

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.219.531,35	3,44%	837	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.295.799,85	2,17%	605	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	489.149,32	0,32%	332	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FL...	D+1	Não há	8.206.798,77	5,40%	90	1,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.492.527,94	2,96%	731	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.659.824,37	4,38%	806	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.760.351,52	4,45%	895	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.724.987,62	1,14%	727	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.901.793,84	2,57%	1.161	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	10.590.537,02	6,97%	229	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.894.078,68	3,22%	403	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	14.065.498,64	9,26%	668	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.727.928,56	1,14%	1.191	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.643.431,18	6,35%	140	1,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.145.252,44	6,02%	141	1,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA RE...	D+0	Não há	14.616.548,97	9,62%	531	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.153.557,89	2,08%	1.059	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	2.350.063,92	1,55%	476	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	130.135,45	0,09%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	28.686,71	0,02%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

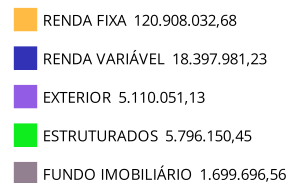
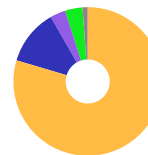
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	7.790.004,08	5,13%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 14,56%	D+0	Não se aplica	303.249,26	0,20%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	155.995,31	0,10%	35	1,10%	Artigo 7º, Inciso V, Alinea a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	621.240,18	0,41%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alinea a
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	941.059,81	0,62%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso V, Alinea b
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	212.895,26	0,14%	445	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FICAÇÕES	D+30	Não há	1.115.496,52	0,73%	2.239	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	D+3	Não há	2.104.228,79	1,39%	16.060	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	4.120.928,89	2,71%	238	5,04%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FICAÇÕES	D+4	Não há	3.019.699,55	1,99%	114	0,94%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FICAÇÕES	D+3	Não há	3.327.516,39	2,19%	342	0,70%	Artigo 8º, Inciso I
MAG BRASIL FICAÇÕES	D+4	Não há	2.610.676,05	1,72%	1.408	0,84%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FICAÇÕES	D+3	Não há	199.466,51	0,13%	3.626	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FICAÇÕES	D+3	Não há	1.687.073,27	1,11%	33	1,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FICAÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.646.555,09	1,08%	21.442	0,27%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FICAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.463.496,04	2,28%	442	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.796.150,43	3,82%	33.295	0,49%	Artigo 10º, Inciso I
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.699.696,56	1,12%		1,20%	Artigo 11º

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			151.911.912,05				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			964.150,36				Artigo 6º
PL Total			152.876.062,41				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	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%	10,00%	25,00%	37.977.978,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	56.235.380,28	37,02%	20,00%	30,00%	80,00%	65.294.149,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	54.861.103,76	36,11%	15,00%	20,00%	50,00%	21.094.852,27
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	8.093.253,34	5,33%	0,00%	15,00%	20,00%	22.289.129,07
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	777.235,49	0,51%	0,00%	1,00%	5,00%	6.818.360,11
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	941.059,81	0,62%	0,00%	1,00%	5,00%	6.654.535,79
Total Renda Fixa	100,00%	120.908.032,68	79,59%	35,00%	77,00%	185,00%	

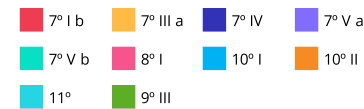
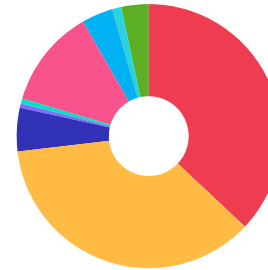


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	18.397.981,23	12,11%	5,00%	15,00%	30,00%	27.175.592,39
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	45.573.573,62
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.796.150,44	3,82%	1,00%	3,00%	10,00%	9.395.040,77
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.595.595,59
Artigo 11º	5,00%	1.699.696,56	1,12%	0,00%	2,00%	5,00%	5.895.899,04
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	25.893.828,24	17,05%	6,00%	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%	5.110.051,13	3,36%	0,00%	2,00%	10,00%	10.081.140,08
Total Exterior	10,00%	5.110.051,13	3,36%	0,00%	2,00%	10,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	7.595.595,60



