	1,33	-
OCCAM BRASIL	1.970.491,28	1,17	-

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 Outubro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	1,01%	8,26%	2,22%	4,57%	10,00%	21,06%	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	0,89%	-	-	-	-	-	0,85%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	4,59%	1,65%	3,61%	9,09%	18,47%	1,04%	2,41%
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,35%	-3,04%	-1,90%	-0,01%	1,36%	-	1,40%	5,10%

IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,10%	9,13%	2,46%	5,06%	11,04%	23,38%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,74%	5,72%	1,88%	4,14%	9,27%	19,71%	0,75%	1,69%

IMA Geral (Benchmark)	0,38%	5,39%	1,52%	3,92%	9,08%	21,85%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,35%	5,17%	1,44%	3,74%	8,83%	21,48%	0,74%	1,61%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	8,08%	2,45%	4,88%	10,15%	25,01%	-	
---------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	--