

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

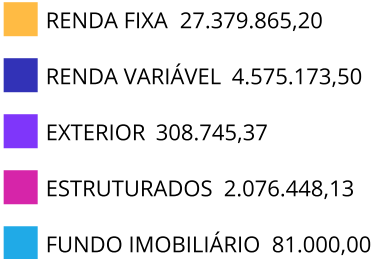
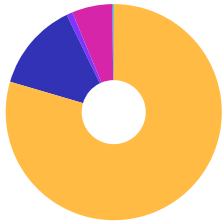
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.018.064,65	2,96%	665	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	797.596,55	2,32%	826	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.506.672,81	4,38%	258	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.830.057,19	5,32%	594	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.406.759,81	4,09%	601	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	1.077.500,80	3,13%	222	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	1.398.228,14	4,06%	85	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2025 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	15/05/2025	2.029.348,71	5,90%	59	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	17/08/2026	1.317.199,99	3,83%	220	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.584.460,06	4,60%	720	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.694.833,65	4,92%	798	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.191.791,96	3,46%	886	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.683.234,19	7,80%	261	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.570.972,16	4,56%	713	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.984.699,08	5,77%	1.157	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.465.766,06	4,26%	227	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	32.696,37	0,09%	1.037	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	890.764,54	2,59%	134	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.860.764,88	5,41%	210	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	38.453,60	0,11%	98	0,13%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	995.438,84	2,89%	480	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	535.399,33	1,56%	1.115	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	379.494,82	1,10%	2.327	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	304.233,21	0,88%	21.298	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	421.607,62	1,22%	16.027	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	331.171,38	0,96%	838	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	654.716,06	1,90%	78	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	151.089,38	0,44%	5.283	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	237.572,29	0,69%	1.888	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	564.450,57	1,64%	4.584	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	308.745,37	0,90%	441	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	508.304,06	1,48%	161	0,16%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.568.144,07	4,56%	4.087	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	81.000,00	0,24%		0,06%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			34.421.232,20				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	40,00%	13.768.492,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	24.557.185,81	71,34%	20,00%	50,00%	90,00%	6.421.923,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	2.784.225,79	8,09%	2,00%	15,00%	40,00%	10.984.267,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.721.061,61
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,85%	10,00%	3.442.123,22
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	38.453,60	0,11%	0,00%	0,15%	2,00%	649.971,04
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	1.721.061,61
Total Renda Fixa	100,00%	27.379.865,20	79,54%	22,00%	75,00%	192,00%	



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

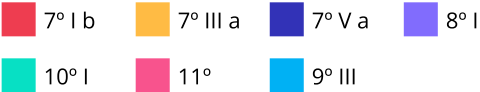
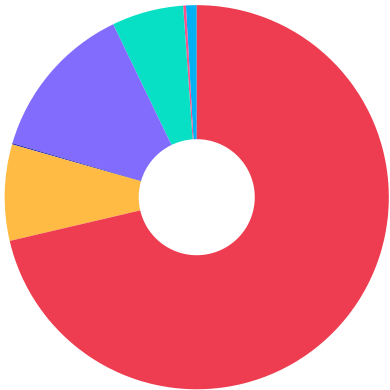


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	4.575.173,50	13,29%	5,00%	15,00%	30,00%	5.751.196,16
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	688.424,64
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.076.448,13	6,03%	0,00%	4,50%	10,00%	1.365.675,09
Artigo 11º	5,00%	81.000,00	0,24%	0,00%	0,05%	5,00%	1.640.061,61
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	6.732.621,63	19,56%	5,00%	19,55%	47,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	308.745,37	0,90%	0,00%	3,00%	10,00%	3.133.377,85
Total Exterior	10,00%	308.745,37	0,90%	0,00%	3,00%	10,00%	

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%	2,00%	5,00%	1.721.061,61



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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	24.557.185,81	71,34	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	2.784.225,79	8,09	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	38.453,60	0,11	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	4.575.173,50	13,29	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 9º, Inciso III	308.745,37	0,90	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.076.448,13	6,03	0,00	10,00
Artigo 11º	81.000,00	0,24	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	22.678.188,00	65,88	0,11
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.813.826,06	31,42	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	890.764,54	2,59	0,01
GRAPHEN INVESTIMENTOS	38.453,60	0,11	0,05

