

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

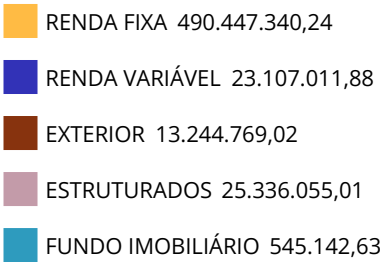
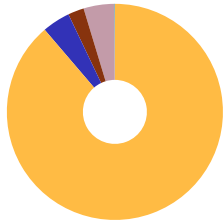
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			151.929.386,58	27,49%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	651.999,67	0,12%	665	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.299.464,90	1,50%	826	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	8.264.919,48	1,50%	765	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.489.093,67	1,90%	720	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	17.832.150,92	3,23%	798	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.531.761,16	1,91%	713	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.106.858,70	1,10%	397	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.234.691,74	2,21%	1.037	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	76.049.829,35	13,76%	198	3,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	48.154.676,28	8,71%	556	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.931.446,06	1,07%	506	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	25.938.171,48	4,69%	479	0,78%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info	Não se aplica	5.247.768,38	0,95%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	38.843.277,79	7,03%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	63.941.844,08	11,57%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	6.173.338,76	1,12%	693	1,49%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	735.127,86	0,13%	168	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.531.620,69	0,46%	1.908	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	8.713.370,91	1,58%	100	0,30%	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
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	661.945,90	0,12%	235	0,85%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+92	Não há	4.291.607,76	0,78%	171	0,71%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	4.312.639,20	0,78%	111	0,26%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	4.344.608,62	0,79%	39	1,29%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+6 du	Não há	356.332,31	0,06%	11	0,02%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INV...	D+6 du	Não há	398.718,60	0,07%	13	0,00%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.832.470,29	0,69%	319	0,51%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	8.198.034,12	1,48%	5.657	0,99%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.000.318,95	0,90%	4.087	0,41%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.701.399,11	1,03%	10	11,13%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	6.436.302,83	1,16%	109	0,67%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	545.142,63	0,10%		0,22%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			552.680.318,78				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	151.929.386,58	27,49%	0,00%	2,00%	45,00%	96.776.756,87
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	62.176.248,50	11,25%	10,00%	31,00%	95,00%	462.870.054,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	168.308.814,91	30,45%	15,00%	24,00%	60,00%	163.299.376,36
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	108.032.890,25	19,55%	10,00%	20,00%	20,00%	2.503.173,51
Total Renda Fixa	100,00%	490.447.340,24	88,74%	35,00%	77,00%	220,00%	

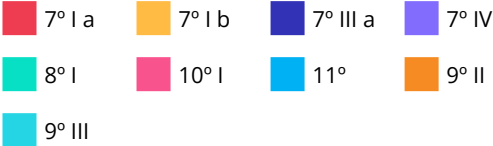
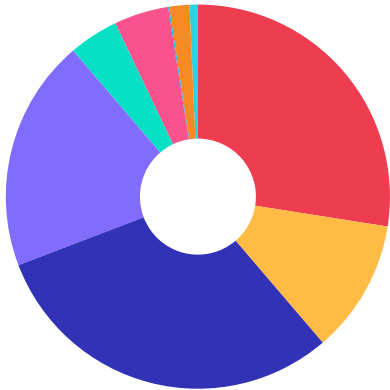


Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	23.107.011,88	4,18%	0,00%	15,00%	30,00%	142.697.083,75
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	25.336.055,01	4,58%	0,00%	5,00%	10,00%	29.931.976,87
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	5.526.803,19
Artigo 11º	5,00%	545.142,63	0,10%	0,00%	1,00%	2,00%	10.508.463,75
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	48.988.209,52	8,86%	0,00%	21,00%	43,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	9.412.298,73	1,70%	0,00%	1,00%	10,00%	45.855.733,15
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.832.470,29	0,69%	0,00%	1,00%	10,00%	51.435.561,59
Total Exterior	10,00%	13.244.769,02	2,40%	0,00%	2,00%	20,00%	

