

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

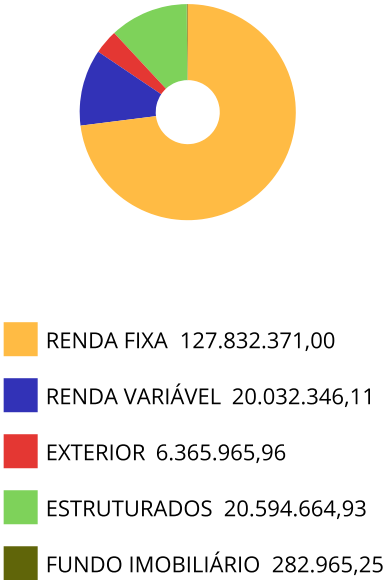
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			18.634.577,77	10,64%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	6.479.641,92	3,70%	720	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.694.162,56	4,97%	798	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.301.702,08	7,03%	1.157	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.581.250,32	3,19%	397	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	1.492.216,76	0,85%	196	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	2.726.092,52	1,56%	105	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.352.812,59	5,34%	198	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	697.767,67	0,40%	1.066	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.720.694,00	3,84%	506	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	1.077.443,89	0,62%	3	35,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	14.423.910,25	8,24%	479	0,43%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	79.735,40	0,05%	31	0,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,00%	S/Info	Não se aplica	16.332.774,84	9,33%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,50%	S/Info	Não se aplica	7.168.779,82	4,09%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,70%	S/Info	Não se aplica	8.260.101,66	4,72%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	Não pos...	Não há	1.140.379,41	0,65%	10	17,29%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.676.437,05	1,53%		2,25%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	3.991.890,49	2,28%	721	1,44%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.932.084,19	2,82%	2.172	0,41%	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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	2.579.830,58	1,47%	195	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	5.050.758,68	2,88%	1.908	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32 du	Não há	5.318.473,00	3,04%	100	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24	Não há	2.151.199,66	1,23%	13.176	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	2.600.645,83	1,49%	137	0,17%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.765.320,13	2,15%	441	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	12.788.657,37	7,30%	7.966	0,63%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	3.723.096,79	2,13%	2.075	0,40%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.095.672,14	1,77%	601	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	987.238,63	0,56%		0,92%	Artigo 10º, Inciso II
SINGULARE FII - REIT11	Não se ...	Não se aplica	282.965,25	0,16%		3,78%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			175.108.313,25				

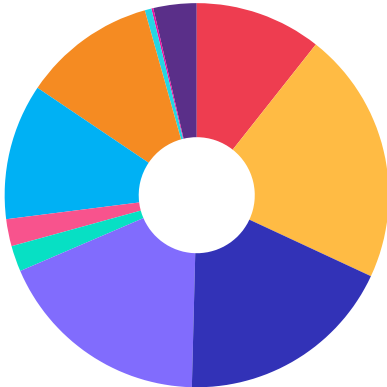
Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	18.634.577,77	10,64%	5,00%	20,00%	70,00%	103.941.241,51
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	37.275.066,16	21,29%	5,00%	32,00%	90,00%	120.322.415,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	32.352.363,80	18,48%	3,00%	5,00%	40,00%	37.690.961,50
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	31.761.656,32	18,14%	3,00%	20,00%	20,00%	3.260.006,33
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	3.816.816,46	2,18%	0,00%	2,00%	5,00%	4.938.599,20
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	3.991.890,49	2,28%	0,00%	2,00%	5,00%	4.763.525,17
Total Renda Fixa	100,00%	127.832.371,00	73,00%	16,00%	81,00%	230,00%	



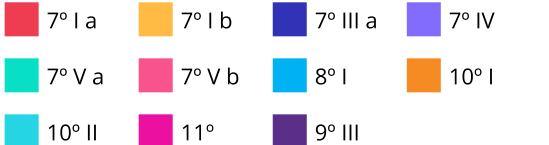
Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	20.032.346,11	11,44%	0,00%	10,00%	30,00%	32.500.147,87
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.510.831,33
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.607.426,30	11,20%	0,00%	5,50%	10,00%	-2.096.594,98
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	987.238,63	0,56%	0,00%	1,00%	3,00%	4.266.010,77
Artigo 11º	5,00%	282.965,25	0,16%	0,00%	0,50%	3,00%	4.970.284,15
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	40.909.976,29	23,36%	0,00%	17,00%	56,00%	



