

# Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2024

**Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			969.542,25	3,10%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.054.934,83	3,37%	668	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	370.449,99	1,18%	837	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	351.721,78	1,12%	776	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	528.763,24	1,69%	267	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	940.740,24	3,01%	605	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	368.112,61	1,18%	91	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	523.531,28	1,67%	1.131	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	821.642,06	2,63%	609	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA F...	D+0	15/05/2025	958.701,29	3,06%	193	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	4.043.105,62	12,92%	332	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	860.059,48	2,75%	222	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITAD...	D+0	17/05/2027	650.213,80	2,08%	77	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2028	408.627,11	1,31%	126	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2030	534.810,49	1,71%	123	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	2.009.473,66	6,42%	1.537	1,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	408.371,07	1,30%	105	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.756.381,03	5,61%	41.647	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	45.300,71	0,14%	1.040	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	401.147,93	1,28%	227	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

**Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)**

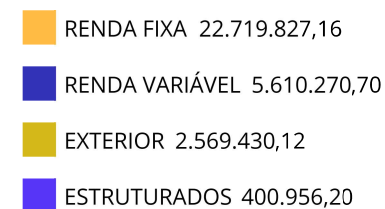
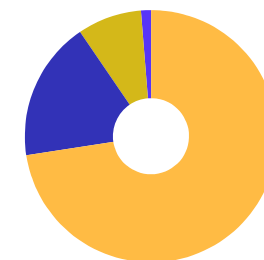
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	203.718,54	0,65%	1.191	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	179.192,36	0,57%	202	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	534.084,43	1,71%	97	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	450.349,60	1,44%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	1.306.293,14	4,17%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB ESPELHO JGP INSTITUCIONAL EQUILÍBRIO 30 IS RE...	D+31	Não há	167.114,00	0,53%	300	0,08%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB INFLAÇÃO FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	998.474,72	3,19%	39	0,40%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	874.969,90	2,80%	57.385	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	297.035,29	0,95%	20.875	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	795.728,01	2,54%	1.144	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	650.037,76	2,08%	5.710	0,44%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	825.289,28	2,64%	16.060	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	233.080,92	0,74%	8.140	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	688.534,10	2,20%	352	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	343.094,21	1,10%	342	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	829.562,22	2,65%	176	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	130.214,78	0,42%	6.983	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	418.823,96	1,34%	3.626	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	398.870,17	1,27%	60	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.424.359,17	4,55%	138	0,09%	Artigo 9º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	565.635,01	1,81%	21.442	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	579.435,94	1,85%	1.568	0,47%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	400.956,20	1,28%	597	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>31.300.484,18</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>28.552,33</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>31.329.036,51</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	969.542,25	3,10%	0,00%	22,95%	81,95%	24.681.204,54
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	14.833.258,55	47,39%	20,48%	27,30%	81,95%	10.817.488,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	3.119.825,00	9,97%	5,00%	12,30%	60,00%	15.660.465,51
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	1.756.642,74	5,61%	0,00%	0,00%	20,00%	4.503.454,10
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	2.040.558,62	6,52%	0,00%	5,00%	5,00%	-475.534,41
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>22.719.827,16</b>	<b>72,59%</b>	<b>25,48%</b>	<b>67,55%</b>	<b>248,90%</b>	

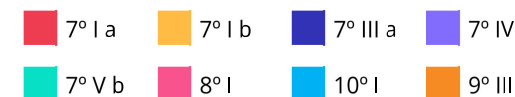
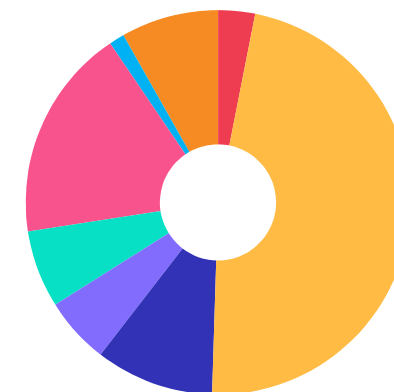


