

# Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

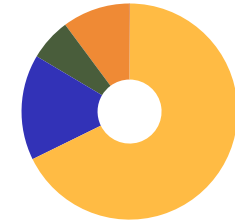
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			888.377.001,85	32,87%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	95.358.338,20	3,53%	798	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	534.457.908,20	19,78%	1.211	2,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	164.972,16	0,01%	368	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	110.919.910,49	4,10%	506	1,88%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	201.327.645,38	7,45%	429	3,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	60.217.019,63	2,23%	20.921	4,16%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	38.921.006,02	1,44%	21.298	5,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	37.543.246,92	1,39%	16.027	3,43%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	29.146.789,44	1,08%	47	10,84%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	35.484.203,68	1,31%	838	6,70%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	45.013.591,97	1,67%	195	5,67%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	119.894.880,64	4,44%	13.176	8,08%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	48.945.733,87	1,81%	32	14,66%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	8.868.935,68	0,33%	14	7,37%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.068.488,18	0,04%	2.651	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.837.674,47	0,07%	105	1,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	45.502.331,23	1,68%	111	2,79%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	36.552.545,52	1,35%	39	10,83%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	7.114.986,32	0,26%	54	7,00%	Artigo 9º, Inciso II

## Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	39.405.345,98	1,46%	4.521	5,89%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	34.589.058,68	1,28%	441	1,31%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.290.685,86	0,27%	319	0,96%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	134.535.183,98	4,98%	7.966	6,62%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	137.630.183,45	5,09%	601	9,81%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.430.000,00	0,09%		1,75%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.702.597.667,80				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			57.080,61	Artigo 6º			
PL Total			2.702.654.748,41				

## 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%	888.377.001,85	32,87%	10,00%	60,00%	100,00%	1.814.220.665,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	95.358.338,20	3,53%	0,00%	3,00%	90,00%	2.336.979.562,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.432.337.901,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	846.870.436,23	31,34%	2,00%	3,00%	65,00%	909.818.047,84
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.756.688.484,07
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.129.883,39
Total Renda Fixa	100,00%	1.830.605.776,28	67,74%	12,00%	66,00%	415,00%	



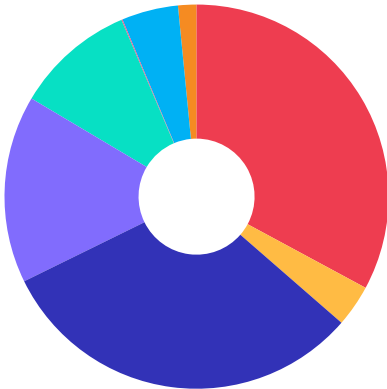
RENDA FIXA	1.830.605.776,28
RENDA VARIÁVEL	426.941.570,50
EXTERIOR	170.454.953,59
ESTRUTURADOS	272.165.367,43
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.430.000,00

**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%	426.941.570,50	15,80%	0,00%	18,20%	35,00%	518.967.613,23
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	945.909.183,73
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	272.165.367,43	10,07%	0,00%	9,50%	10,00%	-1.905.600,65
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.129.883,39
Artigo 11º	5,00%	2.430.000,00	0,09%	0,00%	0,30%	5,00%	132.699.883,39
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	701.536.937,93	25,96%	0,00%	28,00%	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%	128.575.209,05	4,76%	0,00%	4,30%	10,00%	141.684.557,73
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	41.879.744,54	1,55%	0,00%	1,70%	10,00%	228.380.022,24
Total Exterior	10,00%	170.454.953,59	6,31%	0,00%	6,00%	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%	0,00%	10,00%	270.259.766,78



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	888.377.001,85	32,87	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	95.358.338,20	3,53	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	846.870.436,23	31,34	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	426.941.570,50	15,80	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	128.575.209,05	4,76	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	41.879.744,54	1,55	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	272.165.367,43	10,07	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.430.000,00	0,09	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
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	888.377.001,85	32,87	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	753.194.057,52	27,87	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	465.967.695,79	17,24	0,03
CAIXA DTVM	458.495.259,16	16,96	2,26
ITAÚ DTVM	57.814.669,55	2,14	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	39.405.345,98	1,46	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	29.146.789,44	1,08	0,48
SAFRA ASSET MANAGEMENT	7.290.685,86	0,27	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	2.906.162,65	0,11	-