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%	0,00%	10,00%	17.510.831,33
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.365.965,96	3,64%	0,00%	2,00%	10,00%	11.144.865,37
Total Exterior	10,00%	6.365.965,96	3,64%	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%	8.755.415,66



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	18.634.577,77	10,64	5,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	37.275.066,16	21,29	5,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	32.352.363,80	18,48	3,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV	31.761.656,32	18,14	3,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	3.816.816,46	2,18	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	3.991.890,49	2,28	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	20.032.346,11	11,44	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	6.365.965,96	3,64	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	19.607.426,30	11,20	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	987.238,63	0,56	0,00	3,00
Artigo 11º	282.965,25	0,16	0,00	3,00
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	63.332.123,42	36,17	0,31
BANCO BTG PACTUAL	31.761.656,32	18,14	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	18.634.577,77	10,64	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	14.423.910,25	8,24	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.953.458,42	6,83	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	9.465.181,08	5,41	0,00
GUEPARDO INVESTIMENTOS	5.318.473,00	3,04	0,06
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	5.050.758,68	2,88	0,21
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.932.084,19	2,82	0,01
SOMMA INVESTIMENTOS	3.991.890,49	2,28	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.816.816,46	2,18	4,48
MULTINVEST CAPITAL	1.077.443,89	0,62	0,12
RJI CORRETORA DE VALORES	987.238,63	0,56	0,66
SINGULARE INVEST	282.965,25	0,16	0,01
GENIAL GESTÃO LTDA	79.735,40	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 + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,09%	9,48%	2,76%	5,86%	12,78%	28,12%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	145,25%	-64,53%	-14,81%	-51,40%	-64,77%	-66,23%	-	-
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,01%	8,71%	2,52%	5,37%	11,73%	25,76%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,21%	-5,00%	-0,60%	-1,15%	-5,59%	-8,11%	-	-
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,40%	5,30%	1,92%	3,18%	8,43%	21,06%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,39%	5,16%	1,87%	3,09%	8,23%	20,61%	0,96%	1,76%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,61%	-7,69%	-1,35%	-6,54%	-17,52%	-34,62%	0,30%	11,19%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-2,10%	-76,78%	-5,14%	-53,40%	-81,10%	-82,21%	2,00%	65,84%
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%

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
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	8,38%	2,75%	5,44%	11,55%	26,85%	0,03%	0,08%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,83%	8,40%	2,78%	5,39%	11,67%	26,17%	0,03%	0,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,86%	8,25%	2,74%	5,38%	11,42%	26,66%	0,02%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	8,08%	2,70%	5,24%	11,26%	26,47%	0,03%	0,10%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,99%	9,45%	3,16%	5,69%	13,06%	26,41%	0,12%	0,54%

IPCA (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,50%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,00%	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,53%	4,59%	2,18%	2,74%	7,65%	21,45%	0,56%	1,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,63%	4,18%	2,23%	2,55%	8,39%	20,05%	0,50%	2,39%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,70%	-	-	-	-	-	-	-	-

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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,79%	6,78%	2,42%	4,35%	9,70%	23,63%	0,08%	0,40%
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%	-	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,07%	-0,87%	5,02%	-3,64%	11,55%	32,93%	6,54%	14,57%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,97%	11,17%	12,08%	9,59%	29,31%	27,61%	6,04%	12,92%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,05%	-0,39%	6,95%	-1,23%	13,96%	26,32%	6,56%	15,64%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,45%	-4,11%	6,25%	-2,52%	7,33%	8,42%	4,72%	13,14%
IFIX (Benchmark)	-2,58%	-0,16%	-1,24%	-3,00%	2,69%	10,54%	-	-
SINGULARE FII - REIT11	-6,38%	-	-	-	-	-78,73%	93,08%	97,46%
IPCA (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,06%	-0,57%	-0,18%	-0,39%	-0,75%	-1,51%	-	-
MSCI ACWI (Benchmark)	-1,59%	31,85%	4,09%	18,60%	41,09%	55,11%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,33%	24,07%	6,32%	11,65%	40,19%	81,31%	6,45%	12,45%

