

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Total para cálculo dos limites da Resolução: R\$ 1.070.632.021,16

Disponibilidades Financeiras: R\$ 1.141,66

PL Total: R\$ 1.070.633.162,82

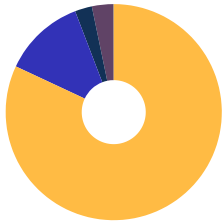
Fundo	Resgate Carência	Saldo	Particip. S/ PL	Cotistas	% PL Fundo	Lei
13.322.205/0001-35 BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1 Não há	64.810.626,98	6,05%	837	1,22%	7º I b
03.543.447/0001-03 BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1 Não há	72.182.596,34	6,74%	776	1,48%	7º I b
13.327.340/0001-73 BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2 Não há	15.778.717,04	1,47%	267	1,28%	7º I b
07.442.078/0001-05 BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1 Não há	43.648.958,20	4,08%	605	0,99%	7º I b
11.328.882/0001-35 BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 Não há	89.272.379,33	8,34%	1.131	1,05%	7º I b
07.111.384/0001-69 BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1 Não há	34.600.912,87	3,23%	609	0,98%	7º I b
11.046.645/0001-81 BB TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0 Não há	74.367.250,50	6,95%	189	0,23%	7º I b
53.828.338/0001-00 BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 15/05/2025	20.702.862,01	1,93%	193	1,66%	7º I b
54.602.092/0001-09 BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 17/08/2026	61.497.267,35	5,74%	332	1,77%	7º I b
55.746.782/0001-02 BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 17/05/2027	37.891.303,62	3,54%	77	5,01%	7º I b
46.134.096/0001-81 BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 15/05/2027	23.297.195,97	2,18%	222	1,82%	7º I b
49.963.751/0001-00 BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 15/08/2028	22.297.362,97	2,08%	126	2,72%	7º I b

Fundo	Resgate Carência	Saldo	Particip. S/ PL	Cotistas	% PL Fundo	Lei
46.134.117/0001-69 BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 15/08/2030	15.607.559,27	1,46%	123	1,67%	7º I b
19.523.305/0001-06 BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 15/08/2022	1.909.476,76	0,18%	40	4,55%	7º I b
10.740.670/0001-06 CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0 Não há	15.735.218,49	1,47%	1.161	0,20%	7º I b
35.292.588/0001-89 BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3 Não há	98.334.982,31	9,18%	668	1,52%	7º III a
07.861.554/0001-22 BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1 Não há	49.086.645,35	4,58%	227	6,31%	7º III a
02.296.928/0001-90 BB INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0 Não há	44.286.716,55	4,14%	199	1,90%	7º III a
13.077.418/0001-49 BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0 Não há	78.612.765,96	7,34%	1.191	0,39%	7º III a
14.091.645/0001-91 BB INFLAÇÃO RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou... Não há	13.512.224,52	1,26%	39	5,44%	7º V b
36.178.569/0001-99 BB BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3 Não há	8.091.511,31	0,76%	20.875	0,57%	8º I
14.213.331/0001-14 BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4 Não há	15.346.796,19	1,43%	2.368	1,87%	8º I
05.100.191/0001-87 BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4 Não há	12.245.460,01	1,14%	19.149	2,04%	8º I
10.418.335/0001-88 BB GOVERNANÇA IS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4 Não há	8.339.557,34	0,78%	1.015	1,24%	8º I
00.822.059/0001-65 BB IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+4 Não há	14.778.566,13	1,38%	5.710	9,96%	8º I

