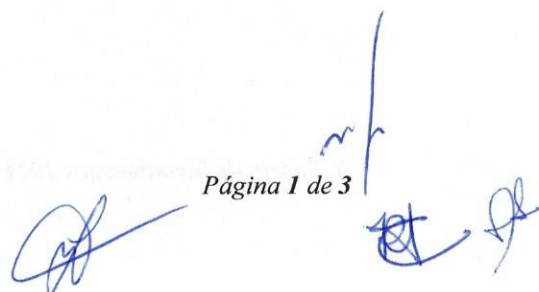


# RELATORIO DE INVESTIMENTOS

## SETEMBRO 3º. Trimestre de 2024

Handwritten signatures in blue ink, including a large signature on the left and several smaller ones on the right.

## SUMÁRIO

1. Apresentação .....	3
2. Parecer do Comitê de Investimentos .....	3
3. Aprovação do Conselho de Administração .....	3

---

## 1. APRESENTAÇÃO

---

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos Deliberativo e Fiscal para acompanhamento e homologação.

---

## 2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

---

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês SET/2024 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

---

## 3. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

---

O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de setembro de 2024, em reunião realizada em 23 de outubro de 2024.

Rosana Teixeira de Carvalho



---

Lisete de Fátima Oliveira




---

Solange Siqueira Duarte Silva



---

Mauracy Moraes de Oliveira



---



CRÉDITO  
& MERCADO

# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

  
\_\_\_\_\_  






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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			181.847.934,83	35,77%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.617.530,50	2,29%	765	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.344.525,56	1,25%	594	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2035	20.908.883,95	4,11%	68	2,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	554.907,70	0,11%	720	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	3.193.532,69	0,63%	196	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.381.650,29	1,06%	88	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.396.618,45	1,06%	38	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	268.099,06	0,05%	1.037	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	31.548.348,46	6,21%	1.211	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.619.634,82	0,71%	85	0,84%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.321.611,92	2,42%	556	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.011.691,83	0,20%	111	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.600.691,56	1,69%	429	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+4 du	Não há	5.939.360,32	1,17%	130	0,78%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	S/Info	Não se aplica	95.431.435,29	18,77%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	5.579.104,97	1,10%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
4UM FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+20 du	Não há	5.175.081,81	1,02%	139	2,19%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.397.263,96	1,06%	2.327	0,67%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.210.179,22	1,02%	3.581	1,14%	Artigo 8º, Inciso I





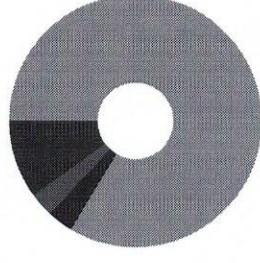
Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.720.558,66	1,13%	53	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.887.370,20	0,76%	10.650	0,44%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.261.859,11	0,84%	441	0,16%	Artigo 9º, Inciso III
DAYCOVAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	5.095.666,52	1,00%	892	13,40%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.736.817,31	0,54%	1.549	2,30%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	653.635,87	0,13%	2.075	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	325.763,77	0,06%	4.389	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
DAO MULTIFACTOR LONG BIASED FIC MULTIMERCADO	D+32	Não há	9.791.112,50	1,93%	1.498	10,51%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	4.558.572,12	0,90%	527	1,09%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	15.406.654,09	3,03%	9.851	7,11%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	20.569.824,29	4,05%	109	2,16%	Artigo 10º, Inciso I
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	D+0		20.049.136,50	3,94%	67.729	0,24%	Em Enquadramento - RF
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>508.405.058,13</b>				
<b>DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS</b>			<b>1.084.109,14</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>509.489.167,27</b>				



**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%	181.847.934,83	35,77%	20,00%	40,50%	80,00%	224.876.111,67
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	53.397.649,14	10,50%	3,00%	4,78%	60,00%	251.645.385,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	63.309.437,97	12,45%	2,00%	10,56%	60,00%	241.733.596,91
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	101.010.540,26	19,87%	15,00%	19,91%	20,00%	670.471,37
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	5.175.081,81	1,02%	0,00%	1,00%	5,00%	20.245.171,10
Em Enquadramento - RF	0,00%	20.049.136,50	3,94%	0,00%	0,00%	0,00%	-20.049.136,50
Total Renda Fixa	100,00%	424.789.780,51	83,55%	40,00%	76,75%	225,00%	



