

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

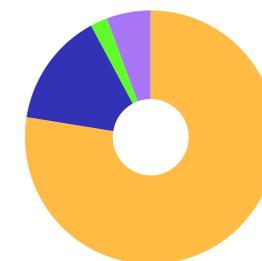
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			103.204.297,45	37,14%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	763.433,07	0,27%	776	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.612.285,15	1,66%	605	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2028	9.928.025,07	3,57%	126	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	32.152.877,52	11,57%	85	6,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	11.981.019,62	4,31%	95	2,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	10.362.147,99	3,73%	21	13,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.272.906,92	3,70%	806	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.621.849,21	0,58%	895	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.306.591,87	0,47%	1.161	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	889.991,90	0,32%	403	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	401.085,34	0,14%	198	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.096.389,75	1,11%	1.040	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.246.385,30	0,45%	140	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	94.800,06	0,03%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	19.479.440,13	7,01%	1.059	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	279.425,67	0,10%	202	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	Não se ...	27 meses	295.116,37	0,11%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.472.056,86	1,25%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.294.383,86	1,19%	1.144	0,43%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.628.150,92	2,03%	2.368	0,68%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.637.331,78	0,95%	16.060	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.309.336,17	1,19%	1.620	3,41%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	6.886.038,03	2,48%	1.706	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	4.403.027,79	1,58%	123	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.559.820,94	1,64%	1.977	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	3.778.053,91	1,36%	342	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.375.864,09	1,21%	12.040	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.648.615,69	0,95%	1.276	1,90%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	3.444.183,58	1,24%	21.442	0,56%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.594.203,33	0,93%	318	0,34%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.671.951,30	0,60%	4.191	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.997.798,01	2,52%	346	7,88%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	3.381.718,03	1,22%	108	0,37%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.512.573,86	0,90%	17	3,28%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.275.452,76	0,46%	28	2,32%	Artigo 10º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			277.858.629,30				

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%	103.204.297,45	37,14%	0,00%	10,00%	50,00%	35.725.017,20
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	84.292.213,66	30,34%	8,00%	27,00%	70,00%	110.208.826,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	24.196.440,91	8,71%	2,00%	16,00%	60,00%	142.518.736,67
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	55.571.725,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	3.767.173,23	1,36%	0,00%	2,00%	3,00%	4.568.585,65
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.892.931,47
Total Renda Fixa	100,00%	215.460.125,25	77,54%	10,00%	60,00%	208,00%	

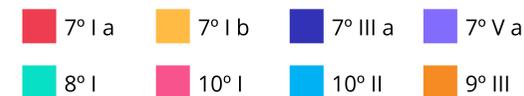
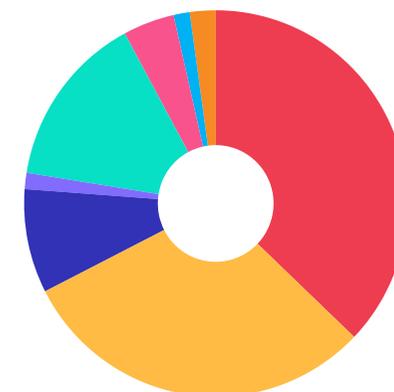


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	40.520.623,18	14,58%	5,00%	20,00%	30,00%	42.836.965,61
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	83.357.588,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	12.051.467,34	4,34%	1,00%	10,00%	10,00%	15.734.395,59
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	3.788.026,62	1,36%	1,00%	3,00%	5,00%	10.104.904,85
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.892.931,47
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	56.360.117,14	20,28%	7,00%	33,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	27.785.862,93
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.038.386,91	2,17%	0,00%	2,00%	10,00%	21.747.476,02
Total Exterior	10,00%	6.038.386,91	2,17%	0,00%	5,00%	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%	2,00%	5,00%	13.892.931,47



