

**REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE
ÁGUAS DA PRATA - SP / AGUASPREV**

**RELATÓRIO MENSAL
DE
INVESTIMENTOS**

**AGOSTO
2024**

11 de setembro de 2024

SUMÁRIO EXECUTIVO

O Sumário Executivo apresenta as principais informações do Relatório Mensal de Investimentos de 2024 do AGUASPREV.

Índice Inflacionário: IPCA – Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo

Taxa de Juros (anual): 4,84% a.a.

Taxa de Juros (mensal): 0,39%

Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice): 4,84% a.a. + IPCA a.a.

Previsão da Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice): 9,60%

Data Focal: 30/08/2024

MENSAL												
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO				
RENTABILIDADE DA CARTEIRA	0,67%	0,66%	0,73%	0,02%	0,95%	0,32%	1,06%	0,72%				
TAXA DE JUROS	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%				
VARIAÇÃO IPCA	0,42%	0,83%	0,16%	0,38%	0,46%	0,21%	0,38%	-0,02%				
META ATUARIAL	0,81%	1,22%	0,55%	0,77%	0,85%	0,60%	0,77%	0,37%				
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%				

ACUMULADO												
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO				
RENTABILIDADE DA CARTEIRA	0,67%	1,33%	2,08%	2,10%	3,07%	3,40%	4,49%	5,24%				
TAXA DE JUROS	0,39%	0,79%	1,19%	1,59%	1,99%	2,39%	2,80%	3,20%				
VARIAÇÃO IPCA	0,42%	1,25%	1,42%	1,80%	2,27%	2,48%	2,87%	2,85%				
META ATUARIAL	0,81%	2,05%	2,62%	3,41%	4,29%	4,92%	5,74%	6,13%				
CDI	0,97%	1,78%	2,62%	3,54%	4,40%	5,22%	6,18%	7,10%				

SUMÁRIO (ÍNDICE)

1	– INTRODUÇÃO	4
2	– MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	5
2.1	- Movimentação Financeira da Carteira	5
2.2	- PAI - Limite de Segmento	6
2.3	- PAI - Limite de Benchmark	7
3	– ENQUADRAMENTO: RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021	8
3.1	- Enquadramento sobre Segmentos e Fundos de Investimento	8
3.1.1	- Disponibilidade Financeira e Total por Segmento	9
3.2	- Enquadramento sobre Patrimônio Líquido dos Fundos de Investimento	10
3.3	- Enquadramento dos Fundos de Investimento que recebem cotas	11
3.4	- Movimentação das Cotas Aplicadas nos Fundos de Investimento	12
3.5	- Enquadramento sobre os recursos de terceiros dos Gestores	13
4	– RECURSOS DE CURTO PRAZO (RISCO DE MERCADO E LIQUIDEZ)	14
5	– PLANEJAMENTO FINANCEIRO	15
6	– DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA	16
6.1	- Distribuição por Segmento (Renda Fixa e Renda Variável)	16
6.2	- Distribuição por índice (Benchmark)	17
6.3	- Distribuição por Instituição Financeira	18
6.4	- Distribuição dos Recursos Disponíveis e Imobilizado	19
6.4.1	- Distribuição da Disponibilidade dos Recursos nos próximos 25 anos	20
7	– RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO	22
8	– RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	25
9	– RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO	34
9.1	- Rentabilidade Mensal da Carteira de Investimentos	34
9.2	- Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos	35
9.3	- Rentabilidade da Carteira de Investimentos	37
9.4	- Meta Atuarial	37
9.4.1	- Projeção da Carteira para Fechamento de 2024	37
10	– ANÁLISE DO MERCADO	38
11	– ANÁLISE MACROECONÔMICA	42
12	– PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA	45
13	– ANEXO I - RENTABILIDADE MENSAL DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS...	46

1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o parecer econômico referente ao mês de AGOSTO, sobre o desempenho mensal das rentabilidades das atuais aplicações financeiras do AGUASPREV.

Este Relatório contém uma análise do enquadramento de suas aplicações frente à Resolução CMN 4.963/2021, um resumo do Regulamento dos fundos de investimento, uma análise sobre o comportamento mensal das rentabilidades ao longo do ano, uma análise do retorno da carteira de investimento quanto a Meta Atuarial e uma projeção sobre o cumprimento da Meta.

O RPPS atenderá aos princípios da segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência, previstos na resolução CMN e no Art. 87º § da Portaria MTP 1.467/2022, através dos Relatórios Mensais de investimentos.

***Art. 87.** Os recursos dos RPPS serão aplicados no mercado financeiro e de capitais em conformidade com regras estabelecidas pelo Conselho Monetário Nacional - CMN.*

***Parágrafo único.** A aplicação dos recursos deverá, com o objetivo de alcançar a meta atuarial, atender aos princípios da segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência, previstos em resolução do CMN, e observar também os parâmetros gerais relativos à gestão de investimentos dos RPPS previstos neste Capítulo.*

2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2024 - AGUASPREV

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	13.444.667,80	787.529,78	(870.127,46)	-	96.993,86	(7.276,54)	89.717,32	13.451.787,44
2	FEVEREIRO	13.451.787,44	347.703,92	(397.544,70)	-	88.263,39	-	88.263,39	13.490.210,05
3	MARÇO	13.490.210,05	409.428,43	(422.770,66)	-	98.508,18	-	98.508,18	13.575.376,00
4	ABRIL	13.575.376,00	336.749,75	(370.862,54)	-	40.419,78	(37.653,63)	2.766,15	13.544.029,36
5	MAIO	13.544.029,36	376.225,54	(519.719,05)	-	127.375,42	-	127.375,42	13.527.911,27
6	JUNHO	13.527.911,27	330.027,47	(387.006,48)	-	58.150,18	(14.880,53)	43.269,65	13.514.201,91
7	JULHO	13.514.201,91	4.890.833,09	(5.007.170,23)	-	141.644,44	-	141.644,44	13.539.509,21
8	AGOSTO	13.539.509,21	853.912,20	(966.511,17)	-	96.920,82	-	96.920,82	13.523.831,06
9	SETEMBRO	13.523.831,06	-	-	-	-	-	-	13.523.831,06
10	OUTUBRO	13.523.831,06	-	-	-	-	-	-	13.523.831,06
11	NOVEMBRO	13.523.831,06	-	-	-	-	-	-	13.523.831,06
12	DEZEMBRO	13.523.831,06	-	-	-	-	-	-	13.523.831,06
13	ANO	13.444.667,80	8.332.410,18	(8.941.712,29)	-	748.276,07	(59.810,70)	688.465,37	13.523.831,06

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2024 - LIMITE DE SEGMENTO - AGUASPREV

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	75,3%	95,0%	75,0%	10.139.266,97	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operação	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	95,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	24,7%	50,0%	25,0%	3.384.564,09	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (60%)	0,0%	0,0%	50,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de 'Crédito Privado'	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	TOTAL - RENDA FIXA					100,0%	13.523.831,06	
RENDA VARIÁVEL								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
14	TOTAL - RENDA VARIÁVEL					0,0%		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					0,0%		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
20	TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS					0,0%		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
24	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR					0,0%		
EMPRÉSTIMO CONSIGNADO								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO					0,0%		
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				0,0%	825,37	
29	PATRIMÔNIO TOTAL					100,0%		13.524.656,43

2.3-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2024 - LIMITE DE BENCHMARK - AGUASPREV

Nº	ÍNDICES DE BENCHMARK	Limites do PAI		Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
		Mínimo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA						
1	DI	0,0%	100,0%	18,8%	2.543.897,75	-
2	IRF - M 1	0,0%	100,0%	6,2%	840.666,34	-
3	IRF - M	0,0%	50,0%	0,1%	10.622,92	-
4	IRF - M 1+	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	IMA - B 5	0,0%	60,0%	17,4%	2.352.628,77	-
6	IMA - B	0,0%	50,0%	5,2%	706.540,80	-
7	IMA - B 5+	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
8	IMA - GERAL e IMA - GERAL ex-C	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
9	IDKA 2, IDKA 3	0,0%	50,0%	7,2%	975.433,02	-
10	IPCA + TAXA DE JUROS	0,0%	70,0%	45,1%	6.094.041,46	-
RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						
11	MULTIMERCADO	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
12	ÍNDICES DE RENDA VARIÁVEL	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
13	ÍNDICES DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
14	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	0,0%	0,0%	0,0%	825,37	-

Os demais índices (Benchmark) não listados acima, e que por ventura o RPPS venha aplicar, não possuem limitação de aplicação conforme PAI em vigor.

3.1-ENQUADRAMENTO SOBRE SEGMENTOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

RENDA FIXA								
Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	706.540,80	5,22%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	74,97%	SIM
2	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	10.622,92	0,08%	SIM			
3	49.963.751/0001-00	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	1.709.943,14	12,64%	SIM			
4	46.134.096/0001-81	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2027 FI	3.058.777,83	22,62%	SIM			
5	35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.325.320,49	9,80%	SIM			
6	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	2.352.628,77	17,40%	SIM			
7	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	975.433,02	7,21%	SIM			
8	19.196.599/0001-09	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	840.666,34	6,22%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	25,03%	SIM
9	42.592.315/0001-15	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	143.994,02	1,06%	SIM			
10	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.273.993,43	16,81%	SIM			
11	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	125.910,30	0,93%	SIM			
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA			13.523.831,06	99,99%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

3.1.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		
12	Banco Cooperativo Sicredi S.A.	825,37	0,01%
(2) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		825,37	0,01%

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS		
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	13.523.831,06	99,99%
(2) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	825,37	0,01%
PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL (1 + 2)	13.524.656,43	100,00%

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

3.2-ENQUADRAMENTO SOBRE O PATRIMÔNIO LÍQUIDO DOS FUNDOS

Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	Patrimônio Líquido do Fundo de Investimento	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	Enquadrado?
Art. 19, § 3º - Não se aplica o disposto neste artigo aos fundos de investimento que apliquem seus recursos exclusivamente em títulos definidos na alínea "a" do inciso I do art. 7º ou em compromissadas lastreadas nesses títulos.	1	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	706.540,80	4.414.843.191,53	0,016%	SIM
	2	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	10.622,92	3.548.363.735,09	0,0003%	SIM
	3	49.963.751/0001-00	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	1.709.943,14	821.214.445,73	0,208%	SIM
	4	46.134.096/0001-81	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2027 FI	3.058.777,83	1.277.962.247,99	0,239%	SIM
	5	35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.325.320,49	6.458.247.673,10	0,021%	SIM
	6	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	2.352.628,77	4.867.666.132,44	0,048%	SIM
	7	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	975.433,02	5.319.492.629,16	0,0183%	SIM
Art. 19 - As aplicações deverão representar até 15% do patrimônio líquido do fundo.	8	19.196.599/0001-09	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	840.666,34	912.411.700,86	0,092%	SIM
	9	42.592.315/0001-15	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	143.994,02	153.727.748.853,32	0,000%	SIM
	10	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.273.993,43	20.250.525.135,03	0,011%	SIM
	11	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	125.910,30	4.410.336.954,15	0,003%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO				13.523.831,06			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)				825,37			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO				13.524.656,43			

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

3.3-ENQUADRAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS QUE RECEBEM COTAS DE FI

