

# Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2024)

| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência      | Saldo          | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                   |
|-----------------------------------------------------|---------|---------------|----------------|--------------------|----------|------------------|---------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                    |         |               | 182.797.623,19 | 35,57%             |          | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea a   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1     | Não há        | 11.740.344,87  | 2,28%              | 740      | 0,26%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1     | Não há        | 6.302.635,23   | 1,23%              | 553      | 0,16%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P... | D+0     | 15/05/2035    | 20.011.518,60  | 3,89%              | 68       | 2,78%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA      | D+0     | Não há        | 562.651,66     | 0,11%              | 666      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA... | D+1     | Não há        | 3.238.568,81   | 0,63%              | 181      | 0,19%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP           | D+1     | Não há        | 5.345.514,42   | 1,04%              | 76       | 1,25%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA      | D+1     | Não há        | 5.377.731,22   | 1,05%              | 32       | 0,91%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO      | D+0     | Não há        | 505.989,17     | 0,10%              | 1.045    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0     | Não há        | 31.658.186,37  | 6,16%              | 1.249    | 0,16%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA          | D+1     | Não há        | 3.594.576,24   | 0,70%              | 74       | 1,01%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| BRDESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA RE...  | D+0     | Não há        | 12.536.455,45  | 2,44%              | 606      | 0,08%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                | D+1     | Não há        | 1.022.406,95   | 0,20%              | 106      | 0,17%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI    | D+0     | Não há        | 8.750.062,62   | 1,70%              | 454      | 0,12%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP                | D+4 du  | Não há        | 6.016.165,87   | 1,17%              | 118      | 0,80%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER                       | S/Info  | Não se aplica | 97.420.149,39  | 18,96%             |          | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso IV            |
| LETRA FINANCEIRA BTG                                | S/Info  | Não se aplica | 5.689.252,27   | 1,11%              |          | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso IV            |
| 4UM FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP                | D+20 du | Não há        | 5.268.772,08   | 1,03%              | 142      | 2,13%            | Artigo 7º, Inciso V, Alínea b   |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                     | D+4     | Não há        | 5.226.739,08   | 1,02%              | 2.216    | 0,68%            | Artigo 8º, Inciso I             |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES                          | D+3     | Não há        | 4.884.613,74   | 0,95%              | 3.442    | 1,08%            | Artigo 8º, Inciso I             |

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2024)

| Produto / Fundo                                     | Resgate    | Carência | Saldo          | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento         |
|-----------------------------------------------------|------------|----------|----------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIF                       | D+32       | Não há   | 5.576.786,63   | 1,09%              | 47       | 0,27%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I              | D+5        | Não há   | 4.450.905,79   | 0,87%              | 11.591   | 0,42%            | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I            | D+4        | Não há   | 4.887.117,87   | 0,95%              | 445      | 0,16%            | Artigo 9º, Inciso III |
| DAYCOVAL BOLSA AMERICANA USD BDR FIF AÇÕES          | D+4        | Não há   | 5.834.613,54   | 1,14%              | 1.112    | 11,39%           | Artigo 9º, Inciso III |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                          | D+3        | Não há   | 3.204.269,21   | 0,62%              | 1.521    | 2,31%            | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP            | D+0        | Não há   | 664.482,73     | 0,13%              | 1.922    | 0,08%            | Artigo 10º, Inciso I  |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                      | D+4        | Não há   | 322.128,13     | 0,06%              | 4.142    | 0,08%            | Artigo 10º, Inciso I  |
| DAO MULTIFACTOR LONG BIASED FIC MULTIMERCADO        | D+32       | Não há   | 9.707.852,40   | 1,89%              | 1.364    | 10,82%           | Artigo 10º, Inciso I  |
| ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC... | D+32       | Não há   | 4.534.871,87   | 0,88%              | 533      | 1,04%            | Artigo 10º, Inciso I  |
| NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                | D+1        | Não há   | 15.048.567,04  | 2,93%              | 9.008    | 7,90%            | Artigo 10º, Inciso I  |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO                 | D+2        | Não há   | 21.716.195,99  | 4,23%              | 121      | 2,04%            | Artigo 10º, Inciso I  |
| NEST EAGLE RESP LIMITADA FII - EAGL11               | Não se ... | Não há   | 20.000.000,00  | 3,89%              |          | 0,00%            | Artigo 11º            |
| Total para cálculo dos limites da Resolução         |            |          | 513.897.748,43 |                    |          |                  |                       |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                        |            |          | 1.394.807,64   | Artigo 6º          |          |                  |                       |
| PL Total                                            |            |          | 515.292.556,07 |                    |          |                  |                       |