**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
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,39%	5,01%	1,75%	2,72%	8,05%	20,40%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40%	4,73%	1,72%	2,60%	7,72%	19,96%	0,92%	1,90%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	8,08%	2,70%	5,24%	11,26%	26,47%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,75%	7,17%	2,36%	4,69%	9,95%	22,88%	0,00%	0,04%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86%	8,36%	2,72%	5,41%	11,64%	27,15%	0,02%	0,08%



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
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-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%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-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%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-3,14%	-7,65%	3,89%	-0,21%	5,18%	7,22%	5,73%	12,56%
BRDESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-3,09%	-1,82%	6,42%	2,91%	13,09%	19,94%	5,82%	12,68%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-3,70%	-4,19%	6,85%	-3,34%	8,14%	7,88%	6,49%	15,42%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-2,85%	-5,55%	5,16%	-1,31%	6,85%	10,80%	5,47%	12,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-2,95%	-4,43%	6,30%	-1,56%	6,67%	5,89%	5,63%	14,10%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,05%	-0,39%	6,95%	-1,23%	13,96%	26,32%	6,56%	15,64%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-3,38%	-2,41%	7,09%	-0,89%	10,51%	10,41%	5,86%	14,04%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,06%	-6,56%	3,12%	-3,79%	3,20%	4,83%	5,85%	13,69%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,97%	11,17%	12,08%	9,59%	29,31%	27,61%	6,04%	12,92%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	-2,58%	-0,16%	-1,24%	-3,00%	2,69%	10,54%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,67%	1,12%	-1,22%	0,95%	-0,69%	15,83%	18,07%	41,16%
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	-1,59%	31,85%	4,09%	18,60%	41,09%	55,11%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,33%	24,07%	6,32%	11,65%	40,19%	81,31%	6,45%	12,45%

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
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,02%	20,81%	5,53%	9,67%	34,38%	60,71%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	2,30%	22,74%	5,59%	11,03%	37,64%	69,92%	6,64%	12,52%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,35%	24,15%	6,34%	11,73%	40,26%	81,33%	6,45%	12,43%

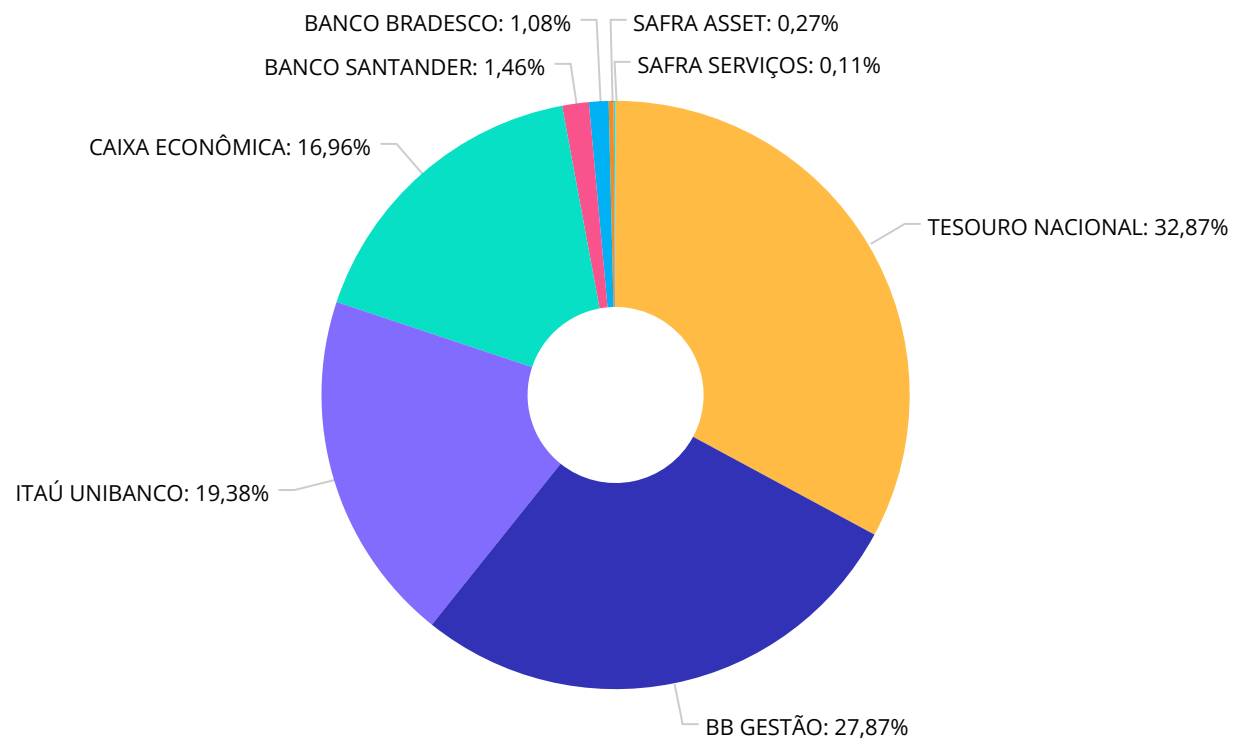
## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,09%	30,22%	1,68%	18,06%	38,90%	58,87%	8,30%	13,832%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	8,93%	15,691%