FIC - Fundo de Investimento em Cotas	Distribuição das cotas do FIC	Valor Aplicado no Fundo (R\$)	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Patrimônio Líquido do FI	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	ENQUADRADO?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO
FI - Fundo de Investimento								
BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	100,00%	2.352.628,77	17,40%	4.867.666.132,44	0,0483%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	75,0%
BB TOP RF IMA-B 5 LP FI	100,00%	2.352.652,30	17,40%	6.108.716.429,28	0,0385%	SIM		
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	100,00%	1.325.320,49	9,80%	6.458.247.673,10	0,021%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	25,0%
BB TOP RF JUROS BRASIL FI LP	100,00%	1.325.307,24	17,39%	6.458.312.459,62	0,02%	SIM		
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	100,01%	125.910,30	0,93%	4.410.336.954,15	0,003%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	25,0%
BB TOP RENDA FIXA SIMPLES FI	100,01%	125.916,60	0,93%	84.167.612.038,74	0,0001%	SIM		
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	100,00%	2.273.993,43	16,81%	20.250.525.135,03	0,011%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	25,0%
BB TOP DI RENDA FIXA REF DI LP FI	100,00%	2.274.016,17	0,93%	32.377.255.995,89	0,01%	SIM		
BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	100,00%	143.994,02	1,06%	153.727.748.853,32	0,000%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	25,0%
BB TOP RF CP AUTOMÁTICO II FI	100,00%	143.989,70	0,93%	153.724.929.655,42	0,0001%	SIM		

3.4-MOVIMENTAÇÃO DAS COTAS APLICADAS NOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

N°	Agência	Conta	Fundo de Investimento	CNPJ	Valor da Cota		Quantidade de Cotas			
					Inicial *	Final **	Inicial *	Aplicação	Resgate	Final **
1	6955-8	6142-5	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	42.592.315/0001-15	2,557936236	2,574355815	138314,2134	0	26446,2124	111868,001
2	6955-8	5359-7	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	13.077.415/0001-05	2,870270138	2,892805134	17261,1523	0	0	17261,1523
3	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	03.543.447/0001-03	27,4758882	27,61847071	85183,16581	0	0	85183,16581
4	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	07.111.384/0001-69	7,775739272	7,826420201	1357,315315	0	0	1357,315315
5	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	07.442.078/0001-05	7,978188597	8,015094814	88151,27162	0	0	88151,27162
6	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	3,839580537	3,863977796	252442,7084	0	0	252442,7084
7	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	13.077.415/0001-05	5,740540082	5,785610545	37676,54132	296032,7258	150864,2899	26264,17732
8	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	6,510112273	3,28408365	692428,5957	0	0	692428,5957
9	6955-8	130098-9	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	35.292.588/0001-89	1,413782344	1,427168304	928636,4379	0	0	928636,4379
10	6955-8	130098-9	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	1,288829386	0	174194,7324	0	174194,7324	0
11	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2027 FI	46.134.096/0001-81	1,181245124	1,189210196	2572108,648	0	0	2572108,648
12	6955-8	130098-9	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	49.963.751/0001-00	1,08282742	1,090230967	1401445,144	207012,3436	40034,65641	1568422,832
13	0718	715053	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	19.196.599/0001-09	2,548752785	2,568448597	327305,1058	0	0	327305,1058

* Informação baseada no último dia útil do mês anterior (31/07/2024).

** Informação baseada no último dia útil do mês (30/08/2024).

3.5-ENQUADRAMENTO SOBRE OS RECURSOS DE TERCEIROS DOS GESTORES

Nº	Gestor de Recursos	Recursos do RPPS aplicado no Gestor	Total de Recursos de Terceiros geridos pelo GESTOR	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do GESTOR	Enquadrado?
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	12.683.164,72	1.675.867.708.232,46	0,0008%	SIM
2	Confederação Interestadual das Cooperativas Ligadas ao Sicredi	840.666,34	130.818.270.178,26	0,0006%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO		13.523.831,06			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		825,37			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		13.524.656,43			

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

4-RECURSOS DE CURTO PRAZO (RISCO DE MERCADO E LIQUIDEZ)

RECURSOS DE CURTO PRAZO (RISCO DE MERCADO E LIQUIDEZ) - PAI/2024

SEPARAÇÃO DOS RECURSOS	VALOR (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido *
RECURSOS DE CURTO PRAZO (RISCO DE MERCADO E LIQUIDEZ)	5.720.000,00	43,8%

*POSIÇÃO DA CARTEIRA (R\$) EM 29/09/2023.

ATUALIZAÇÃO DOS VALORES EM PROVISÃO DE CAIXA

SEPARAÇÃO DOS RECURSOS	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido *
Valor Atualizado em Fundos para Provisão de Caixa (Curto Prazo)	3.190.636,92	23,6%

Referência: AGOSTO

NECESSIDADE ATUAL DAS OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS ATÉ O FIM DO ANO	VALOR (em R\$)	% dos Recursos em Fundos para Provisão de Caixa
	2.200.000,00	16,3%

Referência: AGOSTO

A Política de Investimento determina que parte dos recursos acumulados sejam separados por **RECURSOS DE CURTO PRAZO (RISCO DE MERCADO E LIQUIDEZ)**. Essa separação tem o intuito de amenizar os efeitos da volatilidade do mercado, sobre os recursos utilizados no curto prazo, em casos de interrupção no Fluxo de caixa (repasso e outras receitas).

5-PLANEJAMENTO FINANCEIRO

PLANEJAMENTO FINANCEIRO (ORGANIZAÇÃO DOS RECURSOS)

Nº	FINALIDADE		AGÊNCIA	CONTA	Fundo de Investimento	Valor Aplicado (R\$)	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	(R\$) Total dos Recursos do RPPS	(%) Total dos Recursos do RPPS
1	PLANO DE BENEFÍCIO	RECURSOS A LONGO PRAZO	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	2.352.628,77	17,40%	10.139.266,97	74,97%
2			6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	10.622,92	0,08%		
3			6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	706.540,80	5,22%		
4			6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	975.433,02	7,21%		
5			6955-8	130098-9	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.325.320,49	9,80%		
6			6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2027 FI	3.058.777,83	22,62%		
7			6955-8	130098-9	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	1.709.943,14	12,64%		
8		RECURSOS DE CURTO PRAZO	6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	75.977,15	0,56%	3.190.636,92	23,59%
9			6955-8	130098-9	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.273.993,43	16,81%		
10			0718	715053	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	840.666,34	6,22%		
11	RESERVA ADMINISTRATIVA	UTILIZADO / CONSTITUÍDO PRÓXIMOS 12 MESES	6955-8	6142-5	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	143.994,02	1,06%	193.927,17	1,43%
12			6955-8	5359-7	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	49.933,15	0,37%		
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS						13.523.831,06	100%	13.523.831,06	100%

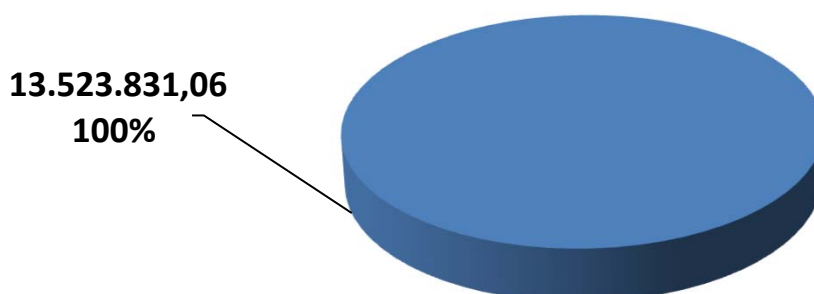
6. - DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA

6.1-DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO (RENDA FIXA e RENDA VARIÁVEL)

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RENDA FIXA	13.523.831,06	100,0%
RENDA VARIÁVEL	-	0,0%
INVESTIMENTO ESTRUTURADO	-	0,0%
IMOBILIÁRIO	-	0,0%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-	0,0%
TOTAL	13.523.831,06	100,0%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / SEGMENTO

■ RENDA FIXA

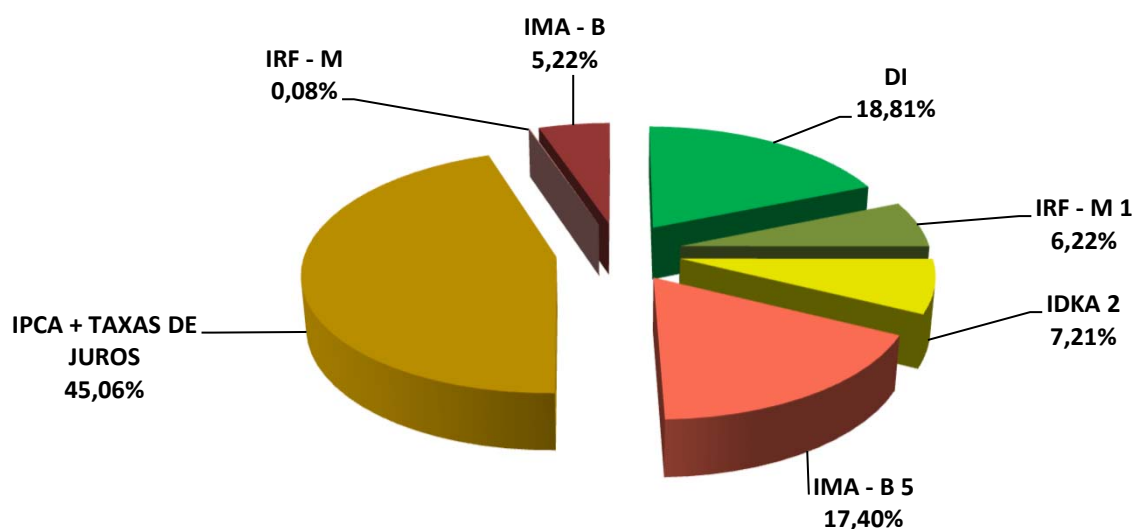


**OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).*

6.2-DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE (Benchmark)

ÍNDICE (BENCHMARK)	VALOR APLICADO (em R\$)	(%) sobre PL RPPS	ÍNDICES AGRUPADOS	VALOR TOTAL (R\$)	(%) TOTAL sobre PL RPPS
DI	2.543.897,75	18,81%	RENDA FIXA - CURTO PRAZO	3.384.564,09	25,03%
IRF - M 1	840.666,34	6,22%			
IDKA 2	975.433,02	7,21%	RENDA FIXA - MÉDIO PRAZO	3.328.061,79	24,61%
IMA - B 5	2.352.628,77	17,40%			
IPCA	1.325.320,49	9,80%	IPCA + TAXAS DE JUROS	6.094.041,46	45,06%
IPCA + 5,00% a.a.	4.768.720,97	35,26%			
IPCA + 6,00% a.a.	-	0,00%			
IMA - GERAL / IMA-GERAL EX - C	-	0,00%	RENDA FIXA - LONGO PRAZO	717.163,72	5,30%
IRF - M	10.622,92	0,08%			
IMA - B	706.540,80	5,22%			
IRF - M 1+	-	0,00%	RENDA FIXA - LONGUÍ. PRAZO	-	0,00%
IMA - B 5+	-	0,00%			
MULTIMERCADO	-	0,00%	MULTIMERCADO	-	0,00%
IBOVESPA	-	0,00%	AÇÕES - ÍNDICE BRASIL	-	0,00%
IBR - X	-	0,00%			
IGC	-	0,00%			
STANDARD & POOR'S 500 (BR)	-	0,00%			
PETROBRÁS	-	0,00%			
SMALL CAPS	-	0,00%	AÇÕES - BRASIL SETOR	-	0,00%
ENERGIA	-	0,00%			
SETOR FINANCEIRO	-	0,00%			
CONSTRUÇÃO CIVIL	-	0,00%			
INFRAESTRUTURA	-	0,00%			
TECNOLOGIA	-	0,00%			
ELETOBRAS	-	0,00%			
IMOBILIÁRIO - IMOB	-	0,00%	SETOR IMOBILIÁRIO	-	0,00%
IMOBILIÁRIO - IFIX	-	0,00%			
BDR - NÍVEL I	-	0,00%	AÇÕES - EXTERIOR	-	0,00%
S&P 500 (BOLSA EUA)	-	0,00%			
TECNOLOGIA - BDR	-	0,00%			
TOTAL	13.523.831,06	99,99%		13.523.831,06	99,99%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR ÍNDICE

