

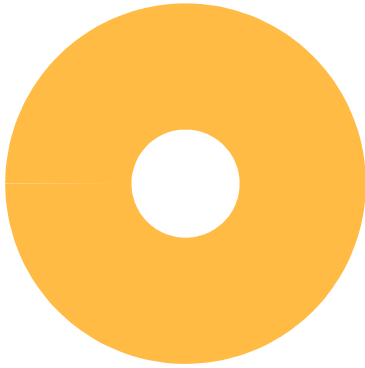
Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	901.447,80	20,37%	665	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	618.136,54	13,96%	826	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	480.512,20	10,86%	765	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	338.608,49	7,65%	594	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	293.707,59	6,64%	1.127	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	259.614,35	5,87%	601	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.281.007,12	28,94%	1.157	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	565,80	0,01%	397	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	252.732,13	5,71%	1.211	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
Total para cálculo dos limites da Resolução			4.426.332,02				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.669,64				Artigo 6º
PL Total			4.428.001,66				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	4.173.599,89	94,29%	0,00%	45,00%	0,00%	-4.173.599,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	252.732,13	5,71%	0,00%	2,00%	0,00%	-252.732,13
Total Renda Fixa	100,00%	4.426.332,02	100,00%	0,00%	62,00%	0,00%	

RENDA FIXA 4.426.332,02

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%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	0,00%	0,00
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	0,00%	0,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	0,00%	



7º I b

7º III a

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%	5,00%	0,00%	0,00

Página 4 de 15

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.144.759,10	71,05	-
CAIXA DTVM	1.281.572,92	28,95	0,01

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

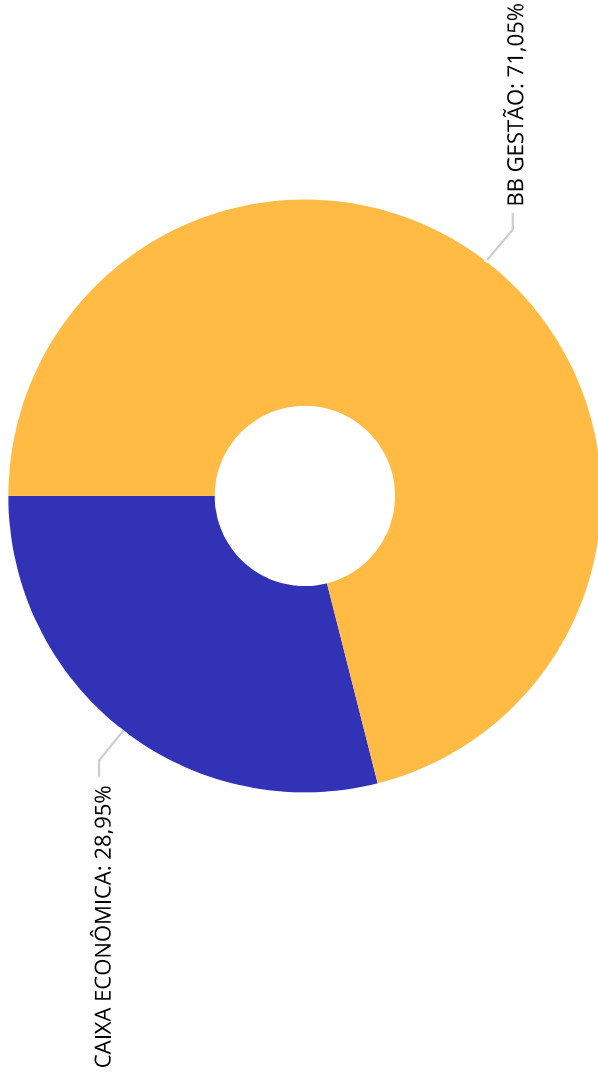
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,39%	5,01%	1,75%	2,72%	8,05%	20,40%	-	-
	0,48%	5,06%	1,89%	2,95%	8,09%	20,22%	0,82%	1,82%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
IRF-M 1 (Benchmark)	0,82%	7,18%	2,55%	4,60%	10,28%	25,21%	-	-
	0,81%	7,10%	2,50%	4,52%	10,13%	24,79%	0,14%	0,41%
	0,80%	6,98%	2,47%	4,44%	9,98%	24,49%	0,14%	0,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA								
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
IMA-B 5								
IMA-B 5 (Benchmark)	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%
IMA-B								
IMA-B (Benchmark)	-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%
IRF-M								
IRF-M (Benchmark)	0,34%	3,90%	2,36%	2,19%	8,45%	23,17%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	3,70%	2,31%	2,06%	8,19%	22,33%	1,35%	2,72%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,32%	3,70%	2,30%	2,05%	8,19%	22,74%	1,35%	2,72%
CDI								
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	6,66%	2,71%	4,15%	9,77%	24,69%	0,18%	0,65%
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%