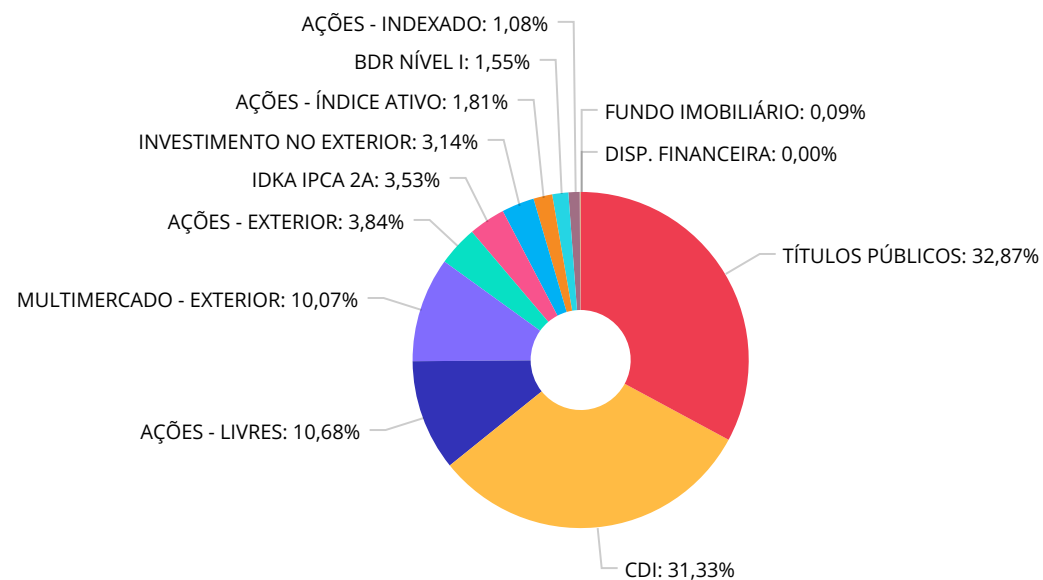
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	-2,05%	32,20%	3,90%	18,13%	41,96%	57,72%	-	-
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2,24%	30,01%	5,05%	23,19%	35,68%	43,87%	7,86%	13,669%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	-3,12%	24,86%	2,18%	13,11%	31,95%	36,51%	6,18%	15,224%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,94%	32,74%	0,97%	16,90%	43,66%	66,83%	6,64%	14,764%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-2,01%	30,29%	2,84%	16,43%	39,64%	54,78%	6,64%	12,080%