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 '	103.204.297,45	37,14	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	84.292.213,66	30,34	8,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	24.196.440,91	8,71	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	3.767.173,23	1,36	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	40.520.623,18	14,58	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	6.038.386,91	2,17	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	12.051.467,34	4,34	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	3.788.026,62	1,36	1,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	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
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	103.204.297,45	37,14	-
CAIXA DTVM	94.236.604,31	33,92	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.404.183,18	12,02	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	6.997.798,01	2,52	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	6.886.038,03	2,48	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.559.820,94	1,64	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	4.056.375,10	1,46	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.778.053,91	1,36	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.472.056,86	1,25	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	3.381.718,03	1,22	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.309.336,17	1,19	-
PERFIN EQUITIES ADMINISTRAÇÃO ...	2.648.615,69	0,95	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.594.203,33	0,93	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.512.573,86	0,90	-
KPTL	1.275.452,76	0,46	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	1.246.385,30	0,45	-
GENIAL GESTÃO LTDA	295.116,37	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 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%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,67%	0,66%	1,56%	-0,46%	0,59%	6,69%	1,62%	4,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	2,34%	1,46%	1,61%	5,43%	-	1,93%	3,35%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	0,72%	1,58%	-0,41%	0,65%	-	1,62%	4,63%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,60%	4,60%	1,53%	3,33%	7,94%	20,67%	-	-
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,57%	7,63%	2,29%	5,07%	11,53%	24,84%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,20%	-4,80%	-0,63%	-4,29%	-5,63%	-8,15%	42,75%	26,28%
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%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	4,66%	1,80%	3,38%	7,84%	20,50%	1,11%	1,79%
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%	-	-
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%

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
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%	-	-
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	-0,44%	-3,67%	-1,63%	-2,82%	-5,50%	14,22%	0,02%	0,51%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	7,33%	2,70%	5,39%	11,61%	26,97%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,78%	6,37%	2,32%	4,69%	10,11%	23,11%	0,00%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,78%	6,89%	2,60%	5,39%	10,64%	24,97%	0,44%	0,70%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,79%	6,39%	2,33%	4,70%	10,11%	23,82%	0,01%	0,05%
IPCA (Benchmark)	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,71%	3,53%	1,39%	2,47%	7,38%	21,12%	0,69%	2,56%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,59%	3,71%	1,66%	2,65%	7,64%	22,83%	1,48%	2,11%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,18%	-3,85%	-1,17%	-1,53%	-1,04%	-	5,50%	5,85%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	0,73%	5,01%	2,45%	4,01%	7,65%	19,97%	0,41%	0,82%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,33%	4,64%	2,69%	3,52%	10,29%	22,63%	1,62%	3,25%

Ibovespa (Benchmark)	6,54%	1,36%	11,39%	5,41%	17,51%	24,18%	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,64%	12,25%	15,21%	11,73%	30,30%	27,56%	6,26%	12,82%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,98%	-4,12%	8,50%	-3,13%	8,84%	6,30%	6,84%	15,00%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,07%	-0,26%	9,16%	3,91%	14,36%	12,53%	5,46%	13,12%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4,68%	-4,65%	9,30%	1,40%	9,11%	10,30%	5,93%	12,93%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,88%	0,82%	12,48%	0,29%	14,97%	11,30%	6,69%	16,15%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	6,10%	-0,20%	10,96%	3,05%	14,19%	16,81%	6,02%	13,53%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	6,42%	0,65%	9,33%	3,50%	15,75%	24,86%	6,39%	14,41%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	5,31%	-1,70%	9,20%	0,98%	8,92%	9,94%	5,56%	13,70%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,77%	-2,23%	12,30%	2,77%	6,87%	6,83%	5,81%	13,30%

IDIV (Benchmark)	6,69%	5,00%	10,87%	7,85%	21,94%	34,91%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,81%	2,47%	10,02%	1,71%	13,82%	26,58%	6,07%	14,98%

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,28%	18,42%	7,03%	10,83%	25,31%	42,82%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2,43%	20,80%	7,78%	12,51%	30,45%	60,63%	9,20%	12,22%