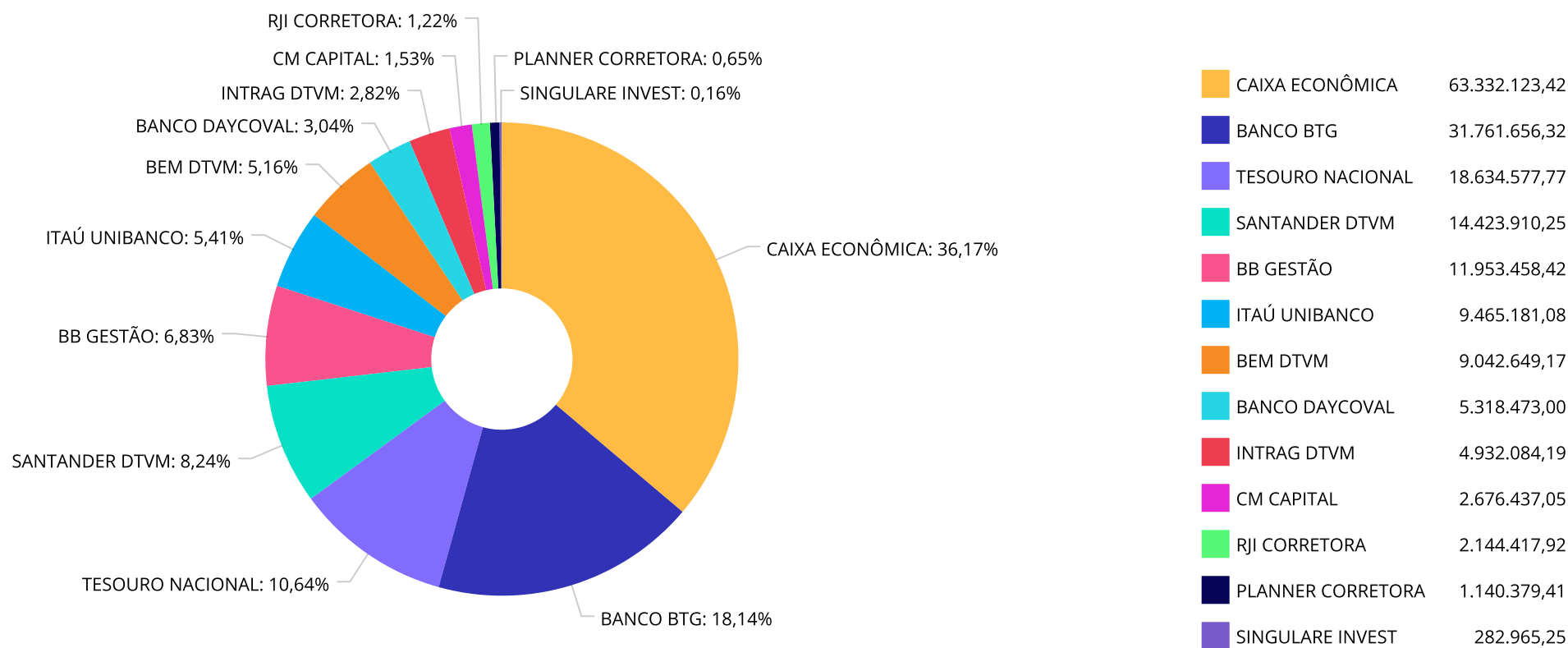
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,02%	20,81%	5,53%	9,67%	34,38%	60,71%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,35%	24,15%	6,34%	11,73%	40,26%	81,33%	6,45%	12,43%
SMLL (Benchmark)	-4,41%	-13,67%	1,39%	-9,99%	-3,75%	-6,59%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,82%	1,37%	7,36%	0,01%	10,40%	12,68%	5,32%	14,98%

