

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			183.735.988,86	35,78%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.700.835,08	2,28%	749	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.301.954,06	1,23%	566	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2035	20.702.825,58	4,03%	68	2,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	559.668,77	0,11%	687	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	3.219.727,82	0,63%	188	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.345.314,85	1,04%	85	1,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.407.072,66	1,05%	35	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.468.125,59	0,29%	1.030	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	31.707.669,43	6,17%	1.235	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.594.597,41	0,70%	78	0,93%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA RE...	D+0	Não há	12.435.910,50	2,42%	584	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.019.538,27	0,20%	107	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.680.785,21	1,69%	442	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+4 du	Não há	6.011.126,65	1,17%	124	0,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	S/Info	Não se aplica	96.527.203,35	18,80%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	5.639.403,03	1,10%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
4UM FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+20 du	Não há	5.225.264,65	1,02%	139	2,15%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.325.424,75	1,04%	2.275	0,67%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	5.117.244,06	1,00%	3.511	1,16%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIF	D+32	Não há	5.749.971,38	1,12%	53	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.101.835,16	0,80%	10.985	0,43%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.514.090,02	0,88%	442	0,16%	Artigo 9º, Inciso III
DAYCOVAL BOLSA AMERICANA USD BDR FIF AÇÕES	D+4	Não há	5.393.381,53	1,05%	975	12,41%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.938.127,78	0,57%	1.534	2,31%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	659.515,71	0,13%	2.006	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	324.789,66	0,06%	4.272	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
DAO MULTIFACTOR LONG BIASED FIC MULTIMERCADO	D+32	Não há	9.809.649,38	1,91%	1.433	10,52%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	4.584.464,89	0,89%	534	1,03%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	14.963.233,39	2,91%	9.394	7,29%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	20.495.275,25	3,99%	116	2,13%	Artigo 10º, Inciso I
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDI...	D+0		20.231.929,23	3,94%	69.067	0,24%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			513.491.943,96				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	183.735.988,86	35,78%	20,00%	40,50%	80,00%	227.057.566,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	53.237.398,82	10,37%	3,00%	4,78%	60,00%	254.857.767,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	64.917.753,06	12,64%	2,00%	10,56%	60,00%	243.177.413,32
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	102.166.606,38	19,90%	15,00%	19,91%	20,00%	531.782,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	5.225.264,65	1,02%	0,00%	1,00%	5,00%	20.449.332,55
Total Renda Fixa	100,00%	409.283.011,77	79,71%	40,00%	76,75%	225,00%	

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	16.192.640,19	3,15%	0,00%	5,25%	30,00%	137.854.943,00
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	51.349.194,40
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	50.836.928,28	9,90%	0,00%	9,00%	10,00%	512.266,12
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	25.674.597,20
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	25.674.597,20
Desenquadrado - RV	0,00%	20.231.929,23	3,94%	0,00%	0,00%	0,00%	-20.231.929,23
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	87.261.497,70	16,99%	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%	51.349.194,40
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	16.947.434,49	3,30%	0,00%	6,00%	10,00%	34.401.759,91
Total Exterior	10,00%	16.947.434,49	3,30%	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%	25.674.597,20

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	183.735.988,86	35,78	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	53.237.398,82	10,37	3,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	64.917.753,06	12,64	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	102.166.606,38	19,90	15,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5.225.264,65	1,02	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	16.192.640,19	3,15	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	16.947.434,49	3,30	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	50.836.928,28	9,90	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	183.735.988,86	35,78	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	81.308.669,65	15,83	-
NOVUS CAPITAL	20.974.360,04	4,08	0,55
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	20.495.275,25	3,99	-
BANCO BRADESCO	16.030.507,91	3,12	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	14.838.640,81	2,89	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	10.752.387,51	2,09	0,00
DAO CAPITAL	9.809.649,38	1,91	-
CAIXA DTVM	7.077.602,43	1,38	0,04
TARPON INVESTIMENTOS	5.749.971,38	1,12	-
BANCO BTG PACTUAL	5.639.403,03	1,10	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.393.381,53	1,05	0,03
4UM INVESTIMENTOS	5.225.264,65	1,02	0,14
GENIAL INVESTIMENTOS	5.117.244,06	1,00	-
ICATU VANGUARDA	4.584.464,89	0,89	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 Outubro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,10%	9,13%	2,46%	5,06%	11,04%	23,38%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	-2,14%	-1,72%	1,44%	3,72%	-	2,61%	5,13%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,74%	6,08%	1,74%	4,16%	9,57%	19,66%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,72%	5,81%	1,62%	3,97%	9,26%	19,08%	0,88%	1,61%
IMA-B (Benchmark)	-0,65%	0,16%	-0,80%	1,63%	5,62%	15,10%	-	-
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,68%	-0,07%	-0,87%	1,49%	5,34%	14,49%	1,89%	3,67%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,69%	-0,27%	-0,91%	1,36%	4,98%	14,18%	1,87%	3,70%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	-0,08%	-0,90%	1,47%	5,34%	14,51%	1,88%	3,67%
IRF-M (Benchmark)	0,21%	4,12%	1,21%	2,94%	8,27%	22,29%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	3,88%	1,17%	2,84%	8,01%	21,68%	1,27%	2,61%
CDI (Benchmark)	0,93%	8,99%	2,65%	5,27%	10,98%	25,87%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,21%	7,95%	3,55%	6,56%	10,85%	25,27%	0,47%	1,42%
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,91%	9,96%	2,79%	5,64%	12,41%	27,77%	0,02%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,93%	9,12%	2,69%	5,38%	11,11%	25,94%	0,02%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85%	8,10%	2,40%	4,75%	9,90%	23,39%	0,03%	0,04%
BRDESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93%	9,68%	2,75%	5,56%	11,80%	27,41%	0,02%	0,10%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93%	9,37%	2,70%	5,43%	11,50%	26,96%	0,02%	0,07%
IPCA (Benchmark)	0,56%	3,88%	0,98%	2,05%	4,76%	9,81%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,78%	7,09%	2,29%	4,47%	9,43%	22,01%	0,72%	0,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,86%	5,49%	2,07%	3,96%				