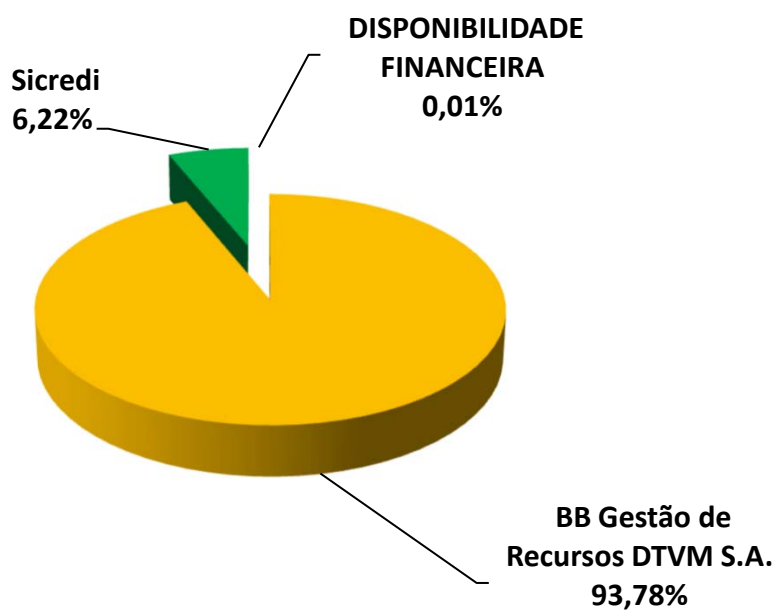


*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

6.3-DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	12.683.164,72	93,78%
Sicredi	840.666,34	6,22%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	825,37	0,01%
TOTAL	13.524.656,43	100,00%

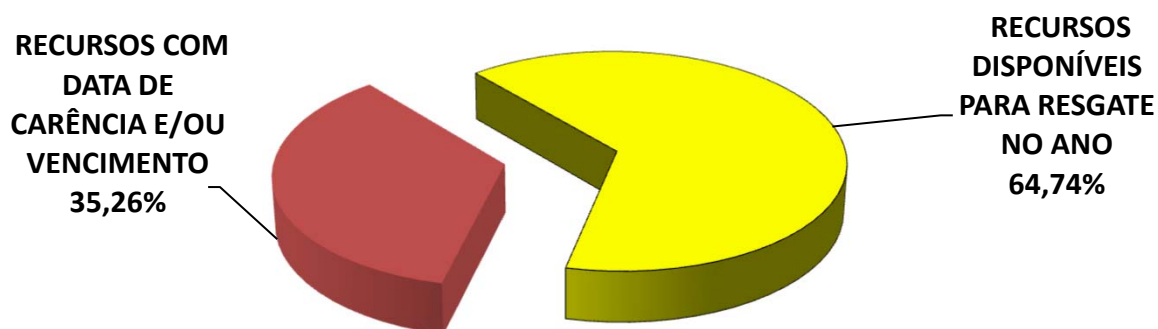
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



6.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS POR LIQUIDEZ

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RECURSOS DISPONÍVEIS PARA RESGATE NO ANO	8.755.935,46	64,74%
RECURSOS COM DATA DE CARÊNCIA E/OU VENCIMENTO	4.768.720,97	35,26%
TOTAL	13.524.656,43	100,00%

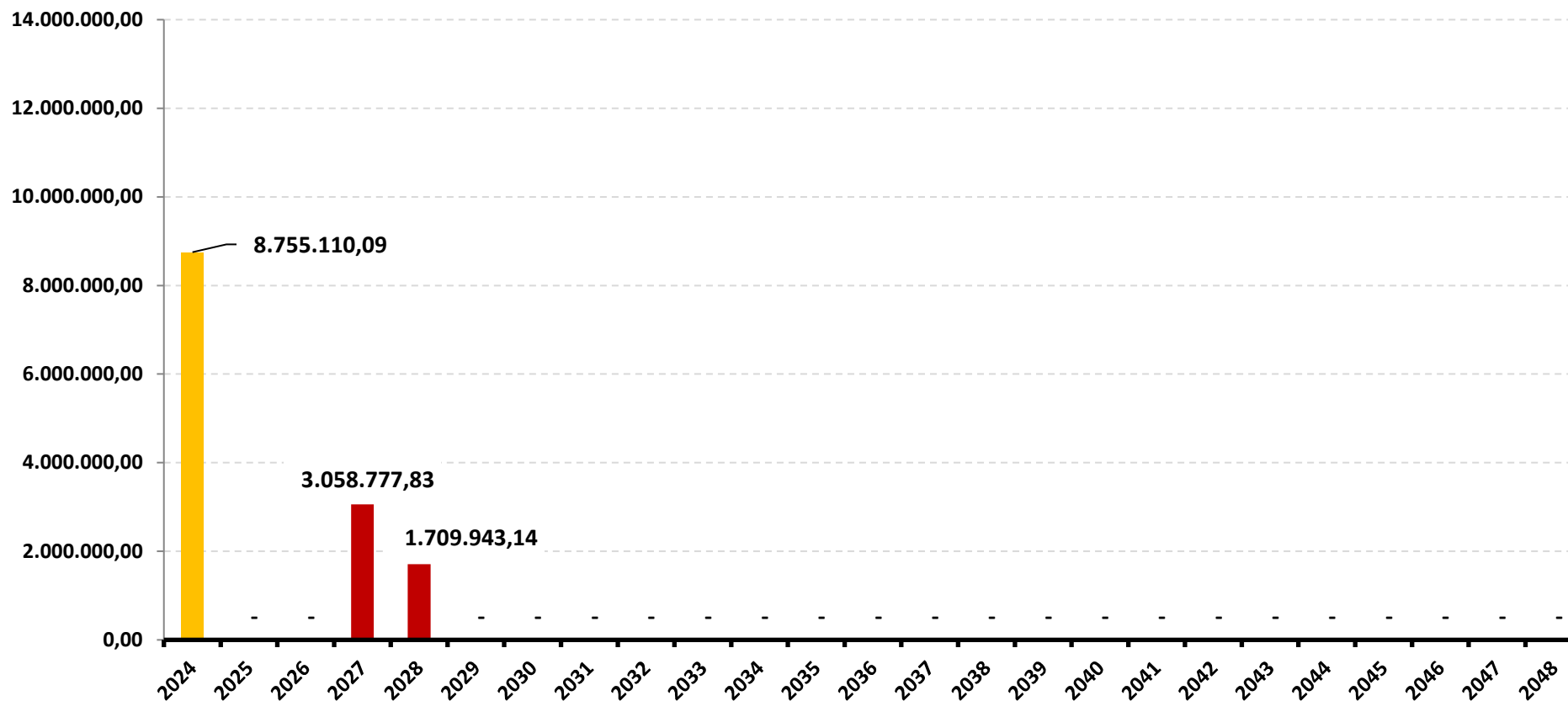
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA /POR LIQUIDEZ



6.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS POR LIQUIDEZ

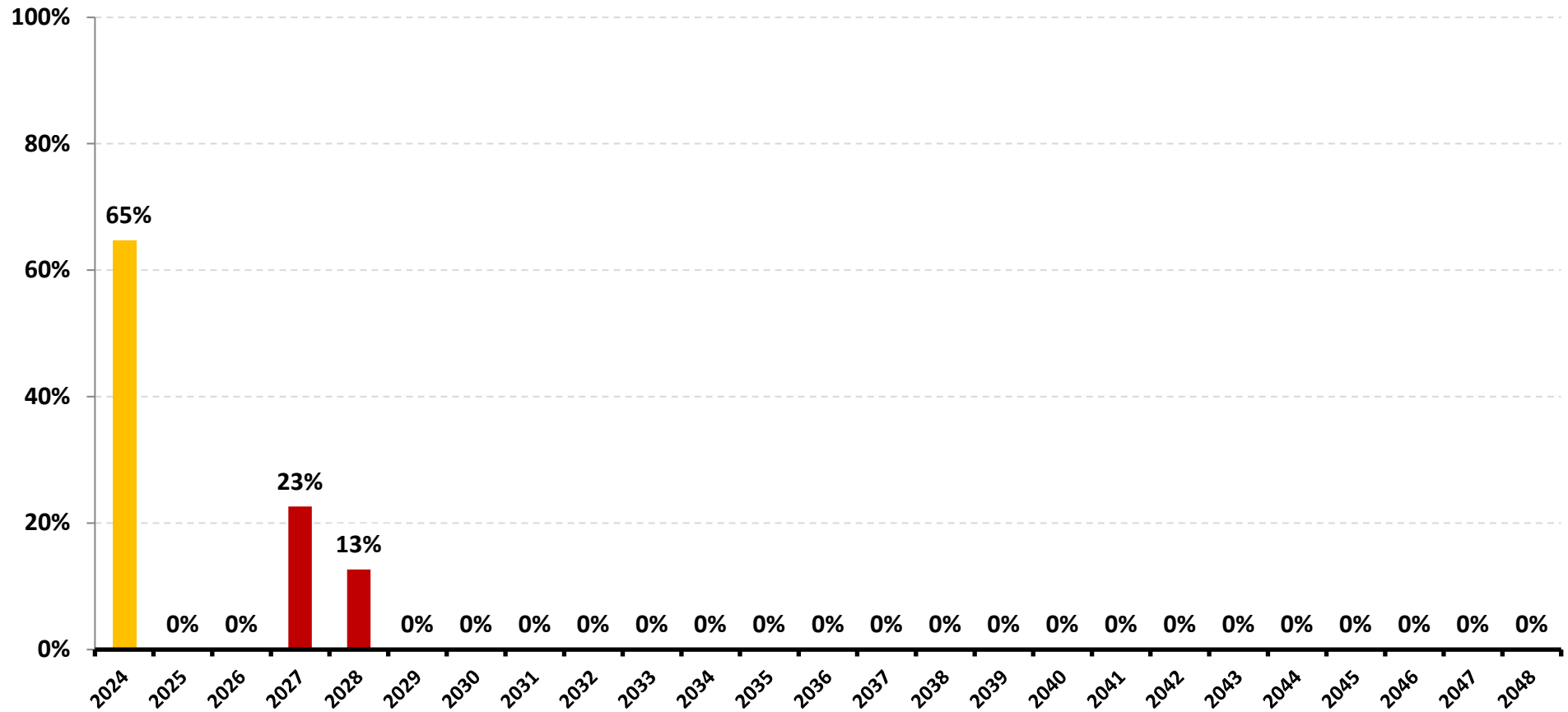
6.4.1-DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS NOS PRÓXIMOS 25 ANOS

DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS (LIQUIDEZ x CARÊNCIA E/OU VENCIMENTO)



*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS (LIQUIDEZ x CARÊNCIA E/OU VENCIMENTO)



**OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).*

7-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI
CNPJ	13.077.415/0001-05	13.077.418/0001-49	42.592.315/0001-15	13.322.205/0001-35
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	CDI	CDI	CDI	IDKA 2
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	28/04/2011	30/09/2021	28/04/2011
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,00% a.a.	0,20% a.a.	1,75% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
APLICAÇÃO INICIAL	1000	1000	0,01	10000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	0,01	0
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	0
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	0
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	1 - Muito Baixo	2 - Baixo	1 - Muito Baixo	3 - Médio
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	4.410.336.954,15	20.250.525.135,03	153.727.748.853,32	5.319.492.629,16
NÚMERO DE COTISTAS **	1040	1191	82724	837
VALOR DA COTA **	2,892805297	3,284083643	1,287177903	3,863977799
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	02/09/2021	06/08/2018	21/09/2021	05/02/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

Continuação.....

