

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.025.938,91	2,68%	668	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.148.864,00	3,00%	837	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	784.599,68	2,05%	776	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	77.731,96	0,20%	609	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA F...	D+0	15/05/2025	903.324,22	2,36%	193	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	161.309,76	0,42%	332	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	859.661,57	2,24%	267	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2025 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	15/05/2025	780.469,23	2,04%	55	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	17/08/2026	517.509,53	1,35%	205	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.694.126,05	4,42%	731	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.389.390,51	3,63%	806	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	992.915,13	2,59%	895	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.852.762,04	4,84%	727	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.903.519,56	7,58%	1.161	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ ASSET NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	15/05/2025	107.706,12	0,28%	8	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	260.985,56	0,68%	3.136	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.128.444,94	2,95%	59	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.331.451,51	3,48%	41.647	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	189.372,06	0,49%	1.040	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	483.630,97	1,26%	140	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

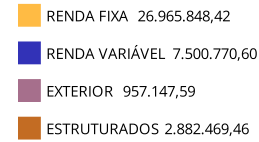
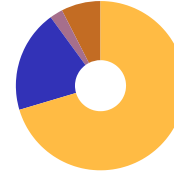
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASILEIRA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.412.762,30	6,30%	112	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	2.239.956,72	5,85%	370	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	988.154,81	2,58%	186	0,69%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	2.417.548,01	6,31%	202	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	313.713,27	0,82%	697	0,12%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.316.778,97	3,44%	2.368	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	435.689,70	1,14%	16.060	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.071.170,28	2,80%	238	1,31%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.467.475,55	3,83%	846	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.464.311,53	3,82%	198	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.321.203,71	3,45%	2.256	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	424.140,86	1,11%	1.977	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	107.961,48	0,28%	70	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	849.186,11	2,22%	442	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	D+0	Não há	744.965,17	1,94%	7	1,97%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	74.214,68	0,19%	471	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	272.398,38	0,71%	4.191	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	435.591,49	1,14%	740	0,73%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	793.063,01	2,07%	2.151	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	562.236,73	1,47%	26	0,59%	Artigo 10º, Inciso I

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			38.306.236,07				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	80,00%	30.644.988,86
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	16.589.258,77	43,31%	0,00%	27,00%	100,00%	21.716.977,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	10.062.876,38	26,27%	0,00%	25,00%	60,00%	12.920.865,26
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	8,00%	20,00%	7.661.247,21
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.915.311,80
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	313.713,27	0,82%	0,00%	1,00%	5,00%	1.601.598,53
Total Renda Fixa	100,00%	26.965.848,42	70,40%	0,00%	71,00%	270,00%	



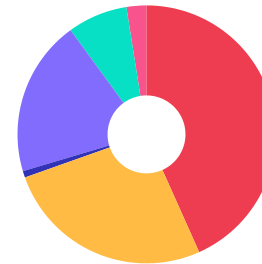
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	7.500.770,60	19,58%	0,00%	18,00%	35,00%	5.906.412,02
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	13.407.182,62
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.882.469,46	7,52%	0,00%	8,00%	10,00%	948.154,15
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.915.311,80
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.915.311,80
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	10.383.240,06	27,11%	0,00%	27,00%	90,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.830.623,61
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	957.147,59	2,50%	0,00%	2,00%	10,00%	2.873.476,02
Total Exterior	10,00%	957.147,59	2,50%	0,00%	2,00%	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%	3.830.623,61



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	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	16.589.258,77	43,31	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	10.062.876,38	26,27	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	313.713,27	0,82	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	7.500.770,60	19,58	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	957.147,59	2,50	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.882.469,46	7,52	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	23.234.457,23	60,65	0,11
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.375.060,77	19,25	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.348.476,42	8,74	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.481.942,58	6,48	0,04
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.128.444,94	2,95	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	424.140,86	1,11	0,02
SOMMA INVESTIMENTOS	313.713,27	0,82	-

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%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,84%	-	2,30%	-	-	-	0,49%	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2025 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-

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%
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%

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%	-	-
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%

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%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	3,37%	1,66%	2,25%	8,00%	23,62%	1,62%	2,68%

CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,85%	6,93%	2,52%	5,10%	10,95%	25,70%	0,00%	0,05%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,87%	7,05%	2,58%	5,20%	11,12%	26,11%	0,01%	0,05%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,02%	7,57%	1,31%	4,74%	8,79%	21,93%	2,49%	3,31%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,04%	8,38%	3,15%	5,78%	13,36%	26,79%	0,18%	0,54%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,78%	6,89%	2,60%	5,39%	10,64%	24,97%	0,44%	0,70%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,78%	6,37%	2,32%	4,69%	10,11%	23,11%	0,00%	0,05%
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%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,78%	5,50%	2,25%	3,90%	8,67%	22,91%	0,24%	0,89%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,59%	3,71%	1,66%	2,65%	7,64%	22,83%	1,48%	2,11%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,60%	3,70%	1,80%	2,75%	8,02%	21,19%	0,83%	1,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,68%	4,05%	1,82%	2,80%	7,52%	22,31%	0,64%	1,36%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,54%	4,58%	1,78%	3,32%	7,69%	20,10%	1,09%	1,79%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,87%	6,98%	2,60%	5,17%	11,11%	26,23%	0,05%	0,19%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	0,79%	6,47%	2,48%	4,75%	10,17%	25,02%	0,45%	0,49%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	0,93%	7,02%	3,14%	5,45%	8,87%	25,01%	0,27%	2,64%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,33%	4,64%	2,69%	3,52%	10,29%	22,63%	1,62%	3,25%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,76%	5,95%	2,29%	4,26%	9,77%	24,14%	0,21%	0,40%

Global BDRX (Benchmark)	0,55%	42,25%	13,74%	27,72%	48,00%	71,14%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,27%	36,77%	14,84%	25,52%	41,84%	54,43%	8,47%	13,30%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES 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 FIC AÇÕES	4,68%	-4,65%	9,30%	1,40%	9,11%	10,30%	5,93%	12,93%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,54%	2,74%	10,19%	3,26%	17,40%	26,11%	7,33%	16,04%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4,51%	-2,60%	8,56%	0,89%	7,56%	8,51%	6,53%	14,00%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	5,31%	-1,70%	9,20%	0,98%	8,92%	9,94%	5,56%	13,70%

IDIV (Benchmark)	6,69%	5,00%	10,87%	7,85%	21,94%	34,91%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,45%	4,12%	10,36%	7,10%	20,29%	31,42%	5,12%	11,58%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,62%	4,29%	10,69%	7,33%	20,89%	32,64%	5,21%	11,85%

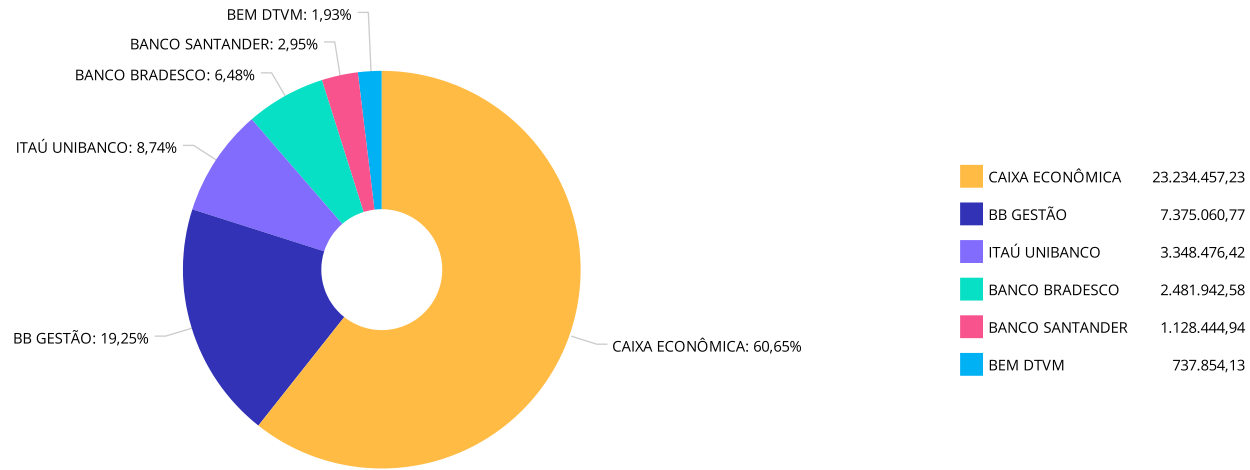
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%	-	-
BRDESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	2,39%	19,44%	7,62%	11,29%	28,61%	53,34%	9,05%	12,28%

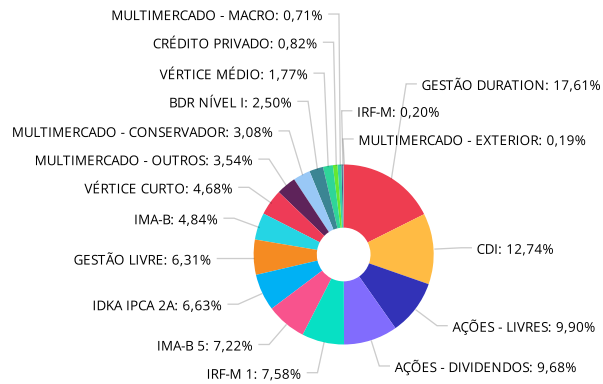
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,57%	41,02%	13,95%	26,91%	46,38%	68,28%	9,23%	15,184%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,27%	36,77%	14,84%	25,52%	41,84%	54,42%	8,47%	13,299%