**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2024)**

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.610.270,70	17,92%	12,75%	18,25%	20,00%	649.826,14
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	400.956,20	1,28%	0,00%	8,20%	10,00%	2.729.092,22
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>6.011.226,90</b>	<b>19,20%</b>	<b>12,75%</b>	<b>26,45%</b>	<b>30,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.569.430,12	8,21%	0,00%	5,00%	10,00%	560.618,30
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>2.569.430,12</b>	<b>8,21%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.565.024,21



**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	969.542,25	3,10	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	14.833.258,55	47,39	20,48	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	3.119.825,00	9,97	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	1.756.642,74	5,61	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	2.040.558,62	6,52	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	5.610.270,70	17,92	12,75	20,00
Artigo 9º, Inciso III	2.569.430,12	8,21	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	400.956,20	1,28	0,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

**Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2024)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	20.778.716,19	66,38	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	3.572.977,66	11,42	0,02
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.061.817,00	9,78	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.306.293,14	4,17	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	969.542,25	3,10	-
BANCO DAYCOVAL	450.349,60	1,44	0,00
GENIAL INVESTIMENTOS	418.823,96	1,34	-
MOS CAPITAL	398.870,17	1,27	0,24
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	343.094,21	1,10	-

**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
<b>IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,41%	6,27%	1,80%	4,09%	9,45%	20,22%	-	-
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%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	3,59%	1,56%	2,43%	6,49%	19,56%	1,62%	2,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	2,34%	1,46%	1,61%	5,43%	-	1,93%	3,35%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,60%	4,60%	1,53%	3,33%	7,94%	20,67%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	4,56%	1,66%	3,36%	7,81%	20,28%	1,25%	1,83%
<b>IMA Geral (Benchmark)</b>	0,79%	4,63%	2,21%	3,49%	8,81%	23,74%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	4,48%	2,14%	3,36%	8,59%	23,59%	0,98%	1,78%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,77%	-1,21%	1,69%	-0,25%	3,11%	18,58%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	-1,44%	1,60%	-0,42%	2,80%	17,77%	3,79%	6,46%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,77%	6,30%	2,36%	4,62%	10,39%	25,57%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	6,13%	2,27%	4,45%	10,09%	24,84%	0,30%	0,40%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,59%	4,88%	1,91%	3,56%	8,14%	21,08%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,55%	3,78%	1,73%	2,59%	6,73%	19,14%	1,15%	1,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,58%	4,75%	1,86%	3,47%	7,94%	20,64%	1,08%	1,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	4,66%	1,80%	3,38%	7,84%	20,50%	1,11%	1,79%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,52%	1,49%	1,63%	1,40%	5,32%	19,81%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	1,18%	1,48%	1,15%	4,90%	19,04%	2,45%	4,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	1,29%	1,54%	1,24%	5,04%	19,17%	2,43%	4,10%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,66%	3,54%	1,70%	2,39%	8,26%	24,46%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	3,37%	1,66%	2,25%	8,00%	23,62%	1,62%	2,68%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,78%	6,89%	2,60%	5,39%	10,64%	24,97%	0,44%	0,70%
BB ESPELHO JGP INSTITUCIONAL EQUILÍBRIO 30 IS RESP LIMITADA FIF C...	1,04%	-	3,32%	-	-	-	0,17%	-
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,02%	7,57%	1,31%	4,74%	8,79%	21,93%	2,49%	3,31%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	5,91%	2,38%	4,21%	9,96%	25,37%	0,41%	0,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	7,21%	2,68%	5,34%	11,32%	26,39%	0,01%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,79%	6,39%	2,33%	4,70%	10,11%	23,82%	0,01%	0,05%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,95%	8,23%	2,88%	5,86%	13,14%	27,40%	0,04%	0,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,97%	7,75%	2,91%	6,07%	11,36%	26,48%	0,52%	0,67%

