

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2024



Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

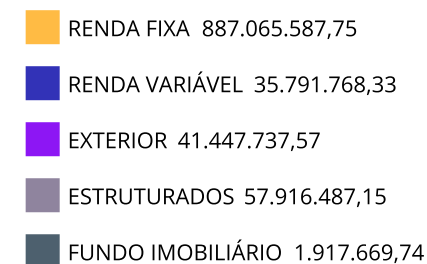
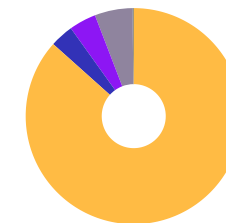
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			771.243.388,84	75,31%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.037.376,39	1,37%	886	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.266.447,92	0,12%	713	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	52.883.263,15	5,16%	1.066	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	792.855,53	0,08%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	43.659.076,93	4,26%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.459.460,61	0,24%		2,07%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	D+1260	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	723.718,37	0,07%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	6.463.112,98	0,63%	16.027	0,59%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.476.980,81	0,34%	195	0,44%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	9.386.255,41	0,92%	13.176	0,63%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	16.034.796,22	1,57%	913	1,71%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	10.780.828,09	1,05%	1.766	5,20%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	14.253.677,24	1,39%	6.022	1,83%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	16.413.232,24	1,60%	441	0,62%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	25.095.413,75	2,45%	7.966	1,23%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	26.478.720,89	2,59%	601	1,89%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.937.733,83	0,29%	14.620	0,56%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	743.028,82	0,07%		2,71%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	754.641,81	0,07%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.906.948,05	0,19%		3,47%	Artigo 10º, Inciso II
BR HOTÉIS FII - BRHT11	Não se ...	Não se aplica	1.917.669,74	0,19%		1,55%	Artigo 11º
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	430.622,91	0,04%		0,00%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.024.139.250,54				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	771.243.388,84	75,31%	50,00%	75,00%	90,00%	150.481.936,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	15.303.824,31	1,49%	0,00%	2,00%	30,00%	291.937.950,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	51.206.962,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	70,00%	53.676.118,68	5,24%	0,00%	2,50%	30,00%	253.565.656,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	102.413.925,05
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	43.659.076,93	4,26%	0,00%	0,00%	10,00%	58.754.848,12
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	10,00%	3.183.178,99	0,31%	0,00%	0,50%	5,00%	48.023.783,54
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	51.206.962,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea c	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	51.206.962,53
Total Renda Fixa	100,00%	887.065.587,75	86,62%	50,00%	80,00%	190,00%	

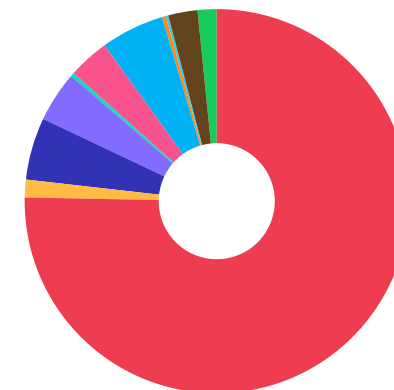


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

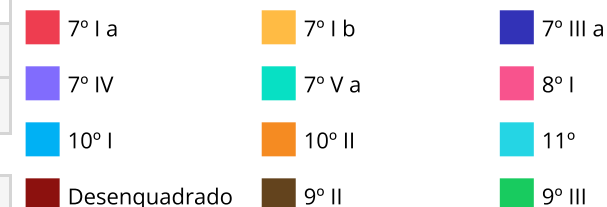


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	35.361.145,42	3,45%	3,00%	9,00%	20,00%	169.466.704,69
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	102.413.925,05
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	54.511.868,47	5,32%	2,00%	5,00%	10,00%	47.902.056,58
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	3.404.618,68	0,33%	0,00%	0,50%	5,00%	47.802.343,85
Artigo 11º	10,00%	1.917.669,74	0,19%	0,00%	0,50%	5,00%	49.289.292,79
Desenquadrado - RV	0,00%	430.622,91	0,04%	0,00%	0,00%	0,00%	-430.622,91
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	95.625.925,22	9,34%	5,00%	15,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	25.034.505,33	2,44%	0,00%	3,00%	10,00%	77.379.419,72
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	16.413.232,24	1,60%	0,00%	2,00%	5,00%	34.793.730,29
Total Exterior	10,00%	41.447.737,57	4,05%	0,00%	5,00%	15,00%	