RENDA FIXA 424.789.780,51

RENDA VARIÁVEL 16.328.001,84

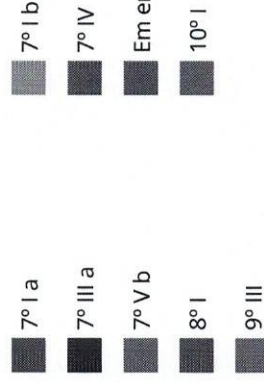
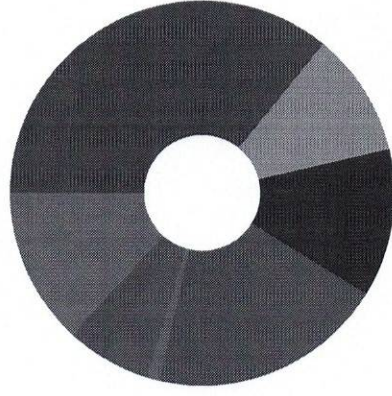
EXTERIOR 15.981.713,14

ESTRUTURADOS 51.305.562,64



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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%	16.328.001,84	3,21%	0,00%	5,25%	30,00%	136.193.515,60
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	50.840.505,81
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	51.305.562,64	10,09%	0,00%	9,00%	10,00%	-465.056,83
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	25.420.252,91
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	25.420.252,91
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	67.633.564,48	13,30%	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%	50.840.505,81
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	15.981.713,14	3,14%	0,00%	6,00%	10,00%	34.858.792,67
Total Exterior	10,00%	15.981.713,14	3,14%	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%	25.420.252,91



**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea a	181.847.934,83	35,77	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea b	53.397.649,14	10,50	3,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea a	63.309.437,97	12,45	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	101.010.540,26	19,87	15,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea b	5.175.081,81	1,02	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	16.328.001,84	3,21	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	15.981.713,14	3,14	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	51.305.562,64	10,09	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 (Setembro / 2024)**

**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)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	181.847.934,83	35,77	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	79.972.021,69	15,73	-
NOVUS CAPITAL	21.346.014,41	4,20	0,61
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	20.569.824,29	4,05	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	14.531.041,56	2,86	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	12.321.611,92	2,42	0,20
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	10.778.268,74	2,12	0,00
DAO CAPITAL	9.791.112,50	1,93	-
CAIXA DTVM	6.807.858,28	1,34	0,03
TARPON INVESTIMENTOS	5.720.558,66	1,13	-
BANCO BTG PACTUAL	5.579.104,97	1,10	0,00
GENIAL INVESTIMENTOS	5.210.179,22	1,02	-
4UM INVESTIMENTOS	5.175.081,81	1,02	0,16
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.095.666,52	1,00	0,03
ICATU VANGUARDA	4.558.572,12	0,90	0,01
BANCO BRADESCO	3.619.634,82	0,71	0,00



**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
<b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,93%	7,95%	2,28%	4,87%	10,69%	23,42%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,19%	-1,17%	2,40%	-0,18%	3,92%	-	2,45%	5,46%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,40%	5,30%	1,92%	3,18%	8,43%	21,06%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,38%	5,06%	1,80%	3,00%	8,13%	20,47%	0,96%	1,77%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,67%	0,82%	1,94%	0,64%	5,61%	17,28%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69%	0,60%	1,84%	0,49%	5,34%	16,66%	1,86%	3,95%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,69%	0,61%	1,87%	0,51%	5,34%	16,68%	1,86%	3,95%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,70%	0,42%	1,83%	0,33%	5,12%	16,35%	1,85%	4,00%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,34%	3,90%	2,36%	2,19%	8,45%	23,17%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,31%	3,68%	2,31%	2,06%	8,19%	22,54%	1,35%	2,74%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,07%	6,66%	3,19%	4,94%	10,29%	24,73%	0,65%	1,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,84%	8,11%	2,73%	5,33%	11,17%	26,08%	0,01%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,19%	2,38%	4,70%	9,96%	23,52%	0,01%	0,05%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,89%	8,67%	2,82%	5,58%	11,94%	27,59%	0,02%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86%	8,36%	2,72%	5,41%	11,64%	27,15%	0,02%	0,08%