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



TESOURO NACIONAL	888.377.001,85
BB GESTÃO	753.194.057,52
ITAÚ UNIBANCO	523.782.365,34
CAIXA ECONÔMICA	458.495.259,16
BANCO SANTANDER	39.405.345,98
BANCO BRADESCO	29.146.789,44
SAFRA ASSET	7.290.685,86
SAFRA SERVIÇOS	2.906.162,65

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



TÍTULOS PÚBLICOS	888.377.001,85	CDI	846.870.436,23	AÇÕES - LIVRES	288.632.027,56	MULTIMERCADO - EXTERIOR	272.165.367,43
AÇÕES - EXTERIOR	103.884.551,47	IDKA IPCA 2A	95.358.338,20	INVESTIMENTO NO EXTERIOR	84.907.677,21	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	48.945.733,87
BDR NÍVEL I	41.879.744,54	AÇÕES - INDEXADO	29.146.789,44	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.430.000,00	DISP. FINANCEIRA	57.080,61

## 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	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3.855,205568	4.375,447286	39.843.549,55	45.220.247,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4.089,215327	4.365,186251	40.000.704,33	42.700.251,90	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4.062,955171	4.339,228815	30.000.860,98	32.040.865,56	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4.004,964372	4.386,093164	39.997.579,18	43.803.912,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.512,77998	39.997.709,63	45.339.900,45	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.499,418581	58.915.192,29	67.896.226,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4.047,135758	4.459,63707	1.197.952,18	1.320.052,57	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.420,326884	1.984.874,49	2.201.322,78	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.449,004164	39.862.509,79	45.281.964,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.427,137306	39.994.357,14	45.267.478,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.392,46253	15.078.262,63	17.086.679,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.539,88762	58.961.325,11	68.166.412,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.509,234236	9.639.666,59	10.822.162,16	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/05/2022	4.840	4.131,678715	4.514,319351	19.997.324,98	21.849.305,65	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4.113,158402	4.488,967286	9.501.395,91	10.369.514,43	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4.039,820802	4.463,822777	900.880,04	995.432,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.463,822777	2.086.995,07	2.321.187,84	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3.816,987204	4.112,552038	39.998.208,91	43.095.432,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.421,092246	19.725.991,27	21.840.195,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.404,275909	39.229.327,99	43.117.861,14	Curva

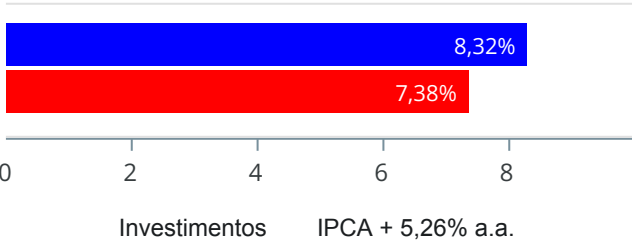
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.421,092246	19.725.991,27	21.840.195,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.366,660761	19.846.240,66	22.051.636,84	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3.851,268116	4.148,52836	39.999.270,65	43.086.615,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.347,846701	19.568.465,57	21.456.623,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.256,941625	19.536.375,31	21.386.874,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.239,143723	40.000.529,76	43.294.374,84	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	4.084,423915	38.836.282,35	42.179.845,77	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3.792,196447	4.084,423915	40.003.880,32	43.086.587,87	Curva