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%	0,00%	5,00%	27.634.015,94



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	151.929.386,58	27,49	0,00	45,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	62.176.248,50	11,25	10,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	168.308.814,91	30,45	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	108.032.890,25	19,55	10,00	20,00
Artigo 8º, Inciso I	23.107.011,88	4,18	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	9.412.298,73	1,70	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.832.470,29	0,69	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	25.336.055,01	4,58	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 11º	545.142,63	0,10	0,00	2,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	151.929.386,58	27,49	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	114.158.152,96	20,66	-
BANCO DAYCOVAL	63.941.844,08	11,57	0,42
CAIXA DTVM	55.891.629,46	10,11	0,28
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	48.154.676,28	8,71	0,80
BANCO BTG PACTUAL	38.843.277,79	7,03	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	25.938.171,48	4,69	0,00
GUEPARDO INVESTIMENTOS	8.713.370,91	1,58	0,10
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	8.198.034,12	1,48	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	6.436.302,83	1,16	-
4UM INVESTIMENTOS	6.173.338,76	1,12	0,19
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.701.399,11	1,03	0,32
BANCO BRADESCO	5.247.768,38	0,95	0,09
TARPON INVESTIMENTOS	4.291.607,76	0,78	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	3.832.470,29	0,69	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.531.620,69	0,46	0,11
MIRAE ASSET	755.050,91	0,14	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	735.127,86	0,13	0,16
PRÓPIO CAPITAL	661.945,90	0,12	-
ZION INVEST	545.142,63	0,10	-

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	5,06%	1,89%	2,95%	8,09%	20,22%	0,82%	1,82%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,40%	5,30%	1,92%	3,18%	8,43%	21,06%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,38%	5,06%	1,80%	3,00%	8,13%	20,47%	0,96%	1,77%
IMA-B (Benchmark)	-0,67%	0,82%	1,94%	0,64%	5,61%	17,28%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,69%	0,63%	1,88%	0,50%	5,37%	16,71%	1,87%	3,95%
IRF-M (Benchmark)	0,34%	3,90%	2,36%	2,19%	8,45%	23,17%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,32%	3,70%	2,30%	2,05%	8,19%	22,74%	1,35%	2,72%
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,83%	8,40%	2,78%	5,39%	11,67%	26,17%	0,03%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,19%	2,38%	4,70%	9,96%	23,52%	0,01%	0,05%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	8,38%	2,75%	5,44%	11,55%	26,85%	0,03%	0,08%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,89%	8,67%	2,82%	5,58%	11,94%	27,59%	0,02%	0,10%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	8,08%	2,70%	5,24%	11,26%	26,47%	0,03%	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%

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 (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,53%	4,59%	2,18%	2,74%	7,65%	21,45%	0,56%	1,34%
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	0,46%	-2,33%	1,04%	-0,16%	1,49%	-	0,50%	7,33%

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
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	0,46%	-2,33%	1,04%	-0,16%	1,49%	-	0,50%	7,33%
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,09%	4,73%	2,78%	2,91%	9,84%	21,02%	1,22%	3,11%
Ibovespa (Benchmark)	-3,08%	-1,77%	6,38%	2,90%	13,08%	19,79%	-	-
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	-3,98%	-6,19%	3,60%	-5,23%	4,96%	17,98%	6,57%	14,41%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	-5,18%	-8,25%	3,49%	-10,44%	-1,34%	2,57%	8,24%	19,91%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,45%	-4,11%	6,25%	-2,52%	7,33%	8,42%	4,72%	13,14%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,07%	-0,87%	5,02%	-3,64%	11,55%	32,93%	6,54%	14,57%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,10%	2,71%	6,11%	0,29%	14,52%	51,40%	5,85%	15,81%
IFIX (Benchmark)	-2,58%	-0,16%	-1,24%	-3,00%	2,69%	10,54%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-3,05%	16,06%	-7,56%	-25,70%	-10,17%	-60,15%	9,35%	41,47%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,02%	20,81%	5,53%	9,67%	34,38%	60,71%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	2,38%	24,57%	6,44%	11,96%	40,91%	83,25%	6,45%	12,45%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2,32%	23,60%	6,20%	11,39%	39,62%	79,74%	6,47%	12,39%