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

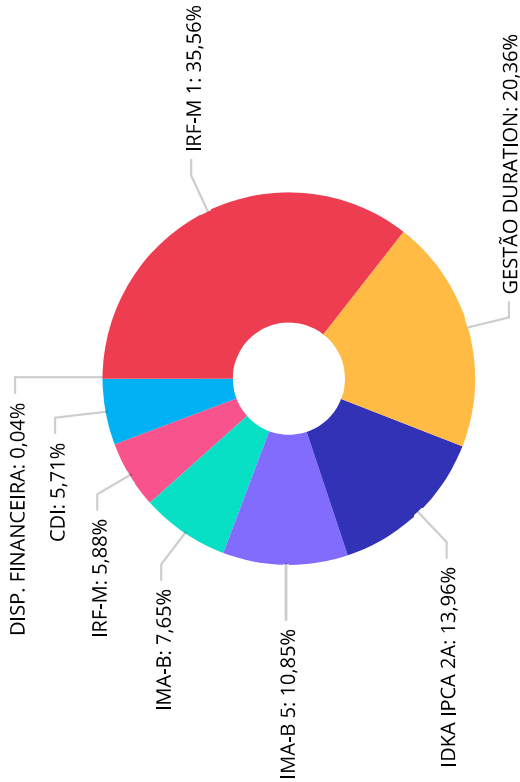
Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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



BB GESTÃO	3.144.759,10
CAIXA ECONÔMICA	1.281.572,92

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

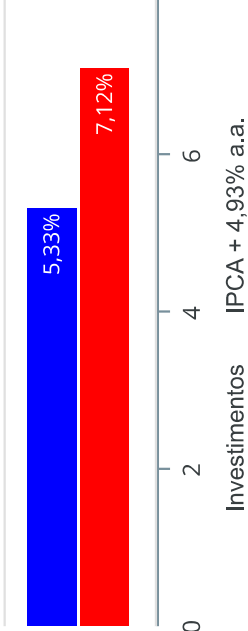


IRF-M 1	1.574.714,71	GESTÃO DURATION	901.447,80	IDKA IPCA 2A	618.136,54	IMA-B 5	480.512,20
IMA-B	338.608,49	IRF-M	260.180,15	CDI	252.732,13	DISP. FINANCEIRA	1.669,64