**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
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,91%	8,97%	2,85%	5,68%	12,58%	27,99%	0,06%	0,16%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,53%	4,59%	2,18%	2,74%	7,65%	21,45%	0,56%	1,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,63%	4,18%	2,23%	2,55%	8,39%	20,05%	0,50%	2,39%
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,72%	6,27%	2,38%	4,01%	8,97%	22,23%	0,38%	0,85%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
4UM FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,93%	9,17%	3,01%	5,92%	12,66%	28,90%	0,06%	0,13%



**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
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
DAO MULTIFACTOR LONG BIASED FIC MULTIMERCADO	-2,00%	-0,07%	4,18%	0,59%	6,83%	18,99%	3,20%	8,41%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,47%	5,15%	2,44%	3,47%	8,54%	20,54%	0,48%	1,23%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,08%	0,99%	2,96%	0,93%	7,00%	17,41%	2,65%	5,19%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,79%	6,78%	2,42%	4,35%	9,70%	23,63%	0,08%	0,40%

<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	8,93%	15,69%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-3,08%	-1,77%	6,38%	2,90%	13,08%	19,79%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-0,30%	2,58%	5,78%	0,18%	14,41%	51,40%	5,79%	15,68%
PLURAL DIVIDENDOS FIAÇÕES	-4,87%	-6,13%	2,84%	-2,02%	6,45%	16,68%	5,16%	12,22%

<b>IDIV (Benchmark)</b>	-0,72%	4,25%	7,93%	8,38%	19,48%	36,40%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,88%	0,54%	6,79%	-1,44%	12,01%	25,23%	5,13%	14,60%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,40%	5,30%	1,92%	3,18%	8,43%	21,06%	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	-0,18%	5,53%	4,28%	4,24%	12,97%	35,43%	2,73%	5,53%



**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
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	-1,61%	35,42%	3,76%	19,62%	46,09%	60,22%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,09%	30,58%	0,80%	14,89%	40,17%	60,67%	7,93%	15,47%
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	2,02%	20,81%	5,53%	9,67%	34,38%	60,71%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2,32%	23,60%	6,20%	11,39%	39,62%	79,74%	6,47%	12,39%