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%	102.413.925,05

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	771.243.388,84	75,31	50,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	15.303.824,31	1,49	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	53.676.118,68	5,24	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV	43.659.076,93	4,26	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	3.183.178,99	0,31	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea c	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	35.361.145,42	3,45	5,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	25.034.505,33	2,44	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	16.413.232,24	1,60	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	54.511.868,47	5,32	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	3.404.618,68	0,33	0,00	5,00
Artigo 11º	1.917.669,74	0,19	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	771.243.388,84	75,31	-
CAIXA DTVM	113.172.714,26	11,05	0,56
BANCO BTG PACTUAL	43.659.076,93	4,26	0,01
ITAU ASSET MANAGEMENT	35.864.976,30	3,50	0,00
XP ASSET MANAGEMENT	25.034.505,33	2,44	-
NAVI CAPITAL	16.034.796,22	1,57	1,71
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.463.112,98	0,63	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	5.893.704,25	0,58	6,92
SICREDI	2.937.733,83	0,29	0,00
KPTL	1.906.948,05	0,19	0,37
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.497.670,63	0,15	-
CADENCE GESTORA	430.622,91	0,04	-
GENIAL GESTÃO LTDA	0,01	0,00	-

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 + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,01%	8,71%	2,52%	5,37%	11,73%	25,76%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,42%	-7,82%	-5,20%	-6,46%	-8,94%	-10,55%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,21%	-5,00%	-0,60%	-1,15%	-5,59%	-8,11%	-	-
120% do CDI (Benchmark)	1,00%	9,66%	3,16%	6,30%	13,40%	31,91%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	0,40%	5,30%	1,92%	3,18%	8,43%	21,06%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	5,14%	1,87%	3,07%	8,21%	20,61%	0,96%	1,77%
IMA-B (Benchmark)	-0,67%	0,82%	1,94%	0,64%	5,61%	17,28%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,01%	-0,63%	-0,69%	-1,15%	0,50%	5,49%	0,40%	1,78%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,69%	0,63%	1,88%	0,50%	5,37%	16,71%	1,87%	3,95%
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,86%	8,25%	2,74%	5,38%	11,42%	26,66%	0,02%	0,06%
IPCA (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-

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
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%	-	-
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,70%	-4,07%	4,87%	-2,03%	9,49%	12,69%	5,28%	13,59%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-3,14%	-7,65%	3,89%	-0,21%	5,18%	7,22%	5,73%	12,56%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,05%	-0,39%	6,95%	-1,23%	13,96%	26,32%	6,56%	15,64%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,97%	11,17%	12,08%	9,59%	29,31%	27,61%	6,04%	12,92%
IFIX (Benchmark)	-2,58%	-0,16%	-1,24%	-3,00%	2,69%	10,54%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,02%	20,81%	5,53%	9,67%	34,38%	60,71%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	2,38%	24,64%	6,49%	12,03%	41,02%	83,07%	6,47%	12,48%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,35%	24,15%	6,34%	11,73%	40,26%	81,33%	6,45%	12,43%

