

Relatório Analítico dos Investimentos

Em Outubro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)

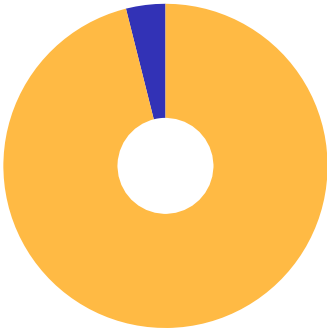
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	176.845.514,65	20,36%	657	2,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.510.298,89	0,52%	566	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	111.550.067,29	12,84%	1.131	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	21.905.027,27	2,52%	574	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	60.834.720,37	7,00%	374	1,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.249.376,35	1,06%	110	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	17/08/2026	30.338.030,76	3,49%	227	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	47.196.259,45	5,43%	687	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	112.253.858,90	12,92%	1.158	1,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.194.202,95	1,63%	378	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	203.055,65	0,02%	188	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.523.705,65	3,40%	1.030	0,73%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	162.441.661,03	18,70%	1.235	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	827.636,70	0,10%	363	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	47.594.947,71	5,48%	1.096	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	Não se ...	27 meses	3.808.485,76	0,44%		12,10%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	583.013,43	0,07%	35	5,84%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	D+3 ou ...	90 dias	759.161,22	0,09%	19	19,50%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	34.028.911,11	3,92%	3.950	2,91%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			868.647.935,14				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			91.109,48	Artigo 6º			
PL Total			868.739.044,62				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	868.647.935,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	589.080.412,53	67,82%	30,00%	35,00%	100,00%	279.567.522,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	240.387.951,09	27,67%	10,00%	30,00%	60,00%	280.800.809,99
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	4.391.499,19	0,51%	1,00%	2,00%	5,00%	39.040.897,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	759.161,22	0,09%	0,00%	0,00%	5,00%	42.673.235,54
Total Renda Fixa	100,00%	834.619.024,03	96,08%	41,00%	77,00%	270,00%	

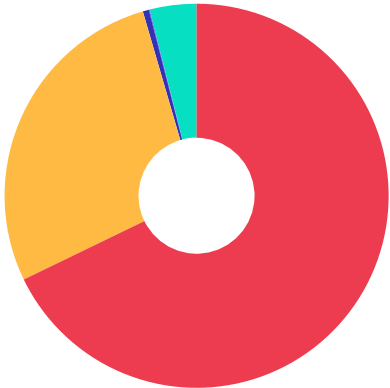


RENTA FIXA 834.619.024,03

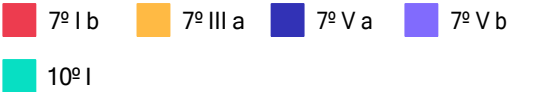
ESTRUTURADOS 34.028.911,11

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%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	173.729.587,03
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	34.028.911,11	3,92%	0,00%	10,00%	10,00%	52.835.882,40
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	43.432.396,76
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	43.432.396,76
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	34.028.911,11	3,92%	0,00%	20,00%	40,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	86.864.793,51
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	86.864.793,51
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	86.864.793,51
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	567.610.995,15	65,34	-
CAIXA DTVM	295.683.223,93	34,04	-
GENIAL GESTÃO LTDA	4.391.499,19	0,51	-
BRZ INVESTIMENTOS	759.161,22	0,09	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	203.055,65	0,02	-

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 + 5,00% ao ano (Benchmark)	1,01%	8,26%	2,22%	4,57%	10,00%	21,06%	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	0,89%	-	-	-	-	-	0,85%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,89%	-	2,01%	-	-	-	0,85%	-

CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,25%	12,21%	3,54%	7,10%	14,86%	34,83%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-25,99%	766,62%	-28,51%	-28,48%	608,78%	239,50%	-	-

IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	8,08%	2,45%	4,88%	10,15%	25,01%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,83%	7,99%	2,40%	4,77%	10,00%	24,59%	0,14%	0,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	7,85%	2,38%	4,70%	9,86%	24,28%	0,14%	0,41%

IMA-B (Benchmark)	-0,65%	0,16%	-0,80%	1,63%	5,62%	15,10%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,47%	-4,89%	-3,18%	-0,83%	-0,07%	2,96%	1,77%	5,54%
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	-4,47%	-24,29%	-8,15%	-14,47%	-16,74%	-64,14%	3,10%	11,02%
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%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	3,90%	1,16%	2,83%	8,01%	21,47%	1,26%	2,60%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,19%	3,89%	1,15%	2,81%	8,01%	21,83%	1,27%	2,60%

