

Relatório Analítico dos Investimentos

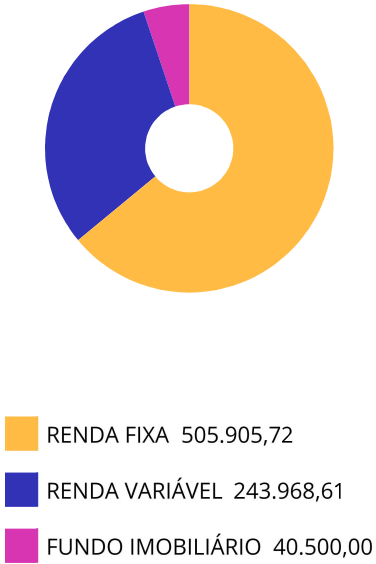
em setembro e 3º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	241.953,81	30,61%	6.827	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	257.559,47	32,59%	1.037	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	6.392,44	0,81%	98	0,02%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	D+4	Não há	243.968,61	30,87%	480	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	40.500,00	5,12%		0,03%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			790.374,33				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			195.377,84	Artigo 6º			
PL Total			985.752,17				

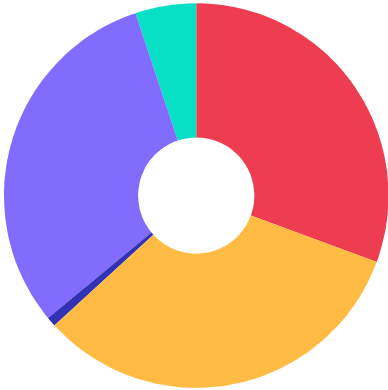
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	50,00%	395.187,17
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	241.953,81	30,61%	5,00%	51,00%	70,00%	311.308,22
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	50,00%	395.187,17
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	7.903,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	257.559,47	32,59%	0,00%	14,00%	45,00%	98.108,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	237.112,30
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	79.037,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	6.392,44	0,81%	0,00%	0,00%	1,00%	1.511,30
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	23.711,23
Artigo 7º, Inciso V, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	7.903,74
Total Renda Fixa	100,00%	505.905,72	64,01%	5,00%	71,00%	261,00%	

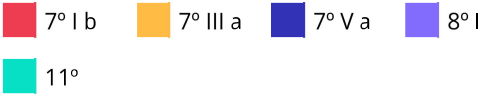


Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	243.968,61	30,87%	0,00%	28,00%	30,00%	-6.856,31
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	158.074,87
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	23.711,23
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	23.711,23
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	15.807,49
Artigo 11º	5,00%	40.500,00	5,12%	0,00%	0,00%	3,00%	-16.788,77
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	284.468,61	35,99%	0,00%	28,00%	61,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	4,00%	31.614,97
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	4,00%	31.614,97
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	39.518,72
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	13,00%	



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	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	241.953,81	30,61	0,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	257.559,47	32,59	0,00	45,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	6.392,44	0,81	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea c	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso I	243.968,61	30,87	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 11º	40.500,00	5,12	0,00	3,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	501.528,08	63,45	-
CAIXA DTVM	282.453,81	35,74	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	6.392,44	0,81	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)