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
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	7,18%	2,04%	4,38%	9,65%	21,10%	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2025 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	1,04%	-	-	-	-	-	0,31%	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,30%	0,97%	1,89%	-0,76%	1,30%	6,55%	1,12%	4,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	3,90%	1,89%	2,11%	7,25%	19,41%	1,13%	2,73%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	0,50%	-	-	-	-	-	0,80%	-
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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,11%	2,50%	2,27%	1,11%	7,67%	22,81%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	2,29%	2,21%	0,98%	7,41%	22,00%	1,96%	3,84%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,42%	-2,62%	2,55%	-1,13%	3,64%	14,16%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,43%	-2,71%	2,50%	-1,20%	3,52%	13,61%	2,55%	6,12%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,46%	-2,88%	2,46%	-1,29%	3,31%	13,37%	2,58%	6,17%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,82%	7,18%	2,55%	4,60%	10,28%	25,21%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,81%	7,10%	2,50%	4,52%	10,13%	24,79%	0,14%	0,41%

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
IMA-B 5 (Benchmark)	0,40%	5,30%	1,92%	3,18%	8,43%	21,06%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	5,14%	1,87%	3,07%	8,21%	20,61%	0,96%	1,77%

IMA-B (Benchmark)	-0,67%	0,82%	1,94%	0,64%	5,61%	17,28%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,64%	0,81%	2,14%	0,61%	5,61%	16,86%	1,79%	4,05%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69%	0,60%	1,84%	0,49%	5,34%	16,66%	1,86%	3,95%

IRF-M (Benchmark)	0,34%	3,90%	2,36%	2,19%	8,45%	23,17%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	3,70%	2,31%	2,06%	8,19%	22,33%	1,35%	2,72%

CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,19%	2,38%	4,70%	9,96%	23,52%	0,01%	0,05%
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%

IPCA (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,53%	4,59%	2,18%	2,74%	7,65%	21,45%	0,56%	1,34%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,31%	4,03%	2,19%	2,47%	7,82%	21,65%	0,89%	2,08%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
--------------------------	---	---	---	---	---	---	---	---

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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,40%	-1,96%	-1,28%	-0,55%	-7,51%	-6,60%	-	-

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
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%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,50%	5,83%	2,97%	3,46%	9,67%	23,14%	0,35%	1,56%

Global BDRX (Benchmark)	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	8,93%	15,69%

Ibovespa (Benchmark)	-3,08%	-1,77%	6,38%	2,90%	13,08%	19,79%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,06%	-6,56%	3,12%	-3,79%	3,20%	4,83%	5,85%	13,69%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-3,14%	-7,65%	3,89%	-0,21%	5,18%	7,22%	5,73%	12,56%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-1,74%	-6,42%	7,13%	0,67%	6,02%	2,69%	6,34%	13,17%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,70%	-3,95%	3,95%	0,33%	9,85%	9,84%	5,58%	12,70%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-2,49%	-4,99%	4,82%	0,49%	7,22%	12,41%	5,33%	12,35%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,44%	-7,90%	3,51%	-3,89%	3,10%	17,52%	6,03%	14,86%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-3,10%	-11,78%	6,90%	-5,46%	2,78%	6,70%	9,04%	24,43%

IBX-50 (Benchmark)	-3,26%	-0,22%	6,28%	4,00%	14,18%	20,25%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-3,46%	-1,73%	6,11%	2,51%	11,74%	14,38%	5,41%	12,49%

IDIV (Benchmark)	-0,72%	4,25%	7,93%	8,38%	19,48%	36,40%	-	-
------------------	--------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