Fundo	Resgate Carência	Saldo	Particip. S/ PL	Cotistas	% PL Fundo	Lei
05.100.221/0001-55 BB SMALL CAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4 Não há	3.592.609,94	0,34%	8.140	1,43%	8º I
30.068.224/0001-04 CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+25 Não há	16.342.551,32	1,53%	846	2,94%	8º I
30.068.169/0001-44 CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+15 Não há	14.135.318,04	1,32%	198	1,72%	8º I
15.154.441/0001-15 CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+33 Não há	8.768.139,95	0,82%	149	0,81%	8º I
14.507.699/0001-95 CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+23 Não há	29.264.859,41	2,73%	123	3,79%	8º I
21.470.644/0001-13 BB GLOBAIS INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4 Não há	20.743.642,39	1,94%	138	1,34%	9º III
17.502.937/0001-68 CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 Não há	6.656.893,43	0,62%	442	0,25%	9º III
06.015.368/0001-00 BB JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	D+1 du Não há	12.944.965,99	1,21%	145.624	0,11%	10º I
05.962.491/0001-75 BB MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	D+1 Não há	6.342.376,61	0,59%	33.295	0,54%	10º I
44.683.343/0001-73 CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO	D+2 du 25 Meses	5.136.792,02	0,48%	121	5,49%	10º I
14.120.520/0001-42 CAIXA JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	D+0 Não há	5.818.771,41	0,54%	2.151	0,60%	10º I
03.737.188/0001-43 CAIXA RV 30 RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	D+4 Não há	4.382.033,96	0,41%	4.466	0,93%	10º I
20.716.161/0001-93 BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ... Não se aplica	268.153,32	0,03%		0,00%	11º

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Agosto / 2024) - Resolução CMN nº 4.963, 25/11/2021

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	81,95%	877.382.941,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	593.599.687,70	55,44%	20,72%	36,34%	81,95%	283.783.253,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	270.321.110,17	25,25%	10,12%	25,42%	60,00%	372.058.102,53
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	214.126.404,23
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	13.512.224,52	1,26%	0,00%	2,78%	5,00%	40.019.376,54
Total Renda Fixa	100,00%	877.433.022,39	81,95%	30,84%	64,54%	248,90%	

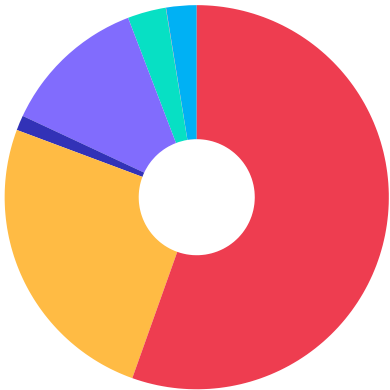


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



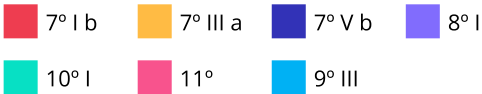
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2024) - Resolução CMN nº 4.963, 25/11/2021

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%	130.905.369,64	12,23%	11,21%	20,32%	30,00%	190.284.236,71
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	321.189.606,35
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	34.624.939,99	3,23%	2,09%	10,00%	10,00%	72.438.262,13
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,50%	26.765.800,53
Artigo 11º	5,00%	268.153,32	0,03%	0,00%	0,14%	2,50%	26.497.647,21
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	165.798.462,95	15,49%	13,30%	30,46%	75,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	107.063.202,12
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	27.400.535,82	2,56%	2,17%	5,00%	10,00%	79.662.666,30
Total Exterior	10,00%	27.400.535,82	2,56%	2,17%	5,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	107.063.202,12



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	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	593.599.687,70	55,44	20,72	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	270.321.110,17	25,25	10,12	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	13.512.224,52	1,26	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	130.905.369,64	12,23	11,21	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	27.400.535,82	2,56	1,88	10,00
Artigo 10º, Inciso I	34.624.939,99	3,23	2,09	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,50
Artigo 11º	268.153,32	0,03	0,00	2,50
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	964.123.289,81	90,05	-
CAIXA DTVM S.A	106.240.578,03	9,92	0,52
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	268.153,32	0,03	0,01

