

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			9.688.250,27	8,33%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.675.717,87	3,16%	668	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.488.987,88	3,86%	837	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	926.042,27	0,80%	95	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.358.601,59	8,91%	731	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.217.601,98	4,49%	806	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.670.596,97	2,30%	895	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.209.665,84	1,04%	727	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	60.893,35	0,05%	152	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.516.475,13	5,60%	730	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	5.939.776,55	5,11%	198	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	2.049.761,38	1,76%	105	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.769.696,71	1,52%	46	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	D+1	Não há	958.833,82	0,82%	23	0,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.187.349,33	5,32%	3.057	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	3.698.852,84	3,18%	1.191	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.306.222,11	3,70%	531	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	502.202,25	0,43%	112	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.849.177,97	7,61%	489	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.274.805,07	3,68%	425	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

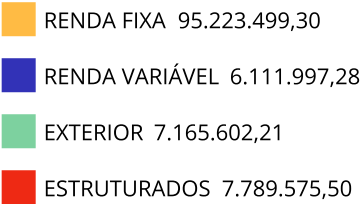
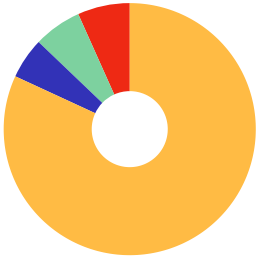
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	5.047.100,48	4,34%	476	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	D+0	Não se aplica	3.115.872,92	2,68%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	508.245,00	0,44%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info	Não se aplica	3.202.769,72	2,75%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.878.091,18	2,47%	846	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	136.288,08	0,12%	5.371	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	161.471,85	0,14%	5.527	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.724.488,35	1,48%	123	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	205.414,59	0,18%	1.930	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	384.352,48	0,33%	4.676	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	621.890,75	0,53%	6.983	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.270.435,08	1,09%	70	0,63%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	5.895.167,13	5,07%	442	0,22%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.321.468,16	1,14%	99	0,28%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.430.048,15	1,23%	4.466	0,30%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	1.936.109,62	1,66%	524	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	1.593.652,23	1,37%	26	1,68%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	872.613,19	0,75%	597	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LIMITADA FIF M...		Não há	635.684,15	0,55%	35	0,22%	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			116.290.674,29				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			621.133,18	Artigo 6º			
PL Total			116.911.807,47				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	9.688.250,27	8,33%	0,00%	15,37%	40,00%	36.828.019,45
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	52.030.000,67	44,74%	0,00%	15,92%	95,00%	58.446.139,91
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	26.678.360,72	22,94%	0,00%	15,39%	45,00%	25.652.442,71
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	6.826.887,64	5,87%	0,00%	15,39%	20,00%	16.431.247,22
Total Renda Fixa	100,00%	95.223.499,30	81,88%	0,00%	62,07%	200,00%	

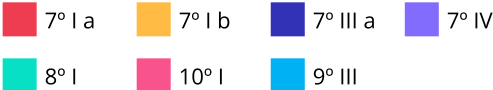
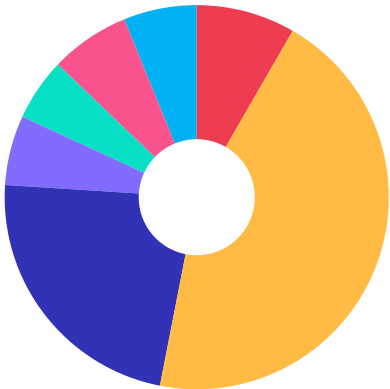


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	6.111.997,28	5,26%	0,00%	25,74%	30,00%	28.775.205,01
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	34.887.202,29
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	7.789.575,50	6,70%	0,00%	2,58%	10,00%	3.839.491,93
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.814.533,71
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,68%	5,00%	5.814.533,71
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	13.901.572,78	11,95%	0,00%	30,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.165.602,21	6,16%	0,00%	6,93%	10,00%	4.463.465,22
Total Exterior	10,00%	7.165.602,21	6,16%	0,00%	6,93%	10,00%	