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	25,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	56.235.380,28	37,02	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	54.861.103,76	36,11	15,00	50,00
Artigo 7º, Inciso IV	8.093.253,34	5,33	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	777.235,49	0,51	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	941.059,81	0,62	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	18.397.981,23	12,11	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	5.110.051,13	3,36	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.796.150,44	3,82	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,01	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	1.699.696,56	1,12	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BANCO BRADESCO	48.752.659,80	32,09	0,00
CAIXA DTVM	45.641.154,92	30,04	0,22
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.344.842,03	22,61	-
BANCO BTG PACTUAL	8.093.253,34	5,33	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.327.516,39	2,19	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	2.610.676,05	1,72	0,02
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM..	2.350.063,92	1,55	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.699.696,56	1,12	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT..	1.687.073,27	1,11	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.115.496,52	0,73	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC..	941.059,81	0,62	5,54
GRAPHEN INVESTIMENTOS	621.240,18	0,41	0,73
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	212.895,26	0,14	0,01
GENIAL INVESTIMENTOS	199.466,51	0,13	-
GENIAL GESTÃO LTDA	184.682,03	0,12	-
RJI CORRETORA DE VALORES	130.135,45	0,09	0,09
ARENA CAPITAL	0,01	0,00	0,00

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 Agosto/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,41%	6,27%	1,80%	4,09%	9,45%	20,22%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,61%	-	1,52%	-	-	-	1,28%	-
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,17%	9,60%	3,47%	7,05%	15,10%	35,28%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1,35%	1.128,49%	2,16%	1.018,46%	974,90%	2.556,46%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,60%	4,60%	1,53%	3,33%	7,94%	20,67%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	4,56%	1,66%	3,36%	7,81%	20,28%	1,25%	1,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	4,32%	1,52%	3,11%	7,68%	20,09%	1,34%	1,88%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,60%	2,39%	1,43%	1,43%	7,39%	24,61%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	2,21%	1,37%	1,30%	7,14%	23,78%	2,30%	3,77%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,77%	6,30%	2,36%	4,62%	10,39%	25,57%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,75%	6,24%	2,30%	4,51%	10,24%	25,14%	0,30%	0,40%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,59%	4,88%	1,91%	3,56%	8,14%	21,08%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-2,82%	-10,13%	-2,16%	-1,23%	-18,45%	-25,90%	4,92%	23,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,57%	4,65%	1,82%	3,39%	7,80%	20,37%	1,12%	1,80%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,96%	-76,28%	-4,19%	-70,21%	-80,75%	-84,25%	0,92%	65,84%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	4,74%	1,86%	3,45%	7,92%	20,66%	1,09%	1,78%
IMA-B (Benchmark)	0,52%	1,49%	1,63%	1,40%	5,32%	19,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	1,33%	1,56%	1,26%	5,08%	19,27%	2,44%	4,09%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,48%	1,26%	1,53%	1,22%	4,96%	19,05%	2,44%	4,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	1,29%	1,54%	1,24%	5,04%	19,17%	2,43%	4,10%
IRF-M (Benchmark)	0,66%	3,54%	1,70%	2,39%	8,26%	24,46%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64%	3,37%	1,65%	2,24%	8,00%	24,03%	1,62%	2,68%
CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	5,91%	2,38%	4,21%	9,96%	25,37%	0,41%	0,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	7,21%	2,68%	5,34%	11,32%	26,39%	0,01%	0,06%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,51%	4,33%	1,61%	3,21%	6,77%	15,76%	0,08%	0,14%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91%	7,44%	2,69%	5,42%	11,71%	27,16%	0,04%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	7,33%	2,70%	5,39%	11,61%	26,97%	0,02%	0,07%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,92%	7,71%	2,77%	5,61%	12,12%	27,88%	0,04%	0,10%
IPCA (Benchmark)	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,59%	3,71%	1,66%	2,65%	7,64%	22,83%	1,48%	2,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,68%	4,05%	1,82%	2,80%	7,52%	22,31%	0,64%	1,36%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 14,56%	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,41%	-1,57%	-1,39%	-0,64%	-7,56%	-6,65%	0,10%	4,95%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,88%	2,79%	2,23%	2,26%	7,03%	15,88%	1,14%	3,05%
Global BDRX (Benchmark)	0,55%	42,25%	13,74%	27,72%	48,00%	71,14%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,57%	41,02%	13,95%	26,91%	46,38%	68,28%	9,23%	15,18%
Ibovespa (Benchmark)	6,54%	1,36%	11,39%	5,41%	17,51%	24,18%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	4,68%	-4,65%	9,30%	1,40%	9,11%	10,30%	5,93%	12,93%
MAG BRASIL FIAÇÕES	6,15%	0,11%	10,92%	4,43%	14,67%	11,90%	5,18%	12,54%
FINACAP MAURITSSTAD FIAÇÕES	6,42%	0,65%	9,33%	3,50%	15,75%	24,86%	6,39%	14,41%
PLURAL DIVIDENDOS FIAÇÕES	4,92%	-1,32%	10,27%	0,71%	12,85%	23,24%	6,26%	12,69%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIAÇÕES	5,57%	1,62%	9,01%	6,28%	15,78%	23,92%	5,49%	12,13%
SCHRODER BEST IDEAS FIAÇÕES	6,44%	-1,21%	13,61%	3,86%	12,47%	17,83%	6,38%	13,78%
BRDESCO SELECTION FICAÇÕES	4,74%	-5,45%	8,95%	-3,09%	4,79%	3,95%	6,41%	14,66%
IDIV (Benchmark)	6,69%	5,00%	10,87%	7,85%	21,94%	34,91%	-	-
BRDESCO H DIVIDENDOS FIAÇÕES	6,62%	4,29%	10,69%	7,33%	20,89%	32,64%	5,21%	11,85%
IFIX (Benchmark)	0,86%	2,48%	0,33%	1,00%	5,63%	14,02%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%