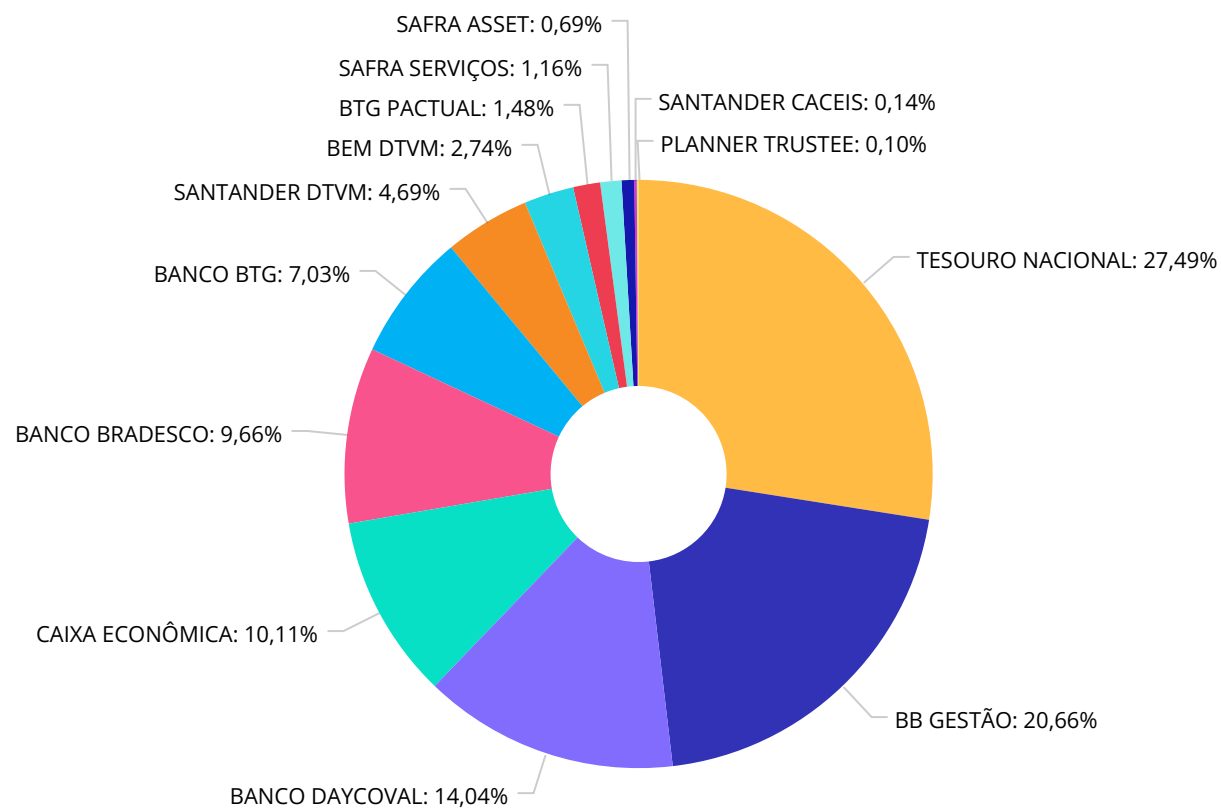
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-4,41%	-13,67%	1,39%	-9,99%	-3,75%	-6,59%	-	-
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	-5,00%	-5,43%	5,94%	-3,32%	6,56%	21,40%	7,50%	18,53%