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

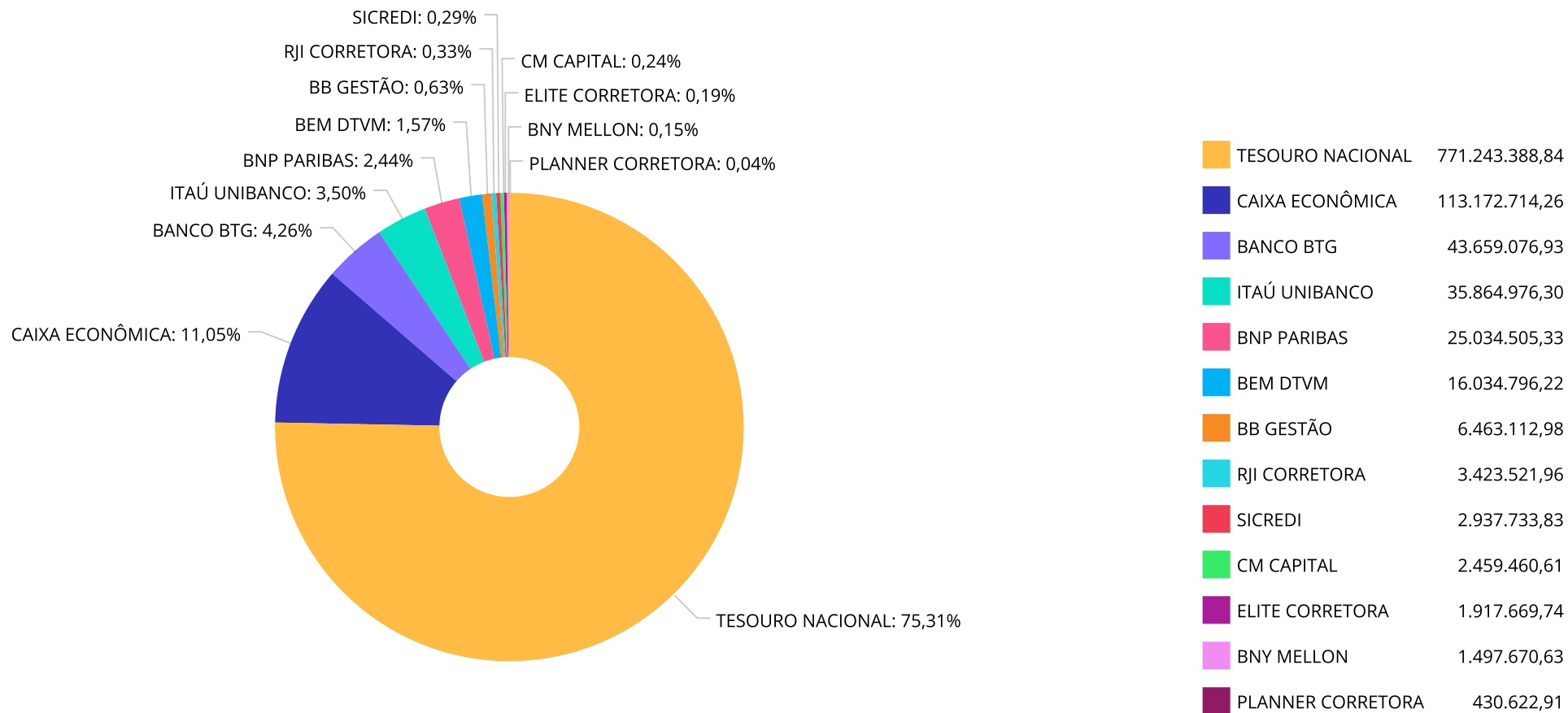
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,28%	11,38%	3,35%	7,08%	15,39%	34,12%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,12%	-55,19%	-19,73%	-20,05%	-55,38%	-	-	-

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,16%	10,24%	3,00%	6,35%	13,82%	30,50%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,05%	-0,42%	-0,15%	-0,29%	-	-1,18%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,03%	-0,27%	-0,10%	-0,18%	-0,37%	-0,73%	-	-

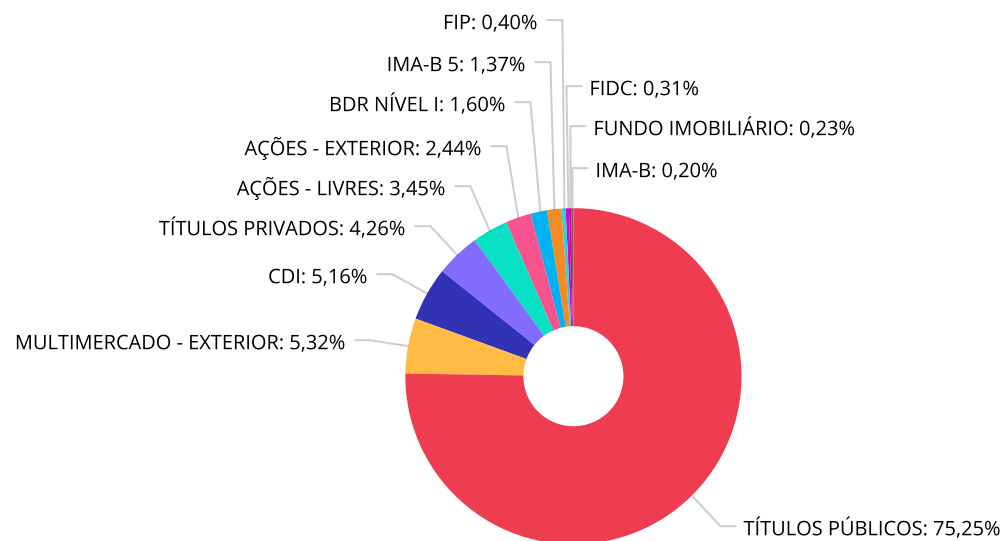
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	8,93%	15,691%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,05%	32,20%	3,90%	18,13%	41,96%	57,72%	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2,42%	35,64%	6,73%	17,70%	52,26%	90,58%	7,87%	19,325%
MSCI ACWI (Benchmark)	-1,59%	31,85%	4,09%	18,60%	41,09%	55,11%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	3,69%	10,46%	6,16%	5,08%	27,21%	61,11%	5,96%	15,241%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	771.243.388,84	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	54.511.868,47	■ CDI	52.883.263,15	■ TÍTULOS PRIVADOS	43.659.076,93
■ AÇÕES - LIVRES	35.361.145,42	■ AÇÕES - EXTERIOR	25.034.505,33	■ BDR NÍVEL I	16.413.232,24	■ IMA-B 5	14.037.376,39
■ FIP	4.147.647,50	■ FIDC	3.183.178,99	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.348.292,65	■ IMA-B	2.059.303,45

