

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)

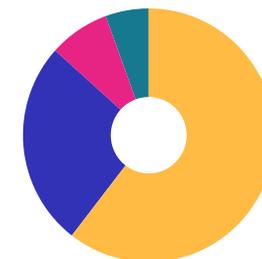
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.479.983,23	3,11%	657	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	559.736,44	1,18%	749	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	287.543,88	0,60%	574	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	1.294.270,30	2,72%	374	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	1.006.354,54	2,11%	222	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITAD...	D+0	17/05/2027	1.798.604,81	3,78%	99	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	15/05/2025	2.361.262,28	4,96%	62	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	Não há	2.313.885,32	4,86%	93	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP...	D+0	17/05/2027	1.178.522,02	2,48%	61	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.130.232,86	4,48%	687	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.549.565,65	3,26%	866	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.057.976,30	4,32%	682	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	64.782,02	0,14%	1.158	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.687.409,73	3,55%	378	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	839.032,56	1,76%	736	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	299.229,77	0,63%	188	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	27.811,98	0,06%	1.030	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	578.946,68	1,22%	212	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.121.166,10	2,36%	191	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.473.769,16	5,20%	516	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	2.071.533,57	4,35%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB ESPELHO JGP INSTITUCIONAL EQUILÍBRIO 30 IS RE...	D+31	Não há	1.596.050,26	3,35%	4.119	0,40%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	951.815,51	2,00%	471	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.661.396,80	7,69%	2.275	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.499.918,51	3,15%	822	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.861.607,09	6,01%	118	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.141.035,01	2,40%	4.452	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	642.839,96	1,35%	13.905	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	922.953,53	1,94%	51	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	183.521,53	0,39%	232	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	591.002,76	1,24%	9.049	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	295.574,34	0,62%	39	0,09%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.489.544,03	3,13%	135	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.923.569,07	4,04%	442	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	752.099,71	1,58%	160	0,24%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.131.219,03	2,38%	95	0,28%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC M...	D+2	Não há	763.975,60	1,61%	461	1,21%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			47.589.741,94				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			794.688,75				Artigo 6º
PL Total			48.384.430,69				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	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%	5,00%	15,00%	7.138.461,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	20.908.391,71	43,93%	30,00%	40,00%	95,00%	24.301.863,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	4.201.693,92	8,83%	10,00%	15,00%	60,00%	24.352.151,24
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	2.071.533,57	4,35%	0,00%	5,00%	20,00%	7.446.414,82
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.379.487,10
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	1.596.050,26	3,35%	0,00%	0,00%	5,00%	783.436,84
Total Renda Fixa	100,00%	28.777.669,46	60,47%	40,00%	65,00%	200,00%	

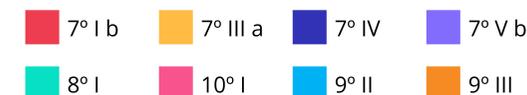
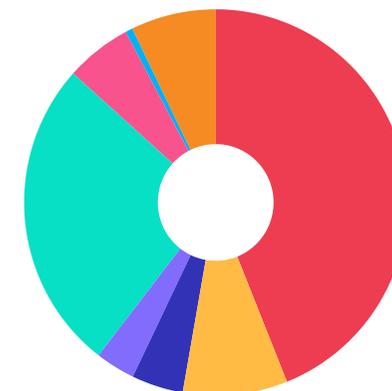


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	12.456.090,70	26,17%	11,00%	20,00%	35,00%	4.200.318,98
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	16.656.409,68
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.647.294,34	5,56%	5,00%	7,00%	10,00%	2.111.679,85
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.379.487,10
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.379.487,10
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	15.103.385,04	31,74%	16,00%	29,00%	90,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	295.574,34	0,62%	0,20%	1,00%	10,00%	4.463.399,85
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.413.113,10	7,17%	3,80%	5,00%	10,00%	1.345.861,09
Total Exterior	10,00%	3.708.687,44	7,79%	4,00%	6,00%	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%	10,00%	4.758.974,19



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	20.908.391,71	43,93	30,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	4.201.693,92	8,83	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	2.071.533,57	4,35	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	1.596.050,26	3,35	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	12.456.090,70	26,17	11,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	295.574,34	0,62	0,20	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.413.113,10	7,17	3,80	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.647.294,34	5,56	5,00	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 (Outubro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	25.977.762,21	54,59	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.900.898,61	35,51	-
ITAU UNIBANCO	2.071.533,57	4,35	-
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	1.865.023,26	3,92	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	591.002,76	1,24	-
PRÓPIO CAPITAL	183.521,53	0,39	-