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,41%	6,27%	1,80%	4,09%	9,45%	20,22%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,68%	2,34%	1,46%	1,61%	5,43%	-	1,93%	3,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,67%	3,59%	1,56%	2,43%	6,49%	19,56%	1,62%	2,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,61%	-	1,52%	-	-	-	1,28%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,84%	-	2,30%	-	-	-	0,49%	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,60%	4,60%	1,53%	3,33%	7,94%	20,67%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,64%	4,56%	1,66%	3,36%	7,81%	20,28%	1,25%	1,83%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,77%	-1,21%	1,69%	-0,25%	3,11%	18,58%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	0,75%	-1,44%	1,60%	-0,42%	2,80%	17,77%	3,79%	6,46%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,77%	6,30%	2,36%	4,62%	10,39%	25,57%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,75%	6,24%	2,30%	4,51%	10,24%	25,14%	0,30%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	0,74%	6,13%	2,27%	4,45%	10,09%	24,84%	0,30%	0,40%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,59%	4,88%	1,91%	3,56%	8,14%	21,08%	-	-
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	4,66%	1,80%	3,38%	7,84%	20,50%	1,11%	1,79%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)	0,52%	1,49%	1,63%	1,40%	5,32%	19,81%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,46%	1,29%	1,54%	1,24%	5,04%	19,17%	2,43%	4,10%
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	1,18%	1,48%	1,15%	4,90%	19,04%	2,45%	4,10%
IRF-M (Benchmark)	0,66%	3,54%	1,70%	2,39%	8,26%	24,46%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,65%	3,37%	1,66%	2,25%	8,00%	23,62%	1,62%	2,68%
CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	0,95%	5,91%	2,38%	4,21%	9,96%	25,37%	0,41%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	0,87%	7,07%	2,59%	5,21%	11,15%	26,18%	0,01%	0,05%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,89%	7,21%	2,68%	5,34%	11,32%	26,39%	0,01%	0,06%
BB INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,93%	7,51%	2,77%	5,50%	11,85%	26,53%	0,03%	0,13%
IPCA (Benchmark)	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,68%	1,60%	1,71%	1,34%	4,57%	18,93%	2,23%	4,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,84%	6,90%	2,51%	5,08%	10,91%	25,65%	0,00%	0,05%
BB INFLAÇÃO RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1,08%	5,32%	2,64%	3,65%	8,73%	21,59%	1,77%	2,37%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	0,76%	5,95%	2,29%	4,26%	9,77%	24,14%	0,21%	0,40%
BB JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	0,80%	5,36%	2,19%	3,61%	9,50%	23,56%	0,28%	0,77%
BB MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	0,88%	2,79%	2,23%	2,26%	7,03%	15,88%	1,14%	3,05%
CAIXA RV 30 RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	2,42%	2,09%	3,80%	2,28%	9,14%	20,44%	2,56%	5,10%

Ibovespa (Benchmark)	6,54%	1,36%	11,39%	5,41%	17,51%	24,18%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV RESP LIMITADA FIF CIC...	2,87%	2,47%	4,95%	3,21%	14,66%	8,78%	2,18%	7,12%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,10%	-0,20%	10,96%	3,05%	14,19%	16,81%	6,02%	13,53%
BB GOVERNANÇA IS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	6,46%	1,88%	11,18%	5,80%	17,26%	20,95%	5,62%	13,15%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5,70%	-3,03%	10,22%	1,58%	10,80%	14,74%	5,81%	14,43%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	9,54%	2,74%	10,19%	3,26%	17,40%	26,11%	7,33%	16,04%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4,51%	-2,60%	8,56%	0,89%	7,56%	8,51%	6,53%	14,00%

IDIV (Benchmark)	6,69%	5,00%	10,87%	7,85%	21,94%	34,91%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	5,73%	5,17%	10,80%	6,59%	19,13%	30,18%	5,34%	11,57%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,49%	1,97%	10,57%	5,42%	17,17%	21,58%	5,73%	12,54%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,81%	2,47%	10,02%	1,71%	13,82%	26,58%	6,07%	14,98%

IFIX (Benchmark)	0,86%	2,48%	0,33%	1,00%	5,63%	14,02%	-	-
-------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