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

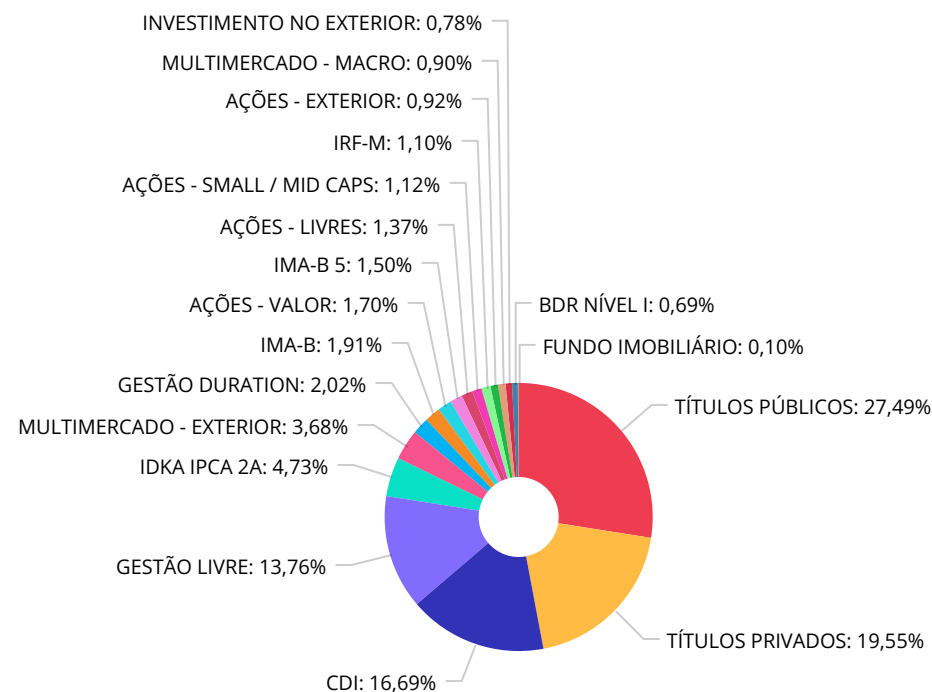
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,09%	30,22%	1,68%	18,06%	38,90%	58,87%	8,30%	13,832%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,05%	32,20%	3,90%	18,13%	41,96%	57,72%	-	-
BB NORDEA GLOBAL 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%
Ibovespa (Benchmark)	-3,08%	-1,77%	6,38%	2,90%	13,08%	19,79%	-	-
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-1,35%	6,22%	1,32%	8,09%	24,36%	35,44%	7,05%	18,748%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO EXTE...	-2,54%	22,69%	-0,51%	8,49%	36,97%	72,65%	7,69%	17,604%

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



TESOURO NACIONAL	151.929.386,58
BB GESTÃO	114.158.152,96
BANCO DAYCOVAL	77.608.768,65
CAIXA ECONÔMICA	55.891.629,46
BANCO BRADESCO	53.402.444,66
BANCO BTG	38.843.277,79
SANTANDER DTVM	25.938.171,48
BEM DTVM	15.141.486,42
BTG PACTUAL	8.198.034,12
SAFRA SERVIÇOS	6.436.302,83
SAFRA ASSET	3.832.470,29
SANTANDER CACEIS	755.050,91
PLANNER TRUSTEE	545.142,63

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



TÍTULOS PÚBLICOS	151.929.386,58	TÍTULOS PRIVADOS	108.032.890,25	CDI	92.258.985,56	GESTÃO LIVRE	76.049.829,35
IDKA IPCA 2A	26.131.615,82	MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.335.736,06	GESTÃO DURATION	11.141.093,34	IMA-B	10.531.761,16
AÇÕES - VALOR	9.375.316,81	IMA-B 5	8.264.919,48	AÇÕES - LIVRES	7.558.356,31	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	6.173.338,76
IRF-M	6.106.858,70	AÇÕES - EXTERIOR	5.099.659,53	MULTIMERCADO - MACRO	5.000.318,95	INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.312.639,20
BDR NÍVEL I	3.832.470,29	FUNDO IMOBILIÁRIO	545.142,63				