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 Outubro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	1,01%	8,26%	2,22%	4,57%	10,00%	21,06%	-	-
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	1,15%	-	3,05%	2,73%	-	-	0,28%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,67%	-	-	-	-	-	1,04%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,89%	-	2,01%	-	-	-	0,85%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	4,59%	1,65%	3,61%	9,09%	18,47%	1,04%	2,41%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,89%	-	-0,67%	1,26%	-	-	0,85%	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	8,08%	2,45%	4,88%	10,15%	25,01%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,83%	7,99%	2,40%	4,77%	10,00%	24,59%	0,14%	0,41%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,74%	6,08%	1,74%	4,16%	9,57%	19,66%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,72%	5,81%	1,62%	3,97%	9,26%	19,08%	0,88%	1,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,72%	5,89%	1,69%	4,04%	9,33%	19,24%	0,88%	1,61%
IMA-B (Benchmark)	-0,65%	0,16%	-0,80%	1,63%	5,62%	15,10%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,68%	-0,21%	-0,94%	1,39%	5,19%	14,38%	1,89%	3,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,68%	-0,06%	-0,87%	1,48%	5,35%	14,56%	1,89%	3,67%
IRF-M (Benchmark)	0,21%	4,12%	1,21%	2,94%	8,27%	22,29%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	3,90%	1,16%	2,83%	8,01%	21,47%	1,26%	2,60%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,19%	3,89%	1,15%	2,81%	8,01%	21,83%	1,27%	2,60%
CDI (Benchmark)	0,93%	8,99%	2,65%	5,27%	10,98%	25,87%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,92%	9,07%	2,66%	5,34%	11,18%	26,34%	0,04%	0,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85%	8,10%	2,40%	4,75%	9,90%	23,39%	0,03%	0,04%
BB ESPELHO JGP INSTITUCIONAL EQUILÍBRIO 30 IS RESP LIMITADA FIF C...	0,87%	-	2,83%	-	-	-	0,06%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,45%	2,42%	4,63%	9,66%	24,36%	0,25%	0,65%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,92%	9,39%	2,70%	5,46%	11,55%	26,02%	0,03%	0,13%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,79%	2,67%	5,25%	10,77%	25,47%	0,06%	0,10%
IPCA (Benchmark)	0,56%	3,88%	0,98%	2,05%	4,76%	9,81%	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,82%	5,04%	2,17%	3,63%	9,51%	19,98%	0,44%	1,91%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,86%	5,49%	2,07%	3,96%	8,29%	21,29%	0,41%	1,24%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	0,68%	-	-	-	-	-	1,04%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,93%	8,99%	2,65%	5,27%	10,98%	25,87%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,28%	1,08%	0,58%	1,33%	6,52%	14,45%	1,60%	4,51%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,45%	6,30%	2,33%	4,08%	9,57%	22,16%	0,44%	1,47%
Global BDRX (Benchmark)	6,02%	50,50%	6,38%	29,14%	64,77%	95,02%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,92%	48,88%	6,17%	28,45%	62,54%	89,30%	6,60%	15,49%
Ibovespa (Benchmark)	-1,60%	-3,33%	1,61%	3,01%	14,64%	11,79%	-	-
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	-1,17%	-9,32%	-3,14%	-2,74%	4,92%	-3,50%	6,52%	19,30%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-1,51%	-7,97%	-1,25%	-0,23%	7,31%	-4,30%	4,62%	12,94%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	-0,45%	2,60%	1,60%	3,28%	10,82%	14,07%	2,55%	5,46%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,53%	2,98%	4,15%	6,80%	21,89%	28,52%	4,31%	10,88%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,19%	-6,13%	1,89%	1,60%	9,76%	7,64%	3,68%	11,81%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-1,95%	-5,24%	0,74%	1,34%	12,78%	3,52%	4,44%	12,40%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-2,12%	-12,21%	-0,85%	-0,52%	3,22%	-21,56%	4,15%	14,62%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,34%	8,56%	4,11%	8,12%	31,93%	12,68%	5,98%	12,73%
IDIV (Benchmark)	-1,72%	2,45%	4,09%	7,11%	21,24%	28,86%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,33%	-0,80%	3,40%	3,55%	17,93%	16,83%	5,63%	13,84%