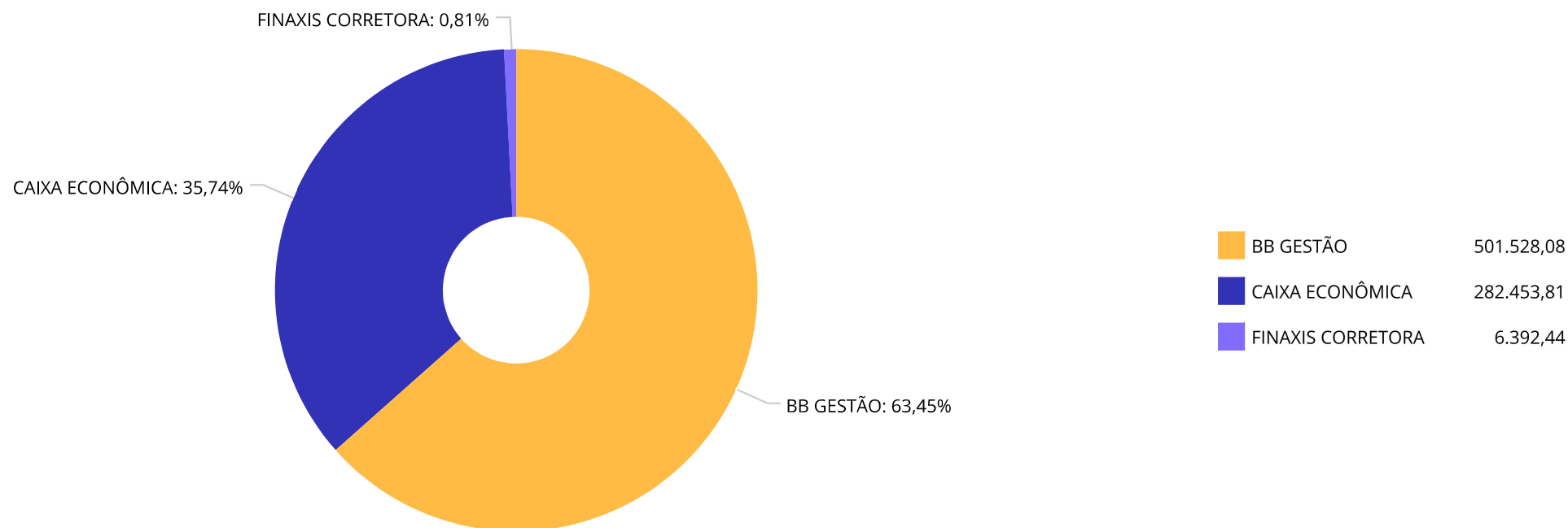
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,19%	2,38%	4,70%	9,96%	23,52%	0,01%	0,05%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,58%	5,49%	1,82%	3,60%	7,60%	-	0,00%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,40%	-1,96%	-1,28%	-0,55%	-7,51%	-6,60%	-	-

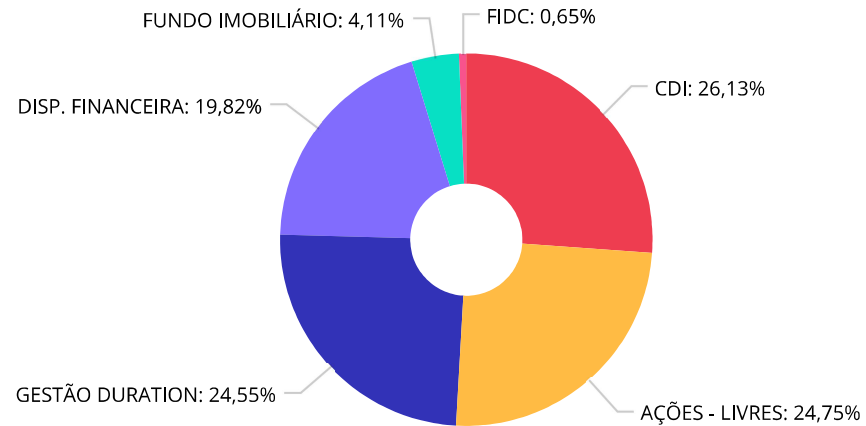
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-3,08%	-1,77%	6,38%	2,90%	13,08%	19,79%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-2,49%	-4,99%	4,82%	0,49%	7,22%	12,41%	5,33%	12,35%
IFIX (Benchmark)	-2,58%	-0,16%	-1,24%	-3,00%	2,69%	10,54%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,67%	1,12%	-1,22%	0,95%	-0,69%	15,83%	18,07%	41,16%

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



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

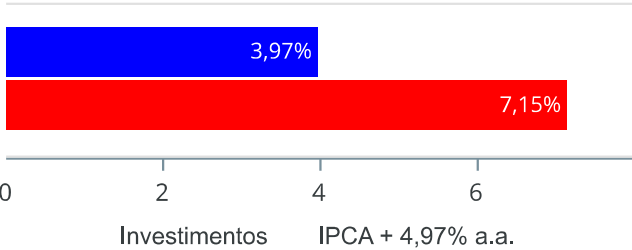


CDI	257.559,47	AÇÕES - LIVRES	243.968,61	GESTÃO DURATION	241.953,81	DISP. FINANCEIRA	195.377,84
FUNDO IMOBILIÁRIO	40.500,00	FIDC	6.392,44				