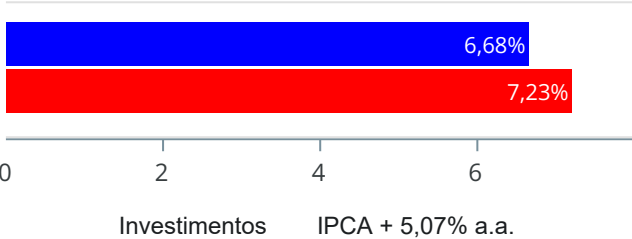
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	20/06/2024	2.311	4.331,488251	4.315,113436	10.010.069,35	9.972.227,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	04/07/2024	2.310	4.373,529844	4.310,638016	10.102.853,94	9.957.573,81	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	14/06/2024	4.701	4.254,309280	4.371,5167	19.999.507,93	20.550.500,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	26/08/2024	2.305	4.350,061802	4.385,457525	10.026.892,45	10.108.479,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	29/05/2024	5.780	4.327,817683	4.337,343517	25.014.786,21	25.069.845,52	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	22/07/2024	2.327	4.319,124924	4.381,959347	10.050.603,70	10.196.819,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	12/08/2024	2.298	4.365,827238	4.412,950008	10.032.670,99	10.140.959,11	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/09/2024	3.524	4.263,219832	4.311,061776	15.023.586,69	15.192.181,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2033	16/09/2024	3.476	4.329,082905	4.349,079063	15.047.892,18	15.117.398,82	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	10/06/2024	5.910	4.228,514294	4.349,455258	24.990.519,48	25.705.280,57	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

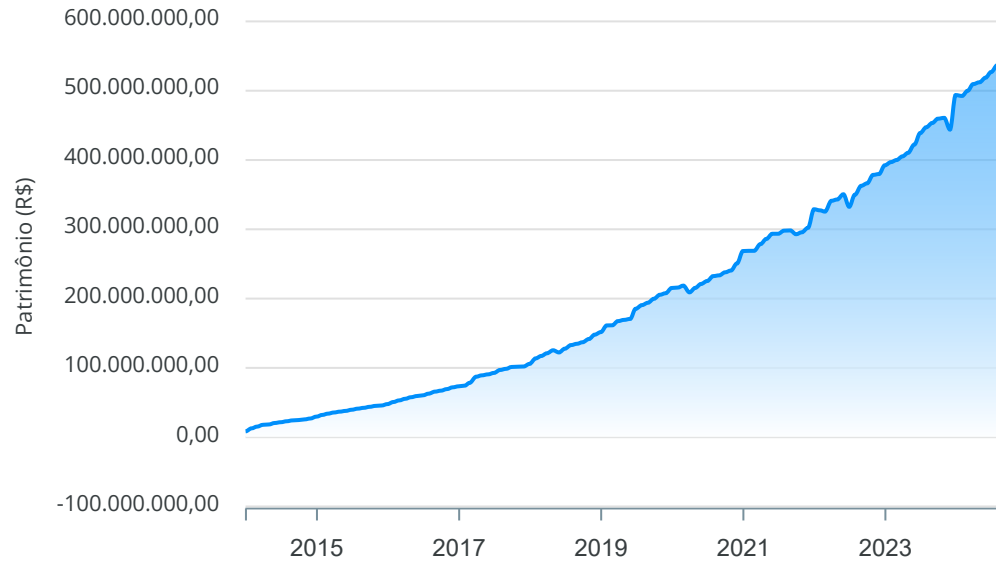
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	493.711.794,42	7.937.647,56	9.511.339,87	492.452.541,40	314.439,29	314.439,29	0,06%	0,06%	0,85%	0,85%	7,45%	1,74%
Fevereiro	492.452.541,40	13.217.914,82	10.903.152,81	499.908.706,02	5.141.402,61	5.455.841,90	1,04%	1,10%	1,21%	2,07%	53,27%	2,01%
Março	499.908.706,02	79.625.810,68	75.657.734,26	509.527.428,03	5.650.645,59	11.106.487,49	1,12%	2,24%	0,55%	2,64%	84,85%	1,11%
Abril	509.527.428,03	24.172.670,09	20.834.978,42	512.198.456,36	-666.663,34	10.439.824,15	-0,13%	2,10%	0,81%	3,47%	60,60%	1,46%
Mai	512.198.456,36	137.935.047,30	135.305.193,61	518.806.081,29	3.977.771,24	14.417.595,39	0,77%	2,89%	0,87%	4,38%	66,09%	1,21%
Junho	518.806.081,29	120.285.732,58	117.252.268,88	526.874.529,26	5.034.984,27	19.452.579,66	0,96%	3,89%	0,60%	5,01%	77,59%	1,53%
Julho	526.874.529,26	38.485.274,68	34.394.219,06	536.946.700,68	5.981.115,80	25.433.695,46	1,13%	5,06%	0,83%	5,88%	85,93%	1,38%
Agosto	536.946.700,68	89.278.380,51	85.006.330,49	547.079.319,26	5.860.568,56	31.294.264,02	1,08%	6,19%	0,41%	6,32%	97,98%	1,91%
Setembro	547.079.319,26	90.673.906,85	87.584.520,36	552.680.318,78	2.511.613,03	33.805.877,05	0,46%	6,68%	0,85%	7,23%	92,37%	1,44%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