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%	1,00%	5,00%	5.814.533,71



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'	9.688.250,27	8,33	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	52.030.000,67	44,74	0,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	26.678.360,72	22,94	0,00	45,00
Artigo 7º, Inciso IV	6.826.887,64	5,87	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso I	6.111.997,28	5,26	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	7.165.602,21	6,16	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	7.789.575,50	6,70	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	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	50.448.047,32	43,38	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	17.122.195,88	14,72	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.863.558,59	10,20	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	9.688.250,27	8,33	-
SICREDI	6.187.349,33	5,32	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	6.005.934,30	5,16	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.576.657,19	4,80	-
BANCO SANTANDER	3.202.769,72	2,75	-
BANCO DAYCOVAL	3.115.872,92	2,68	-
ICATU VANGUARDA	1.936.109,62	1,66	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	635.684,15	0,55	-
ITAÚ UNIBANCO	508.245,00	0,44	-

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 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%
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%

IMA Geral (Benchmark)	0,79%	4,63%	2,21%	3,49%	8,81%	23,74%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,50%	1,34%	1,56%	1,28%	5,08%	19,25%	2,43%	4,09%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	4,48%	2,13%	3,37%	8,59%	23,54%	0,99%	1,82%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,77%	6,30%	2,36%	4,62%	10,39%	25,57%	-	-
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	0,75%	6,17%	2,31%	4,50%	10,16%	25,13%	0,30%	0,41%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,59%	4,88%	1,91%	3,56%	8,14%	21,08%	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,58%	4,75%	1,86%	3,47%	7,94%	20,64%	1,08%	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
CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
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%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,88%	7,13%	2,61%	5,26%	11,20%	26,25%	0,01%	0,06%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91%	7,44%	2,69%	5,42%	11,71%	27,16%	0,04%	0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,89%	7,44%	2,68%	5,45%	11,86%	27,48%	0,01%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	6,88%	2,58%	5,04%	10,91%	25,87%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,87%	7,17%	2,64%	5,24%	11,44%	26,80%	0,04%	0,10%
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,92%	7,71%	2,77%	5,61%	12,12%	27,88%	0,04%	0,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	7,21%	2,68%	5,34%	11,32%	26,39%	0,01%	0,06%
IPCA (Benchmark)	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,68%	4,05%	1,82%	2,80%	7,52%	22,31%	0,64%	1,36%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,78%	5,50%	2,25%	3,90%	8,67%	22,91%	0,24%	0,89%

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
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO	2,60%	-	-	-	-	-	8,32%	-

CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,35%	1,86%	2,01%	1,30%	7,87%	19,83%	2,69%	4,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,87%	6,98%	2,60%	5,17%	11,11%	26,23%	0,05%	0,19%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,42%	2,09%	3,80%	2,28%	9,14%	20,44%	2,56%	5,10%

Global BDRX (Benchmark)	0,55%	42,25%	13,74%	27,72%	48,00%	71,14%	-	-
BRDESCO 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%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	6,10%	-0,20%	10,96%	3,05%	14,19%	16,81%	6,02%	13,53%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	6,07%	-7,69%	8,69%	0,85%	-0,87%	-17,14%	9,26%	20,75%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	5,57%	-8,96%	11,32%	-1,55%	2,65%	23,32%	11,50%	25,10%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4,51%	-2,60%	8,56%	0,89%	7,56%	8,51%	6,53%	14,00%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3,06%	-4,63%	9,00%	-1,19%	7,75%	17,01%	7,72%	15,02%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,59%	4,88%	1,91%	3,56%	8,14%	21,08%	-	-
---------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