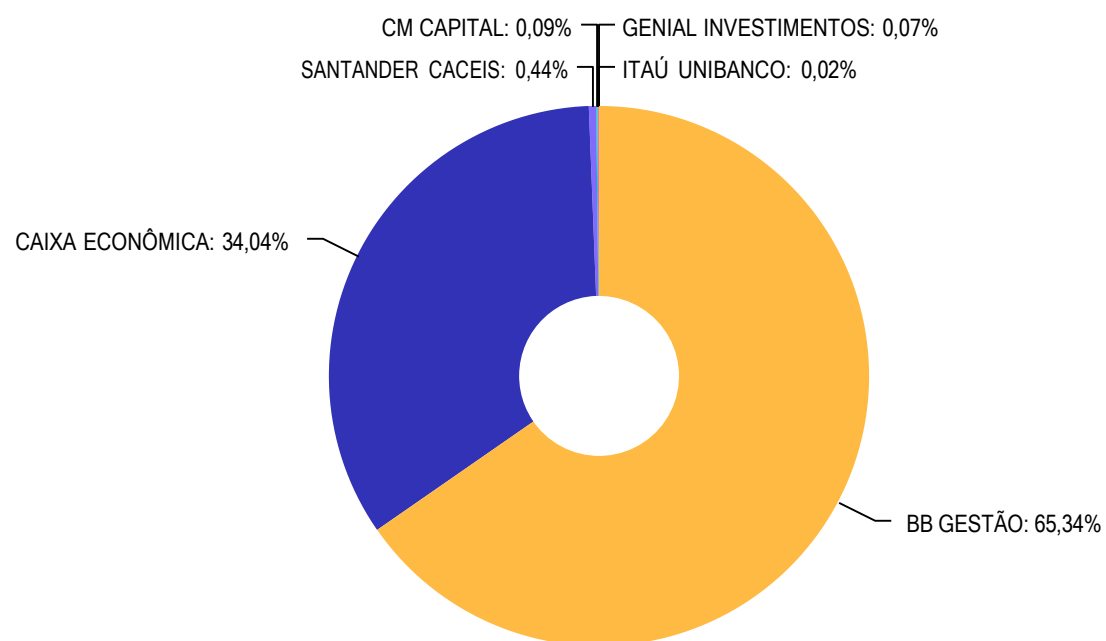
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,93%	8,99%	2,65%	5,27%	10,98%	25,87%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,45%	2,42%	4,63%	9,66%	24,36%	0,25%	0,65%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,84%	8,06%	2,38%	4,72%	9,86%	22,82%	0,00%	0,03%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	-0,58%	-4,81%	-1,62%	-3,19%	-5,98%	13,63%	0,17%	0,55%
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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,91%	9,23%	2,67%	5,40%	11,31%	26,50%	0,02%	0,06%
IPCA (Benchmark)	0,56%	3,88%	0,98%	2,05%	4,76%	9,81%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,86%	5,49%	2,07%	3,96%	8,29%	21,29%	0,41%	1,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,82%	5,04%	2,17%	3,63%	9,51%	19,98%	0,44%	1,91%

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

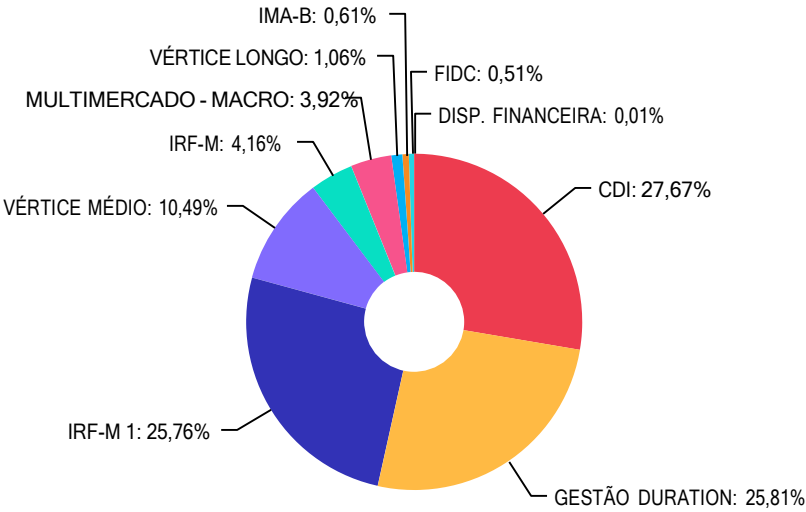
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,93%	8,99%	2,65%	5,27%	10,98%	25,87%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,45%	5,20%	1,88%	3,76%	10,79%	19,33%	0,83%	2,75%

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



BB GESTÃO	567.610.995,15
CAIXA ECONÔMICA	295.683.223,93
SANTANDER CACEIS	3.808.485,76
CM CAPITAL	759.161,22
GENIAL INVESTIMENTOS	583.013,43
ITAÚ UNIBANCO	203.055,65