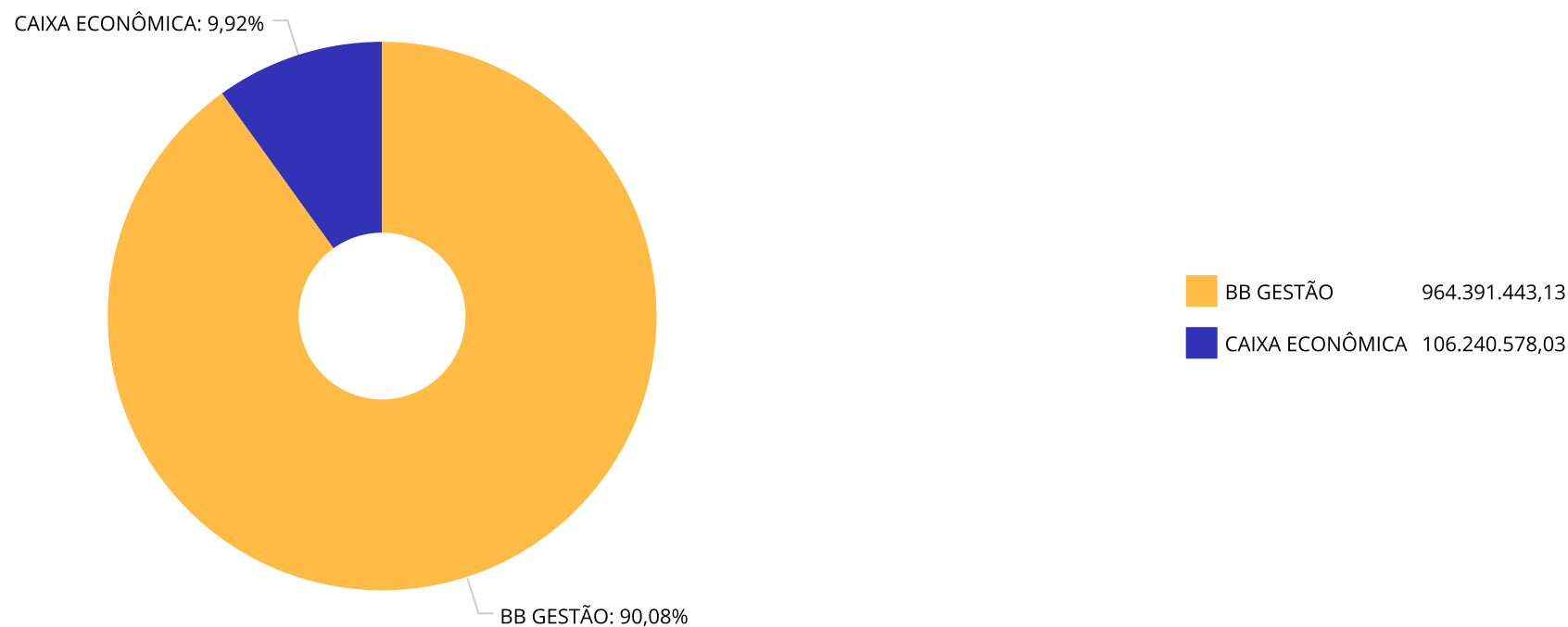
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,28%	18,42%	7,03%	10,83%	25,31%	42,82%	-	-
BB BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	1,74%	19,99%	7,29%	12,12%	28,27%	52,77%	9,37%	12,31%
SMLL (Benchmark)	4,51%	-9,69%	5,65%	-3,81%	-2,18%	-4,07%	-	-
BB SMALL CAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3,17%	-13,48%	4,07%	-7,97%	-8,13%	-9,16%	13,38%	22,95%

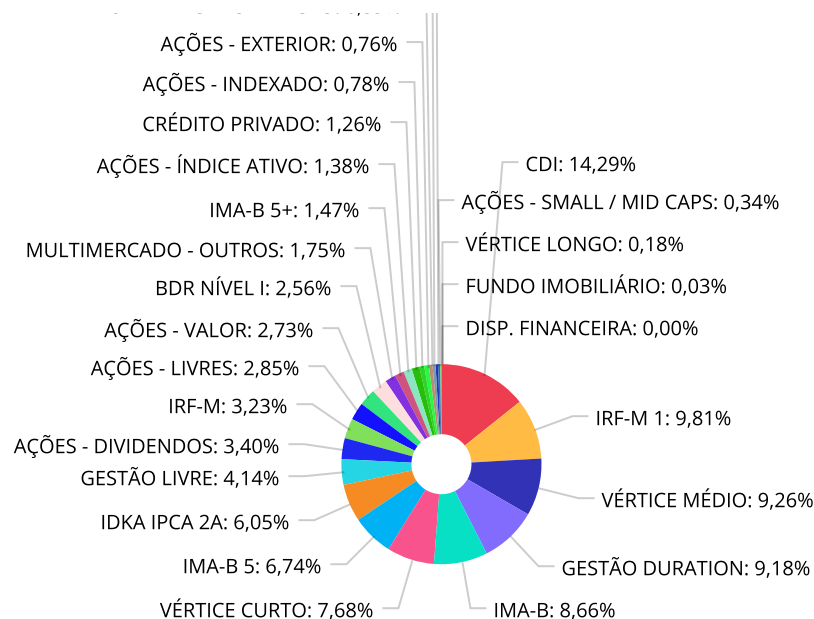
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB GLOBAIS INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES	1,39%	31,34%	10,76%	17,87%	36,69%	53,29%	9,80%	15,184%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES 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)