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	1.520.935,66	369.440,45	152.468,14	1.735.825,04	-2.082,93	-2.082,93	-0,12%	-0,12%	0,85%	0,85%	-14,16%	1,25%
Fevereiro	1.735.825,04	374.591,36	1.080.942,15	1.044.482,92	15.008,67	12.925,74	0,86%	0,74%	1,20%	2,06%	36,18%	3,83%
Março	1.044.482,92	377.247,44	446.234,12	968.614,67	-6.881,57	6.044,17	-0,66%	0,08%	0,55%	2,61%	3,06%	3,12%
Abril	968.614,67	382.352,18	373.894,75	976.135,23	-936,87	5.107,30	-0,10%	-0,02%	0,81%	3,44%	-0,46%	1,97%
Maiο	976.135,23	384.618,35	68.397,65	1.293.592,94	1.237,01	6.344,31	0,10%	0,08%	0,87%	4,34%	1,84%	1,05%
Junho	1.293.592,94	388.042,21	318.404,75	1.374.613,91	11.383,51	17.727,82	0,84%	0,92%	0,60%	4,96%	18,46%	1,38%
Julho	1.374.613,91	742.392,83	1.620.877,33	506.758,37	10.628,96	28.356,78	0,50%	1,42%	0,83%	5,83%	24,41%	3,39%
Agosto	506.758,37	580.813,87	383.422,10	722.062,61	17.912,47	46.269,25	2,54%	4,00%	0,40%	6,25%	64,00%	2,66%
Setembro	722.062,61	1.386.731,95	1.317.827,67	790.374,33	-592,56	45.676,69	-0,03%	3,97%	0,85%	7,15%	55,54%	2,60%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

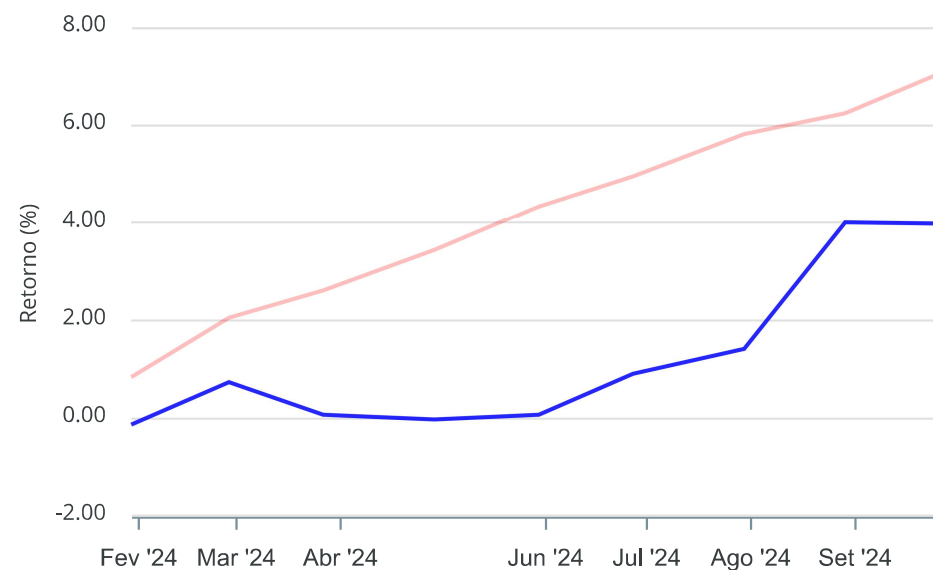
Evolução do Patrimônio



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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	255.635,44	0,00	0,00	257.559,47	1.924,03	0,75%	0,75%	0,01%
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	169.977,08	1.386.731,95	1.317.532,67	241.953,81	2.777,45	0,18%	0,58%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	6.417,93	0,00	0,00	6.392,44	-25,49	-0,40%	-	-
Total Renda Fixa	432.030,45	1.386.731,95	1.317.532,67	505.905,72	4.675,99	0,93%		0,01%

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	39.835,00	0,00	295,00	40.500,00	960,00	2,41%	2,43%	18,07%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	250.197,16	0,00	0,00	243.968,61	-6.228,55	-2,49%	-2,49%	5,33%
Total Renda Variável	290.032,16	0,00	295,00	284.468,61	-5.268,55	-1,82%		7,14%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	971.952,14	788.383,88	1.514.733,76	257.559,47	11.957,21	0,68%	2,38%
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.571.554,77	1.332.626,66	241.953,81	3.025,70	0,19%	1,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	51.978,32	175.000,00	227.694,55	0,00	716,23	0,32%	1,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	32.599,12	0,00	33.022,33	0,00	423,21	1,30%	1,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	37.850,56	175.000,00	213.164,80	0,00	314,24	0,15%	1,89%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	6.475,53	0,00	0,00	6.392,44	-83,09	-1,28%	-1,28%
Total Renda Fixa	1.100.855,67	2.709.938,65	3.321.242,10	505.905,72	16.353,50	0,43%	

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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	232.758,24	0,00	0,00	243.968,61	11.210,37	4,82%	4,82%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	41.000,00	0,00	885,00	40.500,00	385,00	0,94%	-1,22%
Total Renda Variável	273.758,24	0,00	885,00	284.468,61	11.595,37	4,24%	

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.