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	2.567.523.344,80	45.095.927,70	48.822.037,76	2.569.922.536,57	6.125.301,83	6.125.301,83	0,23%	0,23%	0,87%	0,87%	26,94%	3,19%
Fevereiro	2.569.922.536,57	58.312.581,69	62.621.601,41	2.610.448.028,88	44.834.512,03	50.959.813,86	1,71%	1,94%	1,22%	2,10%	92,52%	3,53%
Março	2.610.448.028,88	33.594.187,36	44.184.187,36	2.629.918.510,18	30.060.481,30	81.020.295,16	1,14%	3,10%	0,57%	2,68%	115,72%	2,91%
Abril	2.629.918.510,18	40.962.954,53	48.037.406,87	2.608.903.681,39	-13.940.376,45	67.079.918,71	-0,52%	2,57%	0,83%	3,53%	72,58%	3,59%
Mai	2.608.903.681,39	36.565.347,44	51.724.247,54	2.617.357.295,49	23.612.514,20	90.692.432,91	0,89%	3,48%	0,89%	4,46%	78,11%	2,76%
Junho	2.617.357.295,49	155.426.054,88	169.999.186,01	2.646.377.469,80	43.593.305,44	134.285.738,35	1,57%	5,11%	0,62%	5,10%	100,11%	2,52%
Julho	2.646.377.469,80	108.635.700,00	119.435.955,52	2.667.369.140,94	31.791.926,66	166.077.665,01	1,15%	6,32%	0,85%	6,00%	105,41%	3,15%
Agosto	2.667.369.140,94	325.294.955,59	339.427.829,40	2.698.566.075,99	45.329.808,86	211.407.473,87	1,51%	7,93%	0,43%	6,45%	122,96%	3,83%
Setembro	2.698.566.075,99	112.071.700,00	126.418.656,05	2.694.382.808,93	10.163.688,99	221.571.162,86	0,36%	8,32%	0,87%	7,38%	112,81%	3,15%