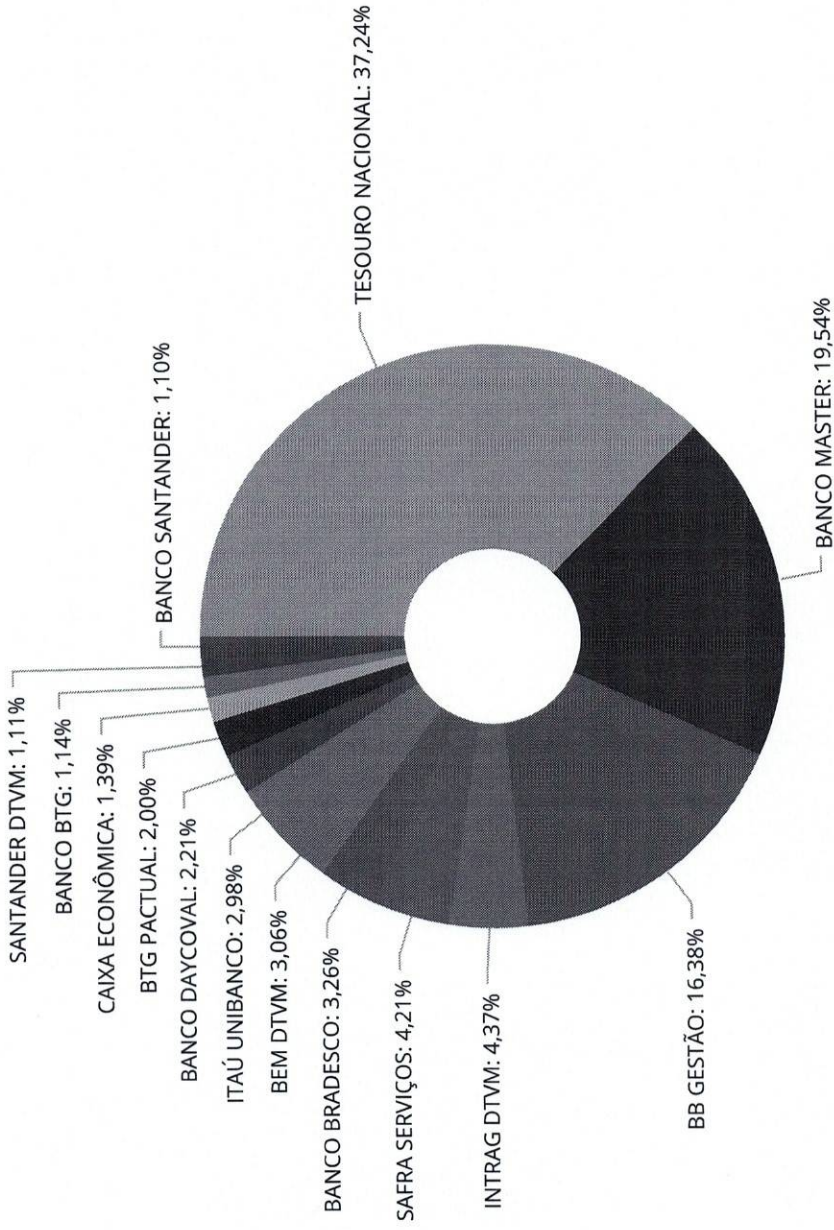


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	-1,61%	35,42%	3,76%	19,62%	46,09%	60,22%	-	-
<b>BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	0,09%	30,57%	0,80%	14,89%	40,17%	60,67%	7,93%	15,469%

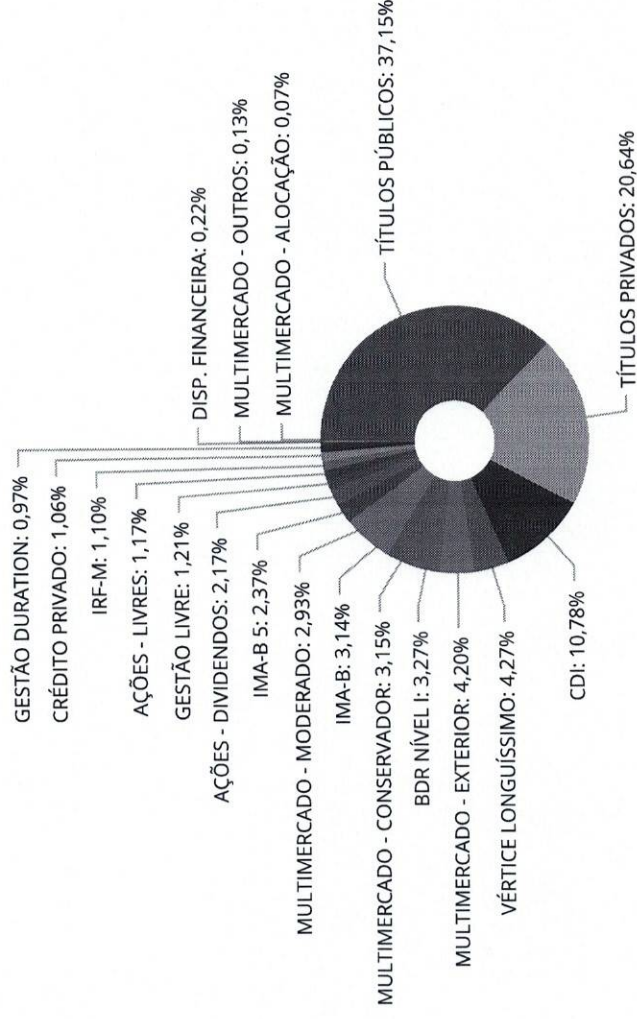
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
<b>CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	8,93%	15,691%
<b>DAYCOVAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-0,26%	38,75%	1,24%	22,08%	49,20%	76,75%	8,60%	14,560%
<b>ITAÚ FIAÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-1,95%	31,27%	0,92%	15,97%	39,00%	52,40%	6,82%	12,734%