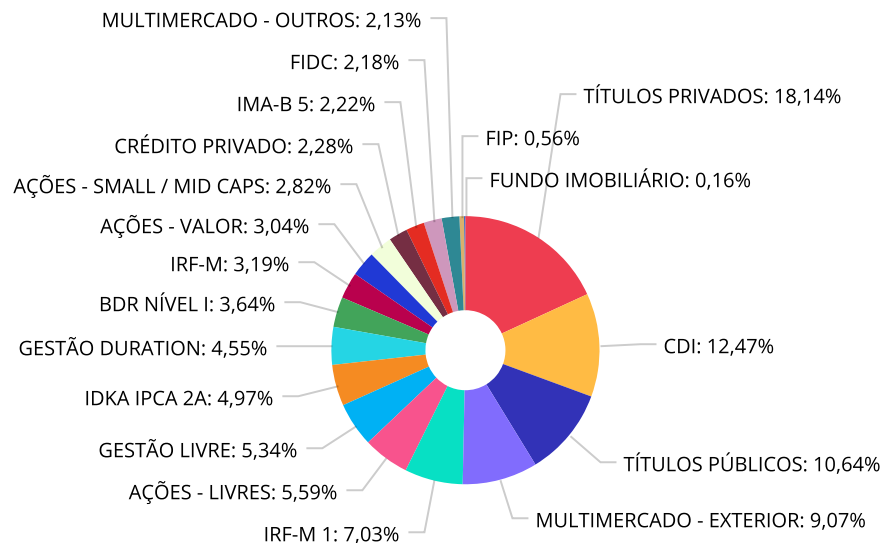
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,17%	31,57%	1,07%	15,48%	41,58%	63,92%	7,93%	15,469%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES 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)



TÍTULOS PRIVADOS	31.761.656,32	CDI	21.842.371,92	TÍTULOS PÚBLICOS	18.634.577,77	MULTIMERCADO - EXTERIOR	15.884.329,51
IRF-M 1	12.301.702,08	AÇÕES - LIVRES	9.781.788,92	GESTÃO LIVRE	9.352.812,59	IDKA IPCA 2A	8.694.162,56
GESTÃO DURATION	7.971.858,68	BDR NÍVEL I	6.365.965,96	IRF-M	5.581.250,32	AÇÕES - VALOR	5.318.473,00
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.932.084,19	CRÉDITO PRIVADO	3.991.890,49	IMA-B 5	3.883.271,81	FIDC	3.816.816,46
MULTIMERCADO - OUTROS	3.723.096,79	FIP	987.238,63	FUNDO IMOBILIÁRIO	282.965,25		