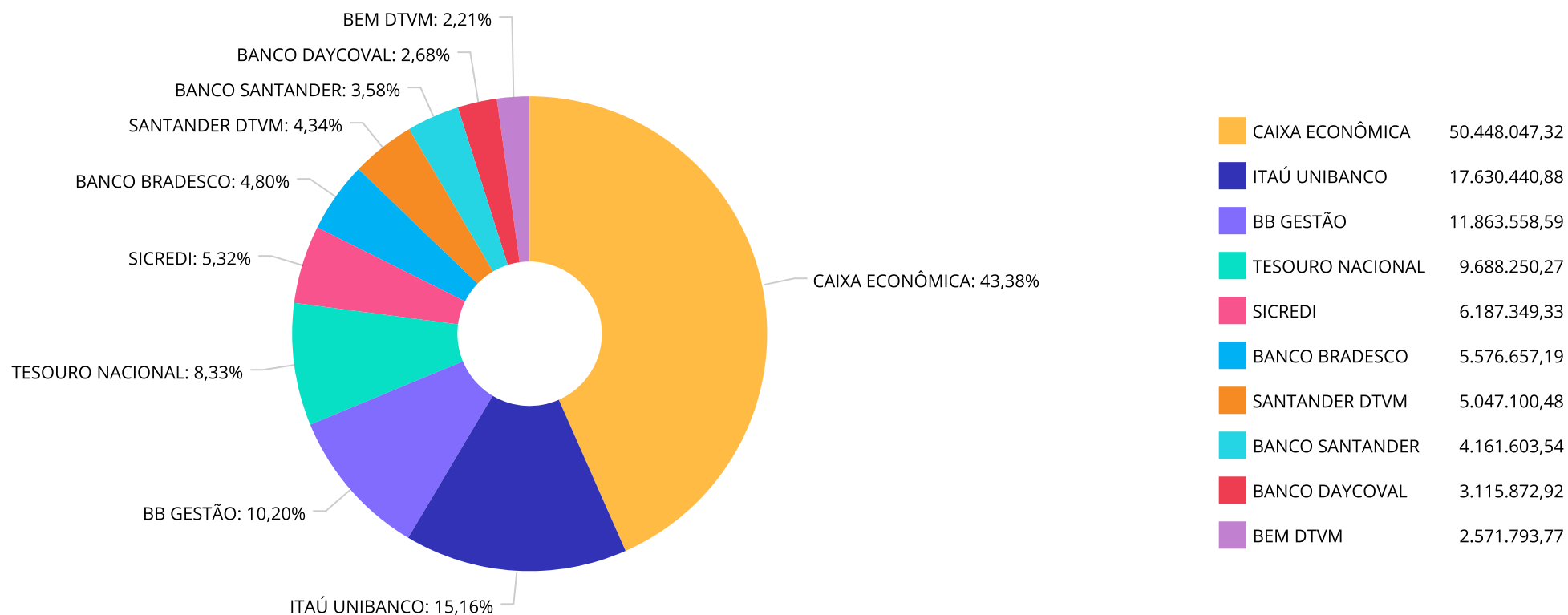
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	2,19%	5,72%	5,77%	5,81%	13,09%	37,29%	2,24%	5,60%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,28%	18,42%	7,03%	10,83%	25,31%	42,82%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,49%	21,30%	8,02%	12,90%	30,96%	61,90%	9,24%	12,28%
SMLL (Benchmark)	4,51%	-9,69%	5,65%	-3,81%	-2,18%	-4,07%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	4,74%	-7,55%	5,93%	-2,52%	0,23%	-1,96%	8,86%	18,50%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4,36%	-10,14%	5,39%	-4,17%	-3,07%	-5,30%	9,84%	19,65%