**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
<b>IPCA (Benchmark)</b>	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	1,60%	1,71%	1,34%	4,57%	18,93%	2,23%	4,21%
BB INFLAÇÃO FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	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
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,95%	8,23%	2,88%	5,86%	13,14%	27,40%	0,04%	0,16%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	6,54%	1,36%	11,39%	5,41%	17,51%	24,18%	-	-
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	6,42%	0,65%	9,33%	3,50%	15,75%	24,86%	6,39%	14,41%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,92%	-1,32%	10,27%	0,71%	12,85%	23,24%	6,26%	12,69%
QLZ MOS FI AÇÕES	5,99%	0,86%	11,42%	2,76%	9,93%	-	7,57%	18,49%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6,42%	0,28%	11,70%	4,64%	14,89%	16,94%	5,66%	12,97%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4,68%	-4,65%	9,30%	1,40%	9,11%	10,30%	5,93%	12,93%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,07%	-0,26%	9,16%	3,91%	14,36%	12,53%	5,46%	13,12%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5,70%	-3,03%	10,22%	1,58%	10,80%	14,74%	5,81%	14,43%

<b>IDIV (Benchmark)</b>	6,69%	5,00%	10,87%	7,85%	21,94%	34,91%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,45%	2,60%	9,17%	5,56%	17,52%	28,41%	5,04%	12,42%

<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	2,28%	18,42%	7,03%	10,83%	25,31%	42,82%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	2,49%	21,30%	8,02%	12,90%	30,96%	61,90%	9,24%	12,28%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1,74%	19,99%	7,29%	12,12%	28,27%	52,77%	9,37%	12,31%

<b>SMLL (Benchmark)</b>	4,51%	-9,69%	5,65%	-3,81%	-2,18%	-4,07%	-	-
-------------------------	-------	--------	-------	--------	--------	--------	---	---

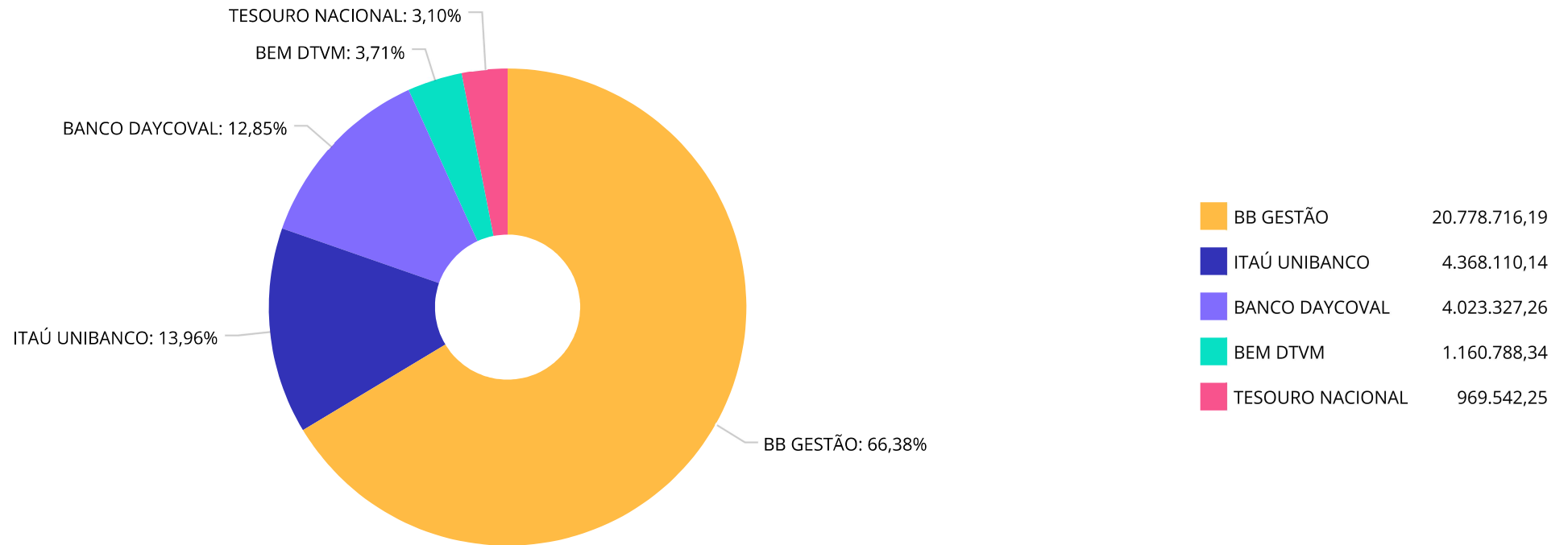
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	4,74%	-7,55%	5,93%	-2,52%	0,23%	-1,96%	8,86%	18,50%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	3,17%	-13,48%	4,07%	-7,97%	-8,13%	-9,16%	13,38%	22,95%