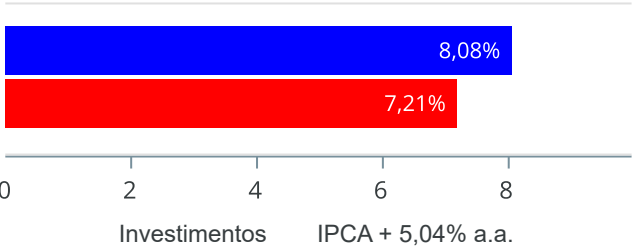
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	13/05/2022	365	4,109760	4.433,843949	1.500,06	1.618.353,04	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	26/05/2022	1.500	4003,010000	4.433,843949	6.004.515,00	6.650.765,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	05/04/2023	720	4.158,39481	4.380,636179	2.994.044,26	3.154.058,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	22/03/2022	631	3960,322358	4.428,261566	2.498.963,41	2.794.233,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	12/05/2022	367	4081,148122	4.259,142580	1.497.781,36	1.563.105,33	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	22/03/2022	618	4042,526766	4.528,519621	2.498.281,54	2.798.625,12	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	153.610.319,81	15.465.180,79	5.961.469,71	163.583.063,99	469.033,10	469.033,10	0,29%	0,29%	0,85%	0,85%	33,75%	2,59%
Fevereiro	163.583.063,99	15.136.495,99	7.365.585,21	173.730.302,20	2.376.327,43	2.845.360,53	1,39%	1,68%	1,20%	2,07%	81,21%	2,52%
Março	173.730.302,20	6.930.533,69	4.301.000,00	178.042.357,00	1.682.521,11	4.527.881,64	0,95%	2,65%	0,55%	2,63%	100,71%	2,00%
Abril	178.042.357,00	6.825.634,66	7.436.161,68	176.309.336,72	-1.122.493,26	3.405.388,38	-0,63%	2,00%	0,81%	3,46%	57,79%	2,76%
Maiο	176.309.336,72	3.606.913,73	6.426.844,84	174.888.251,89	1.398.846,28	4.804.234,66	0,79%	2,81%	0,87%	4,37%	64,38%	1,99%
Junho	174.888.251,89	11.040.891,88	13.424.056,89	175.432.989,92	2.927.903,04	7.732.137,70	1,67%	4,53%	0,60%	4,99%	90,75%	2,27%
Julho	175.432.989,92	12.292.552,46	14.047.996,98	175.779.033,46	2.101.488,06	9.833.625,76	1,20%	5,78%	0,83%	5,87%	98,59%	2,46%
Agosto	175.779.033,46	11.391.716,34	13.287.759,15	176.368.192,61	2.485.201,96	12.318.827,72	1,41%	7,28%	0,41%	6,30%	115,53%	4,00%
Setembro	176.368.192,61	18.834.566,59	21.413.186,73	175.108.313,25	1.318.740,78	13.637.568,50	0,75%	8,08%	0,85%	7,21%	112,13%	2,71%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