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	15/08/2026	20/09/2024	3.191	4.293,249217	4.304,727003	13.699.758,25	13.736.383,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/10/2022	1.592	4080,866490	4.451,966157	6.496.739,45	7.087.530,12	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	09/11/2022	1.600	4060,354006	4.404,236993	6.496.566,41	7.046.779,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	02/12/2022	1.724	4.059,444003	4.369,095217	6.998.481,46	7.532.320,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	29/12/2022	3.200	4.062,499278	4.344,404736	12.999.997,69	13.902.095,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	24/05/2022	10.309	4.151,368820	4.477,512806	42.796.461,17	46.158.679,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	01/06/2022	1.942	4119,013540	4.436,814591	7.999.124,29	8.616.293,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	18/08/2022	2.161	4.003,343810	4.424,33098	8.651.225,97	9.560.979,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	23/08/2022	3.607	4.003,343810	4.402,524658	14.440.061,12	15.879.906,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	13.717	4.009,617406	4.390,555612	54.999.921,96	60.225.251,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	28/10/2021	1.449	3977,478261	4.196,162395	5.763.366,00	6.080.239,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	30/11/2021	1.387	4169,633376	4.196,162395	5.783.281,49	5.820.077,24	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/11/2021	303	4.128,989331	4.196,162395	1.251.083,77	1.271.437,21	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/12/2021	1.452	4200,155373	4.196,162395	6.098.625,60	6.092.827,80	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	13.639	4.193,558503	4.535,265181	57.195.944,42	61.856.481,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/07/2022	2.940	4081,521882	4.360,252479	11.999.674,33	12.819.142,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/08/2022	803	4.010,486989	4.453,393103	3.220.421,05	3.576.074,66	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/03/2023	7.730	3.880,60527900	4.179,6228	29.997.078,81	32.308.484,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2023	5.532	3.886,16363200	4.179,942782	21.498.257,21	23.123.443,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	27/03/2023	13.187	4.011,33	4.271,738617	52.897.408,71	56.331.417,14	Curva

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	15/08/2040	10/04/2023	5.626	4.088,420000	4.327,605696	23.001.450,92	24.347.109,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/05/2023	3.620	4.289,326116	4.470,13593	15.527.360,54	16.181.892,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	09/06/2023	1.650	4.423,334274	4.584,058069	7.298.501,55	7.563.695,81	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	04/10/2023	1.751	4.282,214064	4.471,441801	7.498.156,83	7.829.494,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	30/10/2023	5.716	4.320,770189	4.484,3362	24.697.522,40	25.632.465,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	02/02/2024	1.671	4.483,496122	4.649,593784	7.491.922,02	7.769.471,21	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	14/03/2024	2.792	4.502,034910	4.597,812959	12.569.681,47	12.837.093,78	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	09/01/2024	3.322	4.514,426000	4.718,242834	14.996.923,17	15.674.002,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	07/05/2024	2.108	4.316,007742	4.353,450705	9.098.144,32	9.177.074,08	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/04/2024	3.684	4.342,953784	4.401,43499	15.999.441,74	16.214.886,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/06/2024	2.040	4.215,490499	4.340,301186	8.599.600,62	8.854.214,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	05/08/2024	1.948	4.361,873903	4.418,40267	8.496.930,36	8.607.048,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	05/12/2023	7.742	4.359,205871	4.614,759017	33.748.971,85	35.727.464,30	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	01/02/2023	1.766	3.849,911563	4.193,935496	6.798.943,82	7.406.490,08	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	7.752	3.869,91365700	4.165,526308	29.999.570,67	32.291.159,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	22/11/2022	428	3.875,925678	4.326,369009	1.658.896,19	1.851.685,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	08/03/2023	5.530	3.887,586344	4.178,619614	21.498.352,48	23.107.766,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	11/05/2023	1.735	4.263,612425	4.464,570842	7.397.367,56	7.746.030,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	10/07/2023	11.310	4.472,934683	4.753,669999	50.588.891,26	53.764.007,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	04/07/2023	1.618	4.511,125907	4.796,205947	7.299.001,72	7.760.261,22	Curva