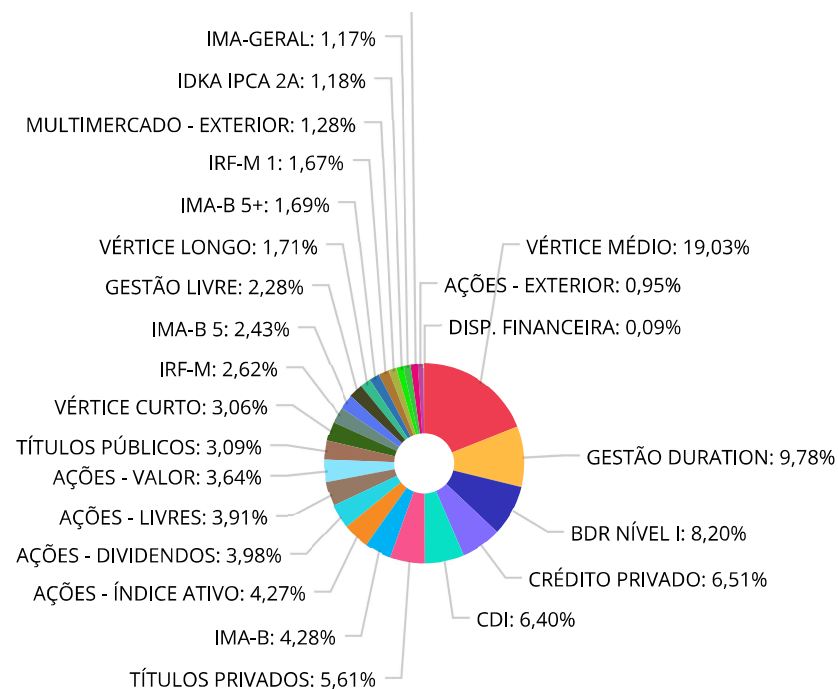
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,63%	33,87%	12,24%	23,06%	40,34%	46,68%	8,53%	12,444%
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,80%	26,47%	6,26%	12,15%	37,48%	61,60%	11,09%	16,618%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1,39%	31,34%	10,76%	17,87%	36,69%	53,29%	9,80%	15,184%

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



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



■ VÉRTICE MÉDIO	5.962.006,01	■ GESTÃO DURATION	3.064.408,49	■ BDR NÍVEL I	2.569.430,12	■ CRÉDITO PRIVADO	2.040.558,62
■ CDI	2.005.400,28	■ TÍTULOS PRIVADOS	1.756.642,74	■ IMA-B	1.341.888,17	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.338.571,86
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.248.386,18	■ AÇÕES - LIVRES	1.224.159,45	■ AÇÕES - VALOR	1.138.822,22	■ TÍTULOS PÚBLICOS	969.542,25
■ VÉRTICE CURTO	958.701,29	■ IRF-M	821.642,06	■ IMA-B 5	760.092,85	■ GESTÃO LIVRE	713.276,79
■ VÉRTICE LONGO	534.810,49	■ IMA-B 5+	528.763,24	■ IRF-M 1	523.531,28	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	400.956,20
■ IDKA IPCA 2A	370.449,99	■ IMA-GERAL	368.112,61	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	363.295,70	■ AÇÕES - EXTERIOR	297.035,29
■ DISP. FINANCEIRA	28.552,33						