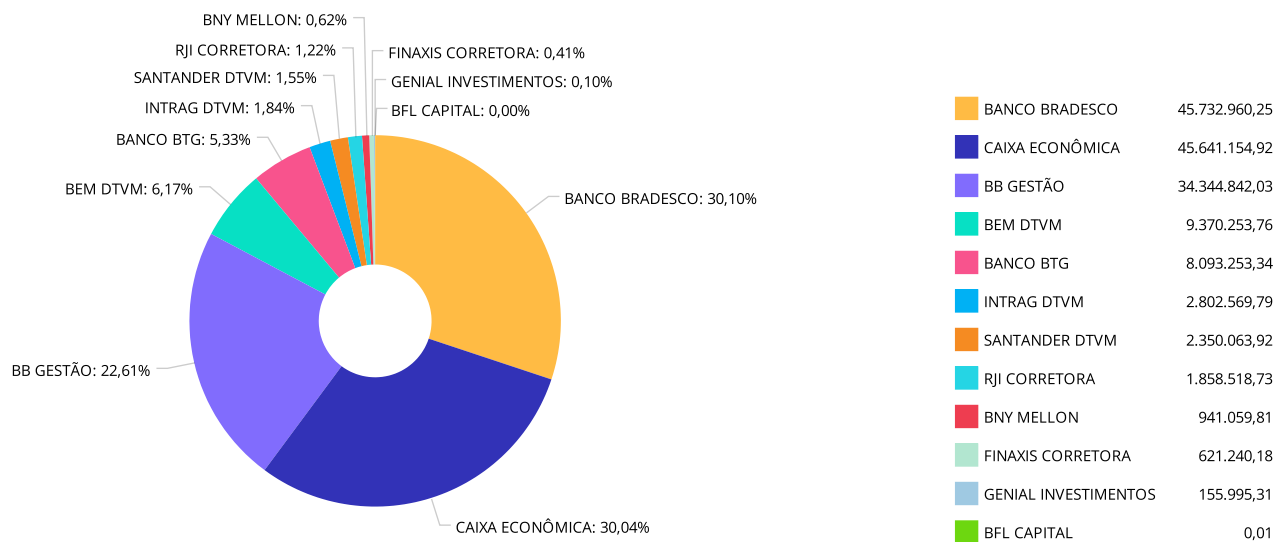
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	4,51%	-9,69%	5,65%	-3,81%	-2,18%	-4,07%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,49%	4,31%	11,15%	5,88%	12,40%	13,42%	6,94%	15,64%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	0,69%	8,64%	2,64%	5,81%	13,10%	28,37%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-

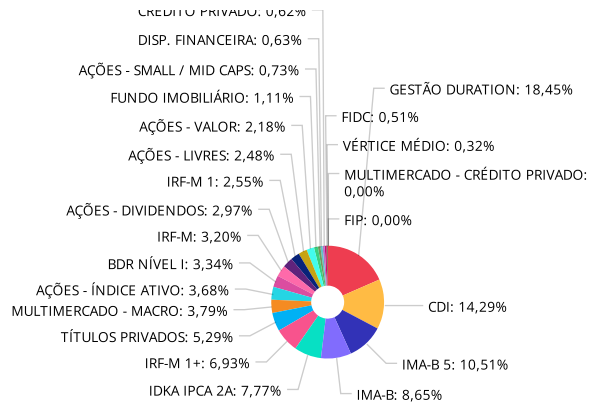
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,55%	42,25%	13,74%	27,72%	48,00%	71,14%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,57%	41,02%	13,95%	26,91%	46,38%	68,28%	9,23%	15,184%
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,80%	26,47%	6,26%	12,15%	37,48%	61,60%	11,09%	16,618%