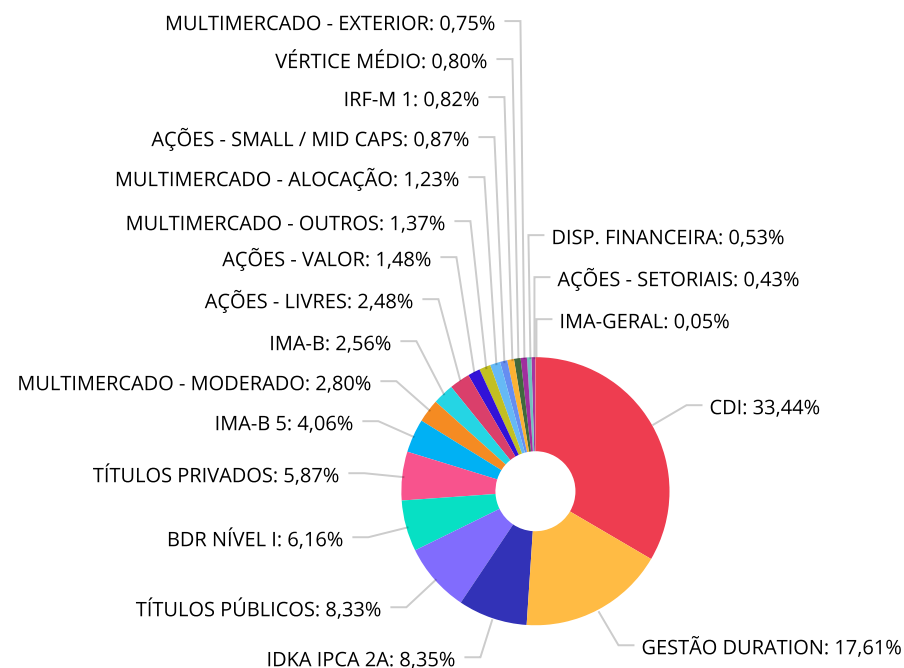
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

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

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



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



CDI	38.879.982,93	GESTÃO DURATION	20.476.298,26	IDKA IPCA 2A	9.706.589,86	TÍTULOS PÚBLICOS	9.688.250,27
BDR NÍVEL I	7.165.602,21	TÍTULOS PRIVADOS	6.826.887,64	IMA-B 5	4.720.358,35	MULTIMERCADO - MODERADO	3.257.577,78
IMA-B	2.979.362,55	AÇÕES - LIVRES	2.878.091,18	AÇÕES - VALOR	1.724.488,35	MULTIMERCADO - OUTROS	1.593.652,23
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.430.048,15	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.006.243,23	IRF-M 1	958.833,82	VÉRTICE MÉDIO	926.042,27
MULTIMERCADO - EXTERIOR	872.613,19	DISP. FINANCEIRA	621.133,18	AÇÕES - SETORIAIS	503.174,52	IMA-GERAL	60.893,35

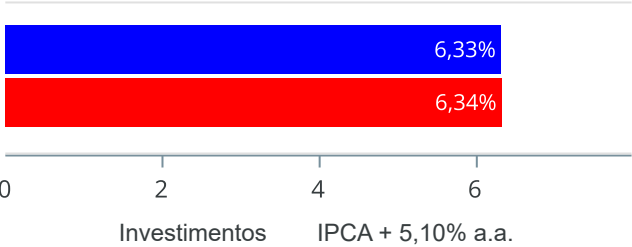
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	11/07/2024	128	4.368,925843	4.296,548065	559.222,51	549.958,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/07/2024	127	4.283,859016	4.338,380282	544.050,10	550.974,29	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	23/08/2024	334	4.398,302374	4.403,370622	1.469.032,99	1.470.725,78	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	26/04/2024	359	4.355,595450	4.373,963345	1.563.658,77	1.570.252,84	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	26/04/2024	364	4.297,845738	4.315,778887	1.564.415,85	1.570.943,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	26/04/2024	359	4.361,057685	4.379,181044	1.565.619,71	1.572.125,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/08/2024	317	4.406,624995	4.413,81465	1.396.900,12	1.399.179,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	26/08/2024	228	4.389,952492	4.393,975312	1.000.909,17	1.001.826,37	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	108.595.135,77	807.607,41	2.304.753,66	107.564.868,65	466.879,13	466.879,13	0,43%	0,43%	0,86%	0,86%	50,16%	1,13%
Fevereiro	107.564.868,65	2.182.020,34	1.161.734,92	109.590.608,04	1.005.453,97	1.472.333,10	0,93%	1,36%	1,21%	2,08%	65,50%	1,46%
Março	109.590.608,04	1.366.919,04	2.055.535,07	109.831.593,23	929.601,22	2.401.934,32	0,85%	2,22%	0,56%	2,64%	83,95%	0,98%
Abril	109.831.593,23	9.259.925,00	8.577.308,73	110.183.738,52	-330.470,98	2.071.463,34	-0,30%	1,91%	0,82%	3,48%	54,96%	1,58%
Maiο	110.183.738,52	4.306.744,45	4.625.729,84	110.958.828,37	1.094.075,24	3.165.538,58	0,99%	2,93%	0,88%	4,39%	66,65%	1,12%
Junho	110.958.828,37	2.403.106,42	2.815.000,00	111.854.569,49	1.307.634,70	4.473.173,28	1,18%	4,14%	0,61%	5,02%	82,39%	1,61%
Julho	111.854.569,49	3.210.185,93	2.494.827,64	113.779.780,52	1.209.852,74	5.683.026,02	1,07%	5,26%	0,84%	5,90%	89,09%	1,60%
Agosto	113.779.780,52	12.549.062,63	11.214.613,48	116.290.674,29	1.176.444,62	6.859.470,64	1,02%	6,33%	0,42%	6,34%	99,88%	1,74%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