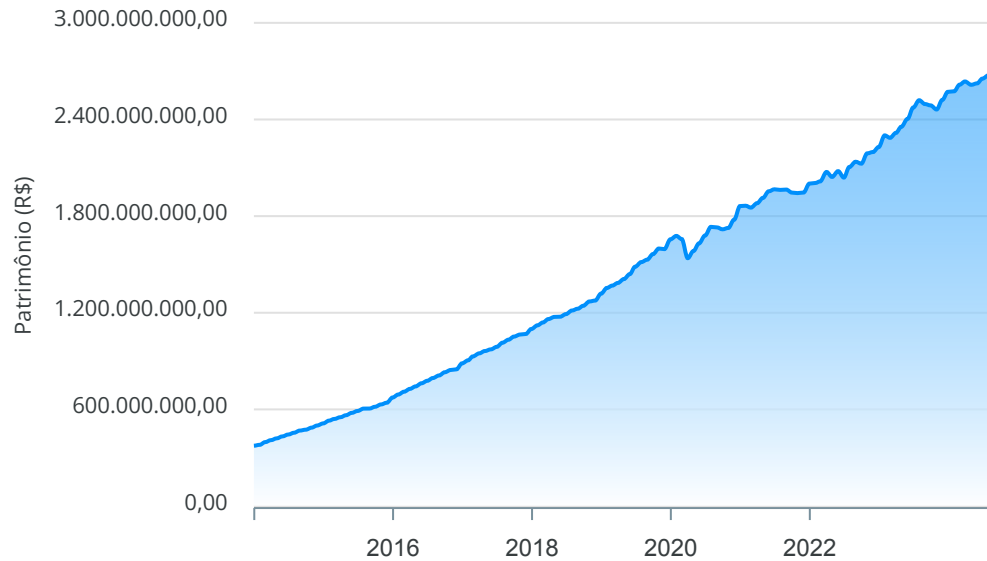
Investimentos x Meta de Rentabilidade





Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

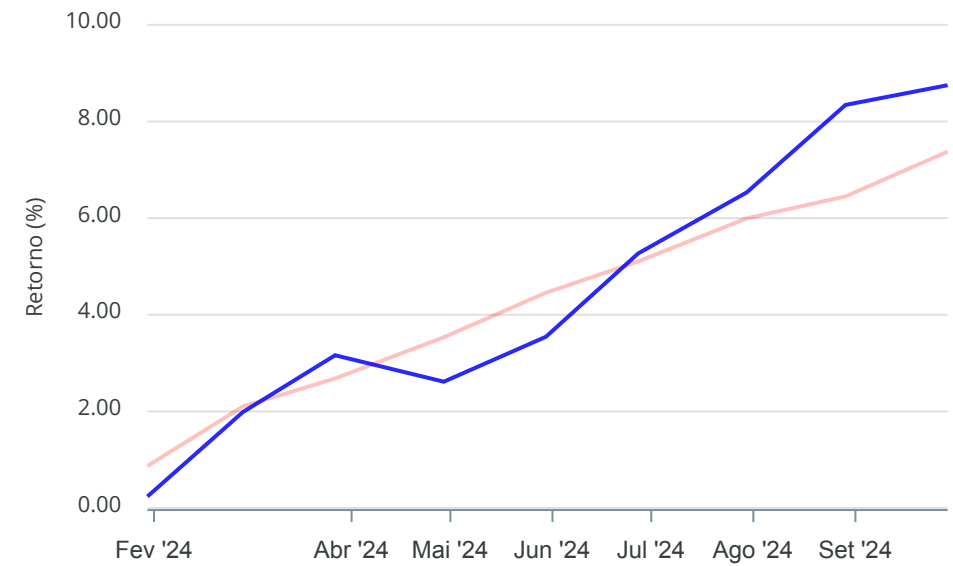
Evolução do Patrimônio



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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	199.612.543,41	0,00	0,00	201.327.645,38	1.715.101,97	0,86%	0,86%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	80.061.271,54	30.000.000,00	67.456,05	110.919.910,49	926.095,00	0,84%	0,85%	0,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	163.745,03	0,00	0,00	164.972,16	1.227,13	0,75%	0,75%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	628.843.593,98	27.995.000,00	127.099.500,00	534.457.908,20	4.718.814,22	0,72%	0,84%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	882.317.072,82	0,00	0,00	888.377.001,85	6.059.929,03	0,69%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	94.964.039,32	17.700,00	0,00	95.358.338,20	376.598,88	0,40%	0,40%	0,92%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.885.962.266,10</b>	<b>58.012.700,00</b>	<b>127.166.956,05</b>	<b>1.830.605.776,28</b>	<b>13.797.766,23</b>	<b>0,73%</b>		<b>0,11%</b>

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.390.100,00	0,00	17.700,00	2.430.000,00	57.600,00	2,41%	2,43%	18,07%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	134.473.815,06	0,00	0,00	137.630.183,45	3.156.368,39	2,35%	2,35%	6,45%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	131.473.468,85	0,00	0,00	134.535.183,98	3.061.715,13	2,33%	2,33%	6,45%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	58.864.838,70	0,00	0,00	60.217.019,63	1.352.180,93	2,30%	2,30%	6,64%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	65.600.913,31	55.000.000,00	0,00	119.894.880,64	-706.032,67	-0,59%	-0,97%	6,04%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	39.608.099,41	0,00	0,00	38.921.006,02	-687.093,39	-1,73%	-1,73%	6,34%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	50.379.098,22	0,00	0,00	48.945.733,87	-1.433.364,35	-2,85%	-2,85%	5,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	9.138.580,76	0,00	0,00	8.868.935,68	-269.645,08	-2,95%	-2,95%	5,63%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	46.429.732,70	0,00	0,00	45.013.591,97	-1.416.140,73	-3,05%	-3,05%	6,56%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	30.075.230,67	0,00	0,00	29.146.789,44	-928.441,23	-3,09%	-3,09%	5,82%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	38.762.070,14	0,00	0,00	37.543.246,92	-1.218.823,22	-3,14%	-3,14%	5,73%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.902.043,97	0,00	0,00	1.837.674,47	-64.369,50	-3,38%	-3,38%	5,86%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.109.510,54	0,00	0,00	1.068.488,18	-41.022,36	-3,70%	-3,70%	6,49%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	36.987.467,79	0,00	0,00	35.484.203,68	-1.503.264,11	-4,06%	-4,06%	5,85%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>647.194.970,12</b>	<b>55.000.000,00</b>	<b>17.700,00</b>	<b>701.536.937,93</b>	<b>-640.332,19</b>	<b>-0,09%</b>		<b>6,26%</b>

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
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6.959.262,26	0,00	0,00	7.114.986,32	155.724,06	2,24%	2,24%	7,86%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	34.701.615,76	0,00	0,00	34.589.058,68	-112.557,08	-0,32%	-0,32%	8,93%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.370.790,91	0,00	0,00	7.290.685,86	-80.105,05	-1,09%	-1,09%	8,30%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	46.402.796,94	0,00	0,00	45.502.331,23	-900.465,71	-1,94%	-1,94%	6,64%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	40.214.226,04	0,00	0,00	39.405.345,98	-808.880,06	-2,01%	-2,01%	6,64%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	37.729.479,19	0,00	0,00	36.552.545,52	-1.176.933,67	-3,12%	-3,12%	6,18%
<b>Total Exterior</b>	<b>173.378.171,10</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>170.454.953,59</b>	<b>-2.923.217,51</b>	<b>-1,69%</b>		<b>7,13%</b>