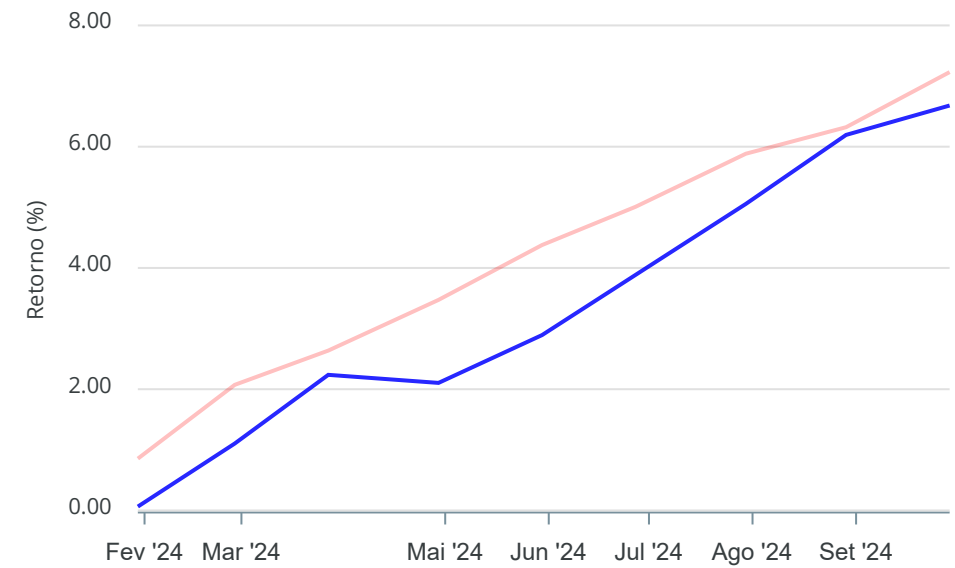
Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO

36M



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1 ☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	47.732.246,35	0,00	0,00	48.154.676,28	422.429,93	0,88%	0,88%	0,02%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	25.712.832,63	0,00	0,00	25.938.171,48	225.338,85	0,88%	0,88%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.881.279,23	0,00	0,00	5.931.446,06	50.166,83	0,85%	0,85%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	647.423,63	0,00	0,00	651.999,67	4.576,04	0,71%	0,71%	0,18%
TÍTULOS PÚBLICOS	120.834.419,90	30.071.478,85	0,00	151.929.386,58	1.023.487,83	0,68%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	63.516.221,12	0,00	0,00	63.941.844,08	425.622,96	0,67%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	38.593.461,32	0,00	0,00	38.843.277,79	249.816,47	0,65%	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	5.214.867,96	0,00	0,00	5.247.768,38	32.900,42	0,63%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.434.360,14	0,00	0,00	10.489.093,67	54.733,53	0,52%	0,52%	0,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.260.022,43	0,00	0,00	8.299.464,90	39.442,47	0,48%	0,48%	0,82%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	77.415.912,55	6.450.570,20	71.982.557,93	12.234.691,74	350.766,92	0,42%	0,75%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	17.761.714,37	0,00	0,00	17.832.150,92	70.436,55	0,40%	0,40%	0,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	23.744.306,45	0,00	15.571.793,26	8.264.919,48	92.406,29	0,39%	0,38%	0,96%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	21.611.923,60	54.151.857,80	0,00	76.049.829,35	286.047,95	0,38%	0,83%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.087.562,63	0,00	0,00	6.106.858,70	19.296,07	0,32%	0,32%	1,35%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.604.724,85	0,00	0,00	10.531.761,16	-72.963,69	-0,69%	-0,69%	1,87%
Total Renda Fixa	484.053.279,16	90.673.906,85	87.554.351,19	490.447.340,24	3.274.505,42	0,67%		0,30%

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
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.007.423,94	0,00	0,00	8.198.034,12	190.610,18	2,38%	2,38%	6,45%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	6.290.648,56	0,00	0,00	6.436.302,83	145.654,27	2,32%	2,32%	6,47%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.675.143,43	0,00	0,00	5.701.399,11	26.255,68	0,46%	0,46%	0,50%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.995.936,70	0,00	0,00	5.000.318,95	4.382,25	0,09%	0,09%	1,22%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.295.948,07	0,00	0,00	4.291.607,76	-4.340,31	-0,10%	-0,10%	5,85%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.595.103,27	0,00	0,00	2.531.620,69	-63.482,58	-2,45%	-2,45%	4,72%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	562.285,48	0,00	0,00	545.142,63	-17.142,85	-3,05%	-3,05%	9,35%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	31.130,07	0,00	30.169,17	0,00	-960,90	-3,09%	-2,93%	5,28%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	765.595,96	0,00	0,00	735.127,86	-30.468,10	-3,98%	-3,98%	6,57%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.083.273,25	0,00	0,00	8.713.370,91	-369.902,34	-4,07%	-4,07%	6,54%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	6.498.110,33	0,00	0,00	6.173.338,76	-324.771,57	-5,00%	-5,00%	7,50%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	698.079,50	0,00	0,00	661.945,90	-36.133,60	-5,18%	-5,18%	8,24%
Total Renda Variável	49.498.678,56	0,00	30.169,17	48.988.209,52	-480.299,87	-0,97%		5,29%

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.874.578,84	0,00	0,00	3.832.470,29	-42.108,55	-1,09%	-1,09%	8,30%
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	361.204,72	0,00	0,00	356.332,31	-4.872,41	-1,35%	-1,35%	7,05%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4.397.983,92	0,00	0,00	4.312.639,20	-85.344,72	-1,94%	-1,94%	6,64%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	409.095,97	0,00	0,00	398.718,60	-10.377,37	-2,54%	-2,54%	7,69%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	4.484.498,09	0,00	0,00	4.344.608,62	-139.889,47	-3,12%	-3,12%	6,18%
Total Exterior	13.527.361,54	0,00	0,00	13.244.769,02	-282.592,52	-2,09%		7,01%