TESOURO NACIONAL	181.847.934,83
BANCO MASTER	95.431.435,29
BB GESTÃO	79.972.021,69
INTRAG DTVM	21.346.014,41
SAFRA SERVIÇOS	20.569.824,29
BANCO BRADESCO	15.941.246,74
BEM DTVM	14.943.833,15
ITAÚ UNIBANCO	14.531.041,56
BANCO DAYCOVAL	10.816.225,18
BTG PACTUAL	9.791.112,50
CAIXA ECONÔMICA	6.807.858,28
BANCO BTG	5.579.104,97
SANTANDER DTVM	5.396.618,45
BANCO SANTANDER	5.381.650,29

2



■ TÍTULOS PÚBLICOS	181.847.934,83	■ TÍTULOS PRIVADOS	101.010.540,26	■ CDI	52.738.751,00	■ VÉRTICE LONGUISSIMO	20.908.883,95
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.569.824,29	■ BDR NÍVEL I	15.981.713,14	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	15.406.654,09	■ IMA-B	15.345.810,67
■ MULTIMERCADO - MODERADO	14.349.684,62	■ IMA-B 5	11.617.530,50	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	10.607.443,18	■ GESTÃO LIVRE	5.939.360,32
■ AÇÕES - LIVRES	5.720.558,66	■ IRF-M	5.396.618,45	■ CRÉDITO PRIVADO	5.175.081,81	■ GESTÃO DURATION	4.760.132,22
■ DISP. FINANCEIRA	1.084.109,14	■ MULTIMERCADO - OUTROS	653.635,87	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	325.763,77		





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	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.433,09156	49.999.526,70	54.243.308,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.297,929553	39.999.580,25	43.116.829,27	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	20/11/2023	1.000	4.352,820989	4.626,114044	4.352.820,99	4.626.114,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	23/11/2023	8.300	4.339,115559	4.607,217827	36.014.659,14	38.239.907,96	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	13/08/2024	6.485	4.525,085253	4.442,025104	29.345.177,87	28.806.532,79	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	15/08/2024	2.885	4.401,057453	4.442,025104	12.697.050,75	12.815.242,42	Curva

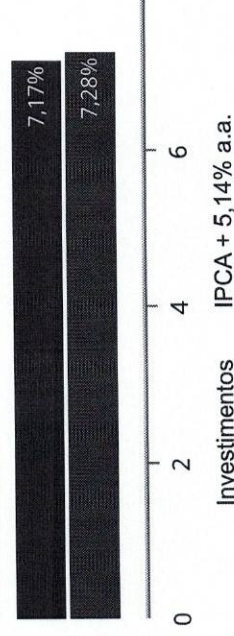




**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	467.376.655,34	3.971.877,17	6.323.338,57	468.727.859,94	3.702.666,00	3.702.666,00	0,79%	0,79%	0,86%	0,86%	92,08%	1,32%
Fevereiro	468.727.859,94	7.476.358,11	6.872.203,35	474.036.452,55	4.704.437,85	8.407.103,85	1,00%	1,80%	1,21%	2,08%	86,55%	1,17%
Março	474.036.452,55	7.709.133,81	6.728.315,32	479.556.933,65	4.539.662,61	12.946.766,46	0,96%	2,78%	0,56%	2,65%	104,60%	1,07%
Abril	479.556.933,65	40.919.744,40	42.823.013,07	479.041.124,04	1.387.459,06	14.334.225,52	0,29%	3,07%	0,82%	3,50%	87,91%	1,59%
Mai	479.041.124,04	11.045.744,85	8.755.318,18	485.930.839,81	4.599.289,10	18.933.514,62	0,96%	4,06%	0,88%	4,41%	92,08%	1,14%
Junho	485.930.839,81	27.352.358,01	26.130.163,67	490.961.655,31	3.808.621,16	22.742.135,78	0,78%	4,87%	0,61%	5,04%	96,59%	1,94%
Julho	490.961.655,31	9.053.692,37	8.865.298,93	496.168.545,87	5.018.497,12	27.760.632,90	1,02%	5,94%	0,84%	5,93%	100,29%	1,99%
Agosto	496.168.545,87	223.048.448,38	222.840.789,16	500.891.308,56	4.515.103,47	32.275.736,37	0,91%	6,91%	0,42%	6,37%	108,44%	2,85%
Setembro	500.891.308,56	76.169.743,45	77.125.192,32	501.169.142,88	1.233.283,19	33.509.019,56	0,25%	7,17%	0,86%	7,28%	98,43%	2,26%