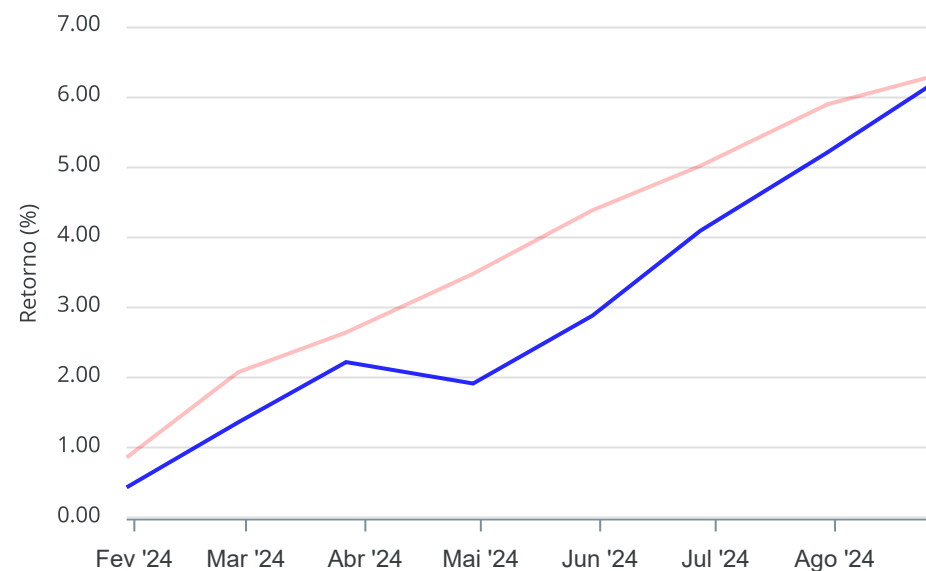
Evolução do Patrimônio



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

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
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.914.316,99	0,00	1.935.783,80	0,00	21.466,81	1,12%	0,59%	1,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.613.263,85	28.169,77	0,00	3.675.717,87	34.284,25	0,94%	0,95%	0,41%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	503.656,66	0,00	0,00	508.245,00	4.588,34	0,91%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.001.615,02	0,00	0,00	5.047.100,48	45.485,46	0,91%	0,91%	0,04%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	3.087.831,55	0,00	0,00	3.115.872,92	28.041,37	0,91%	-	-
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	6.133.285,63	0,00	0,00	6.187.349,33	54.063,70	0,88%	0,88%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.520.083,17	146.982,67	0,00	3.698.852,84	31.787,00	0,87%	0,89%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	8.773.308,11	0,00	0,00	8.849.177,97	75.869,86	0,86%	0,86%	0,04%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	2.377.395,02	800.000,00	0,00	3.202.769,72	25.374,70	0,80%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	60.422,15	0,00	0,00	60.893,35	471,20	0,78%	0,78%	0,99%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	498.322,72	0,00	0,00	502.202,25	3.879,53	0,78%	0,78%	0,24%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	951.686,56	0,00	0,00	958.833,82	7.147,26	0,75%	0,75%	0,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	5.898.201,70	0,00	0,00	5.939.776,55	41.574,85	0,70%	0,70%	0,69%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	919.786,14	0,00	0,00	926.042,27	6.256,13	0,68%	0,68%	1,62%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.298.895,50	0,00	10.000,00	10.358.601,59	69.706,09	0,68%	0,68%	0,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.246.136,87	1.994.126,14	1.000.000,03	4.274.805,07	34.542,09	0,66%	0,89%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.460.644,26	0,00	0,00	4.488.987,88	28.343,62	0,64%	0,64%	1,25%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.186.926,36	0,00	0,00	5.217.601,98	30.675,62	0,59%	0,59%	1,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.655.180,21	0,00	0,00	2.670.596,97	15.416,76	0,58%	0,58%	1,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	2.037.967,61	0,00	0,00	2.049.761,38	11.793,77	0,58%	0,58%	1,08%