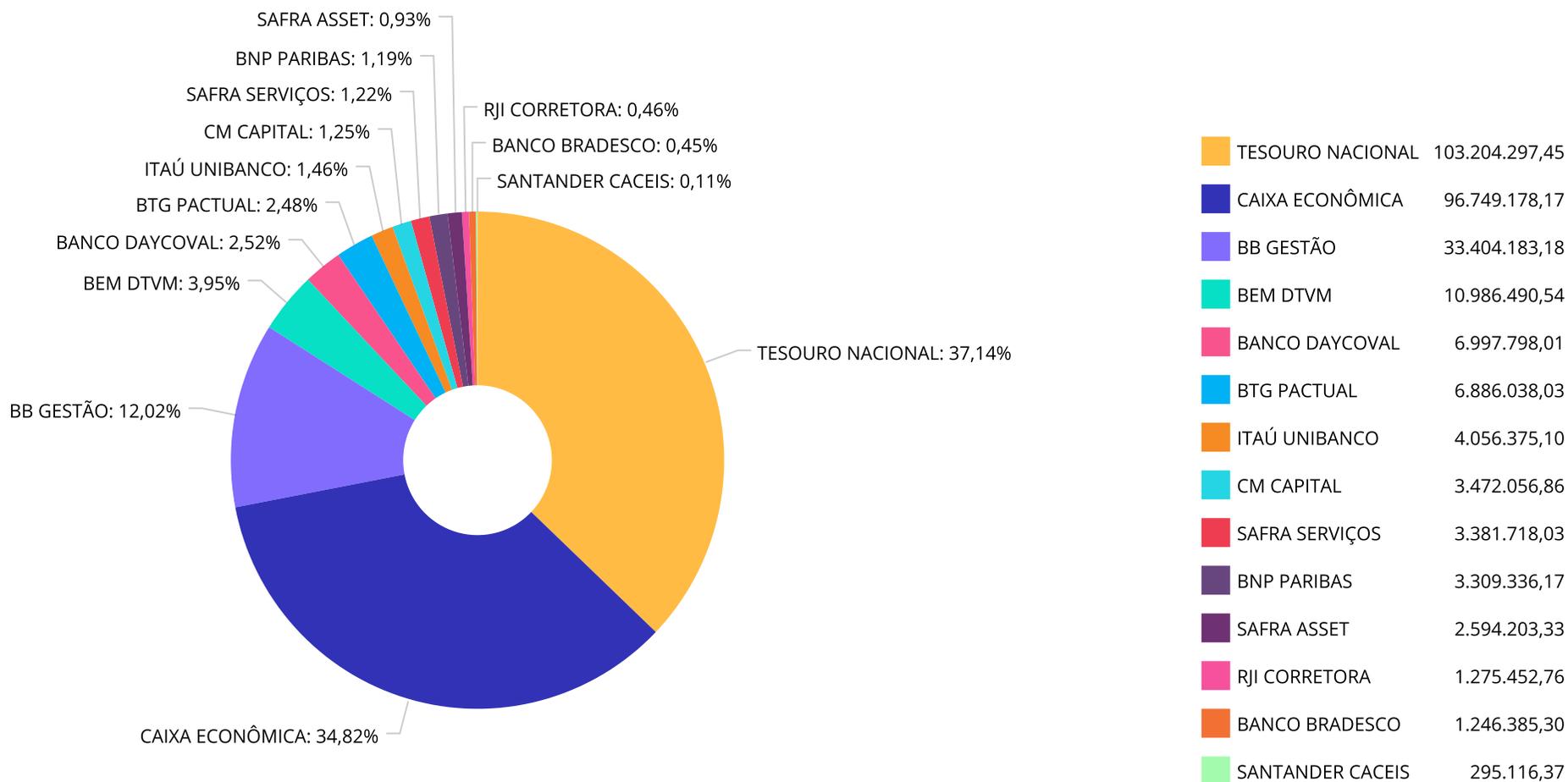
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,86%	9,98%	3,11%	6,78%	15,18%	33,14%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,12%	-55,14%	-19,73%	-20,06%	-55,39%	-59,21%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,65%	8,30%	2,52%	5,56%	12,58%	27,19%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-41,85%	-20,44%	-26,03%	-26,46%	-20,30%	-20,14%	67,14%	50,90%