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**

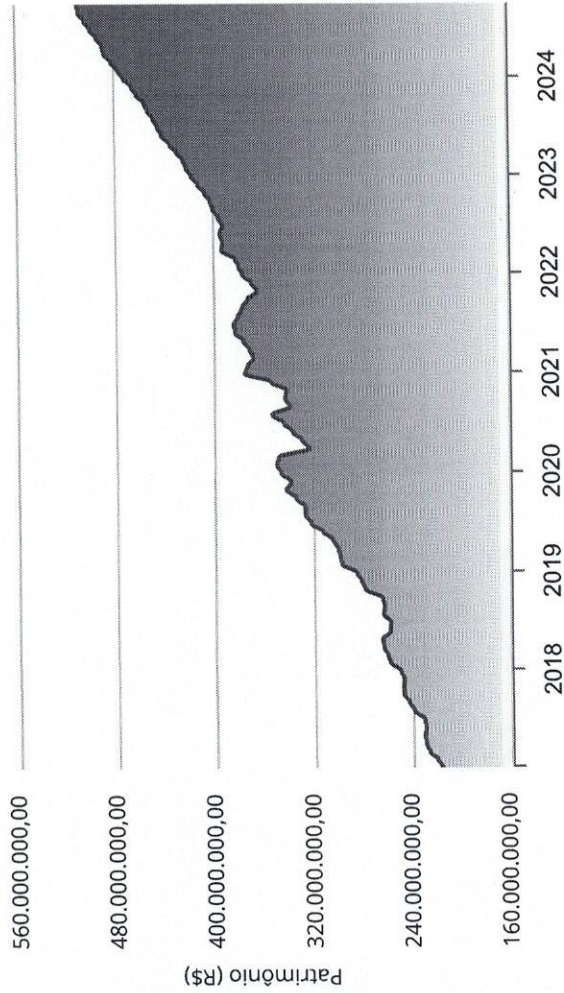




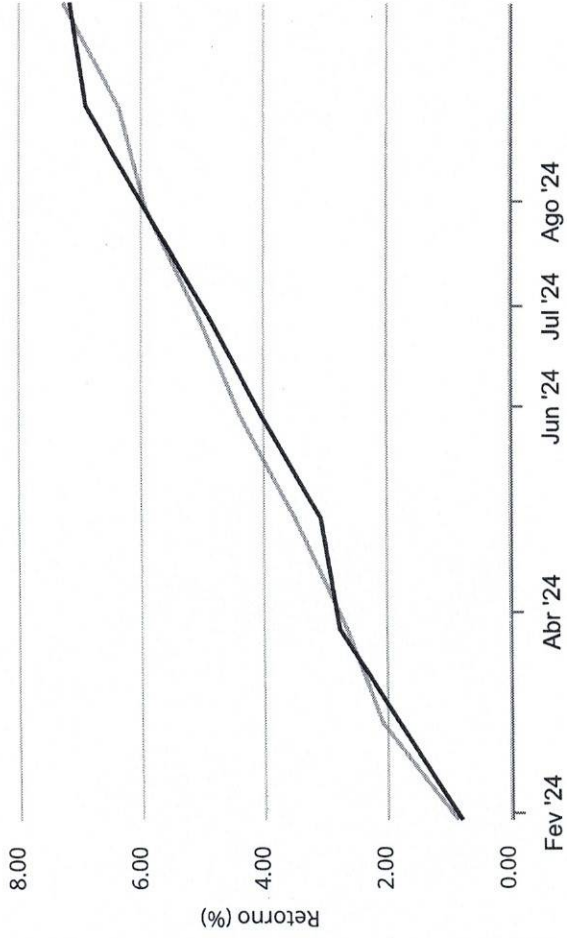
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO