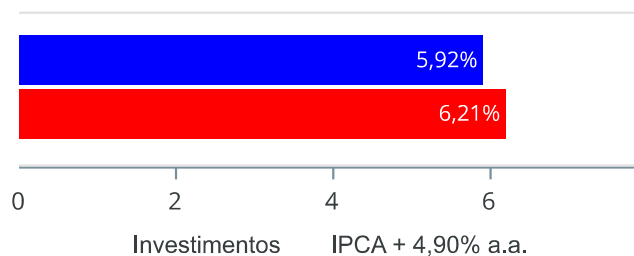
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2033	14/07/2023	115	4.342,32518690	4.331,203250	499.367,40	498.088,37	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	14/07/2023	110	4.389,37139706	4.285,944355	482.830,85	471.453,88	Mercado

**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024**

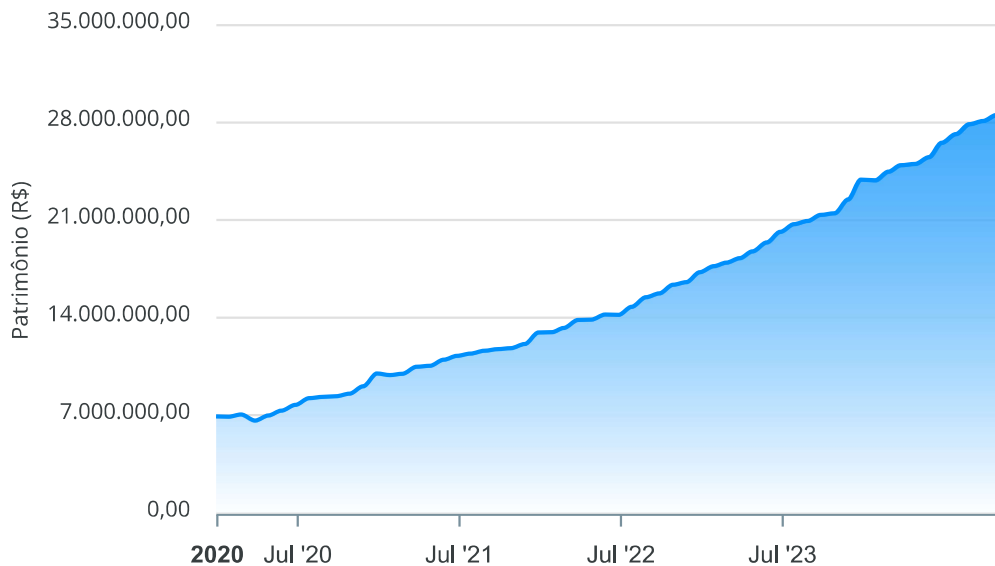
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	26.866.290,46	120.383,91	202.251,39	26.789.839,64	5.416,66	5.416,66	0,02%	0,02%	0,84%	0,84%	2,40%	2,11%
Fevereiro	26.789.839,64	676.141,60	297.543,34	27.476.083,97	307.646,07	313.062,73	1,13%	1,15%	1,19%	2,04%	56,38%	2,41%
Março	27.476.083,97	560.539,86	208.818,52	28.020.986,35	193.181,04	506.243,77	0,69%	1,85%	0,54%	2,60%	71,44%	1,99%
Abril	28.020.986,35	990.410,98	669.245,56	28.118.663,44	-223.488,33	282.755,44	-0,79%	1,05%	0,80%	3,42%	30,78%	2,64%
Mai	28.118.663,44	3.650.486,52	3.328.323,65	28.647.488,93	206.662,62	489.418,06	0,73%	1,79%	0,86%	4,31%	41,46%	2,15%
Junho	28.647.488,93	1.186.744,87	359.480,69	29.810.457,74	335.704,63	825.122,69	1,14%	2,95%	0,59%	4,92%	59,81%	2,51%
Julho	29.810.457,74	508.562,73	216.124,69	30.517.031,32	414.135,54	1.239.258,23	1,38%	4,36%	0,82%	5,78%	75,40%	2,73%
Agosto	30.517.031,32	6.692.147,29	6.370.341,90	31.300.484,18	461.647,47	1.700.905,70	1,50%	5,92%	0,40%	6,21%	95,46%	3,28%