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



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

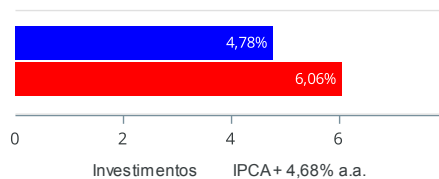


■ GESTÃO DURATION	28.201.457,76	■ CDI	21.848.099,34	■ IMA-B 5	16.064.426,12
■ IMA-B	13.227.586,24	■ IDKA IPCA 2A	11.879.355,72	■ IRF-M 1+	10.590.537,02
■ TÍTULOS PRIVADOS	8.093.253,34	■ MULTIMERCADO - MACRO	5.796.150,43	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.630.375,60
■ BDR NÍVEL I	5.110.051,13	■ IRF-M	4.894.078,68	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	4.533.290,66
■ IRF-M 1	3.901.793,84	■ AÇÕES - LIVRES	3.791.302,06	■ AÇÕES - VALOR	3.327.516,39
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.699.696,56	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.115.496,52	■ DISP. FINANCEIRA	964.150,36
■ CRÉDITO PRIVADO	941.059,81	■ FIDC	777.235,49	■ VÉRTICE MÉDIO	489.149,32
■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	0,01	■ FIP	0,01		

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	131.921.519,37	5.400.000,00	3.100.000,00	134.359.826,23	138.306,86	138.306,86	0,10%	0,10%	0,82%	0,82%	12,54%	1,31%
Fevereiro	134.359.826,23	2.750.000,00	3.329.427,64	134.956.658,54	1.176.259,95	1.314.566,81	0,88%	0,98%	1,18%	2,01%	48,73%	1,48%
Março	134.956.658,54	6.009.427,64	3.342.028,30	138.717.712,10	1.093.654,22	2.408.221,03	0,79%	1,78%	0,52%	2,54%	70,03%	1,29%
Abril	138.717.712,10	0,00	310.000,00	137.292.029,03	-1.115.683,07	1.292.537,96	-0,80%	0,96%	0,78%	3,35%	28,79%	1,89%
Maio	137.292.029,03	2.000.000,00	2.800.000,00	137.296.883,50	804.854,47	2.097.392,43	0,59%	1,56%	0,84%	4,22%	36,87%	1,46%
Junho	137.296.883,50	0,00	4.550.000,00	133.497.603,98	750.720,48	2.848.112,91	0,55%	2,11%	0,57%	4,82%	43,82%	1,86%
Julho	133.497.603,98	4.199.988,01	3.150.000,00	136.343.882,10	1.796.290,11	4.644.403,02	1,34%	3,47%	0,80%	5,66%	61,43%	1,83%
Agosto	136.343.882,10	4.011.393,11	4.424.393,11	137.651.210,56	1.720.328,46	6.364.731,48	1,26%	4,78%	0,38%	6,06%	78,91%	2,02%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