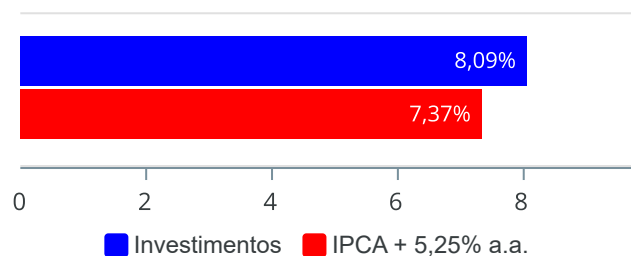
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	14/03/2024	2.792	4.502,034910	4.597,812959	12.569.681,47	12.837.093,78	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	09/01/2024	3.322	4.514,426000	4.718,242834	14.996.923,17	15.674.002,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	07/05/2024	2.108	4.316,007742	4.353,450705	9.098.144,32	9.177.074,08	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

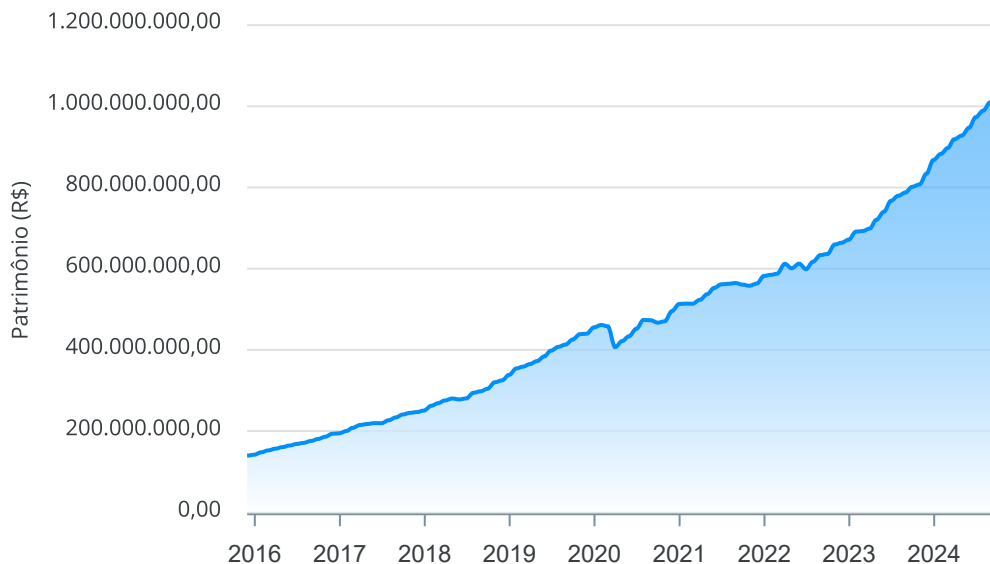
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	858.545.572,20	28.209.983,76	19.552.624,87	873.067.719,94	5.864.788,85	5.864.788,85	0,68%	0,68%	0,87%	0,87%	77,77%	4,76%
Fevereiro	873.067.719,94	29.566.726,70	26.575.025,48	886.629.975,11	10.570.553,95	16.435.342,80	1,21%	1,89%	1,22%	2,10%	90,05%	4,57%
Março	886.629.975,11	43.522.309,29	31.554.583,37	907.467.108,63	8.869.407,60	25.304.750,40	0,99%	2,90%	0,57%	2,68%	108,11%	3,98%
Abril	907.467.108,63	39.933.485,97	31.324.167,22	916.777.792,56	701.365,18	26.006.115,58	0,08%	2,98%	0,83%	3,53%	84,27%	4,87%
Mai	916.777.792,56	30.713.303,01	21.234.030,78	935.739.967,93	9.482.903,14	35.489.018,72	1,02%	4,03%	0,89%	4,45%	90,52%	3,48%
Junho	935.739.967,93	33.857.279,41	20.174.257,15	961.668.917,45	12.245.927,26	47.734.945,98	1,29%	5,37%	0,62%	5,10%	105,39%	3,39%
Julho	961.668.917,45	19.749.738,28	12.431.842,01	977.458.639,89	8.471.826,17	56.206.772,15	0,87%	6,29%	0,85%	5,99%	105,05%	4,70%
Agosto	977.458.639,89	47.788.720,85	38.083.549,75	997.759.306,83	10.595.495,84	66.802.267,99	1,07%	7,43%	0,43%	6,44%	115,37%	6,32%
Setembro	997.759.306,83	24.196.007,97	16.139.232,03	1.011.940.183,43	6.124.100,66	72.926.368,65	0,61%	8,09%	0,87%	7,37%	109,76%	4,42%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