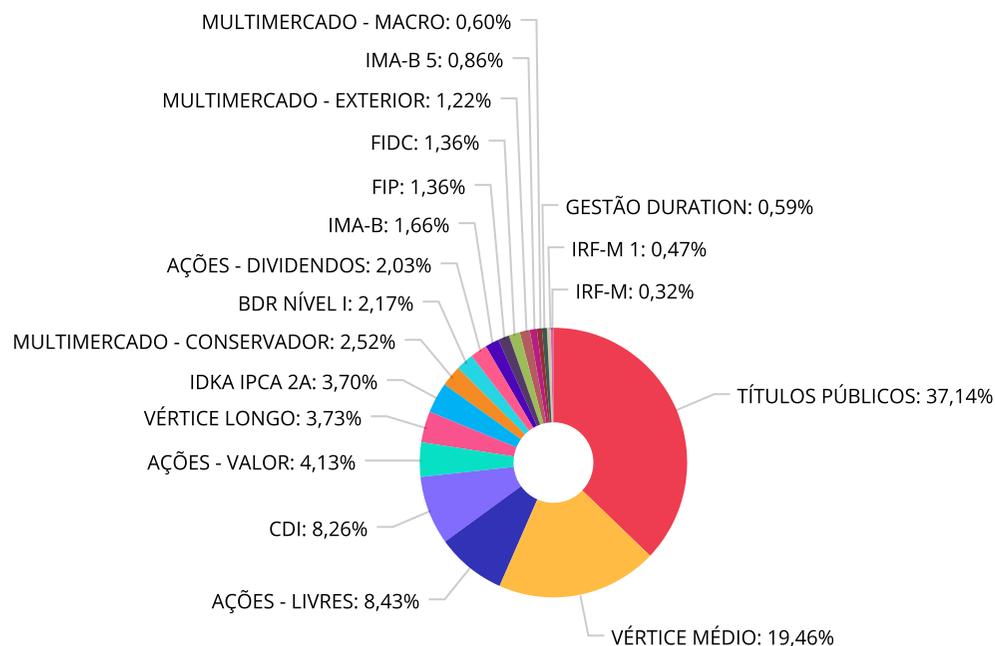
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,16%	31,65%	13,54%	22,58%	36,50%	49,59%	9,09%	13,346%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES 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)



■ TÍTULOS PÚBLICOS	103.204.297,45	■ VÉRTICE MÉDIO	54.061.922,21	■ AÇÕES - LIVRES	23.417.006,70	■ CDI	22.950.055,61
■ AÇÕES - VALOR	11.475.465,56	■ VÉRTICE LONGO	10.362.147,99	■ IDKA IPCA 2A	10.272.906,92	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	6.997.798,01
■ BDR NÍVEL I	6.038.386,91	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	5.628.150,92	■ IMA-B	4.612.285,15	■ FIP	3.788.026,62
■ FIDC	3.767.173,23	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.381.718,03	■ IMA-B 5	2.385.282,28	■ MULTIMERCADO - MACRO	1.671.951,30
■ GESTÃO DURATION	1.647.470,64	■ IRF-M 1	1.306.591,87	■ IRF-M	889.991,90		

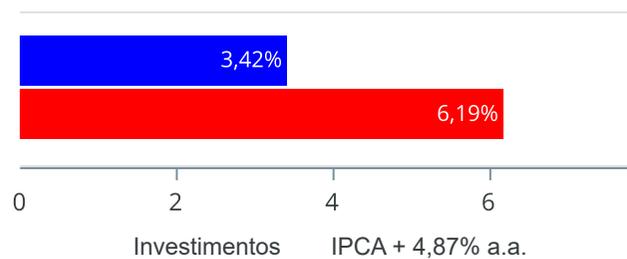
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2024)