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**



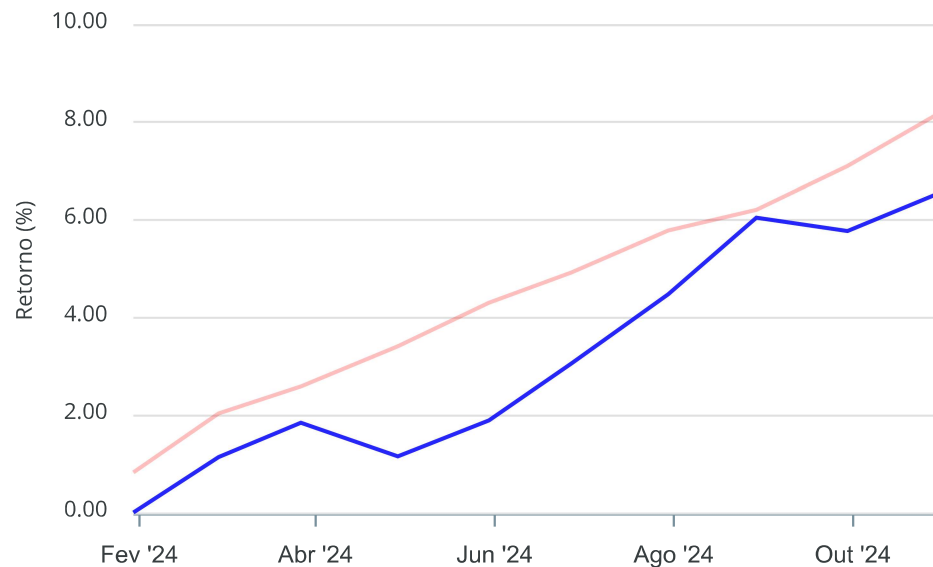
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	528.957,95	0,00	0,00	534.084,43	5.126,48	0,97%	0,97%	0,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.045.040,19	0,00	0,00	1.054.934,83	9.894,64	0,95%	0,95%	0,41%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	866.775,00	0,00	0,00	874.969,90	8.194,90	0,95%	0,95%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	43.883,41	393.210,63	236.899,59	203.718,54	3.524,09	0,81%	0,89%	0,01%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	1.295.973,12	0,00	0,00	1.306.293,14	10.320,02	0,80%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	975.832,51	0,00	14.033,70	969.542,25	7.743,44	0,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	177.801,51	0,00	0,00	179.192,36	1.390,85	0,78%	0,78%	0,44%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	365.260,98	0,00	0,00	368.112,61	2.851,63	0,78%	0,78%	0,98%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	446.915,12	0,00	0,00	450.349,60	3.434,48	0,77%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	546.821,25	0,00	15.908,26	534.810,49	3.897,50	0,71%	0,68%	2,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	417.787,00	0,00	12.083,92	408.627,11	2.924,03	0,70%	0,68%	1,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	854.298,99	0,00	0,00	860.059,48	5.760,49	0,67%	0,67%	1,62%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	816.321,38	0,00	0,00	821.642,06	5.320,68	0,65%	0,65%	1,62%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	508.696,20	16.692,44	0,00	528.763,24	3.374,60	0,64%	0,75%	3,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	368.110,95	0,00	0,00	370.449,99	2.339,04	0,64%	0,64%	1,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	406.021,41	0,00	0,00	408.371,07	2.349,66	0,58%	0,58%	1,08%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	716.387,93	103.500,00	301.000,00	523.531,28	4.643,35	0,57%	0,74%	0,30%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.998.558,96	0,00	0,00	2.009.473,66	10.914,70	0,55%	0,55%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.739.728,77	0,00	1.749.160,09	0,00	9.431,32	0,54%	0,93%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.913.366,19	0,00	1.923.647,43	0,00	10.281,24	0,54%	0,92%	0,08%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	349.905,99	0,00	0,00	351.721,78	1.815,79	0,52%	0,52%	1,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	936.408,52	0,00	0,00	940.740,24	4.331,72	0,46%	0,46%	2,43%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	399.428,70	0,00	0,00	401.147,93	1.719,23	0,43%	0,43%	2,45%
BB ESPELHO JGP INSTITUCIONAL EQUILÍBRIO 30 IS RESP...	0,00	166.421,22	0,00	167.114,00	692,78	0,42%	1,04%	0,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	0,00	955.000,00	0,00	958.701,29	3.701,29	0,39%	0,84%	0,49%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	79.850,26	78.155,60	113.308,99	45.300,71	603,84	0,38%	0,79%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	727.288,21	3.328.705,77	21.172,54	4.043.105,62	8.284,18	0,20%	0,61%	1,28%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.755.988,65	0,00	0,00	1.756.381,03	392,38	0,02%	0,02%	2,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA ...	0,00	650.461,63	0,00	650.213,80	-247,83	-0,04%	-	-
BB INFLAÇÃO FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	0,00	1.000.000,00	0,00	998.474,72	-1.525,28	-0,15%	1,08%	1,77%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>20.281.409,15</b>	<b>6.692.147,29</b>	<b>4.387.214,52</b>	<b>22.719.827,16</b>	<b>133.485,24</b>	<b>0,59%</b>		<b>1,38%</b>