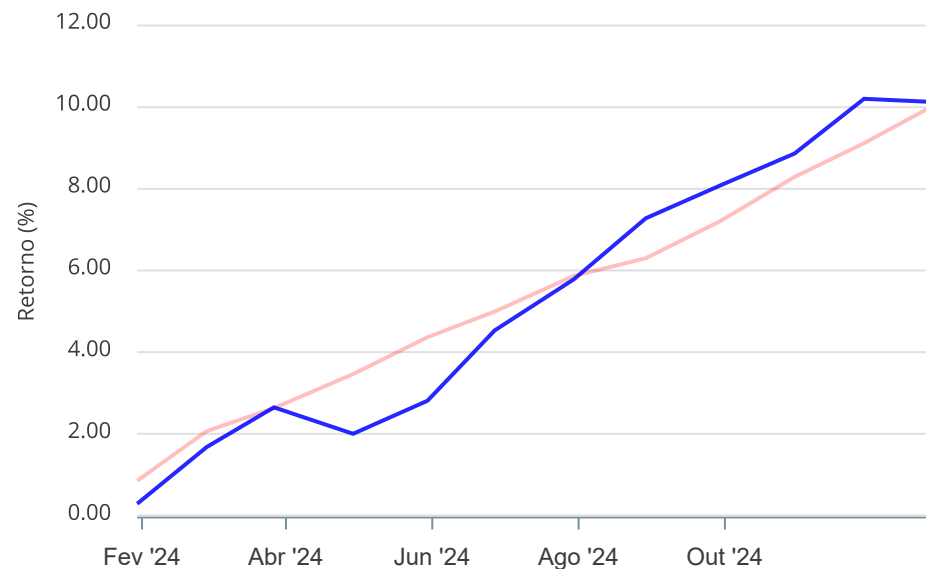
Evolução do Patrimônio



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
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	464.996,50	0,00	0,00	1.140.379,41	675.382,91	145,24%	-	-
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	3.952.807,88	0,00	0,00	3.991.890,49	39.082,61	0,99%	0,99%	0,12%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,70%	8.185.456,72	0,00	0,00	8.260.101,66	74.644,94	0,91%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6.663.851,90	0,00	0,00	6.720.694,00	56.842,10	0,85%	0,85%	0,03%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,00%	16.200.689,30	0,00	0,00	16.332.774,84	132.085,54	0,82%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.203.263,57	0,00	0,00	12.301.702,08	98.438,51	0,81%	0,81%	0,14%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,50%	7.112.019,03	0,00	0,00	7.168.779,82	56.760,79	0,80%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	642.274,69	50.000,00	0,00	697.767,67	5.492,98	0,79%	0,86%	0,02%
TÍTULOS PÚBLICOS	18.512.974,84	0,00	0,00	18.634.577,77	121.602,93	0,66%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	1.482.829,72	0,00	0,00	1.492.216,76	9.387,04	0,63%	0,63%	0,50%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	5.087.773,59	4.209.953,98	0,00	9.352.812,59	55.085,02	0,59%	0,83%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	6.445.830,27	0,00	0,00	6.479.641,92	33.811,65	0,52%	0,52%	0,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	4.133.516,42	57.219,21	4.209.953,98	0,00	19.218,35	0,46%	0,75%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.659.820,83	0,00	0,00	8.694.162,56	34.341,73	0,40%	0,40%	0,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	2.715.603,33	0,00	0,00	2.726.092,52	10.489,19	0,39%	0,39%	0,96%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	17.000.228,63	140.000,00	17.200.895,45	0,00	60.666,82	0,35%	0,83%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	0,00	14.377.393,40	0,00	14.423.910,25	46.516,85	0,32%	0,88%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.563.615,03	0,00	0,00	5.581.250,32	17.635,29	0,32%	0,32%	1,35%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.682.095,06	0,00	0,00	2.676.437,05	-5.658,01	-0,21%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.084.082,40	0,00	0,00	1.077.443,89	-6.638,51	-0,61%	-0,61%	0,30%

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	81.443,06	0,00	0,00	79.735,40	-1.707,66	-2,10%	-2,10%	2,00%
Total Renda Fixa	128.875.172,77	18.834.566,59	21.410.849,43	127.832.371,00	1.533.481,07	1,19%		0,36%

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.024.676,94	0,00	0,00	3.095.672,14	70.995,20	2,35%	2,35%	6,45%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12.497.616,58	0,00	0,00	12.788.657,37	291.040,79	2,33%	2,33%	6,45%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.694.048,12	0,00	0,00	3.723.096,79	29.048,67	0,79%	0,79%	0,08%
SINGULARE FII - REIT11	284.909,23	0,00	2.337,30	282.965,25	393,32	0,14%	-6,38%	93,08%
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	987.841,74	0,00	0,00	987.238,63	-603,11	-0,06%	-	-
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	2.172.173,16	0,00	0,00	2.151.199,66	-20.973,50	-0,97%	-0,97%	6,04%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	5.177.410,82	0,00	0,00	5.050.758,68	-126.652,14	-2,45%	-2,45%	4,72%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.075.322,53	0,00	0,00	4.932.084,19	-143.238,34	-2,82%	-2,82%	5,32%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.660.992,80	0,00	0,00	2.579.830,58	-81.162,22	-3,05%	-3,05%	6,56%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.544.254,22	0,00	0,00	5.318.473,00	-225.781,22	-4,07%	-4,07%	6,54%
Total Renda Variável	41.119.246,14	0,00	2.337,30	40.909.976,29	-206.932,55	-0,50%		6,11%

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
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	2.596.200,75	0,00	0,00	2.600.645,83	4.445,08	0,17%	0,17%	7,93%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.777.572,95	0,00	0,00	3.765.320,13	-12.252,82	-0,32%	-0,32%	8,93%
Total Exterior	6.373.773,70	0,00	0,00	6.365.965,96	-7.807,74	-0,12%		8,52%