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2027 FI	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI
CNPJ	03.543.447/0001-03	35.292.588/0001-89	46.134.096/0001-81	44.345.590/0001-60
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	IMA - B 5	IPCA	IPCA + 5,00% a.a.	IPCA + 5,00% a.a.
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
DATA DE INÍCIO	17/12/1999	16/03/2020	20/06/2022	24/01/2022
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,30% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
APLICAÇÃO INICIAL	1000	10000	100000	100000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	1000	100000	100000
RESGATE MÍNIMO	0,01	1000	100000	100000
SALDO MÍNIMO	0,01	1000	100000	100000
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Até o dia 15/05/2027	Até o dia 15/08/2024
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	3 - Médio	3 - Médio	3 - Médio	3 - Médio
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	4.867.666.132,44	6.458.247.673,10	1.277.962.247,99	392.787.249,14
NÚMERO DE COTISTAS **	776	668	222	79
VALOR DA COTA **	27,61847069	1,427168299	1,189210196	1,300722074
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	05/02/2020	02/03/2020	07/06/2022	19/01/2022
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

Continuação.....

3

INFORMAÇÕES	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1
CNPJ	49.963.751/0001-00	07.111.384/0001-69	07.442.078/0001-05	19.196.599/0001-09
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa Duração Livre Soberano	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	IPCA + 5,00% a.a.	IRF - M	IMA - B	IRF - M 1
PÚBLICO ALVO	Investidor Qualificado	Público Geral	Público Geral	Público Geral
DATA DE INÍCIO	10/05/2023	08/12/2004	24/07/2005	27/02/2014
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,15% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,18% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não Possui	Não Possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	100000	10000	10000	50000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100000	0,01	0,01	5000
RESGATE MÍNIMO	100000	0,01	0,01	5000
SALDO MÍNIMO	100000	0,01	0,01	50000
CARÊNCIA	Até o dia 15/08/2028	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	3 - Médio	3 - Médio	4 - Alto	2 - Baixo
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	821.214.445,73	3.548.363.735,09	4.414.843.191,53	912.411.700,86
NÚMERO DE COTISTAS **	126	609	605	434
VALOR DA COTA **	1,090230969	7,826420024	8,015094766	2,5684486
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	26/04/2023	09/10/2017	11/10/2017	14/08/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

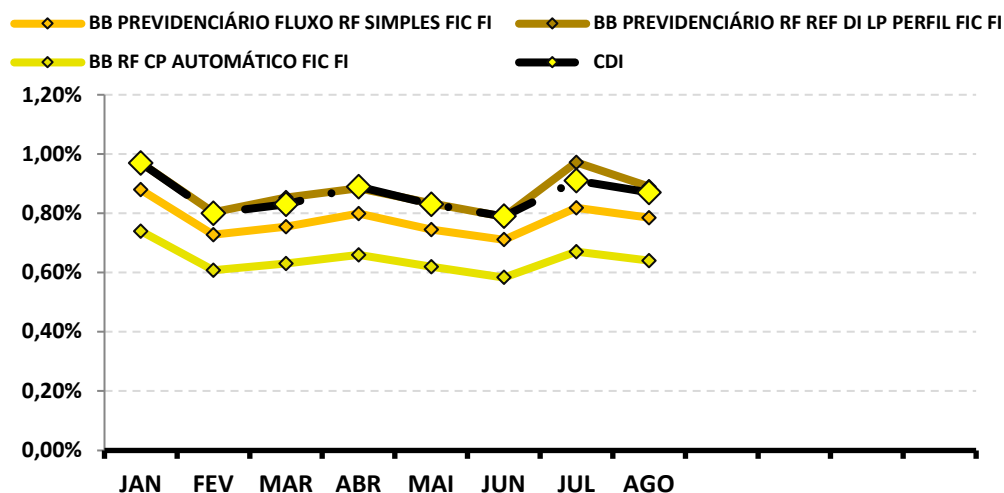
** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

8-RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

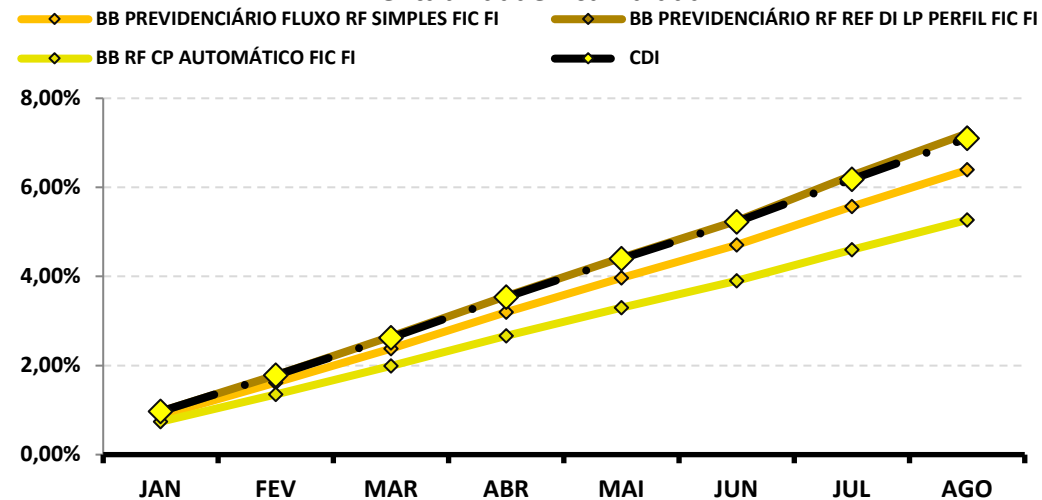
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao CDI

Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL										RETORNO ACUMULADO		
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO			(R\$)	(%)	(R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	0,88%	0,73%	0,75%	0,80%	0,75%	0,71%	0,82%	0,79%			2.903,87	6,39%	21.066,28
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,97%	0,80%	0,85%	0,88%	0,83%	0,79%	0,97%	0,89%			20.099,48	7,21%	163.753,97
BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	0,74%	0,61%	0,63%	0,66%	0,62%	0,58%	0,67%	0,64%			1.121,65	5,27%	13.091,37
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%				7,10%	-

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada

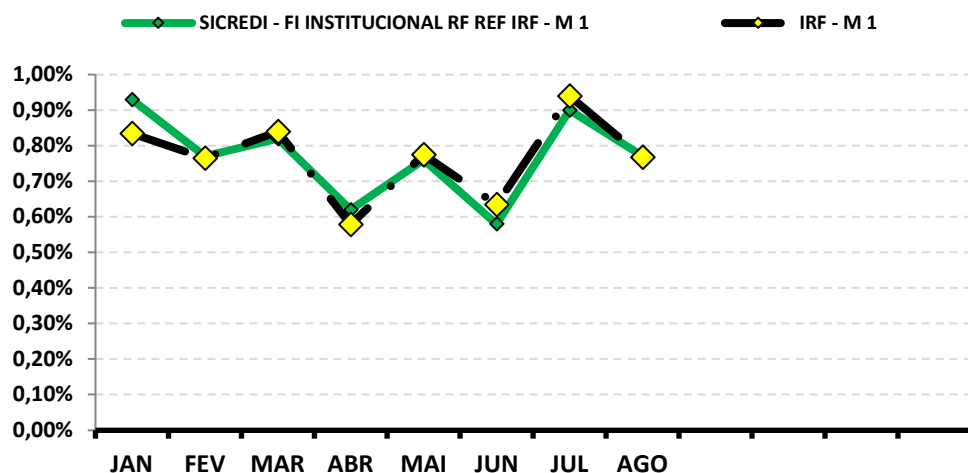


Continuação....

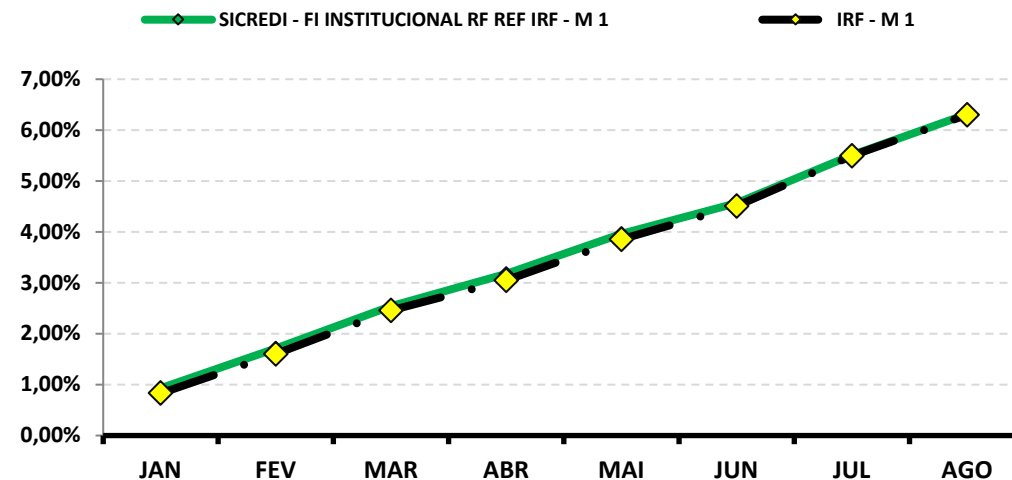
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao IRF - M 1

Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL										RETORNO ACUMULADO				
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO			(R\$)	(%)	(R\$)		
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	0,93%	0,77%	0,82%	0,62%	0,76%	0,58%	0,90%	0,77%					6.446,54	6,32%	50.005,80
IRF - M 1	0,83%	0,77%	0,84%	0,58%	0,78%	0,63%	0,94%	0,77%						6,30%	-

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada

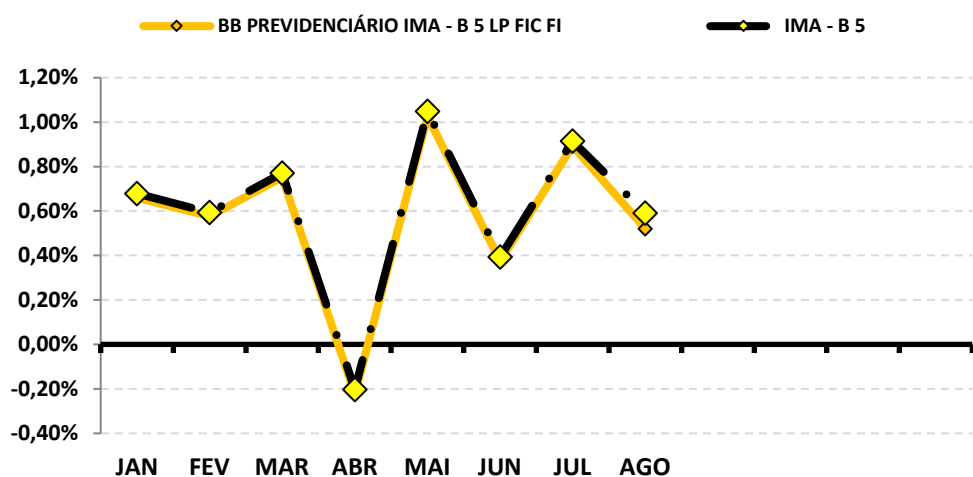


Continuação....