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



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

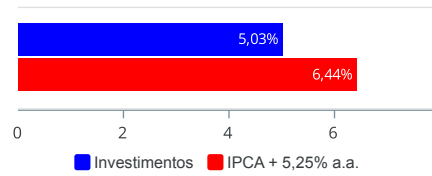


■ GESTÃO DURATION	6.744.903,17	■ CDI	4.881.427,42	■ AÇÕES - LIVRES	3.791.617,64	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.709.152,96
■ IRF-M 1	2.903.519,56	■ IMA-B 5	2.765.669,62	■ IDKA IPCA 2A	2.538.254,51	■ GESTÃO LIVRE	2.417.548,01
■ IMA-B	1.852.762,04	■ VÉRTICE CURTO	1.791.499,57	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.355.299,74	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.180.556,66
■ BDR NÍVEL I	957.147,59	■ VÉRTICE MÉDIO	678.819,29	■ CRÉDITO PRIVADO	313.713,27	■ MULTIMERCADO - MACRO	272.398,38
■ IRF-M	77.731,96	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	74.214,68				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

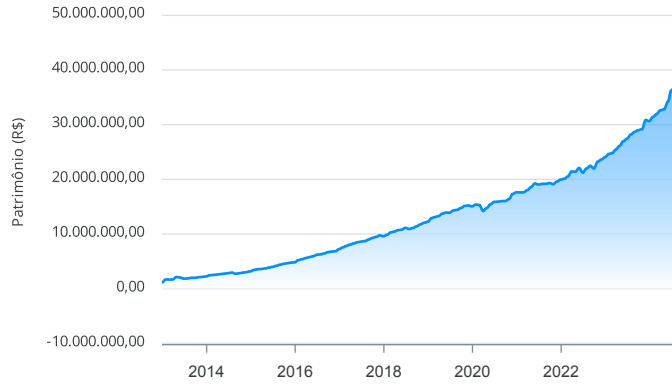
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	30.641.664,27	1.039.009,65	228.013,99	31.439.991,21	-12.668,72	-12.668,72	-0,04%	-0,04%	0,87%	0,87%	-4,63%	1,56%
Fevereiro	31.439.991,21	459.378,70	216.890,27	31.950.285,59	267.805,95	255.137,23	0,85%	0,80%	1,22%	2,10%	38,32%	1,88%
Março	31.950.285,59	566.350,14	118.492,85	32.600.783,89	202.641,01	457.778,24	0,63%	1,44%	0,57%	2,68%	53,56%	1,29%
Abril	32.600.783,89	1.491.840,25	1.106.944,14	32.817.426,25	-168.253,75	289.524,49	-0,51%	0,92%	0,83%	3,53%	25,99%	1,97%
Mai	32.817.426,25	3.389.332,64	2.185.816,00	34.161.535,08	140.592,19	430.116,68	0,41%	1,33%	0,89%	4,45%	29,98%	1,67%
Junho	34.161.535,08	2.524.682,77	720.670,69	36.268.383,53	302.836,37	732.953,05	0,84%	2,19%	0,62%	5,10%	42,93%	1,87%
Julho	36.268.383,53	3.336.213,61	2.936.920,43	37.051.890,37	384.213,66	1.117.166,71	1,05%	3,26%	0,85%	5,99%	54,40%	1,80%
Agosto	37.051.890,37	5.345.599,81	4.736.922,07	38.306.236,07	645.667,96	1.762.834,67	1,71%	5,03%	0,43%	6,44%	78,05%	2,08%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