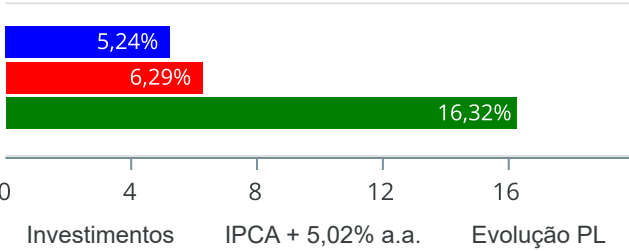


CDI	152.980.016,46	IRF-M 1	105.007.597,82	Vértice Médio	99.093.421,83	Gestão Duration	98.334.982,31
IMA-B	92.735.603,55	Vértice Curto	82.200.129,36	IMA-B 5	72.182.596,34	IDKA IPCA 2A	64.810.626,98
Gestão Livre	44.286.716,55	Ações - Dividendos	36.360.396,15	IRF-M	34.600.912,87	Ações - Livres	30.477.869,36
Ações - Valor	29.264.859,41	BDR Nível I	27.400.535,82	Multimercado - Outros	18.763.737,40	IMA-B 5+	15.778.717,04
Ações - Índice Ativo	14.778.566,13	Crédito Privado	13.512.224,52	Ações - Indexado	8.339.557,34	Ações - Exterior	8.091.511,31
Multimercado - Macro	6.342.376,61	Multimercado - Conservador	5.136.792,02	Multimercado - Alocação	4.382.033,96	Ações - Small / Mid Caps	3.592.609,94
Vértice Longo	1.909.476,76	Fundo Imobiliário	268.153,32	Disp. Financeira	1.141,66		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

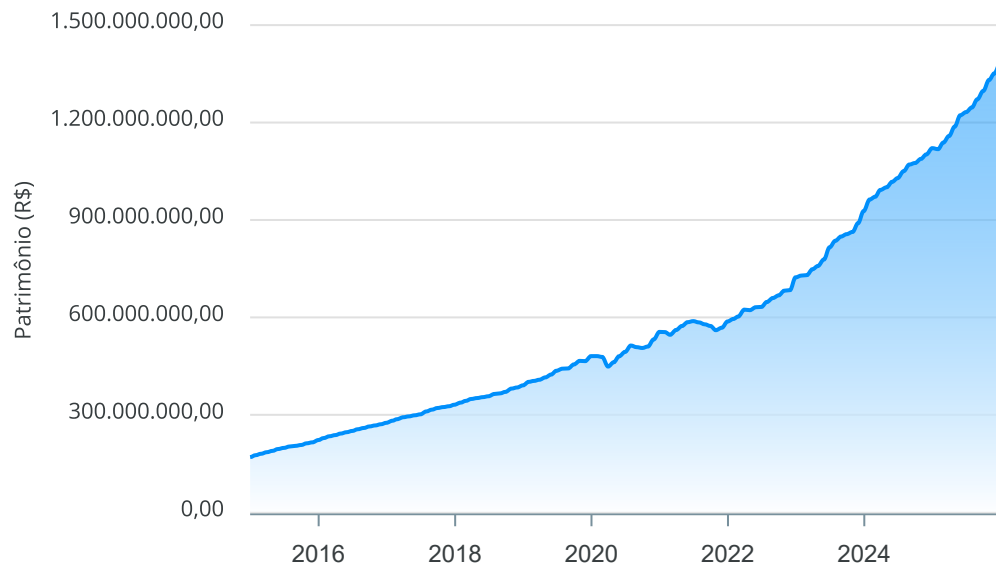
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	902.123.914,12	34.167.259,75	19.500,00	937.774.859,45	1.503.185,58	1.503.185,58	0,16%	0,16%	0,85%	0,85%	18,88%	1,16%
Fevereiro	937.774.859,45	22.947.732,01	21.765.173,80	947.307.015,99	8.349.598,33	9.852.783,91	0,89%	1,05%	1,20%	2,06%	50,94%	1,22%
Março	947.307.015,99	22.281.755,59	7.010.600,00	968.712.902,61	6.134.731,03	15.987.514,94	0,64%	1,70%	0,55%	2,63%	64,58%	1,02%
Abril	968.712.902,61	21.528.955,94	11.698.358,59	973.592.504,06	-4.950.995,90	11.036.519,04	-0,51%	1,18%	0,81%	3,46%	34,16%	1,56%
Maiο	973.592.504,06	25.059.393,93	8.299.711,74	997.294.158,58	6.941.972,33	17.978.491,37	0,70%	1,89%	0,87%	4,36%	43,37%	1,20%
Junho	997.294.158,58	75.326.156,40	71.082.802,13	1.007.494.574,60	5.957.061,75	23.935.553,12	0,59%	2,50%	0,60%	4,98%	50,08%	1,60%
Julho	1.007.494.574,60	24.261.106,62	16.606.000,00	1.028.138.601,58	12.988.920,36	36.924.473,48	1,28%	3,81%	0,83%	5,86%	65,03%	1,63%
Agosto	1.028.138.601,58	75.229.152,81	68.300.229,53	1.049.341.040,58	14.273.515,72	51.197.989,20	1,38%	5,24%	0,41%	6,29%	83,32%	1,90%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