**Evolução do Patrimônio**



**Comparativo**



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  SMIL  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
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.876.587,83	0,00	0,00	5.939.360,32	62.772,49	1,07%	1,07%	0,65%
4UM FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	5.127.502,15	0,00	0,00	5.175.081,81	47.579,66	0,93%	0,93%	0,06%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.213.522,36	0,00	0,00	12.321.611,92	108.089,56	0,88%	0,88%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.527.422,62	0,00	0,00	8.600.691,56	73.268,94	0,86%	0,86%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	53.564.184,98	0,00	22.416.470,31	31.548.348,46	400.633,79	0,75%	0,84%	0,01%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.004.434,52	0,00	0,00	1.011.691,83	7.257,31	0,72%	0,72%	0,38%
TÍTULOS PÚBLICOS	180.626.174,60	0,00	0,00	181.847.934,83	1.221.760,23	0,68%	-	-
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	55.798.322,34	39.000.000,00	0,00	95.431.435,29	633.112,95	0,67%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	3.173.443,24	0,00	0,00	3.193.532,69	20.089,45	0,63%	0,63%	0,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	11.836.811,73	3.175.734,80	14.834.525,96	268.099,06	90.078,49	0,60%	0,75%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	552.012,11	0,00	0,00	554.907,70	2.895,59	0,52%	0,52%	0,56%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.379.911,63	0,00	0,00	5.396.618,45	16.706,82	0,31%	0,31%	1,35%
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,00	20.000.000,00	0,00	20.049.136,50	49.136,50	0,25%	0,91%	0,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	620.496,15	11.000.000,00	0,00	11.617.530,50	-2.965,65	-0,03%	0,38%	0,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.375.160,86	3.000.000,00	0,00	6.344.525,56	-30.635,30	-0,48%	-0,69%	1,86%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.418.859,93	0,00	0,00	5.381.650,29	-37.209,64	-0,69%	-0,69%	1,86%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.645.093,47	0,00	0,00	3.619.634,82	-25.458,65	-0,70%	-0,70%	1,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	21.161.224,27	0,00	0,00	20.908.883,95	-252.340,32	-1,19%	-1,19%	2,45%
LETRA FINANCEIRA BTG	46.608.281,71	0,00	40.036.105,92	5.579.104,97	-993.070,82	-2,13%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>424.509.446,50</b>	<b>76.175.734,80</b>	<b>77.287.102,19</b>	<b>424.789.780,51</b>	<b>1.391.701,40</b>	<b>0,33%</b>		<b>0,75%</b>





**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
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	20.104.326,78	0,00	0,00	20.569.824,29	465.497,51	2,32%	2,32%	6,47%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	648.536,01	0,00	0,00	653.635,87	5.099,86	0,79%	0,79%	0,08%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	15.334.770,14	0,00	0,00	15.406.654,09	71.883,95	0,47%	0,47%	0,48%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD ...	4.566.707,83	0,00	0,00	4.558.572,12	-8.135,71	-0,18%	-0,18%	2,73%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.737.541,16	0,00	0,00	5.720.558,66	-16.982,50	-0,30%	-0,30%	5,79%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	329.305,67	0,00	0,00	325.763,77	-3.541,90	-1,08%	-1,08%	2,65%
DAO MULTIFACTOR LONG BIASED FIC MULTIMERCADO	9.953.424,49	0,00	0,00	9.791.112,50	-162.311,99	-1,63%	-2,00%	3,20%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.500.609,73	0,00	0,00	5.397.263,96	-103.345,77	-1,88%	-1,88%	5,13%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.477.123,14	0,00	0,00	5.210.179,22	-266.943,92	-4,87%	-4,87%	5,16%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>67.652.344,95</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>67.633.564,48</b>	<b>-18.780,47</b>	<b>-0,03%</b>		<b>4,04%</b>



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 (%)	(%) Instít	Var - Mês
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.883.993,10	0,00	0,00	3.887.370,20	3.377,10	0,09%	0,09%	7,93%
DAYCOVAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	5.109.180,45	0,00	0,00	5.095.666,52	-13.513,93	-0,26%	-0,26%	8,60%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4.275.727,73	0,00	0,00	4.261.859,11	-13.868,62	-0,32%	-0,32%	8,93%
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.791.130,58	0,00	0,00	2.736.817,31	-54.313,27	-1,95%	-1,95%	6,82%
<b>Total Exterior</b>	<b>16.060.031,86</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>15.981.713,14</b>	<b>-78.318,72</b>	<b>-0,49%</b>		<b>8,22%</b>