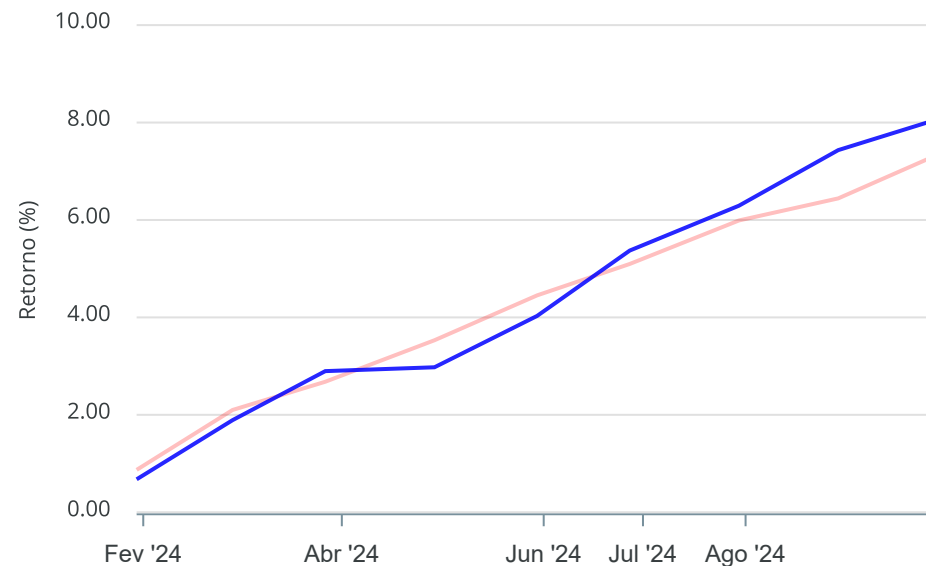
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Setembro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	58.105.352,85	11.829.820,29	17.511.849,78	52.883.263,15	459.939,79	0,66%	0,86%	0,02%
LETRA FINANCEIRA BTG	43.384.187,09	0,00	0,00	43.659.076,93	274.889,84	0,63%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	752.967.458,62	13.699.758,25	0,00	771.243.388,84	4.576.171,97	0,60%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.983.975,27	0,00	0,00	14.037.376,39	53.401,12	0,38%	0,38%	0,96%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	792.779,71	0,00	0,00	792.855,53	75,82	0,01%	0,01%	0,40%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.464.659,93	0,00	0,00	2.459.460,61	-5.199,32	-0,21%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	726.789,27	0,00	0,00	723.718,37	-3.070,90	-0,42%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.275.221,84	0,00	0,00	1.266.447,92	-8.773,92	-0,69%	-0,69%	1,87%
Total Renda Fixa	873.700.424,59	25.529.578,54	17.511.849,78	887.065.587,75	5.347.434,40	0,61%		0,25%