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.485.871,69	3.777.157,98	2.800.000,00	6.516.475,13	53.445,46	0,58%	0,86%	0,04%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.347.119,47	1.935.783,80	0,00	4.306.222,11	23.318,84	0,54%	0,91%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.248.183,60	0,00	2.260.330,63	0,00	12.147,03	0,54%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.508.737,36	0,00	1.516.827,36	0,00	8.090,00	0,54%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	5.834.816,35	3.866.842,27	62.768,92	9.688.250,27	49.360,57	0,51%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.203.653,83	0,00	0,00	1.209.665,84	6.012,01	0,50%	0,50%	2,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.760.953,07	0,00	0,00	1.769.696,71	8.743,64	0,50%	0,50%	2,43%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1.667.406,52	0,00	1.628.902,74	0,00	-38.503,78	-2,31%	-	-
Total Renda Fixa	93.195.667,97	12.549.062,63	11.214.613,48	95.223.499,30	693.382,18	0,73%		0,51%

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 EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.625.306,41	0,00	0,00	1.724.488,35	99.181,94	6,10%	6,10%	6,02%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	152.239,05	0,00	0,00	161.471,85	9.232,80	6,06%	6,06%	9,26%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	129.095,77	0,00	0,00	136.288,08	7.192,31	5,57%	5,57%	11,50%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	593.772,08	0,00	0,00	621.890,75	28.118,67	4,74%	4,74%	8,86%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.753.808,38	0,00	0,00	2.878.091,18	124.282,80	4,51%	4,51%	6,53%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	368.311,36	0,00	0,00	384.352,48	16.041,12	4,36%	4,36%	9,84%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	199.307,02	0,00	0,00	205.414,59	6.107,57	3,06%	3,06%	7,72%
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LIMITADA FIF MUL...	619.572,02	0,00	0,00	635.684,15	16.112,13	2,60%	2,60%	8,32%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	851.454,73	0,00	0,00	872.613,19	21.158,46	2,48%	2,48%	9,24%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.396.284,27	0,00	0,00	1.430.048,15	33.763,88	2,42%	2,42%	2,56%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	1.894.673,62	0,00	0,00	1.936.109,62	41.436,00	2,19%	2,19%	2,24%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.303.824,18	0,00	0,00	1.321.468,16	17.643,98	1,35%	1,35%	2,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1.579.939,79	0,00	0,00	1.593.652,23	13.712,44	0,87%	0,87%	0,05%
Total Renda Variável	13.467.588,68	0,00	0,00	13.901.572,78	433.984,10	3,22%		4,90%

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
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.254.504,87	0,00	0,00	1.270.435,08	15.930,21	1,27%	1,27%	8,47%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.862.019,00	0,00	0,00	5.895.167,13	33.148,13	0,57%	0,57%	9,23%
Total Exterior	7.116.523,87	0,00	0,00	7.165.602,21	49.078,34	0,69%		9,09%

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.