**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	225.236.333,05	42.042.228,61	89.974.795,55	181.847.934,83	4.544.168,72	1,70%	-
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	43.077.535,79	50.950.000,00	0,00	95.431.435,29	1.403.899,50	1,49%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	14.906.198,69	91.217.486,59	75.447.062,92	31.548.348,46	871.726,10	0,82%	2,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	20.419.667,92	0,00	0,00	20.908.883,95	489.216,03	2,40%	2,40%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.928.162,34	12.000.000,00	11.900.000,00	12.321.611,92	293.449,58	1,23%	2,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.958.611,69	8.500.000,00	8.062.752,71	8.600.691,56	204.832,58	1,24%	2,72%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.416.036,85	11.000.000,00	11.000.000,00	11.617.530,50	201.493,65	0,90%	1,80%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.755.872,15	0,00	0,00	5.939.360,32	183.488,17	3,19%	3,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.165.231,24	3.000.000,00	3.000.000,00	6.344.525,56	179.294,32	1,96%	1,84%
4UM FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	5.023.974,64	0,00	0,00	5.175.081,81	151.107,17	3,01%	3,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	230.081,17	34.598.187,52	34.700.321,69	268.099,06	140.152,06	0,40%	2,38%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.274.672,50	0,00	0,00	5.396.618,45	121.945,95	2,31%	2,31%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.282.691,09	0,00	0,00	5.381.650,29	98.959,20	1,87%	1,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	3.123.817,41	0,00	0,00	3.193.532,69	69.715,28	2,23%	2,23%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.554.567,21	0,00	0,00	3.619.634,82	65.067,61	1,83%	1,83%
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,00	20.000.000,00	0,00	20.049.136,50	49.136,50	0,25%	2,85%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	988.190,99	0,00	0,00	1.011.691,83	23.500,84	2,38%	2,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	543.065,96	0,00	0,00	554.907,70	11.841,74	2,18%	2,18%
LETRA FINANCEIRA BTG	57.311.043,00	0,00	51.223.981,22	5.579.104,97	-507.956,81	-0,89%	-



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Ativos Renda Fixa	428.195.753,69	273.307.902,72	285.308.914,09	424.789.780,51	8.595.038,19	1,23%	
Total Renda Fixa							





**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 (%)	(%) Insttit
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	38.590.515,77	0,00	24.000.000,00	15.406.654,09	816.138,32	2,11%	2,44%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	0,00	20.000.000,00	0,00	20.569.824,29	569.824,29	2,85%	6,20%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.054.274,35	0,00	0,00	5.397.263,96	342.989,61	6,79%	6,79%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.408.012,07	0,00	0,00	5.720.558,66	312.546,59	5,78%	5,78%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	4.371.636,84	0,00	0,00	4.558.572,12	186.935,28	4,28%	4,28%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.066.477,46	0,00	0,00	5.210.179,22	143.701,76	2,84%	2,84%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	638.207,18	0,00	0,00	653.635,87	15.428,69	2,42%	2,42%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	316.411,28	0,00	0,00	325.763,77	9.352,49	2,96%	2,96%
DAO MULTIFACTOR LONG BIASED FIC MULTIMERCADO	0,00	10.000.000,00	0,00	9.791.112,50	-208.887,50	-2,09%	4,18%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>59.445.534,95</b>	<b>30.000.000,00</b>	<b>24.000.000,00</b>	<b>67.633.564,48</b>	<b>2.188.029,53</b>	<b>3,34%</b>	



**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
DAYCOVAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	5.000.000,00	0,00	5.095.666,52	95.666,52	1,91%	1,24%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4.230.196,47	0,00	0,00	4.261.859,11	31.662,64	0,75%	0,75%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.856.397,84	0,00	0,00	3.887.370,20	30.972,36	0,80%	0,80%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.711.945,66	0,00	0,00	2.736.817,31	24.871,65	0,92%	0,92%
<b>Total Exterior</b>	<b>10.798.539,97</b>	<b>5.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>15.981.713,14</b>	<b>183.173,17</b>	<b>1,16%</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.