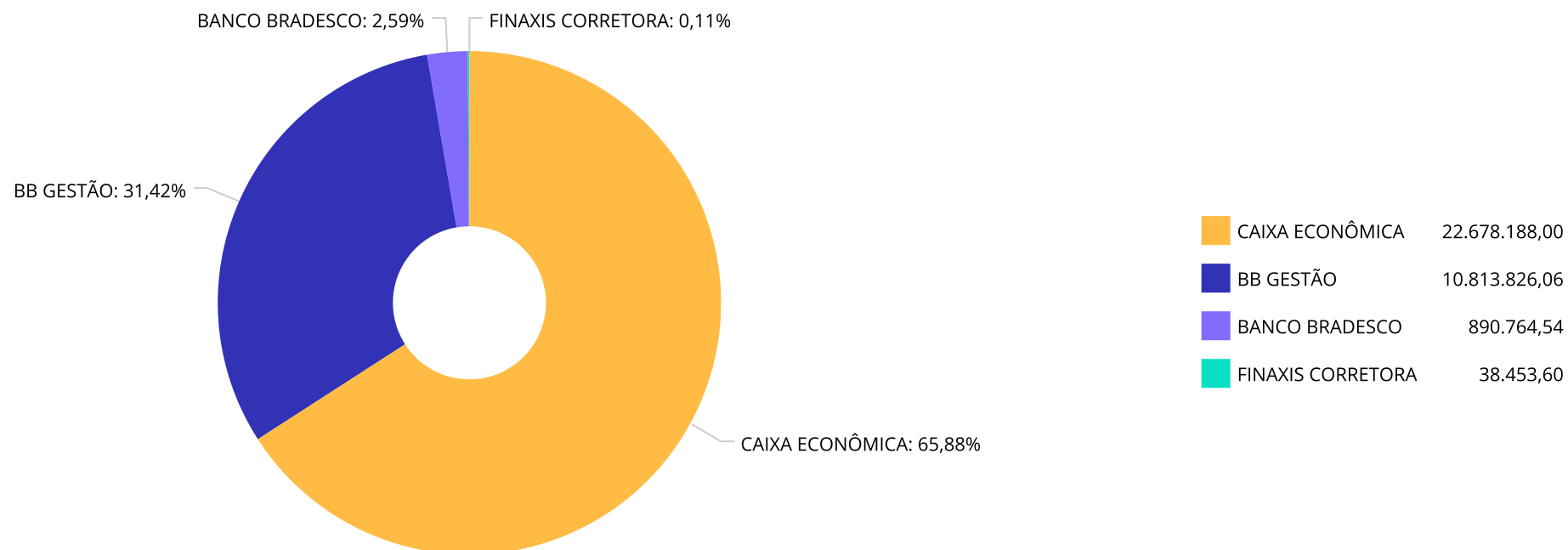
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,88%	0,54%	6,79%	-1,44%	12,01%	25,23%	5,13%	14,60%
IFIX (Benchmark)	-2,58%	-0,16%	-1,24%	-3,00%	2,69%	10,54%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,67%	1,12%	-1,22%	0,95%	-0,69%	15,83%	18,07%	41,16%
SMLL (Benchmark)	-4,41%	-13,67%	1,39%	-9,99%	-3,75%	-6,59%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-4,57%	-14,25%	1,02%	-10,43%	-4,77%	-7,85%	8,15%	19,37%

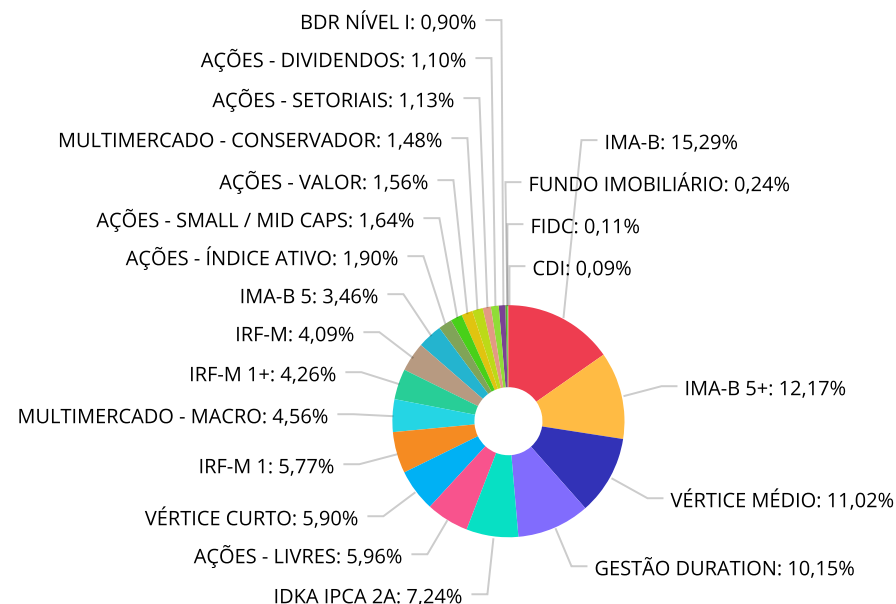
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	8,93%	15,691%