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
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	1.338.681,40	0,00	864.281,24	1.140.379,41	665.979,25	49,75%	-14,81%
TÍTULOS PÚBLICOS	18.462.663,02	0,00	219.180,93	18.634.577,77	391.095,68	2,12%	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,00%	15.973.199,37	0,00	0,00	16.332.774,84	359.575,47	2,25%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.001.153,67	0,00	0,00	12.301.702,08	300.548,41	2,50%	2,50%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	15.488.521,63	15.024.624,26	30.770.689,69	0,00	257.543,80	0,84%	2,61%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,70%	8.063.095,32	0,00	0,00	8.260.101,66	197.006,34	2,44%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6.543.815,25	0,00	0,00	6.720.694,00	176.878,75	2,70%	2,70%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA IPCA + 6,50%	6.998.216,04	0,00	0,00	7.168.779,82	170.563,78	2,44%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.546.848,91	0,00	0,00	8.694.162,56	147.313,65	1,72%	1,72%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	6.341.366,25	0,00	0,00	6.479.641,92	138.275,67	2,18%	2,18%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.455.736,08	0,00	0,00	5.581.250,32	125.514,24	2,30%	2,30%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	3.869.799,02	0,00	0,00	3.991.890,49	122.091,47	3,15%	3,15%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	9.247.978,45	0,00	9.352.812,59	104.834,14	1,13%	2,78%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.182.879,45	0,00	5.261.171,48	0,00	78.292,03	1,51%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.030.755,18	1.103.397,23	4.209.953,98	0,00	75.801,57	1,83%	2,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	2.676.002,69	0,00	0,00	2.726.092,52	50.089,83	1,87%	1,87%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	0,00	14.377.393,40	0,00	14.423.910,25	46.516,85	0,32%	2,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	1.459.641,45	0,00	0,00	1.492.216,76	32.575,31	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	301.687,83	382.000,00	0,00	697.767,67	14.079,84	2,06%	2,73%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	84.057,61	0,00	0,00	79.735,40	-4.322,21	-5,14%	-5,14%

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
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.092.191,61	0,00	0,00	1.077.443,89	-14.747,72	-1,35%	-1,35%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.692.603,49	0,00	0,00	2.676.437,05	-16.166,44	-0,60%	-0,60%
Total Renda Fixa	125.602.915,27	40.135.393,34	41.325.277,32	127.832.371,00	3.419.339,71	2,06%	

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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12.028.884,49	0,00	0,00	12.788.657,37	759.772,88	6,32%	6,32%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.594.059,25	0,00	0,00	4.932.084,19	338.024,94	7,36%	7,36%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.753.515,95	0,00	0,00	5.050.758,68	297.242,73	6,25%	6,25%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.919.403,00	0,00	0,00	2.151.199,66	231.796,66	12,08%	12,08%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.911.177,11	0,00	0,00	3.095.672,14	184.495,03	6,34%	6,34%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.763.023,10	2.383.442,05	0,00	5.318.473,00	172.007,85	3,34%	5,02%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.412.292,03	0,00	0,00	2.579.830,58	167.538,55	6,95%	6,95%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.635.215,27	0,00	0,00	3.723.096,79	87.881,52	2,42%	2,42%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.959.161,99	0,00	3.035.927,36	0,00	76.765,37	2,59%	6,75%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.320.529,45	0,00	2.383.442,05	0,00	62.912,60	2,71%	6,20%
META VALOR RESP LIMITADA FIF	1.947.624,95	0,00	2.001.958,83	0,00	54.333,88	2,79%	5,25%
SINGULARE FII - REIT11	285.672,18	0,00	2.337,30	282.965,25	-369,63	-0,13%	-
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	989.048,30	0,00	0,00	987.238,63	-1.809,67	-0,18%	-0,18%
Total Renda Variável	43.519.607,07	2.383.442,05	7.423.665,54	40.909.976,29	2.430.592,71	5,30%	

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	3.737.346,43	0,00	0,00	3.765.320,13	27.973,70	0,75%	0,75%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	2.573.121,15	0,00	0,00	2.600.645,83	27.524,68	1,07%	1,07%
Total Exterior	6.310.467,58	0,00	0,00	6.365.965,96	55.498,38	0,88%	

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.