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
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	2.869.440,33	0,00	0,00	2.937.733,83	68.293,50	2,38%	2,38%	6,47%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	25.871.466,04	0,00	0,00	26.478.720,89	607.254,85	2,35%	2,35%	6,45%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.524.299,15	0,00	0,00	25.095.413,75	571.114,60	2,33%	2,33%	6,45%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	754.872,39	0,00	0,00	754.641,81	-230,58	-0,03%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	743.382,16	0,00	0,00	743.028,82	-353,34	-0,05%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	1.909.187,38	0,00	0,00	1.906.948,05	-2.239,33	-0,12%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	431.332,53	0,00	0,00	430.622,91	-709,62	-0,16%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11	1.924.575,65	0,00	0,00	1.917.669,74	-6.905,91	-0,36%	0,00%	0,00%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	9.477.768,35	0,00	0,00	9.386.255,41	-91.512,94	-0,97%	-0,97%	6,04%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.586.367,65	0,00	0,00	3.476.980,81	-109.386,84	-3,05%	-3,05%	6,56%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	6.672.934,79	0,00	0,00	6.463.112,98	-209.821,81	-3,14%	-3,14%	5,73%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	16.651.186,11	0,00	0,00	16.034.796,22	-616.389,89	-3,70%	-3,70%	5,28%
Total Renda Variável	95.416.812,53	0,00	0,00	95.625.925,22	209.112,69	0,22%		6,03%

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
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	10.397.040,14	0,00	0,00	10.780.828,09	383.787,95	3,69%	3,69%	5,96%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	13.917.474,57	0,00	0,00	14.253.677,24	336.202,67	2,42%	2,42%	7,87%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	16.466.642,94	0,00	0,00	16.413.232,24	-53.410,70	-0,32%	-0,32%	8,93%
Total Exterior	40.781.157,65	0,00	0,00	41.447.737,57	666.579,92	1,63%		7,79%

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
TÍTULOS PÚBLICOS	753.124.088,93	22.196.688,61	20.578.471,68	771.243.388,84	16.501.082,98	2,13%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	36.156.302,44	65.570.089,15	49.935.470,20	52.883.263,15	1.092.341,76	1,07%	2,73%
LETRA FINANCEIRA BTG	34.210.017,73	8.400.000,00	0,00	43.659.076,93	1.049.059,20	2,46%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.780.214,27	0,00	0,00	14.037.376,39	257.162,12	1,87%	1,87%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.243.117,39	0,00	0,00	1.266.447,92	23.330,53	1,88%	1,88%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	798.368,94	0,00	0,00	792.855,53	-5.513,41	-0,69%	-0,69%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.474.316,45	0,00	0,00	2.459.460,61	-14.855,84	-0,60%	-0,60%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	763.402,99	0,00	0,00	723.718,37	-39.684,62	-5,20%	-5,20%
Total Renda Fixa	842.549.829,15	96.166.777,76	70.513.941,88	887.065.587,75	18.862.922,72	2,17%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	24.900.649,32	0,00	0,00	26.478.720,89	1.578.071,57	6,34%	6,34%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.604.497,69	0,00	0,00	25.095.413,75	1.490.916,06	6,32%	6,32%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8.374.865,01	0,00	0,00	9.386.255,41	1.011.390,40	12,08%	12,08%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	15.289.846,84	0,00	0,00	16.034.796,22	744.949,38	4,87%	4,87%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	6.221.159,05	0,00	0,00	6.463.112,98	241.953,93	3,89%	3,89%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.251.179,82	0,00	0,00	3.476.980,81	225.800,99	6,95%	6,95%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	2.758.835,44	0,00	0,00	2.937.733,83	178.898,39	6,48%	6,48%
BRASIL FLORESTAL MULTIELSTRATÉGIA FIP	755.571,71	0,00	0,00	754.641,81	-929,90	-0,12%	-0,10%
OSASCO PROPERTIES FII	431.893,17	0,00	0,00	430.622,91	-1.270,26	-0,29%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	744.454,13	0,00	0,00	743.028,82	-1.425,31	-0,19%	-0,15%
BR HOTÉIS FII - BRHT11	1.926.640,94	0,00	0,00	1.917.669,74	-8.971,20	-0,47%	-
W7 FIP MULTIELSTRATÉGIA	2.375.512,21	0,00	0,00	1.906.948,05	-468.564,16	-19,72%	-19,72%
Total Renda Variável	90.635.105,33	0,00	0,00	95.625.925,22	4.990.819,89	5,51%	

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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	13.355.283,15	0,00	0,00	14.253.677,24	898.394,09	6,73%	6,73%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	10.155.108,32	0,00	0,00	10.780.828,09	625.719,77	6,16%	6,16%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	16.291.293,38	0,00	0,00	16.413.232,24	121.938,86	0,75%	0,75%
Total Exterior	39.801.684,85	0,00	0,00	41.447.737,57	1.646.052,72	4,14%	

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.