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



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

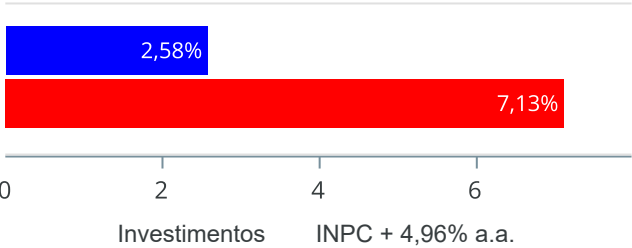


IMA-B	5.261.794,23	IMA-B 5+	4.189.907,00	VÉRTICE MÉDIO	3.792.928,93	GESTÃO DURATION	3.493.289,25
IDKA IPCA 2A	2.492.430,20	AÇÕES - LIVRES	2.052.451,05	VÉRTICE CURTO	2.029.348,71	IRF-M 1	1.984.699,08
MULTIMERCADO - MACRO	1.568.144,07	IRF-M 1+	1.465.766,06	IRF-M	1.406.759,81	IMA-B 5	1.191.791,96
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	654.716,06	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	564.450,57	AÇÕES - VALOR	535.399,33	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	508.304,06
AÇÕES - SETORIAIS	388.661,67	AÇÕES - DIVIDENDOS	379.494,82	BDR NÍVEL I	308.745,37	FUNDO IMOBILIÁRIO	81.000,00
FIDC	38.453,60	CDI	32.696,37				

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	33.610.110,65	1.101.609,96	759.858,25	33.821.793,38	-130.068,98	-130.068,98	-0,38%	-0,38%	1,00%	1,00%	-38,47%	1,66%
Fevereiro	33.821.793,38	949.091,13	950.026,62	34.052.055,81	231.197,92	101.128,94	0,68%	0,30%	1,18%	2,19%	13,62%	2,34%
Março	34.052.055,81	823.286,79	830.150,20	34.165.277,54	120.085,14	221.214,08	0,35%	0,65%	0,58%	2,77%	23,48%	1,47%
Abril	34.165.277,54	801.640,94	844.105,59	33.747.168,18	-375.644,71	-154.430,63	-1,10%	-0,46%	0,80%	3,59%	-12,67%	2,05%
Maiο	33.747.168,18	889.254,73	906.053,85	33.896.063,72	165.694,66	11.264,03	0,49%	0,03%	0,87%	4,49%	0,75%	1,76%
Junho	33.896.063,72	828.034,83	906.529,28	33.838.674,95	21.105,68	32.369,71	0,06%	0,10%	0,64%	5,15%	1,86%	2,17%
Julho	33.838.674,95	753.555,18	860.477,10	34.272.190,79	540.437,76	572.807,47	1,60%	1,69%	0,70%	5,89%	28,75%	2,14%
Agosto	34.272.190,79	5.949.530,56	6.036.504,87	34.633.060,63	447.844,15	1.020.651,62	1,31%	3,02%	0,28%	6,19%	48,82%	2,66%
Setembro	34.633.060,63	801.989,31	864.904,89	34.421.232,20	-148.912,85	871.738,77	-0,43%	2,58%	0,89%	7,13%	36,17%	2,01%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