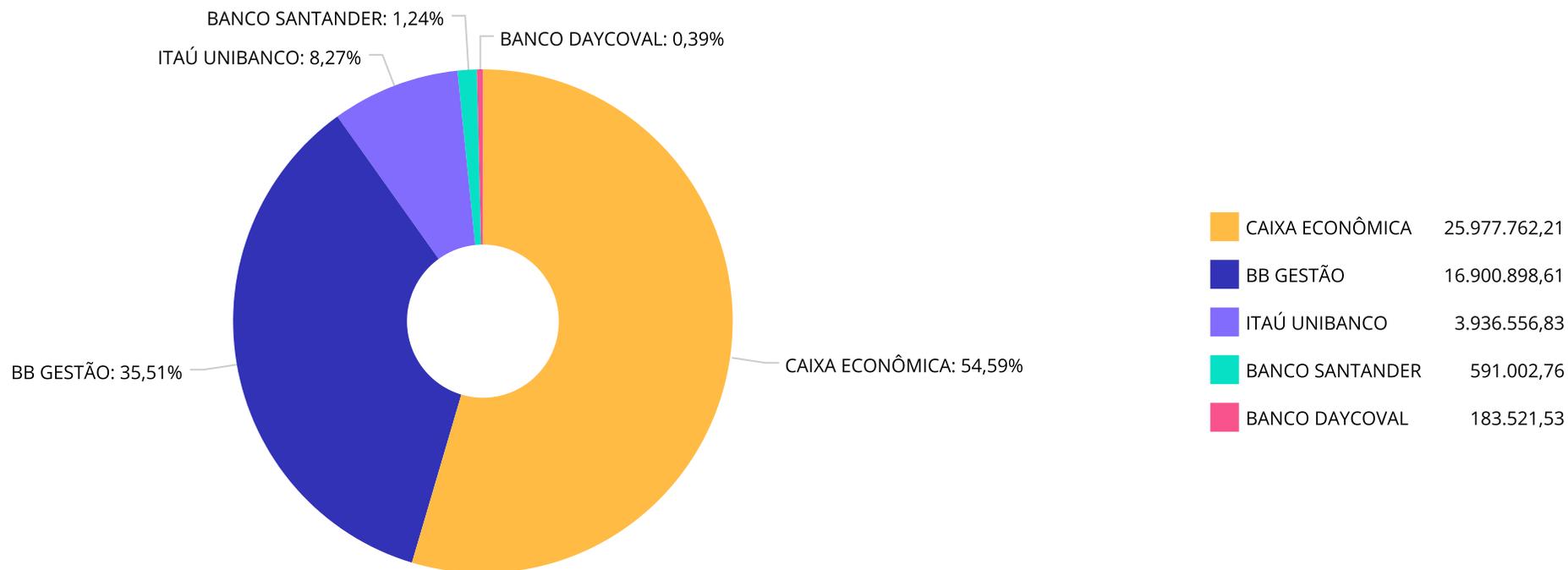
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-1,37%	-14,85%	-1,46%	-3,76%	2,51%	-14,14%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-1,52%	-15,55%	-1,93%	-4,29%	1,33%	-15,27%	5,57%	18,14%

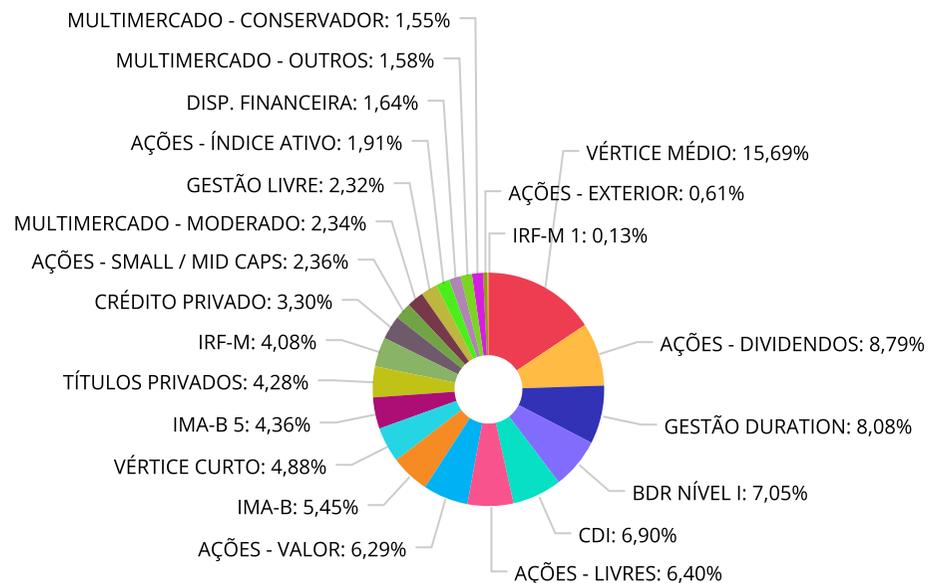
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,02%	50,50%	6,38%	29,14%	64,77%	95,02%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,61%	38,96%	7,27%	24,51%	51,92%	65,81%	6,49%	15,246%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,92%	48,88%	6,17%	28,45%	62,54%	89,30%	6,60%	15,494%
MSCI WORLD (Benchmark)	3,89%	37,35%	4,20%	23,27%	50,50%	57,34%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	1,64%	26,91%	1,57%	15,09%	41,24%	36,69%	6,55%	15,197%