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
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	779.308,86	0,00	0,00	829.562,22	50.253,36	6,45%	6,45%	5,04%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	322.390,80	0,00	0,00	343.094,21	20.703,41	6,42%	6,42%	6,39%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	647.015,38	0,00	0,00	688.534,10	41.518,72	6,42%	6,42%	5,66%
QLZ MOS FI AÇÕES	376.320,98	0,00	0,00	398.870,17	22.549,19	5,99%	5,99%	7,57%
BB IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	614.983,90	0,00	0,00	650.037,76	35.053,86	5,70%	5,70%	5,81%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	757.366,14	0,00	0,00	795.728,01	38.361,87	5,07%	5,07%	5,46%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	399.176,07	0,00	0,00	418.823,96	19.647,89	4,92%	4,92%	6,26%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	124.327,15	0,00	0,00	130.214,78	5.887,63	4,74%	4,74%	8,86%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	788.401,65	0,00	0,00	825.289,28	36.887,63	4,68%	4,68%	5,93%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	225.914,21	0,00	0,00	233.080,92	7.166,71	3,17%	3,17%	13,38%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	391.234,10	0,00	0,00	400.956,20	9.722,10	2,48%	2,48%	9,24%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	291.952,39	0,00	0,00	297.035,29	5.082,90	1,74%	1,74%	9,37%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	593.835,73	0,00	599.064,80	0,00	5.229,07	0,88%	1,36%	0,55%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	165.411,42	0,00	166.748,82	0,00	1.337,40	0,81%	1,07%	0,62%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.208.994,68	0,00	1.217.313,76	0,00	8.319,08	0,69%	0,88%	1,14%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.686.633,46</b>	<b>0,00</b>	<b>1.983.127,38</b>	<b>6.011.226,90</b>	<b>307.720,82</b>	<b>4,00%</b>		<b>6,60%</b>

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.404.768,56	0,00	0,00	1.424.359,17	19.590,61	1,39%	1,39%	9,80%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	561.125,27	0,00	0,00	565.635,01	4.509,74	0,80%	0,80%	11,09%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	583.094,88	0,00	0,00	579.435,94	-3.658,94	-0,63%	-0,63%	8,53%
<b>Total Exterior</b>	<b>2.548.988,71</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.569.430,12</b>	<b>20.441,41</b>	<b>0,80%</b>		<b>9,80%</b>

## 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.