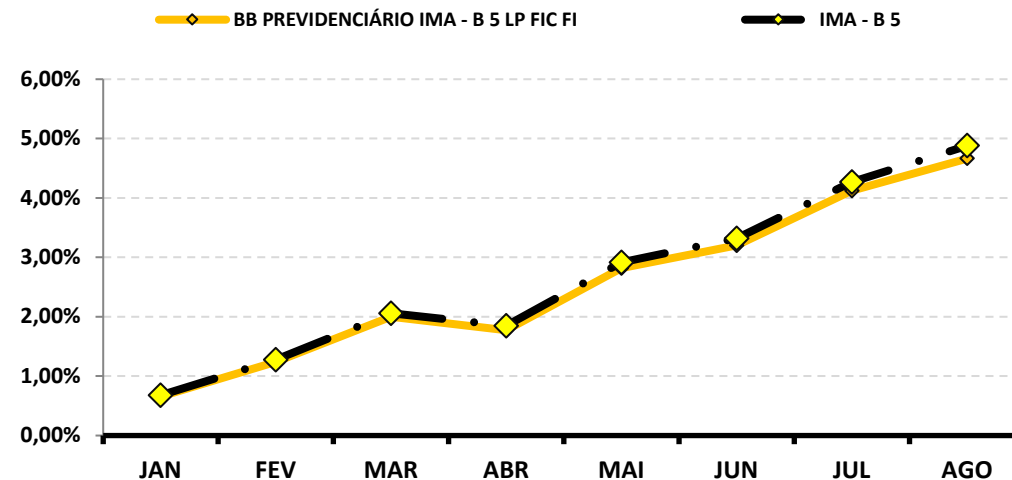
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao IMA - B 5

Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL										RETORNO ACUMULADO				
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO			(R\$)	(%)	(R\$)		
BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	0,66%	0,58%	0,75%	-0,22%	1,03%	0,37%	0,89%	0,52%					12.145,63	4,66%	133.819,94
IMA - B 5	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	1,05%	0,39%	0,91%	0,59%						4,88%	-

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada

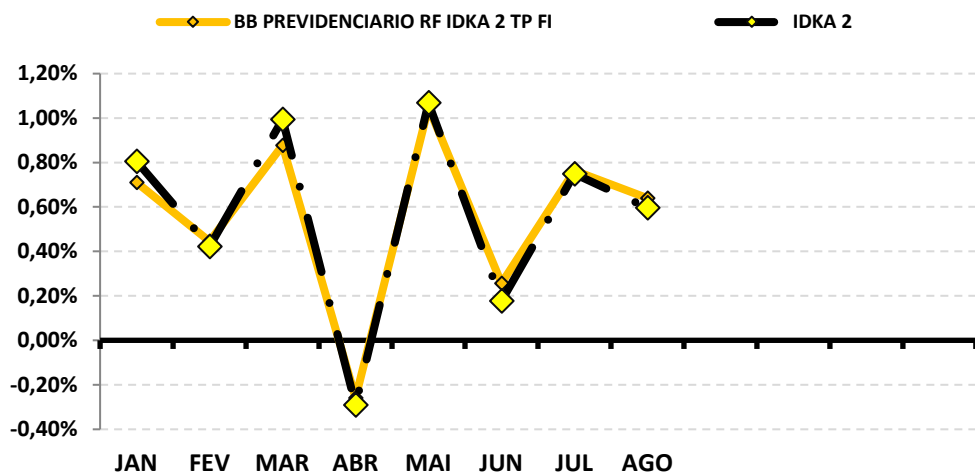


Continuação....

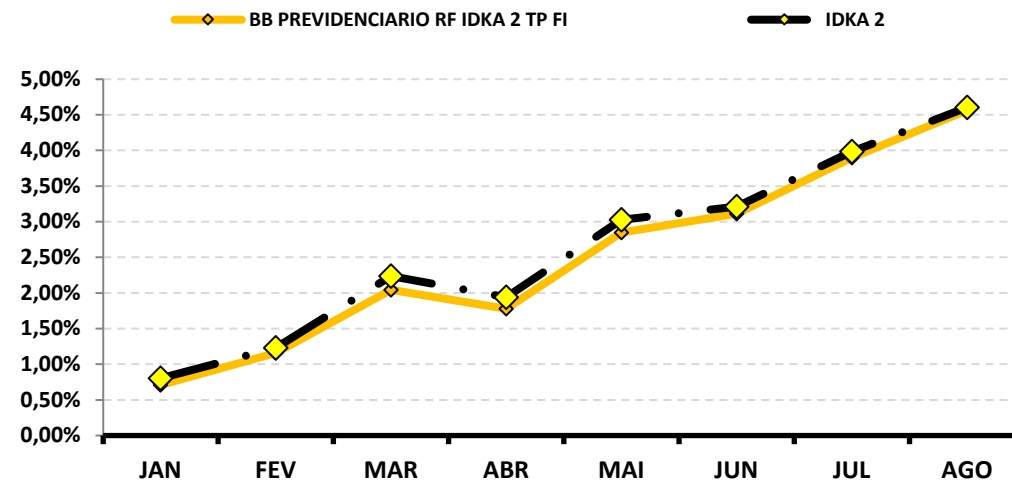
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao IDKA 2

Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL										RETORNO ACUMULADO				
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO			(R\$)	(%)	(R\$)		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	0,71%	0,44%	0,88%	-0,26%	1,05%	0,26%	0,76%	0,64%					6.158,91	4,56%	75.874,69
IDKA 2	0,81%	0,42%	0,99%	-0,29%	1,07%	0,18%	0,75%	0,60%						4,60%	-

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada

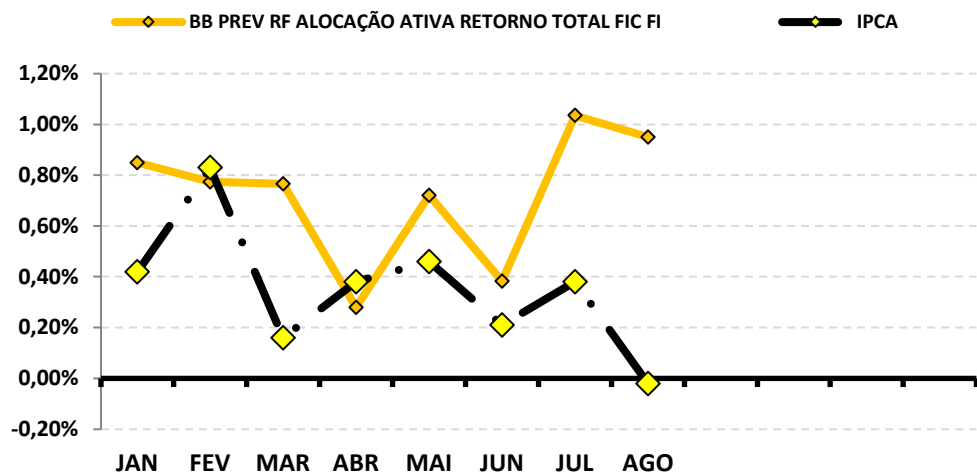


Continuação....

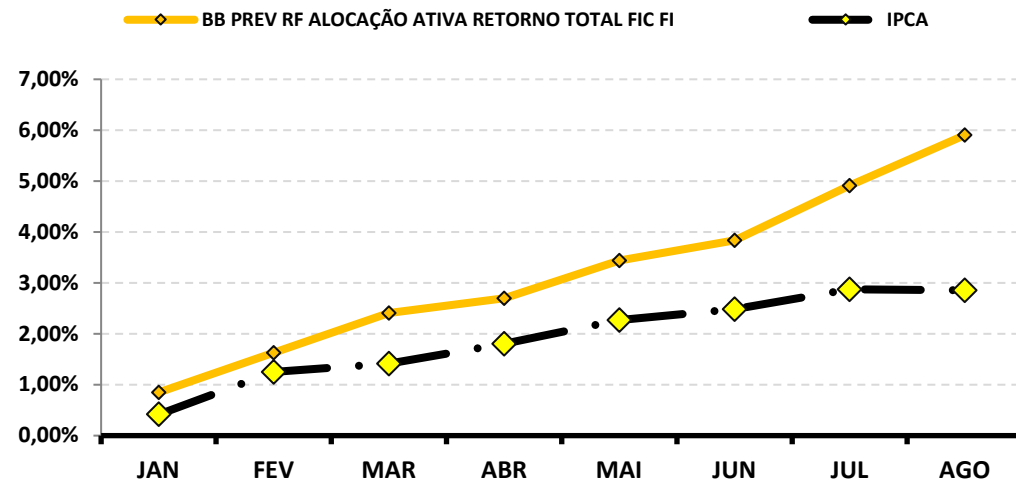
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao IPCA

Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL										RETORNO ACUMULADO				
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO			(R\$)	(%)	(R\$)		
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC	0,85%	0,77%	0,77%	0,28%	0,72%	0,38%	1,04%	0,95%					12.430,69	5,90%	131.455,96
IPCA	0,42%	0,83%	0,16%	0,38%	0,46%	0,21%	0,38%	-0,02%						2,85%	-

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada

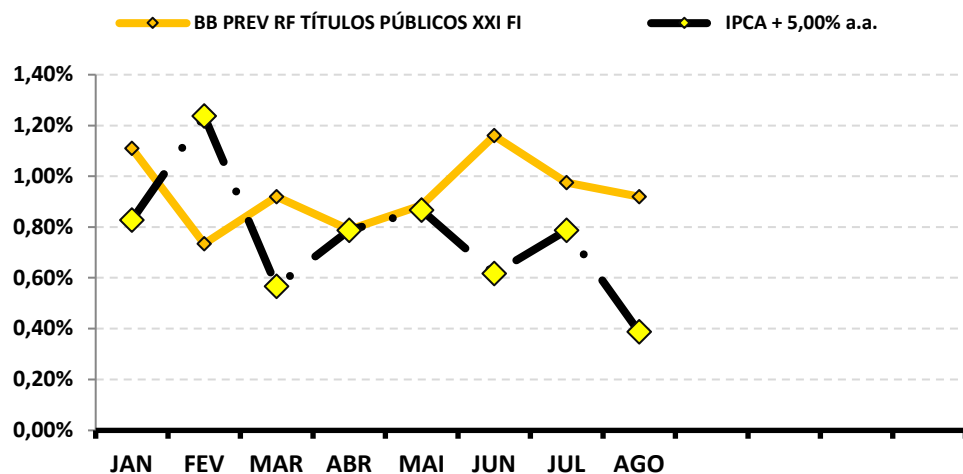


Continuação....

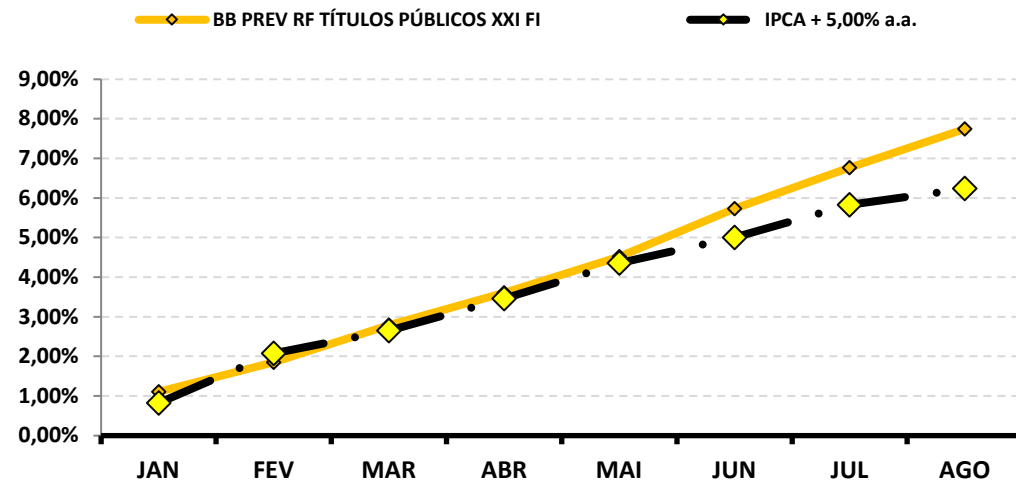
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao IPCA + 5,00% a.a.

Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL										RETORNO ACUMULADO				
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO			(R\$)	(%)	(R\$)		
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,11%	0,73%	0,92%	0,79%	0,89%	1,16%	0,98%	0,92%					1.812,04	7,75%	16.115,22
IPCA + 5,00% a.a.	0,83%	1,24%	0,57%	0,79%	0,87%	0,62%	0,79%	0,39%						6,24%	-

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada

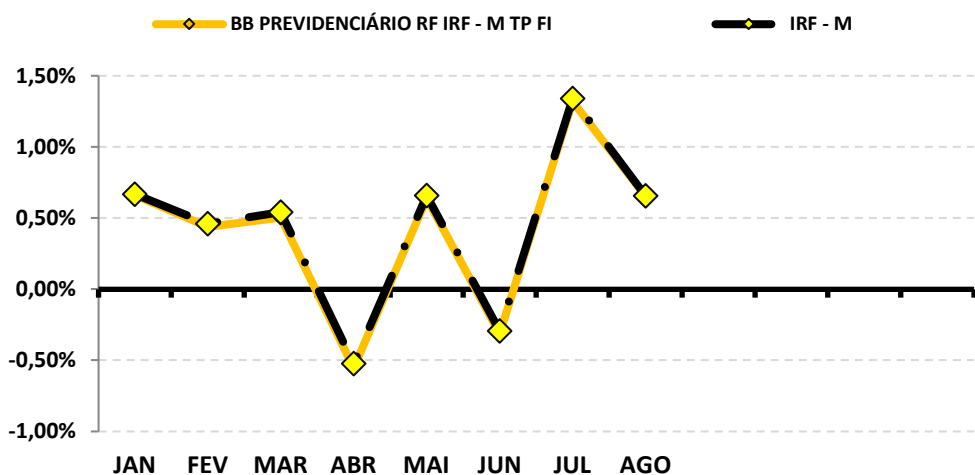


Continuação....

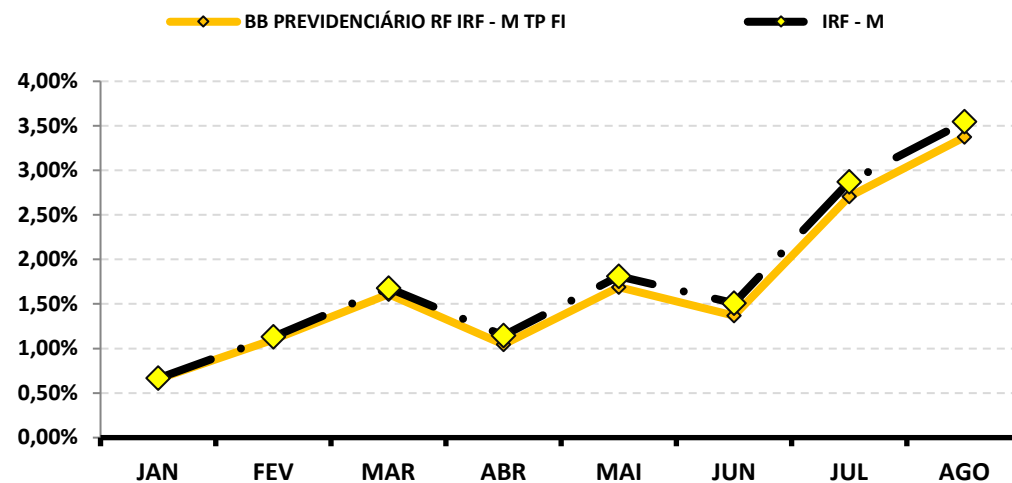
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao IRF - M

Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL									RETORNO ACUMULADO		
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	(R\$)	(%)	(R\$)	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	0,66%	0,44%	0,50%	-0,56%	0,64%	-0,32%	1,32%	0,65%		68,79	3,37%	1.083,33
IRF - M	0,67%	0,46%	0,54%	-0,52%	0,66%	-0,29%	1,34%	0,66%			3,54%	-

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada

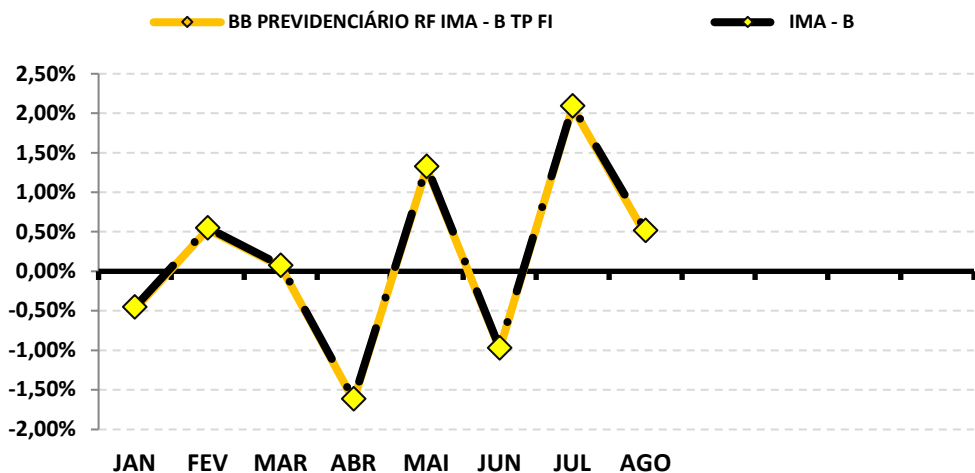


Continuação....

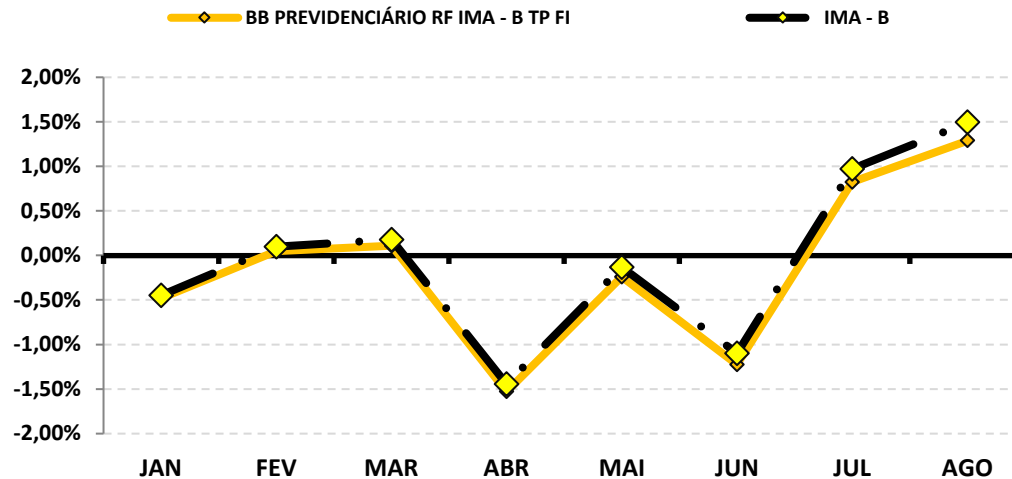
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao IMA - B

Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL										RETORNO ACUMULADO				
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO			(R\$)	(%)	(R\$)		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	-0,48%	0,53%	0,06%	-1,63%	1,31%	-0,99%	2,07%	0,46%					3.253,33	1,29%	(4.095,11)
IMA - B	-0,45%	0,55%	0,08%	-1,61%	1,33%	-0,97%	2,09%	0,52%						1,49%	-

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada



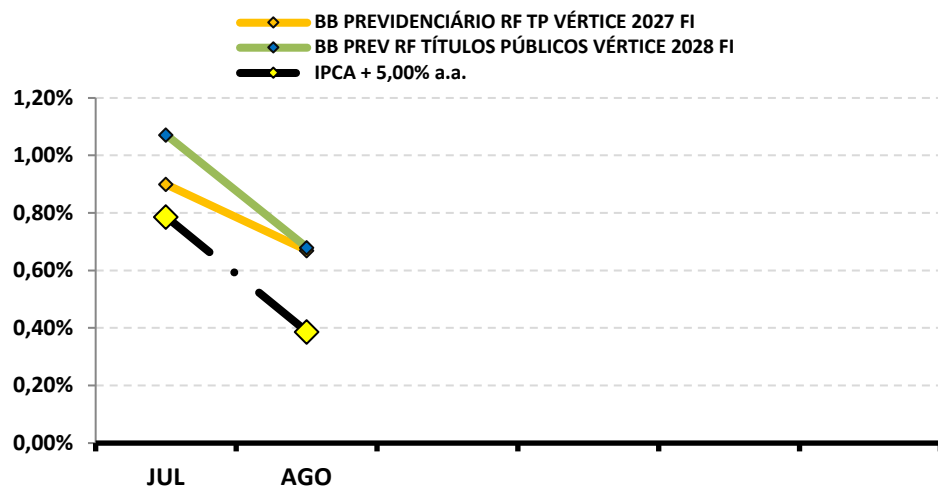
Continuação....

RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2024 - Fundos atrelados ao IPCA + 5,00% a.a.

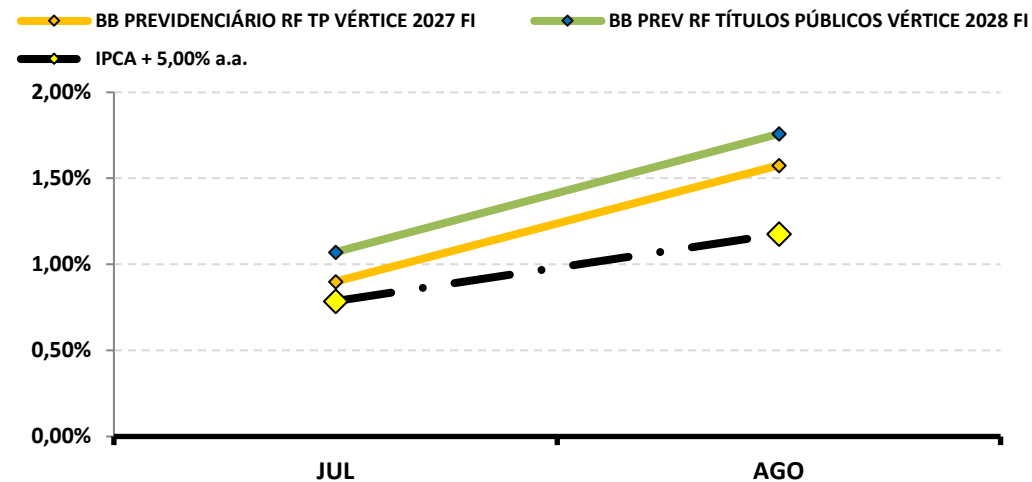
Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL												RETORNO ACUMULADO		
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO					(R\$)	(%)	(R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2027 FI	*	*	*	*	*	*	0,90%	0,67%					20.487,03	1,58%	58.777,83
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	*	*	*	*	*	*	1,07%	0,68%					9.992,86	1,76%	27.516,09
IPCA + 5,00% a.a.	*	*	*	*	*	*	0,79%	0,39%						1,18%	

*O AGUASPREV NÃO REALIZOU APLICAÇÃO NOS REFERIDOS MESES ACIMA.