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Novembro / 2024)

| Artigos - Renda Fixa            | Resolução | Carteira \$    | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 |        |         | GAP Superior   |
|---------------------------------|-----------|----------------|----------|-------------------------------|--------|---------|----------------|
|                                 |           |                |          | Inf                           | Alvo   | Sup     |                |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea a   | 100,00%   | 182.797.623,19 | 35,57%   | 20,00%                        | 40,50% | 80,00%  | 228.320.575,55 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   | 100,00%   | 52.578.964,81  | 10,23%   | 3,00%                         | 4,78%  | 60,00%  | 255.759.684,25 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea a | 60,00%    | 64.083.842,67  | 12,47%   | 2,00%                         | 10,56% | 60,00%  | 244.254.806,39 |
| Artigo 7º, Inciso IV            | 20,00%    | 103.109.401,66 | 20,06%   | 15,00%                        | 19,91% | 20,00%  | -329.851,97    |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea b   | 5,00%     | 5.268.772,08   | 1,03%    | 0,00%                         | 1,00%  | 5,00%   | 20.426.115,34  |
| Total Renda Fixa                | 100,00%   | 407.838.604,41 | 79,36%   | 40,00%                        | 76,75% | 225,00% |                |

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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$   | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 |        |        | GAP Superior   |
|------------------------------------------------------|-----------|---------------|----------|-------------------------------|--------|--------|----------------|
|                                                      |           |               |          | Inf                           | Alvo   | Sup    |                |
| Artigo 8º, Inciso I                                  | 30,00%    | 15.688.139,45 | 3,05%    | 0,00%                         | 5,25%  | 30,00% | 138.481.185,08 |
| Artigo 8º, Inciso II                                 | 30,00%    | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 10,00% | 51.389.774,84  |
| Artigo 10º, Inciso I                                 | 10,00%    | 51.994.098,16 | 10,12%   | 0,00%                         | 9,00%  | 10,00% | -604.323,32    |
| Artigo 10º, Inciso II                                | 5,00%     | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 2,00%  | 5,00%  | 25.694.887,42  |
| Artigo 11º                                           | 5,00%     | 20.000.000,00 | 3,89%    | 0,00%                         | 1,00%  | 5,00%  | 5.694.887,42   |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário     | 30,00%    | 87.682.237,61 | 17,06%   | 0,00%                         | 17,25% | 60,00% |                |

| Artigos - Exterior    | Resolução | 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%   | 51.389.774,84 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00%    | 18.376.906,41 | 3,58%    | 0,00%                                  | 6,00% | 10,00%   | 33.012.868,43 |
| Total Exterior        | 10,00%    | 18.376.906,41 | 3,58%    | 0,00%                                  | 6,00% | 20,00%   |               |

| Empréstimo Consignado | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2024 |       |          | GAP Superior  |
|-----------------------|-----------|-------------|----------|----------------------------------------|-------|----------|---------------|
|                       |           |             |          | Inferior                               | Alvo  | Superior |               |
| Artigo 12º            | 5,00%     | 0,00        | 0,00%    | 0,00%                                  | 0,00% | 5,00%    | 25.694.887,42 |

**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   | 182.797.623,19                | 35,57      | 20,00               | 80,00               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   | 52.578.964,81                 | 10,23      | 3,00                | 60,00               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea a | 64.083.842,67                 | 12,47      | 2,00                | 60,00               |
| Artigo 7º, Inciso IV            | 103.109.401,66                | 20,06      | 15,00               | 20,00               |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea b   | 5.268.772,08                  | 1,03       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I             | 15.688.139,45                 | 3,05       | 0,00                | 30,00               |
| Artigo 8º, Inciso II            | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 9º, Inciso II            | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 9º, Inciso III           | 18.376.906,41                 | 3,58       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 10º, Inciso I            | 51.994.098,16                 | 10,12      | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 10º, Inciso II           | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 11º                      | 20.000.000,00                 | 3,89       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 12º                      | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |

Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2024)

| Gestão                            | Valor          | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL... | 182.797.623,19 | 35,57         | -              |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM        | 79.896.319,11  | 15,55         | -              |
| SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ... | 21.716.195,99  | 4,23          | -              |
| NOVUS CAPITAL                     | 21.064.732,91  | 4,10          | 0,52           |
| NEST ASSET MANAGEMENT             | 20.000.000,00  | 3,89          | -              |
| BANCO BRADESCO                    | 16.131.031,69  | 3,14          | 0,00           |
| ITAU ASSET MANAGEMENT             | 15.192.900,64  | 2,96          | 0,00           |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 10.723.245,64  | 2,09          | 0,00           |
| DAO CAPITAL                       | 9.707.852,40   | 1,89          | -              |
| CAIXA DTVM                        | 7.458.787,34   | 1,45          | 0,04           |
| DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT         | 5.834.613,54   | 1,14          | 0,04           |
| BANCO BTG PACTUAL                 | 5.689.252,27   | 1,11          | 0,00           |
| TARPON INVESTIMENTOS              | 5.576.786,63   | 1,09          | -              |
| 4UM INVESTIMENTOS                 | 5.268.772,08   | 1,03          | 0,17           |
| GENIAL INVESTIMENTOS              | 4.884.613,74   | 0,95          | -              |
| ICATU VANGUARDA                   | 4.534.871,87   | 0,88          | 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 Novembro/2024 - RENDA FIXA**

|                                                               | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>                        | 0,83%  | 10,04% | 2,88%  | 4,99%  | 11,17% | 23,35% | -       | -                |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,35% | -2,48% | -2,51% | -0,62% | 0,64%  | -      | 3,69%   | 5,30%            |
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                    | 0,36%  | 6,46%  | 1,51%  | 3,44%  | 8,02%  | 20,49% | -       | -                |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                   | 0,34%  | 6,17%  | 1,44%  | 3,26%  | 7,71%  | 19,93% | 1,07%   | 1,66%            |
| <b>IMA-B (Benchmark)</b>                                      | 0,02%  | 0,19%  | -1,29% | 0,32%  | 2,94%  | 16,04% | -       | -                |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP                     | 0,00%  | -0,06% | -1,35% | 0,19%  | 2,66%  | 15,44% | 2,98%   | 3,86%            |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                    | 0,00%  | -0,27% | -1,39% | 0,08%  | 2,44%  | 15,20% | 2,96%   | 3,89%            |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 0,01%  | -0,07% | -1,34% | 0,17%  | 2,67%  | 15,44% | 2,97%   | 3,86%            |
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                                      | -0,52% | 3,57%  | 0,03%  | 1,73%  | 5,11%  | 22,46% | -       | -                |
| SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                | -0,54% | 3,32%  | -0,04% | 1,64%  | 4,83%  | 21,86% | 1,70%   | 2,70%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                        | 0,79%  | 9,85%  | 2,58%  | 5,23%  | 10,84% | 25,58% | -       | -                |
| NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP                          | 0,08%  | 8,04%  | 2,38%  | 5,41%  | 9,36%  | 25,43% | 0,61%   | 1,37%            |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP    | 0,81%  | 10,00% | 2,60%  | 5,35%  | 10,99% | 25,67% | 0,01%   | 0,05%            |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                | 0,72%  | 8,88%  | 2,34%  | 4,73%  | 9,78%  | 23,13% | 0,01%   | 0,04%            |
| BRDESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI  | 0,81%  | 10,56% | 2,64%  | 5,49%  | 11,60% | 27,09% | 0,01%   | 0,09%            |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI              | 0,80%  | 10,24% | 2,61%  | 5,37%  | 11,29% | 26,61% | 0,01%   | 0,06%            |

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

|                                                                      | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|----------------------------------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                              | 0,39%  | 4,29%  | 1,40%  | 1,98%  | 4,87%  | 9,78%  | -       | -                |
| LETRA FINANCEIRA BTG                                                 | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -                |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                                 | 0,28%  | 7,39%  | 1,79%  | 4,08%  | 8,44%  | 22,59% | 0,96%   | 0,96%            |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                       | 0,53%  | 6,05%  | 1,93%  | 3,78%  | 7,33%  | 21,83% | 0,52%   | 1,24%            |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ... | 0,59%  | 5,65%  | 2,05%  | 3,47%  | 7,36%  | 21,94% | 0,50%   | 1,73%            |
| LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER                                        | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -                |
| <b>IFIX (Benchmark)</b>                                              | -2,11% | -5,26% | -7,55% | -7,24% | -1,23% | 9,42%  | -       | -                |
| NEST EAGLE RESP LIMITADA FII - EAGL11                                | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -                |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>                                     | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -                |
| 4UM FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP                                 | 0,83%  | 11,15% | 2,76%  | 5,81%  | 12,25% | 28,39% | 0,03%   | 0,12%            |