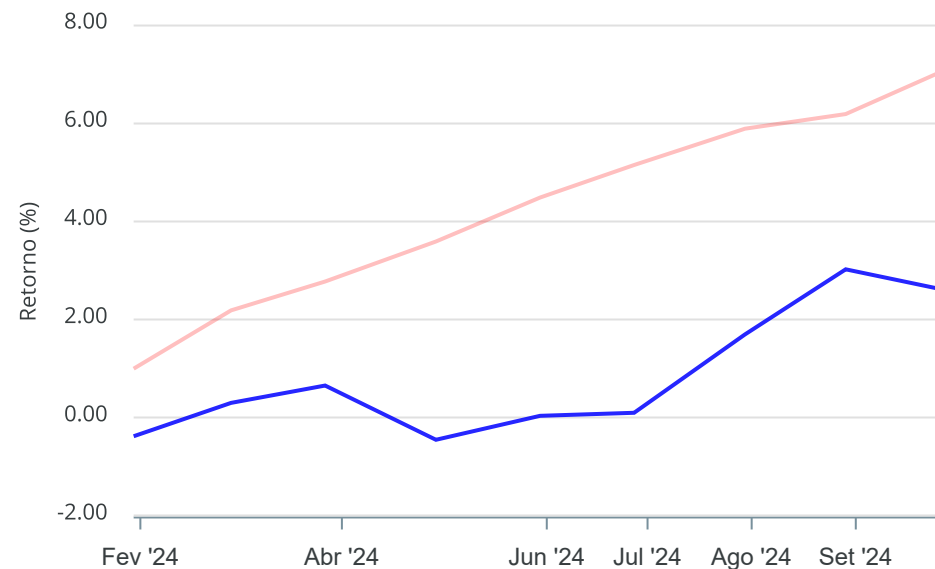
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2025 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	2.008.514,76	0,00	0,00	2.029.348,71	20.833,95	1,04%	1,04%	0,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.386.316,09	429.932,66	851.999,31	1.984.699,08	20.449,64	0,73%	0,81%	0,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.010.919,39	0,00	0,00	1.018.064,65	7.145,26	0,71%	0,71%	0,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	22.059,51	22.685,61	12.315,58	32.696,37	266,83	0,60%	0,75%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.576.192,15	0,00	0,00	1.584.460,06	8.267,91	0,52%	0,52%	0,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	793.806,05	0,00	0,00	797.596,55	3.790,50	0,48%	0,48%	0,82%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.688.139,11	0,00	0,00	1.694.833,65	6.694,54	0,40%	0,40%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.187.258,14	0,00	0,00	1.191.791,96	4.533,82	0,38%	0,38%	0,96%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	1.001.744,96	310.476,30	0,00	1.317.199,99	4.978,73	0,38%	0,50%	0,80%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.402.288,86	0,00	0,00	1.406.759,81	4.470,95	0,32%	0,32%	1,35%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	888.012,16	0,00	0,00	890.764,54	2.752,38	0,31%	0,31%	0,89%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.393.986,92	0,00	0,00	1.398.228,14	4.241,22	0,30%	0,30%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.074.242,36	0,00	0,00	1.077.500,80	3.258,44	0,30%	0,30%	1,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.464.621,73	0,00	0,00	1.465.766,06	1.144,33	0,08%	0,08%	1,96%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	38.606,91	0,00	0,00	38.453,60	-153,31	-0,40%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.872.720,27	0,00	0,00	1.860.764,88	-11.955,39	-0,64%	-0,64%	1,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.820.540,99	22.000,00	0,00	1.830.057,19	-12.483,80	-0,68%	-0,69%	1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.581.855,80	0,00	0,00	1.570.972,16	-10.883,64	-0,69%	-0,69%	1,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.704.985,48	16.894,74	0,00	2.683.234,19	-38.646,03	-1,42%	-1,43%	2,55%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.528.997,51	0,00	0,00	1.506.672,81	-22.324,70	-1,46%	-1,46%	2,58%

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
Total Renda Fixa	27.445.809,15	801.989,31	864.314,89	27.379.865,20	-3.618,37	-0,01%		1,29%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	79.670,00	0,00	590,00	81.000,00	1.920,00	2,41%	2,43%	18,07%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	505.758,08	0,00	0,00	508.304,06	2.545,98	0,50%	0,50%	0,35%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.566.769,76	0,00	0,00	1.568.144,07	1.374,31	0,09%	0,09%	1,22%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	309.604,00	0,00	0,00	304.233,21	-5.370,79	-1,73%	-1,73%	6,34%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	386.761,32	0,00	0,00	379.494,82	-7.266,50	-1,88%	-1,88%	5,13%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.020.852,51	0,00	0,00	995.438,84	-25.413,67	-2,49%	-2,49%	5,33%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	155.924,40	0,00	0,00	151.089,38	-4.835,02	-3,10%	-3,10%	9,04%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	435.294,91	0,00	0,00	421.607,62	-13.687,29	-3,14%	-3,14%	5,73%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	246.026,89	0,00	0,00	237.572,29	-8.454,60	-3,44%	-3,44%	6,03%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	678.181,43	0,00	0,00	654.716,06	-23.465,37	-3,46%	-3,46%	5,41%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	555.952,01	0,00	0,00	535.399,33	-20.552,68	-3,70%	-3,70%	5,58%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	345.201,22	0,00	0,00	331.171,38	-14.029,84	-4,06%	-4,06%	5,85%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	591.504,88	0,00	0,00	564.450,57	-27.054,31	-4,57%	-4,57%	8,15%
Total Renda Variável	6.877.501,41	0,00	590,00	6.732.621,63	-144.289,78	-2,10%		4,61%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	309.750,07	0,00	0,00	308.745,37	-1.004,70	-0,32%	-0,32%	8,93%
Total Exterior	309.750,07	0,00	0,00	308.745,37	-1.004,70	-0,32%		8,93%