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	80.483.871,62	70.183.151,62	1.326.950,42	151.929.386,58	2.589.313,76	1,72%	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	62.498.666,45	0,00	0,00	63.941.844,08	1.443.177,63	2,31%	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	46.833.417,61	0,00	0,00	48.154.676,28	1.321.258,67	2,82%	2,82%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	35.763.080,82	84.102.552,62	108.695.348,15	12.234.691,74	1.064.406,45	0,89%	2,38%
LETRA FINANCEIRA BTG	28.123.523,10	10.000.000,00	0,00	38.843.277,79	719.754,69	1,89%	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	21.202.479,07	54.151.857,80	0,00	76.049.829,35	695.492,48	0,92%	2,78%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	25.244.922,92	0,00	0,00	25.938.171,48	693.248,56	2,75%	2,75%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	23.412.526,31	0,00	15.571.793,26	8.264.919,48	424.186,43	1,81%	1,80%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.396.941,77	0,00	23.751.766,62	0,00	354.824,85	1,52%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	20.440.125,63	0,00	20.753.232,74	0,00	313.107,11	1,53%	2,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	17.530.003,46	0,00	0,00	17.832.150,92	302.147,46	1,72%	1,72%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.265.256,22	0,00	0,00	10.489.093,67	223.837,45	2,18%	2,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.337.744,75	0,00	0,00	10.531.761,16	194.016,41	1,88%	1,88%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.775.339,14	0,00	0,00	5.931.446,06	156.106,92	2,70%	2,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.145.666,94	0,00	0,00	8.299.464,90	153.797,96	1,89%	1,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	8.396.767,44	0,00	8.539.263,18	0,00	142.495,74	1,70%	2,23%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.138.374,34	0,00	9.276.417,66	0,00	138.043,32	1,51%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.969.524,28	0,00	0,00	6.106.858,70	137.334,42	2,30%	2,30%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	5.136.516,33	0,00	0,00	5.247.768,38	111.252,05	2,17%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.950.639,53	0,00	5.993.022,13	0,00	42.382,60	0,71%	2,31%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	634.776,39	0,00	0,00	651.999,67	17.223,28	2,71%	2,71%
Total Renda Fixa	454.680.164,12	218.437.562,04	193.907.794,16	490.447.340,24	11.237.408,24	2,34%	

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
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.360.487,45	0,00	13.047.106,58	0,00	686.619,13	5,55%	-3,21%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.702.031,29	0,00	0,00	8.198.034,12	496.002,83	6,44%	6,44%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.296.975,94	0,00	0,00	8.713.370,91	416.394,97	5,02%	5,02%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	6.060.741,53	0,00	0,00	6.436.302,83	375.561,30	6,20%	6,20%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	5.826.973,12	0,00	0,00	6.173.338,76	346.365,64	5,94%	5,94%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.044.372,58	0,00	0,00	4.291.607,76	247.235,18	6,11%	6,11%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.382.632,02	0,00	0,00	2.531.620,69	148.988,67	6,25%	6,25%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.865.275,73	0,00	0,00	5.000.318,95	135.043,22	2,78%	2,78%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.642.668,41	0,00	0,00	5.701.399,11	58.730,70	1,04%	1,04%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	709.607,93	0,00	0,00	735.127,86	25.519,93	3,60%	3,60%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	639.644,29	0,00	0,00	661.945,90	22.301,61	3,49%	3,49%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	28.347,60	0,00	30.169,17	0,00	1.821,57	6,43%	6,60%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	589.714,04	0,00	0,00	545.142,63	-44.571,41	-7,56%	-7,56%
Total Renda Variável	59.149.471,93	0,00	13.077.275,75	48.988.209,52	2.916.013,34	4,93%	

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 NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	4.252.036,59	0,00	0,00	4.344.608,62	92.572,03	2,18%	2,18%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.769.008,75	0,00	0,00	3.832.470,29	63.461,54	1,68%	1,68%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4.271.405,70	0,00	0,00	4.312.639,20	41.233,50	0,97%	0,97%
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	351.681,12	0,00	0,00	356.332,31	4.651,19	1,32%	1,32%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	400.761,05	0,00	0,00	398.718,60	-2.042,45	-0,51%	-0,51%
Total Exterior	13.044.893,21	0,00	0,00	13.244.769,02	199.875,81	1,53%	

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.