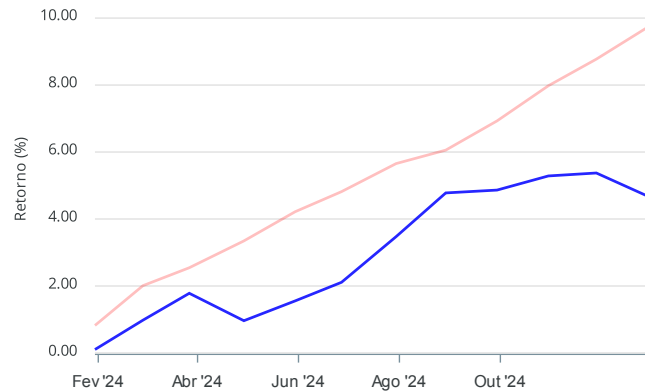
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	153.918,85	0,00	0,00	155.995,31	2.076,46	1,35%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	13.933.572,93	0,00	0,00	14.065.498,64	131.925,71	0,95%	0,95%	0,41%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 14,56%	300.506,86	0,00	0,00	303.249,26	2.742,40	0,91%	-	-
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFE...	13.580.589,04	908.250,00	0,00	14.616.548,97	127.709,93	0,88%	0,91%	0,04%
LETRA FINANCEIRA BTG	7.729.575,94	0,00	0,00	7.790.004,08	60.428,14	0,78%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.872.808,83	0,00	0,00	3.901.793,84	28.985,01	0,75%	0,75%	0,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.230.939,85	900.000,00	0,00	3.153.557,89	22.618,04	0,72%	0,88%	0,02%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	1.433.546,10	900.000,00	0,00	2.350.063,92	16.517,82	0,71%	0,91%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.462.329,23	0,00	0,00	4.492.527,94	30.198,71	0,68%	0,68%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.862.873,88	0,00	0,00	4.894.078,68	31.204,80	0,64%	0,64%	1,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.186.575,06	0,00	0,00	5.219.531,35	32.956,29	0,64%	0,64%	1,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	814.208,58	903.143,11	0,00	1.727.928,56	10.576,87	0,62%	0,89%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	500.664,79	0,00	14.575,17	489.149,32	3.059,70	0,61%	0,61%	1,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.620.669,57	0,00	0,00	6.659.824,37	39.154,80	0,59%	0,59%	1,34%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.587.046,51	0,00	0,00	9.643.431,18	56.384,67	0,59%	0,59%	1,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	10.529.381,60	0,00	0,00	10.590.537,02	61.155,42	0,58%	0,58%	2,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.721.325,51	0,00	0,00	6.760.351,52	39.026,01	0,58%	0,58%	1,09%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	12.413.226,42	0,00	3.340.000,00	9.145.252,44	72.026,02	0,58%	0,57%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.064.049,58	0,00	1.069.817,94	0,00	5.768,36	0,54%	0,93%	0,08%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	936.281,58	0,00	0,00	941.059,81	4.778,23	0,51%	0,51%	0,08%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.716.414,47	0,00	0,00	1.724.987,62	8.573,15	0,50%	0,50%	2,44%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	8.167.320,35	0,00	0,00	8.206.798,77	39.478,42	0,48%	0,48%	2,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.280.624,05	0,00	0,00	3.295.799,85	15.175,80	0,46%	0,46%	2,43%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	623.771,30	0,00	0,00	621.240,18	-2.531,12	-0,41%	-0,41%	0,10%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	29.259,77	0,00	0,00	28.686,71	-573,06	-1,96%	-1,96%	0,92%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	133.905,11	0,00	0,00	130.135,45	-3.769,66	-2,82%	-2,82%	4,92%
Total Renda Fixa	120.885.385,76	3.611.393,11	4.424.393,11	120.908.032,68	835.646,92	0,69%		1,10%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO H DIVIDENDOS FIAÇÕES	3.865.051,97	0,00	0,00	4.120.928,89	255.876,92	6,62%	6,62%	5,21%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIAÇÕES	0,00	200.000,00	0,00	212.895,26	12.895,26	6,45%	5,57%	5,49%
SCHRODER BEST IDEAS FIAÇÕES	1.584.997,78	0,00	0,00	1.687.073,27	102.075,49	6,44%	6,44%	6,38%
FINACAP MAURITSSAD FIAÇÕES	3.126.723,35	0,00	0,00	3.327.516,39	200.793,04	6,42%	6,42%	6,39%
MAG BRASIL FIAÇÕES	2.459.318,04	0,00	0,00	2.610.676,05	151.358,01	6,15%	6,15%	5,18%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.883.080,95	0,00	0,00	3.019.699,55	136.618,60	4,74%	4,74%	6,41%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.010.176,89	0,00	0,00	2.104.228,79	94.051,90	4,68%	4,68%	5,93%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.067.529,89	0,00	0,00	1.115.496,52	47.966,63	4,49%	4,49%	6,94%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.745.553,11	0,00	0,00	5.796.150,43	50.597,32	0,88%	0,88%	1,14%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
PLURAL DIVIDENDOS FIAÇÕES	0,00	200.000,00	0,00	199.466,51	-533,49	-0,27%	4,92%	6,26%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.743.982,33	0,00	0,00	1.699.696,56	-44.285,77	-2,54%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	24.486.414,33	400.000,00	0,00	25.893.828,24	1.007.413,91	4,05%		4,47%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.633.427,29	0,00	0,00	1.646.555,09	13.127,80	0,80%	0,80%	11,09%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3.444.021,03	0,00	0,00	3.463.496,04	19.475,01	0,57%	0,57%	9,23%
Total Exterior	5.077.448,32	0,00	0,00	5.110.051,13	32.602,81	0,64%		9,83%

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.