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
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.611.346,93	0,00	3.666.586,42	0,00	55.239,49	1,53%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.079.744,33	3.411.648,99	2.550.162,43	1.984.699,08	43.468,19	0,97%	2,50%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.821.782,91	0,00	0,00	1.860.764,88	38.981,97	2,14%	2,14%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.470.575,51	0,00	0,00	1.506.672,81	36.097,30	2,45%	2,45%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.977.914,15	671.295,21	0,00	2.683.234,19	34.024,83	1,28%	2,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.550.647,66	0,00	0,00	1.584.460,06	33.812,40	2,18%	2,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.743.083,65	55.000,00	0,00	1.830.057,19	31.973,54	1,78%	1,84%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.375.060,24	0,00	0,00	1.406.759,81	31.699,57	2,31%	2,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.434.117,46	0,00	0,00	1.465.766,06	31.648,60	2,21%	2,21%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2025 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.029.348,71	29.348,71	1,47%	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.542.031,67	0,00	0,00	1.570.972,16	28.940,49	1,88%	1,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.666.116,45	0,00	0,00	1.694.833,65	28.717,20	1,72%	1,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	991.171,36	0,00	0,00	1.018.064,65	26.893,29	2,71%	2,71%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.372.269,74	0,00	0,00	1.398.228,14	25.958,40	1,89%	1,89%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.457.561,76	0,00	1.479.666,30	0,00	22.104,54	1,52%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.169.958,56	0,00	0,00	1.191.791,96	21.833,40	1,87%	1,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.057.485,32	0,00	0,00	1.077.500,80	20.015,48	1,89%	1,89%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	871.702,16	0,00	0,00	890.764,54	19.062,38	2,19%	2,19%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	782.816,24	0,00	0,00	797.596,55	14.780,31	1,89%	1,89%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	0,00	1.310.476,30	0,00	1.317.199,99	6.723,69	0,51%	-

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 FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	38.688,28	56.654,55	63.701,71	32.696,37	1.055,25	1,11%	2,38%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	38.953,41	0,00	0,00	38.453,60	-499,81	-1,28%	-1,28%
Total Renda Fixa	27.053.027,79	7.505.075,05	7.760.116,86	27.379.865,20	581.879,22	1,68%	

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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	949.698,39	0,00	0,00	995.438,84	45.740,45	4,82%	4,82%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.525.793,33	0,00	0,00	1.568.144,07	42.350,74	2,78%	2,78%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	617.016,72	0,00	0,00	654.716,06	37.699,34	6,11%	6,11%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	355.378,39	0,00	0,00	379.494,82	24.116,43	6,79%	6,79%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	515.049,20	0,00	0,00	535.399,33	20.350,13	3,95%	3,95%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	283.989,01	0,00	0,00	304.233,21	20.244,20	7,13%	7,13%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	405.824,26	0,00	0,00	421.607,62	15.783,36	3,89%	3,89%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	493.645,59	0,00	0,00	508.304,06	14.658,47	2,97%	2,97%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	321.156,88	0,00	0,00	331.171,38	10.014,50	3,12%	3,12%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	141.344,39	0,00	0,00	151.089,38	9.744,99	6,89%	6,89%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	229.526,76	0,00	0,00	237.572,29	8.045,53	3,51%	3,51%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	558.772,63	0,00	0,00	564.450,57	5.677,94	1,02%	1,02%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	82.000,00	0,00	1.770,00	81.000,00	770,00	0,94%	-1,22%
Total Renda Variável	6.479.195,55	0,00	1.770,00	6.732.621,63	255.196,08	3,94%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	306.451,61	0,00	0,00	308.745,37	2.293,76	0,75%	0,75%
Total Exterior	306.451,61	0,00	0,00	308.745,37	2.293,76	0,75%	

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.