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	04/07/2024	2.647	4.344,312936	4.279,841935	11.499.396,34	11.328.741,60	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	21/08/2024	3.509	4.273,754599	4.281,417171	14.996.604,89	15.023.492,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	04/07/2024	117	4.271,346157	4.333,546682	499.747,50	507.024,96	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	26/06/2024	2.539	4.292,963338	4.362,928064	10.899.833,92	11.077.474,35	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	21/08/2024	3.509	4.274,617730	4.281,978214	14.999.633,61	15.025.461,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/07/2024	115	4.340,532858	4.268,845496	499.161,28	490.917,23	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	26/06/2024	2.485	4.341,924875	4.284,295752	10.789.683,31	10.646.474,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	09/07/2024	115	4.316,172797	4.244,340871	496.359,87	488.099,20	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	26/06/2024	2.435	4.310,371980	4.252,769461	10.495.755,77	10.355.493,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/07/2024	119	4.185,841436	4.246,093051	498.115,13	505.285,07	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	26/06/2024	2.401	4.230,974313	4.300,000636	10.158.569,33	10.324.301,52	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	04/07/2024	2.235	4.241,967744	4.174,495353	9.480.797,91	9.329.997,11	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/07/2024	1.911	4.185,041277	4.239,420957	7.997.613,88	8.101.533,44	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	262.588.417,28	13.304.514,97	9.901.084,94	264.939.005,41	-1.052.841,90	-1.052.841,90	-0,40%	-0,40%	0,84%	0,84%	-47,25%	1,99%
Fevereiro	264.939.005,41	30.502.448,14	30.033.713,68	266.775.669,17	1.367.929,30	315.087,40	0,52%	0,12%	1,19%	2,04%	5,76%	2,95%
Março	266.775.669,17	7.687.942,07	7.244.174,87	268.904.957,09	1.685.520,72	2.000.608,12	0,63%	0,75%	0,54%	2,59%	28,93%	1,70%
Abril	268.904.957,09	6.028.079,58	5.119.710,95	266.522.435,27	-3.290.890,45	-1.290.282,33	-1,22%	-0,48%	0,80%	3,41%	-14,08%	2,26%
Mai	266.522.435,27	17.982.545,57	19.254.977,39	265.880.981,16	630.977,71	-659.304,62	0,24%	-0,24%	0,86%	4,30%	-5,68%	2,42%
Junho	265.880.981,16	75.259.481,15	81.692.827,99	261.311.207,21	1.863.572,89	1.204.268,27	0,70%	0,46%	0,59%	4,91%	9,27%	2,27%
Julho	261.311.207,21	83.183.591,84	77.729.937,28	270.777.816,09	4.012.954,32	5.217.222,59	1,50%	1,97%	0,82%	5,77%	34,09%	3,20%
Agosto	270.777.816,09	103.773.893,03	100.585.970,74	277.858.629,30	3.892.890,92	9.110.113,51	1,42%	3,42%	0,40%	6,19%	55,21%	4,87%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