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

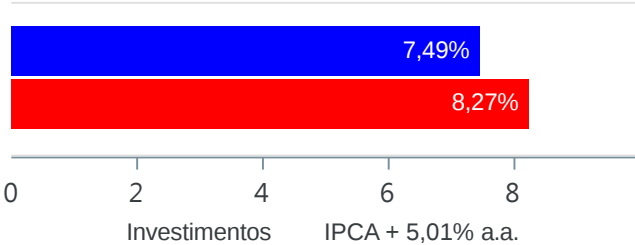


CDI	240.387.951,09	GESTÃO DURATION	224.244.829,75	IRF-M 1	223.803.926,19	VÉRTICE MÉDIO	91.172.751,13
IRF-M	36.099.230,22	MULTIMERCADO - MACRO	34.028.911,11	VÉRTICE LONGO	9.249.376,35	IMA-B	5.269.460,11
FIDC	4.391.499,19	DISP. FINANCEIRA	91.109,48				

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	788.435.283,80	41.405.150,98	33.556.920,55	802.668.106,11	6.384.591,88	6.384.591,88	0,80%	0,80%	0,85%	0,85%	94,39%	0,22%
Fevereiro	802.668.106,11	34.348.126,37	27.828.272,11	814.905.694,53	5.717.734,16	12.102.326,04	0,71%	1,51%	1,20%	2,06%	73,43%	0,22%
Março	814.905.694,53	15.868.338,45	14.207.630,14	823.950.515,71	7.384.112,87	19.486.438,91	0,90%	2,43%	0,55%	2,62%	92,73%	0,20%
Abril	823.950.515,71	25.851.787,40	32.136.890,74	820.486.671,05	2.821.258,68	22.307.697,59	0,34%	2,78%	0,81%	3,45%	80,58%	0,45%
Maiο	820.486.671,05	35.646.585,65	29.852.747,85	832.559.595,75	6.279.086,90	28.586.784,49	0,76%	3,56%	0,87%	4,35%	81,86%	0,36%
Junho	832.559.595,75	40.094.045,21	39.081.010,69	837.584.999,56	4.012.369,29	32.599.153,78	0,48%	4,06%	0,60%	4,98%	81,59%	0,46%
Julho	837.584.999,56	38.902.405,59	36.790.464,35	848.059.585,66	8.362.644,86	40.961.798,64	1,00%	5,10%	0,83%	5,85%	87,17%	0,41%
Agosto	848.059.585,66	86.952.802,16	85.263.469,18	856.849.322,43	7.100.403,79	48.062.202,43	0,84%	5,98%	0,41%	6,28%	95,16%	0,52%
Setembro	856.849.322,43	133.877.612,56	133.233.766,17	863.107.055,48	5.613.886,66	53.676.089,09	0,65%	6,67%	0,85%	7,18%	92,86%	0,33%
Outubro	863.107.055,48	18.974.850,17	20.095.883,37	868.647.935,14	6.661.912,86	60.338.001,95	0,77%	7,49%	1,01%	8,27%	90,66%	0,32%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



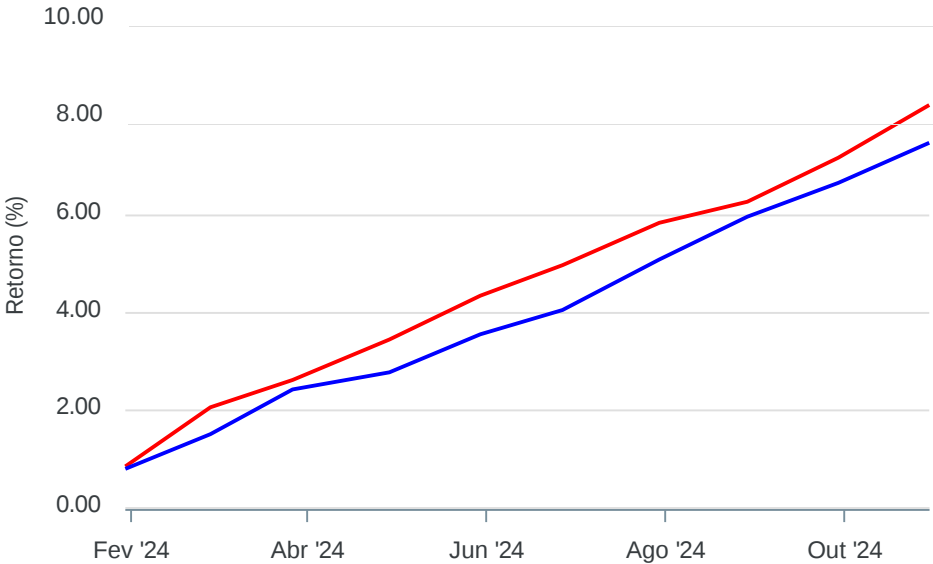
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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