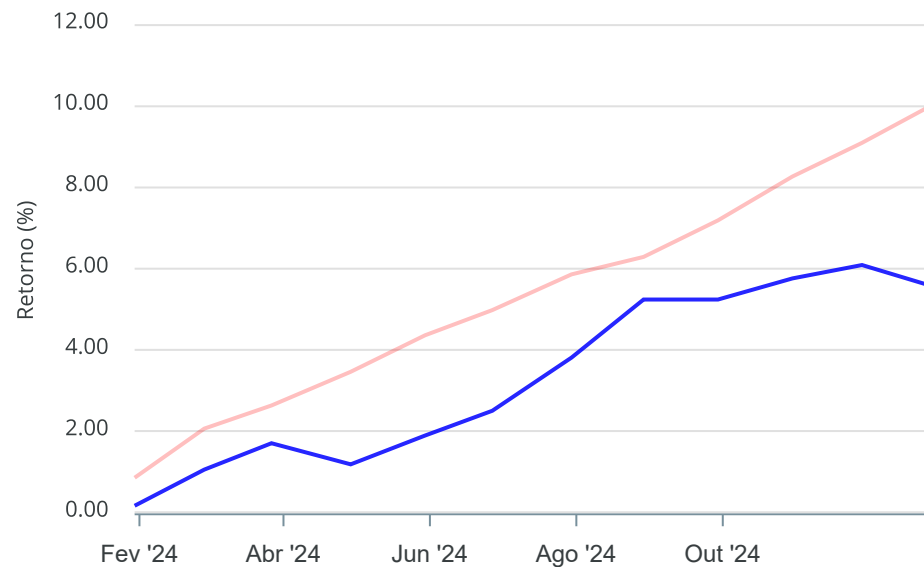
Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO