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



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

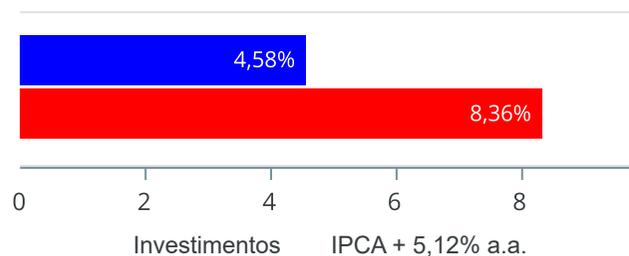


■ VÉRTICE MÉDIO	7.591.636,99	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	4.252.399,56	■ GESTÃO DURATION	3.909.445,86	■ BDR NÍVEL I	3.413.113,10
■ CDI	3.340.613,70	■ AÇÕES - LIVRES	3.094.573,98	■ AÇÕES - VALOR	3.045.128,62	■ IMA-B	2.636.922,98
■ VÉRTICE CURTO	2.361.262,28	■ IMA-B 5	2.109.302,09	■ TÍTULOS PRIVADOS	2.071.533,57	■ IRF-M	1.974.953,61
■ CRÉDITO PRIVADO	1.596.050,26	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.141.035,01	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.131.219,03	■ GESTÃO LIVRE	1.121.166,10
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	922.953,53	■ DISP. FINANCEIRA	794.688,75	■ MULTIMERCADO - OUTROS	763.975,60	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	752.099,71
■ AÇÕES - EXTERIOR	295.574,34	■ IRF-M 1	64.782,02				

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	48.452.028,05	2.154.000,00	1.179.474,13	49.139.202,34	-287.351,58	-287.351,58	-0,58%	-0,58%	0,86%	0,86%	-67,70%	2,57%
Fevereiro	49.139.202,34	1.819.890,94	1.547.337,95	49.954.288,83	542.533,50	255.181,92	1,10%	0,51%	1,21%	2,08%	24,54%	2,93%
Março	49.954.288,83	6.091.500,00	7.222.162,45	49.163.433,24	339.806,86	594.988,78	0,68%	1,19%	0,56%	2,65%	45,08%	1,93%
Abril	49.163.433,24	3.437.715,85	4.600.410,63	47.388.077,73	-612.660,73	-17.671,95	-1,25%	-0,07%	0,82%	3,49%	-1,92%	2,78%
Mai	47.388.077,73	5.115.062,88	4.901.716,75	47.687.408,94	85.985,08	68.313,13	0,18%	0,11%	0,88%	4,40%	2,58%	2,35%
Junho	47.687.408,94	4.871.112,36	4.638.053,80	48.499.343,02	578.875,52	647.188,65	1,21%	1,32%	0,61%	5,03%	26,28%	2,77%
Julho	48.499.343,02	4.083.068,30	5.626.231,68	47.616.923,21	660.743,57	1.307.932,22	1,36%	2,70%	0,84%	5,91%	45,71%	2,91%
Agosto	47.616.923,21	6.520.219,66	6.235.714,86	48.875.588,79	974.160,78	2.282.093,00	2,03%	4,79%	0,42%	6,36%	75,40%	3,66%
Setembro	48.875.588,79	431.506,08	1.543.218,10	47.492.899,60	-270.977,17	2.011.115,83	-0,55%	4,21%	0,86%	7,27%	57,93%	2,89%
Outubro	47.492.899,60	4.135.015,29	4.208.476,40	47.589.741,94	170.303,45	2.181.419,28	0,36%	4,58%	1,02%	8,36%	54,83%	2,39%