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada



9-RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

9.1-RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2024 - AGUASPREV

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO				
RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA	0,67%	0,66%	0,73%	0,02%	0,95%	0,32%	1,06%	0,72%				
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%				
IBOVESPA	-4,79%	0,99%	-0,71%	-1,70%	-3,04%	1,48%	3,02%	6,54%				
META ATUARIAL	0,81%	1,22%	0,55%	0,77%	0,85%	0,60%	0,77%	0,37%				

A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DO AGUASPREV NO MÊS DE AGOSTO FOI DE:

R\$	96.920,82
------------	------------------

A META ATUARIAL NO MÊS DE AGOSTO FOI DE:

R\$	50.726,22
------------	------------------

9.2-RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2024 - AGUASPREV

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO				
RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA	0,67%	1,33%	2,08%	2,10%	3,07%	3,40%	4,49%	5,24%				
CDI	0,97%	1,78%	2,62%	3,54%	4,40%	5,22%	6,18%	7,10%				
IBOVESPA	-4,79%	-3,85%	-4,53%	-6,15%	-9,01%	-7,66%	-4,87%	1,35%				
META ATUARIAL	0,81%	2,05%	2,62%	3,41%	4,29%	4,92%	5,74%	6,13%				

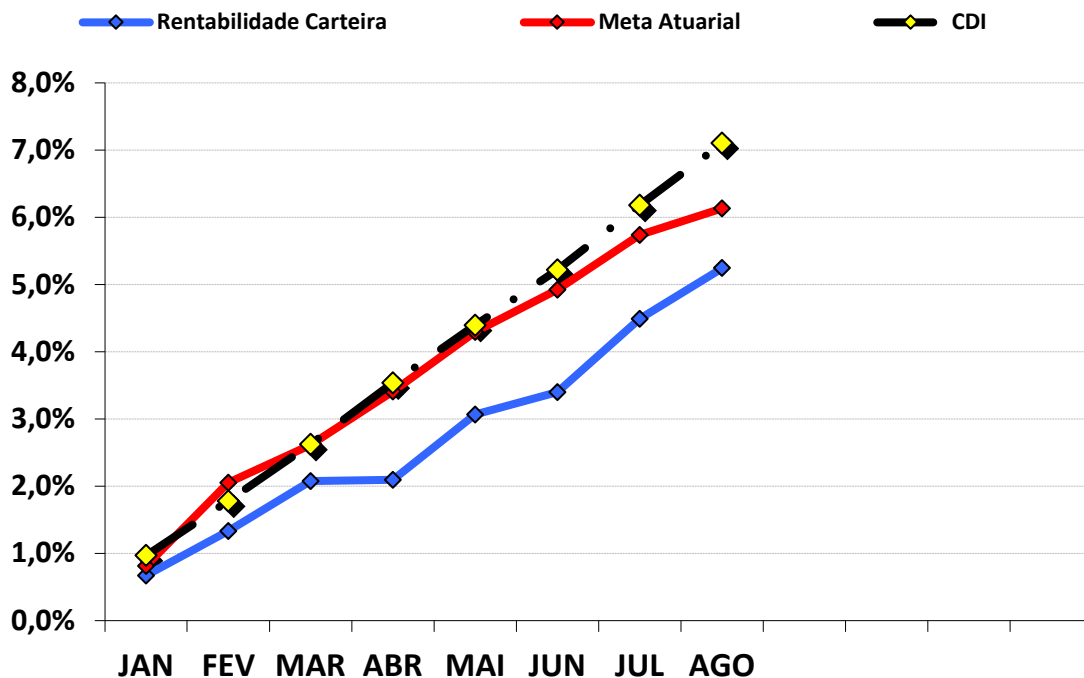
RENTABILIDADE ACUMULADA DO AGUASPREV: R\$ 688.465,37

META ATUARIAL ACUMULADA: R\$ 807.217,09

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ (118.751,72)

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

RENTABILIDADE DA CARTEIRA (Acumulada) 2024



RENTABILIDADE e ÍNDICES ACUMULADOS

	Rentabilidade Carteira	Meta Atuarial	CDI
JAN	0,67%	0,81%	0,97%
FEV	1,33%	2,05%	1,78%
MAR	2,08%	2,62%	2,62%
ABR	2,10%	3,41%	3,54%
MAI	3,07%	4,29%	4,40%
JUN	3,40%	4,92%	5,22%
JUL	4,49%	5,74%	6,18%
AGO	5,24%	6,13%	7,10%

9.3.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA

A Carteira de Investimentos do AGUASPREV, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada de 5,24% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado de 7,10% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou até o momento, uma rentabilidade de 73,86% sobre o índice de referência do mercado.

9.4-META ATUARIAL

Conforme a Política Anual de Investimentos/2024, a Meta Atuarial é uma Taxa de Juros de 4,84% a.a. mais a variação do IPCA. Até agosto/2024, o AGUASPREV não vem superando a Meta Atuarial, conforme tabela abaixo:

	RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA	META ATUARIAL ACUMULADA	GANHO SOBRE A META ATUARIAL
AGO	5,24%	6,13%	85,51%

9.4.1-PROJEÇÃO DA CARTEIRA PARA FECHAMENTO DE 2024

PROJEÇÃO - META ATUARIAL	PROJEÇÃO - RETORNO (Pessimista)	PROJEÇÃO - RETORNO (Otimista)
9,60%	9,39%	10,10%

Conforme o Boletim FOCUS, emitido pelo Banco Central em 06/09/2024, a inflação projetada (IPCA) para o final do ano deverá ficar em 4,30% e a Meta Atuarial no final de 2024 em 9,60%. Conforme nossa projeção de Retorno Pessimista e Otimista da carteira, a atual carteira do AGUASPREV poderá encontrar dificuldades para alcançar a Meta Atuarial. Essa Projeção da Carteira é melhor detalhada na página 45 do Relatório Mensal.

10-ANÁLISE DE MERCADO

10.1-TAXA SELIC

Nas reuniões nos dias 30 e 31 de julho de 2024, o COPOM decidiu manter a Taxa SELIC em 10,50% a.a. O ambiente externo continua adverso devido à incerteza sobre os impactos da flexibilização da política monetária nos EUA e a dinâmica da inflação global. Apesar disso, os Bancos Centrais das principais economias estão focados em promover a convergência das taxas de inflação para suas metas, mesmo diante das pressões do mercado de trabalho, o que exige cautela por parte dos países emergentes.

O COPOM tira como base a conjuntura macroeconômica nacional e internacional. No mercado interno, a política monetária segue cautelosa diante das incertezas do cenário global e movimentos cambiais. A atividade econômica e o mercado de trabalho mostram dinamismo acima do esperado, interferindo na conversão da inflação à meta. O comitê ressalta o impacto da política fiscal, destacando a importância de um compromisso com a sustentabilidade da dívida para ancorar as expectativas de inflação e redução de risco. O mercado de trabalho e a renda seguem em níveis altos de ocupação, indicando um ambiente apertado.

Em relação ao cenário internacional, ainda há adversidade com menor sincronia nos ciclos de queda de juros entre países avançados, causando um cenário volátil nos mercados. As autoridades monetárias indicam ciclos cautelosos, afetando a precificação dos ativos financeiros. O fluxo de capital atual reflete uma aversão global ao risco, pressionando as taxas de câmbio em economias emergentes de formas diferentes. Nos EUA, há incertezas sobre o ritmo econômico, com dados de resiliência contrastando com a desaceleração no emprego e condições financeiras apertadas. A expectativa é de uma redução global gradual na inflação e atividade, seguida por uma flexibilização monetária cautelosa. Já as economias emergentes se encontram cautelosas quanto a queda dos juros, com depreciação das taxas de câmbio. Nos países emergentes, o ciclo de queda de juros segue cauteloso ou é interrompido, enquanto as taxas de câmbio se depreciam, refletindo um cenário econômico mais desafiador.

A principal mensagem que traz a ata de reunião é que o COPOM decidiu manter a Taxa Selic em 10,50% a.a., após considerar o cenário global incerto e o contexto doméstico, caracterizado pela resiliência da atividade, aumento das projeções de inflação e expectativas desancoradas que exigem maior cautela. Essa decisão é considerada compatível com a estratégia de levar a inflação para a meta a longo prazo no horizonte relevante. O Comitê enfatiza a importância de manter uma política monetária restritiva até que a desinflação se solidifique, mas, também, até que as expectativas de inflação se ajustem dentro das metas estabelecidas

A previsão do Boletim Focus, emitido pelo Banco Central no final de dezembro/2023, projetava a taxa de juros finalizando 2024 em 9,00% a.a..

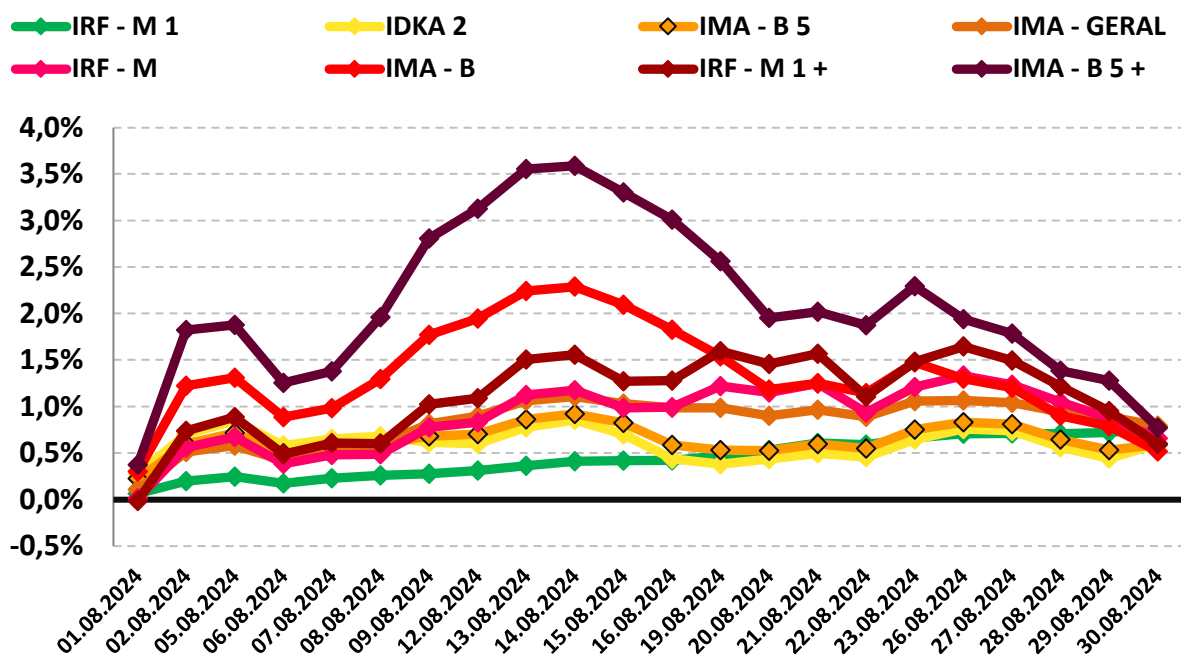
10.2-RENDA FIXA

O mês de agosto foi marcado por oscilação dos Subíndices IMA. O mês iniciou com valorização, tendo uma pequena queda ainda no início do mês, voltando a valorizar e oscilando durante as demais semanas, mas, conseguindo finalizar de forma positiva.

O destaque fica por conta dos ativos Moderados e Arrojados de Médio e Longo Prazo. Somente os índices IMA – GERAL e IMA – B 5+, iniciaram o mês rentabilizando 0,11% e 0,37%, respectivamente, conseguindo maior valorização e finalizando o mês com retorno de 0,79% e 0,77%. Dentre os demais índices que apresentam recuperação durante o mês, destaca-se o índice Arrojado de Longo Prazo IRF – M 1+ que chegou a rentabilizar -0,02% no início do mês e conseguiu finalizar em 0,60%.