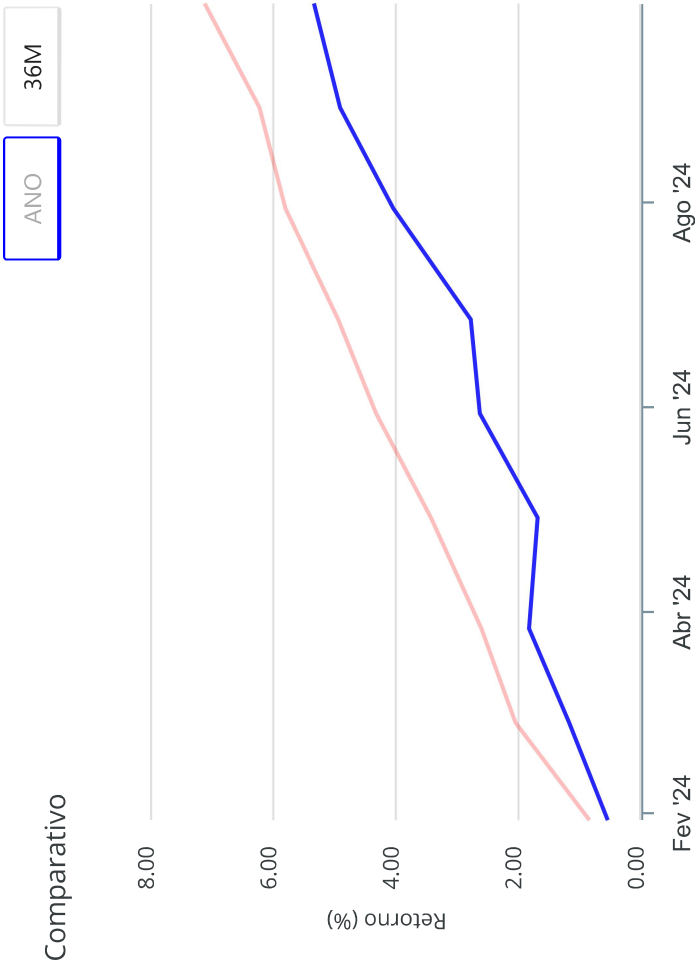
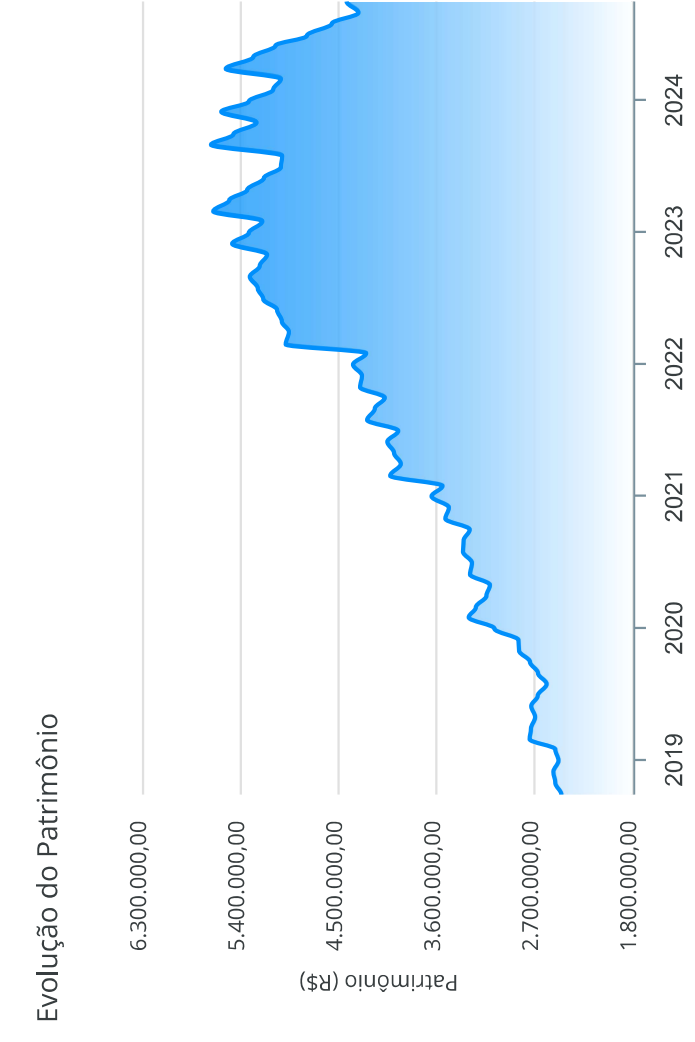
Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	4.240.694,74	0,00	242.668,36	4.021.128,61	23.102,23	23.102,23	0,54%	0,54%	0,84%	0,84%	64,64%	0,44%
Fevereiro	4.021.128,61	0,00	138.171,79	3.908.129,97	25.173,15	48.275,38	0,63%	1,17%	1,20%	2,05%	57,30%	0,31%
Março	3.908.129,97	473.000,00	513.549,89	3.892.842,20	25.262,12	73.537,50	0,65%	1,83%	0,54%	2,60%	70,21%	0,36%
Abril	3.892.842,20	497.000,00	238.369,10	4.145.745,06	-5.728,04	67.809,46	-0,14%	1,69%	0,80%	3,43%	49,24%	0,71%
Maiο	4.145.745,06	0,00	239.400,43	3.944.753,40	38.408,77	106.218,23	0,93%	2,63%	0,86%	4,32%	60,87%	0,56%
Junho	3.944.753,40	0,00	345.770,27	3.604.664,01	5.680,88	111.899,11	0,14%	2,78%	0,59%	4,94%	56,23%	0,75%
Julho	3.604.664,01	0,00	277.091,91	3.371.832,78	44.260,68	156.159,79	1,23%	4,04%	0,82%	5,80%	69,62%	0,70%
Agosto	3.371.832,78	0,00	272.758,79	3.127.207,26	28.133,27	184.293,06	0,83%	4,91%	0,40%	6,23%	78,82%	0,68%
Setembro	3.127.207,26	510.800,00	476.253,58	3.174.602,24	12.848,56	197.141,62	0,41%	5,33%	0,84%	7,12%	74,89%	0,53%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- ☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+
- ☐ CDI