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
TÍTULOS PÚBLICOS	1.055.335.987,38	0,00	188.802.542,88	888.377.001,85	21.843.557,35	2,07%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	588.670.425,00	292.110.510,56	361.654.009,11	534.457.908,20	15.330.981,75	1,74%	2,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	126.060.190,68	70.000.000,00	0,00	201.327.645,38	5.267.454,70	2,69%	2,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	93.690.198,28	53.100,00	0,00	95.358.338,20	1.615.039,92	1,72%	1,72%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	110.000.000,00	67.456,05	110.919.910,49	987.366,54	0,90%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.306.394,81	0,00	11.477.316,09	0,00	170.921,28	1,51%	2,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.579.879,90	0,00	3.632.225,53	0,00	52.345,63	1,46%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	237.628,23	21.325.000,00	21.570.791,31	0,00	8.163,08	0,04%	2,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	0,00	163.745,03	0,00	164.972,16	1.227,13	0,75%	2,36%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.878.880.704,28</b>	<b>493.652.355,59</b>	<b>587.204.340,97</b>	<b>1.830.605.776,28</b>	<b>45.277.057,38</b>	<b>1,91%</b>	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	129.427.737,36	0,00	0,00	137.630.183,45	8.202.446,09	6,34%	6,34%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	126.542.461,93	0,00	0,00	134.535.183,98	7.992.722,05	6,32%	6,32%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	57.967.105,08	55.000.000,00	0,00	119.894.880,64	6.927.775,56	6,13%	12,08%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	57.027.274,25	0,00	0,00	60.217.019,63	3.189.745,38	5,59%	5,59%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	42.090.333,41	0,00	0,00	45.013.591,97	2.923.258,56	6,95%	6,95%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	36.331.135,44	0,00	0,00	38.921.006,02	2.589.870,58	7,13%	7,13%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	46.542.765,52	0,00	0,00	48.945.733,87	2.402.968,35	5,16%	5,16%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	27.389.829,80	0,00	0,00	29.146.789,44	1.756.959,64	6,41%	6,41%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	36.137.773,12	0,00	0,00	37.543.246,92	1.405.473,80	3,89%	3,89%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	34.411.175,31	0,00	0,00	35.484.203,68	1.073.028,37	3,12%	3,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	8.343.103,88	0,00	0,00	8.868.935,68	525.831,80	6,30%	6,30%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.715.996,40	0,00	0,00	1.837.674,47	121.678,07	7,09%	7,09%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	999.990,40	0,00	0,00	1.068.488,18	68.497,78	6,85%	6,85%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.460.000,00	0,00	53.100,00	2.430.000,00	23.100,00	0,94%	-1,22%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>607.386.681,90</b>	<b>55.000.000,00</b>	<b>53.100,00</b>	<b>701.536.937,93</b>	<b>39.203.356,03</b>	<b>5,92%</b>	

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	38.316.762,89	0,00	0,00	39.405.345,98	1.088.583,09	2,84%	2,84%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	35.773.708,26	0,00	0,00	36.552.545,52	778.837,26	2,18%	2,18%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	45.067.279,66	0,00	0,00	45.502.331,23	435.051,57	0,97%	0,97%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6.772.933,56	0,00	0,00	7.114.986,32	342.052,76	5,05%	5,05%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	34.332.086,13	0,00	0,00	34.589.058,68	256.972,55	0,75%	0,75%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.169.960,04	0,00	0,00	7.290.685,86	120.725,82	1,68%	1,68%
<b>Total Exterior</b>	<b>167.432.730,54</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>170.454.953,59</b>	<b>3.022.223,05</b>	<b>1,81%</b>	

## 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.