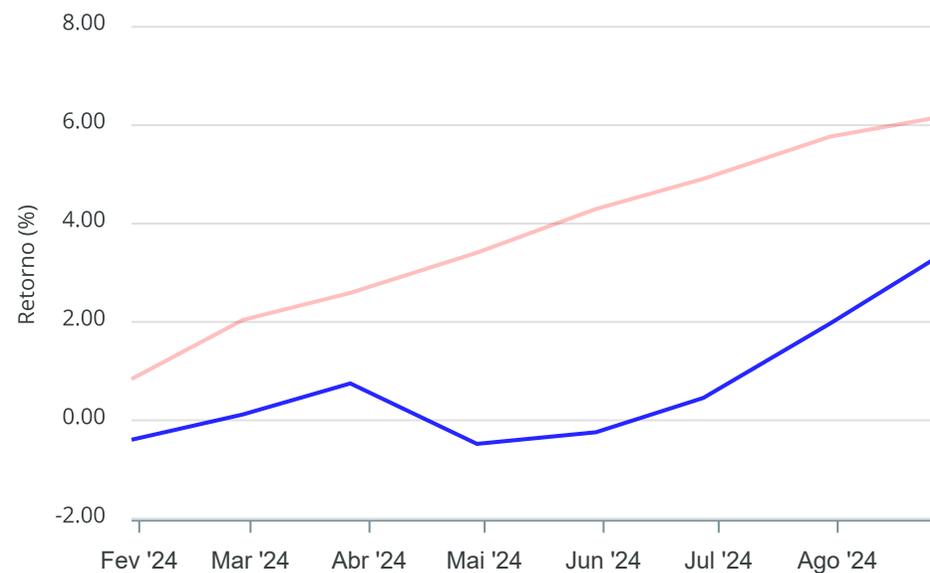


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	277.256,84	0,00	0,00	279.425,67	2.168,83	0,78%	0,78%	0,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.525.587,12	0,00	230.000,00	1.306.591,87	11.004,75	0,72%	0,75%	0,30%
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.593.500,98	0,00	307.052,91	10.362.147,99	75.699,92	0,71%	-2,18%	5,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	398.277,98	0,00	0,00	401.085,34	2.807,36	0,70%	0,70%	0,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	10.150.574,12	0,00	293.591,47	9.928.025,07	71.042,42	0,70%	0,68%	1,93%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.900.078,55	0,00	0,00	11.981.019,62	80.941,07	0,68%	0,68%	1,62%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.937.464,96	0,00	0,00	32.152.877,52	215.412,56	0,67%	0,67%	1,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	876.329,93	11.524,51	3.426,52	889.991,90	5.563,98	0,63%	0,64%	1,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.230.383,10	0,00	1.237.886,70	0,00	7.503,60	0,61%	0,91%	0,09%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.239.097,73	0,00	0,00	1.246.385,30	7.287,57	0,59%	0,59%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.612.486,64	0,00	0,00	1.621.849,21	9.362,57	0,58%	0,58%	1,09%
TÍTULOS PÚBLICOS	73.885.031,77	29.996.238,49	1.279.873,70	103.204.297,45	602.900,89	0,58%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.051.846,50	0,00	16.138.575,30	0,00	86.728,80	0,54%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.344.827,49	0,00	22.464.642,61	0,00	119.815,12	0,54%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	759.491,79	0,00	0,00	763.433,07	3.941,28	0,52%	0,52%	1,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.591.047,46	0,00	0,00	4.612.285,15	21.237,69	0,46%	0,46%	2,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.609.153,84	5.205.150,42	6.604.787,96	10.272.906,92	63.390,62	0,38%	0,59%	1,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	507.578,55	2.600.766,63	22.345,61	3.096.389,75	10.390,18	0,33%	0,79%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	19.444.706,88	0,00	19.479.440,13	34.733,25	0,18%	0,88%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	67.694,95	46.515.506,10	46.532.715,22	94.800,06	44.314,23	0,10%	0,78%	0,00%

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
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.479.140,16	0,00	0,00	3.472.056,86	-7.083,30	-0,20%	-0,20%	42,75%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	296.421,22	0,00	0,00	295.116,37	-1.304,85	-0,44%	-0,44%	0,02%
Total Renda Fixa	205.333.271,68	103.773.893,03	95.114.898,00	215.460.125,25	1.467.858,54	0,69%		2,92%

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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.136.166,94	0,00	0,00	3.375.864,09	239.697,15	7,64%	7,64%	6,26%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.478.149,93	0,00	0,00	2.648.615,69	170.465,76	6,88%	6,88%	6,69%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.269.565,35	0,00	0,00	5.628.150,92	358.585,57	6,80%	6,80%	6,07%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.550.073,98	0,00	0,00	3.778.053,91	227.979,93	6,42%	6,42%	6,39%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	4.149.792,72	0,00	0,00	4.403.027,79	253.235,07	6,10%	6,10%	6,02%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.330.123,38	0,00	0,00	4.559.820,94	229.697,56	5,30%	5,30%	5,56%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.135.562,37	0,00	0,00	3.294.383,86	158.821,49	5,07%	5,07%	5,46%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.158.690,80	0,00	0,00	3.309.336,17	150.645,37	4,77%	4,77%	5,81%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.519.451,98	0,00	0,00	2.637.331,78	117.879,80	4,68%	4,68%	5,93%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.622.260,17	0,00	0,00	6.886.038,03	263.777,86	3,98%	3,98%	6,84%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	3.301.413,44	0,00	0,00	3.381.718,03	80.304,59	2,43%	2,43%	9,20%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.650.027,29	0,00	0,00	1.671.951,30	21.924,01	1,33%	1,33%	1,62%
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	6.947.319,28	0,00	0,00	6.997.798,01	50.478,73	0,73%	0,73%	0,41%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II RESP LIMITADA F...	3.642.456,00	0,00	3.664.833,00	0,00	22.377,00	0,61%	-1,53%	3,65%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	4.320.584,99	0,00	1.806.239,74	2.512.573,86	-1.771,39	-0,04%	-41,85%	67,14%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	1.276.952,58	0,00	0,00	1.275.452,76	-1.499,82	-0,12%	-	-
Total Renda Variável	59.488.591,20	0,00	5.471.072,74	56.360.117,14	2.342.598,68	3,94%		8,25%

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.539.229,71	0,00	0,00	2.594.203,33	54.973,62	2,16%	2,16%	9,09%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.416.723,50	0,00	0,00	3.444.183,58	27.460,08	0,80%	0,80%	11,09%
Total Exterior	5.955.953,21	0,00	0,00	6.038.386,91	82.433,70	1,38%		10,23%

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 & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