☐ IMA-B

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	250.622,50	0,00	0,00	252.732,13	2.109,63	0,84%	0,84%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.215.039,28	65.618,62	9.529,16	1.281.007,12	9.878,38	0,77%	0,81%	0,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	895.121,01	0,00	0,00	901.447,80	6.326,79	0,71%	0,71%	0,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	121.467,82	170.800,00	0,00	293.707,59	1.439,77	0,49%	0,80%	0,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	514.690,04	0,00	36.094,00	480.512,20	1.916,16	0,37%	0,38%	0,96%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	376.089,99	240.000,00	0,00	618.136,54	2.046,55	0,33%	0,48%	0,82%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	564,01	0,00	0,00	565,80	1,79	0,32%	0,32%	1,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	439.320,18	0,00	440.159,58	0,00	839,40	0,19%	0,81%	0,00%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	159.342,23	100.000,00	0,00	259.614,35	272,12	0,10%	0,32%	1,35%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	340.946,42	0,00	0,00	338.608,49	-2.337,93	-0,69%	-0,69%	1,86%
Total Renda Fixa	4.313.203,48	576.418,62	485.782,74	4.426.332,02	22.492,66	0,51%		0,53%

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
Total Renda Variável	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.213.647,90	65.618,62	28.371,16	1.281.007,12	30.111,76	2,35%	2,50%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	877.635,07	0,00	0,00	901.447,80	23.812,73	2,71%	2,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	844.449,62	0,00	527.481,22	338.608,49	21.640,09	2,56%	1,84%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	507.498,26	0,00	36.094,00	480.512,20	9.107,94	1,79%	1,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	431.099,14	0,00	440.159,58	0,00	9.060,44	2,10%	2,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	370.883,23	240.000,00	0,00	618.136,54	7.253,31	1,19%	1,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	268.245,81	0,00	22.369,48	252.732,13	6.855,80	2,56%	2,73%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	119.489,52	170.800,00	0,00	293.707,59	3.418,07	1,18%	2,47%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	156.248,24	100.000,00	0,00	259.614,35	3.366,11	1,31%	2,31%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	553,07	0,00	0,00	565,80	12,73	2,30%	2,30%
Total Renda Fixa	4.789.749,86	576.418,62	1.054.475,44	4.426.332,02	114.638,98	2,14%	

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 SERCONPREV - SERVIÇOS E CONSULTORIA EM PREVIDÊNCIA S/S LTDA.. 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.