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 Outubro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	2.334.362,59	0,00	0,00	2.361.262,28	26.899,69	1,15%	1,15%	0,28%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	2.051.526,04	0,00	0,00	2.071.533,57	20.007,53	0,98%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.110.982,80	0,00	0,00	1.121.166,10	10.183,30	0,92%	0,92%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	1.282.853,24	0,00	0,00	1.294.270,30	11.417,06	0,89%	0,89%	0,85%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	2.293.528,97	0,00	0,00	2.313.885,32	20.356,35	0,89%	0,89%	0,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.112.111,08	0,00	0,00	2.130.232,86	18.121,78	0,86%	0,86%	0,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	64.251,64	0,00	0,00	64.782,02	530,38	0,83%	0,83%	0,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	296.795,29	0,00	0,00	299.229,77	2.434,48	0,82%	0,82%	0,44%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.468.991,30	0,00	0,00	1.479.983,23	10.991,93	0,75%	0,75%	0,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.538.528,99	0,00	0,00	1.549.565,65	11.036,66	0,72%	0,72%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	555.751,38	0,00	0,00	559.736,44	3.985,06	0,72%	0,72%	0,88%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP L...	1.170.609,98	0,00	0,00	1.178.522,02	7.912,04	0,68%	0,68%	1,04%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1.625.166,35	1.000.000,00	169.137,75	2.473.769,16	17.740,56	0,68%	0,92%	0,04%
BB ESPELHO JGP INSTITUCIONAL EQUILÍBRIO 30 IS RESP...	585.358,23	1.000.000,00	0,00	1.596.050,26	10.692,03	0,67%	0,87%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA ...	1.786.589,06	0,00	0,00	1.798.604,81	12.015,75	0,67%	0,67%	1,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	999.740,86	0,00	0,00	1.006.354,54	6.613,68	0,66%	0,66%	1,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	250.930,39	2.056.150,00	1.480.505,94	839.032,56	12.458,11	0,54%	0,95%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	50.020,76	22.326,83	27.811,98	118,05	0,24%	0,85%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.684.245,43	0,00	0,00	1.687.409,73	3.164,30	0,19%	0,19%	1,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	293.023,66	27.000,00	33.004,93	287.543,88	525,15	0,16%	0,19%	1,26%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.582.218,60	1.844,53	1.003.500,95	578.946,68	-1.615,50	-0,10%	-0,68%	1,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.072.098,93	0,00	0,00	2.057.976,30	-14.122,63	-0,68%	-0,68%	1,89%
Total Renda Fixa	27.159.664,81	4.135.015,29	2.708.476,40	28.777.669,46	191.465,76	0,67%		0,71%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	748.725,86	0,00	0,00	752.099,71	3.373,85	0,45%	0,45%	0,44%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.638.620,19	0,00	1.500.000,00	1.131.219,03	-7.401,16	-0,28%	-0,28%	1,60%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MUL...	767.435,42	0,00	0,00	763.975,60	-3.459,82	-0,45%	-0,45%	2,55%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	185.685,11	0,00	0,00	183.521,53	-2.163,58	-1,17%	-1,17%	6,52%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	963.294,67	0,00	0,00	951.815,51	-11.479,16	-1,19%	-1,19%	3,68%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.710.788,52	0,00	0,00	3.661.396,80	-49.391,72	-1,33%	-1,33%	5,63%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.522.939,70	0,00	0,00	1.499.918,51	-23.021,19	-1,51%	-1,51%	4,62%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.158.603,73	0,00	0,00	1.141.035,01	-17.568,72	-1,52%	-1,52%	5,57%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	600.172,06	0,00	0,00	591.002,76	-9.169,30	-1,53%	-1,53%	4,31%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.918.523,32	0,00	0,00	2.861.607,09	-56.916,23	-1,95%	-1,95%	4,44%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	942.910,88	0,00	0,00	922.953,53	-19.957,35	-2,12%	-2,12%	4,15%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	658.268,44	0,00	0,00	642.839,96	-15.428,48	-2,34%	-2,34%	5,98%
Total Renda Variável	16.815.967,90	0,00	1.500.000,00	15.103.385,04	-212.582,86	-1,26%		4,34%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.816.087,04	0,00	0,00	1.923.569,07	107.482,03	5,92%	5,92%	6,60%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.410.366,69	0,00	0,00	1.489.544,03	79.177,34	5,61%	5,61%	6,49%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	290.813,16	0,00	0,00	295.574,34	4.761,18	1,64%	1,64%	6,55%
Total Exterior	3.517.266,89	0,00	0,00	3.708.687,44	191.420,55	5,44%		6,55%

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.