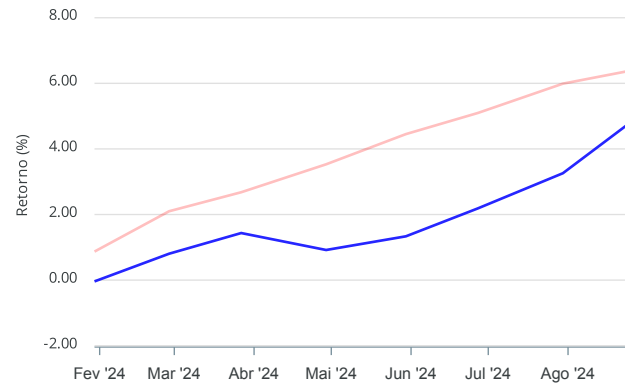
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	310.498,21	0,00	0,00	313.713,27	3.215,06	1,04%	1,04%	0,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.016.316,24	0,00	0,00	1.025.938,91	9.622,67	0,95%	0,95%	0,41%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	852.440,99	0,00	0,00	859.661,57	7.220,58	0,85%	0,85%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	2.398.783,59	0,00	0,00	2.417.548,01	18.764,42	0,78%	0,78%	0,44%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.394.123,61	0,00	0,00	2.412.762,30	18.638,69	0,78%	0,78%	0,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.881.950,34	0,00	0,00	2.903.519,56	21.569,22	0,75%	0,75%	0,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	94.399,78	93.665,98	0,00	189.372,06	1.306,30	0,69%	0,79%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.682.738,13	0,00	0,00	1.694.126,05	11.387,92	0,68%	0,68%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	160.043,14	0,00	161.097,74	0,00	1.054,60	0,66%	0,93%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	895.061,46	0,00	900.905,65	0,00	5.844,19	0,65%	0,92%	0,08%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	77.228,59	0,00	0,00	77.731,96	503,37	0,65%	0,65%	1,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.141.610,04	0,00	0,00	1.148.864,00	7.253,96	0,64%	0,64%	1,25%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	102.170,43	159.439,47	2.203,43	260.985,56	1.579,09	0,60%	0,87%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.121.769,71	0,00	0,00	1.128.444,94	6.675,23	0,60%	0,60%	0,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.381.221,94	0,00	0,00	1.389.390,51	8.168,57	0,59%	0,59%	1,34%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	480.803,20	0,00	0,00	483.630,97	2.827,77	0,59%	0,59%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	987.183,25	0,00	0,00	992.915,13	5.731,88	0,58%	0,58%	1,09%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	982.869,30	0,00	0,00	988.154,81	5.285,51	0,54%	0,54%	1,09%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.287.899,08	0,00	1.294.804,92	0,00	6.905,84	0,54%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	780.549,12	0,00	0,00	784.599,68	4.050,56	0,52%	0,52%	1,11%

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 ...	1.843.553,85	0,00	0,00	1.852.762,04	9.208,19	0,50%	0,50%	2,44%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2025 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	0,00	777.804,92	0,00	780.469,23	2.664,31	0,34%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	0,00	900.560,78	0,00	903.324,22	2.763,44	0,31%	0,84%	0,49%
ITAÚ ASSET NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,00	107.438,44	0,00	107.706,12	267,68	0,25%	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	0,00	517.000,00	0,00	517.509,53	509,53	0,10%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.168.599,42	2.139.092,37	2.071.363,85	2.239.956,72	3.628,78	0,08%	0,78%	0,00%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.331.154,07	0,00	0,00	1.331.451,51	297,44	0,02%	0,02%	2,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	161.442,61	0,00	161.309,76	-132,85	-0,08%	0,61%	1,28%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	106.722,98	0,00	104.360,70	0,00	-2.362,28	-2,21%	-	-
Total Renda Fixa	26.479.690,47	4.856.444,57	4.534.736,29	26.965.848,42	164.449,67	0,61%		0,81%

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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.336.752,56	0,00	0,00	1.464.311,53	127.558,97	9,54%	9,54%	7,33%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.004.659,13	0,00	0,00	1.071.170,28	66.511,15	6,62%	6,62%	5,21%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.241.186,36	0,00	0,00	1.321.203,71	80.017,35	6,45%	6,45%	5,12%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	962.369,39	286.969,46	0,00	1.316.778,97	67.440,12	5,40%	6,80%	6,07%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	402.775,08	0,00	0,00	424.140,86	21.365,78	5,30%	5,30%	5,56%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	416.215,85	0,00	0,00	435.689,70	19.473,85	4,68%	4,68%	5,93%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.404.106,48	0,00	0,00	1.467.475,55	63.369,07	4,51%	4,51%	6,53%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	72.486,07	0,00	0,00	74.214,68	1.728,61	2,38%	2,38%	9,05%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	268.826,47	0,00	0,00	272.398,38	3.571,91	1,33%	1,33%	1,62%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	431.561,43	0,00	0,00	435.591,49	4.030,06	0,93%	0,93%	0,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	557.399,02	0,00	0,00	562.236,73	4.837,71	0,87%	0,87%	0,05%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	739.166,15	0,00	0,00	744.965,17	5.799,02	0,78%	0,78%	0,45%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	787.060,95	0,00	0,00	793.063,01	6.002,06	0,76%	0,76%	0,21%
Total Renda Variável	9.624.564,94	286.969,46	0,00	10.383.240,06	471.705,66	4,76%		4,56%

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
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	106.607,74	0,00	0,00	107.961,48	1.353,74	1,27%	1,27%	8,47%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	640.060,37	202.185,78	0,00	849.186,11	6.939,96	0,82%	0,57%	9,23%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	200.966,85	0,00	202.185,78	0,00	1.218,93	0,61%	1,31%	9,80%
Total Exterior	947.634,96	202.185,78	202.185,78	957.147,59	9.512,63	0,83%		9,14%

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.