36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1 ☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB INFLAÇÃO RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	13.368.498,28	0,00	0,00	13.512.224,52	143.726,24	1,08%	1,08%	1,77%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	97.412.660,79	0,00	0,00	98.334.982,31	922.321,52	0,95%	0,95%	0,41%
BB INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	43.880.279,93	0,00	0,00	44.286.716,55	406.436,62	0,93%	0,93%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA R...	73.725.714,21	0,00	0,00	74.367.250,50	641.536,29	0,87%	0,87%	0,01%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	81.765.099,36	2.714.216,85	6.579.276,23	78.612.765,96	712.725,98	0,84%	0,89%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	1.893.531,90	0,00	0,00	1.909.476,76	15.944,86	0,84%	0,84%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	19.343.995,96	1.192.147,32	0,00	20.702.862,01	166.718,73	0,81%	0,84%	0,49%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	15.660.984,86	0,00	0,00	15.778.717,04	117.732,18	0,75%	0,75%	3,79%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	15.253.592,65	365.544,46	0,00	15.735.218,49	116.081,38	0,74%	0,75%	0,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 RESP LIMITADA FIF...	15.958.073,61	0,00	464.256,31	15.607.559,27	113.741,97	0,71%	0,68%	2,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 RESP LIMITADA FIF...	22.797.186,15	0,00	659.377,43	22.297.362,97	159.554,25	0,70%	0,68%	1,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA FIF...	48.094.348,34	0,00	48.429.987,82	0,00	335.639,48	0,70%	0,93%	0,08%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC ...	76.266.151,78	13.178.105,27	791.000,00	89.272.379,33	619.122,28	0,69%	0,74%	0,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	11.204.500,07	0,00	11.281.976,13	0,00	77.476,06	0,69%	0,92%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 RESP LIMITADA FIF...	23.141.156,39	0,00	0,00	23.297.195,97	156.039,58	0,67%	0,67%	1,62%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	34.376.849,08	0,00	0,00	34.600.912,87	224.063,79	0,65%	0,65%	1,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	64.401.410,58	0,00	0,00	64.810.626,98	409.216,40	0,64%	0,64%	1,25%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	71.809.948,23	0,00	0,00	72.182.596,34	372.648,11	0,52%	0,52%	1,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	43.447.972,65	0,00	0,00	43.648.958,20	200.985,55	0,46%	0,46%	2,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	42.099.171,94	20.360.891,76	1.236.009,42	61.497.267,35	273.213,07	0,44%	0,61%	1,28%

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
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	48.876.271,48	0,00	0,00	49.086.645,35	210.373,87	0,43%	0,43%	2,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA ...	0,00	37.898.252,99	0,00	37.891.303,62	-6.949,37	-0,02%	-	-
Total Renda Fixa	864.777.398,24	75.709.158,65	69.441.883,34	877.433.022,39	6.388.348,84	0,73%		0,96%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITAD...	12.903.963,60	0,00	0,00	14.135.318,04	1.231.354,44	9,54%	9,54%	7,33%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	14.369.007,96	0,00	0,00	15.346.796,19	977.788,23	6,80%	6,80%	6,07%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	11.499.713,04	0,00	0,00	12.245.460,01	745.746,97	6,48%	6,48%	5,73%
BB GOVERNANÇA IS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	7.833.425,97	0,00	0,00	8.339.557,34	506.131,37	6,46%	6,46%	5,62%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS RESP LIMITADA FIF CI...	27.581.724,71	0,00	0,00	29.264.859,41	1.683.134,70	6,10%	6,10%	6,02%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS RESP LIMI...	8.292.790,70	0,00	0,00	8.768.139,95	475.349,25	5,73%	5,73%	5,34%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	13.981.618,98	0,00	0,00	14.778.566,13	796.947,15	5,70%	5,70%	5,81%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃO...	15.636.841,27	0,00	0,00	16.342.551,32	705.710,05	4,51%	4,51%	6,53%
BB SMALL CAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.482.145,39	0,00	0,00	3.592.609,94	110.464,55	3,17%	3,17%	13,38%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV RESP L...	4.993.602,13	0,00	0,00	5.136.792,02	143.189,89	2,87%	2,87%	2,18%
CAIXA RV 30 RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	4.278.572,78	0,00	0,00	4.382.033,96	103.461,18	2,42%	2,42%	2,56%
BB BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	7.953.048,52	0,00	0,00	8.091.511,31	138.462,79	1,74%	1,74%	9,37%
BB GLOBAIS INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES	20.458.334,65	0,00	0,00	20.743.642,39	285.307,74	1,39%	1,39%	9,80%
BB MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	6.287.011,02	0,00	0,00	6.342.376,61	55.365,59	0,88%	0,88%	1,14%
BB JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCA...	12.842.041,75	0,00	0,00	12.944.965,99	102.924,24	0,80%	0,80%	0,28%
CAIXA JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	5.427.096,25	350.288,61	0,00	5.818.771,41	41.386,55	0,72%	0,76%	0,21%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	6.619.462,15	0,00	0,00	6.656.893,43	37.431,28	0,57%	0,57%	9,23%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	363.732,82	0,00	0,00	268.153,32	-95.579,50	-26,28%	-	-
Total Renda Variável	184.804.133,69	350.288,61	0,00	193.198.998,77	8.044.576,47	4,34%		5,97%

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.

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.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

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.