PERFIL	Conservad.	Moderado			(do menos) Arrojado (para o mais)			
ÍNDICE	IRF – M 1	IDKA 2	IMA – B 5	IMA – GERAL	IRF – M	IMA – B	IRF – M 1+	IMA – B 5+
AGOSTO	0,77%	0,60%	0,59%	0,79%	0,66%	0,52%	0,60%	0,77%
Acumulado/2024	6,30%	4,60%	4,88%	4,63%	3,54%	1,49%	2,39%	-1,21%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



10.3-RENDA VARIÁVEL - AÇÕES BRASILEIRAS

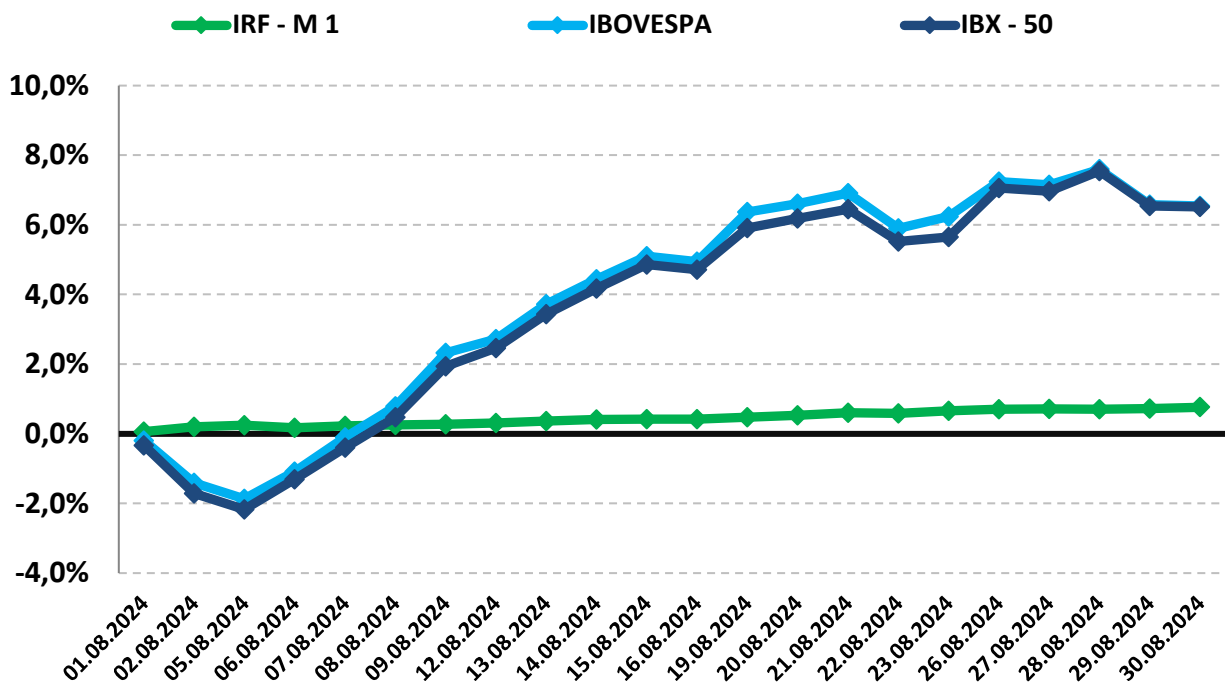
O segmento de Renda Variável iniciou o mês de agosto com desvalorização, tomando força ainda no início do mês, valorizando durante o mês e fechando de forma positiva. As expectativas sobre a taxa de juros americana movimentaram o mercado financeiro, fazendo com que o início do mês fosse tomado de apreensão com o risco de uma resseção na economia, mas voltando a mostrar expectativas otimistas após analisarem novos dados da economia dos EUA.

O índice IBOVESPA, principal indicador de ações negociadas na Bolsa brasileira fechou o mês com variação positiva de 6,54% aos 136.004,01 pontos. O índice acumula a variação positiva de 1,35% no ano. O índice IBRX-50 que representa as 50 maiores empresas negociadas na Bolsa, finalizou o mês com uma variação positiva de 6,51% aos 22.610,27 pontos. O índice acumula uma variação positiva de 3,15% no ano.

Analisando por setor, os principais responsáveis pela valorização do IBOVESPA foram as ações de empresas ligadas ao Setor Financeiro e Seguridade negociadas na B3, com valorização de 13,06% e 8,21%, respectivamente.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)		
ÍNDICE	IRF - M 1	IBOVESPA	MELHORES DESEMPENHOS	
			SETOR FINANCEIRO	SEGURIDADE
AGOSTO	0,77%	6,54%	13,06%	8,21%
Acumulado/2024	6,30%	1,35%	1,48%	16,35%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



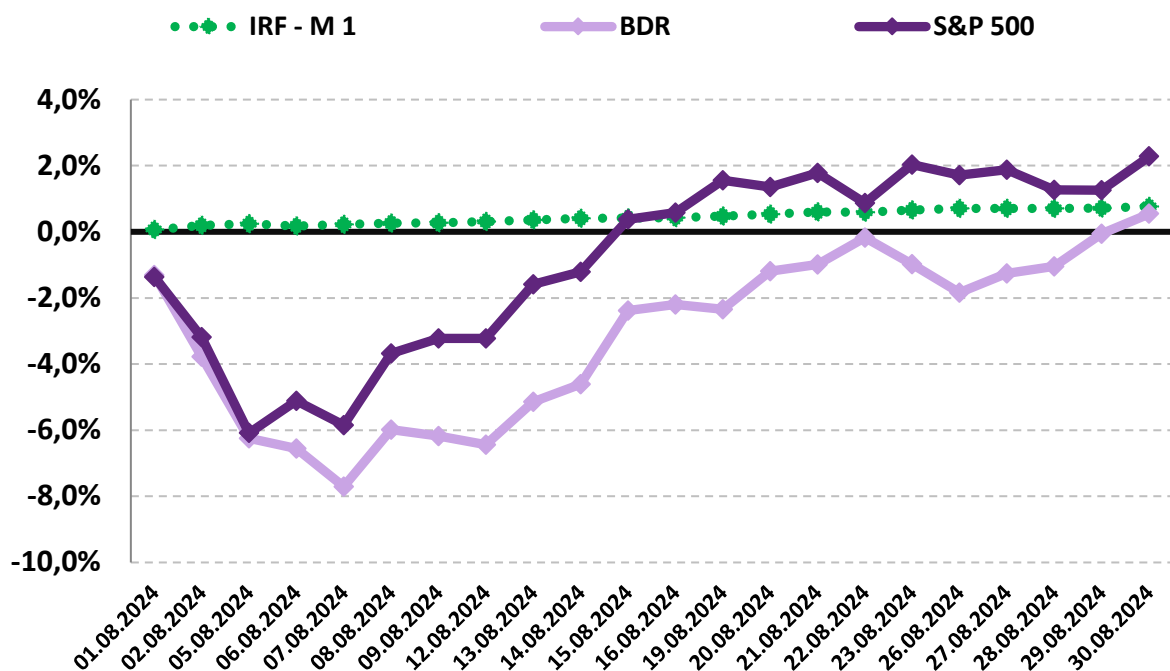
10.4-INVESTIMENTO NO EXTERIOR

O segmento de Investimentos no Exterior apresentou recuperação no mês de agosto. Os índices BDR e S&P 500 iniciaram o mês com desvalorização, conseguindo tomar força durante o mês e, apesar de sofrer pequenas oscilações, finalizaram de forma positiva.

O índice BDR, principal indicador de ações negociadas no Brasil de empresas do exterior fechou o mês com variação positiva de 0,55% com cotação de R\$ 19.887,12. O índice acumula uma variação positiva de 42,26% no ano. O índice S&P 500 que representa as 500 maiores empresas negociadas na Bolsa mundialmente, finalizou o mês com uma variação positiva de 2,28% com cotação de R\$ 5.648,40. O índice acumula uma variação positiva de 18,41% no ano.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)	
ÍNDICE	IRF – M 1	BDR	S&P 500
AGOSTO	0,77%	0,55%	2,28%
Acumulado/2024	6,30%	42,26%	18,41%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



11-ANÁLISE MACROECONÔMICA

11.1-IPCA

O IPCA de agosto/2024 (-0,02%), apresentou deflação em relação ao mês anterior (julho/2024 = 0,38%).

No ano, o IPCA registra alta de 2,85%. Nos últimos doze meses, o IPCA registra acumulação de 4,25%, abaixo dos últimos 12 meses anterior, que registrou acumulação de 4,50%.

Em agosto de 2023, o IPCA havia ficado em 0,23%.

11.1.1-MAIOR ALTA DE PREÇOS

O grupo que apresentou o maior impacto de alta no IPCA, foi o grupo EDUCAÇÃO, cujo índice apresentou inflação de 0,04%, influenciado pelos cursos regulares e subitens dos cursos superiores.

11.1.2-MENOR ALTA DE PREÇOS

O grupo que apresentou maior impacto negativo no IPCA foi o grupo ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS, cujo índice apresentou deflação de -0,09%, influenciado pelo recuo na alimentação domiciliar.

11.1.3-ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS ¹

No mês de agosto, o grupo ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS apresentou deflação de -0,09%, uma redução menor em relação ao mês anterior (julho/2024 = -0,22%). Os três produtos do grupo, com a maior alta de preços foram o Mamão (17,58% a.m. e 1,35% a.a.), a Banana-prata (11,35% a.m. e 10,05% a.a.) e a Banana-d'água (7,81% a.m. e 4,50% a.a.).

11.1.4-INFLAÇÃO POR REGIÃO

No mês, Porto Alegre - RS foi a capital que apresentou a maior inflação (0,18%), enquanto São Luiz - MA apresentou deflação de -0,54%. No mesmo período, o IPCA registra inflação de -0,02%.

Em 2024, São Luiz - MA é a capital que apresenta a maior inflação (4,10%), enquanto Aracaju - SE apresenta inflação de 2,07%. No mesmo período, o IPCA registra alta de 2,85%.

¹ O grupo Alimentação e Bebidas, que representa 21,12% do IPCA, é o maior peso entre os 9 grupos pesquisados pelo IBGE. 1% de alta dos preços deste grupo, tem uma representatividade maior do que o grupo Comunicação, por exemplo, que representa 4,80% do IPCA. Por isso, este grupo merece uma análise especial sobre o aumento de preços.

11.2-CENÁRIO ECONÔMICO EXTERNO E INTERNO

INTERNACIONAL

O mês de agosto foi marcado pelas expectativas quanto ao início do ciclo de cortes da taxa de juros americana em setembro/2024. Nos EUA, apesar da desaceleração do mercado do trabalho e da atividade, não foi previsto risco de uma recessão. A inflação americana permanece controlada, com a desaceleração atingindo os núcleos dentro da meta projetada. A desinflação agora inclui também o setor de serviços, criando condições para o início da redução dos juros. Na zona do Euro, o Banco Central da Inglaterra iniciou os cortes de juros, apesar das preocupações com a inflação de serviços, e manterá a política monetária restritiva por mais tempo. Enquanto isso, a atividade econômica fraca e a inflação de serviços desacelerando de forma lenta, faz com que o BCE aponte cortes de juros em setembro/2024. Na China, existem atrasos quanto às medidas de estímulos direcionados ao setor de infraestrutura e imobiliário, já anunciados. Além disso, a questão tarifária entrou em relevância após aumento cogitado dos EUA de 60% para China e 10% para demais regiões, afetando a triangulação dos produtos chineses. Na América Latina, a inflação no México caiu abaixo das expectativas em agosto e, apesar da desvalorização do peso, o Banxico deve continuar com cortes graduais da taxa de juros. No Chile, houve superávit comercial, com exportações desacelerando e importações caindo. O mercado de trabalho segue fraco, e as expectativas da inflação seguem acima da meta. Na Colômbia, a inflação desacelerou, impulsionada pela queda nos preços dos alimentos e é esperado novos cortes nos juros pelo Banco Central. Na Argentina, o setor de construção se expandiu mensalmente, mas caiu significativamente em comparação de forma anual e a atividade econômica cresceu, diante dos dados positivos pelo setor de mineração.

BRASIL

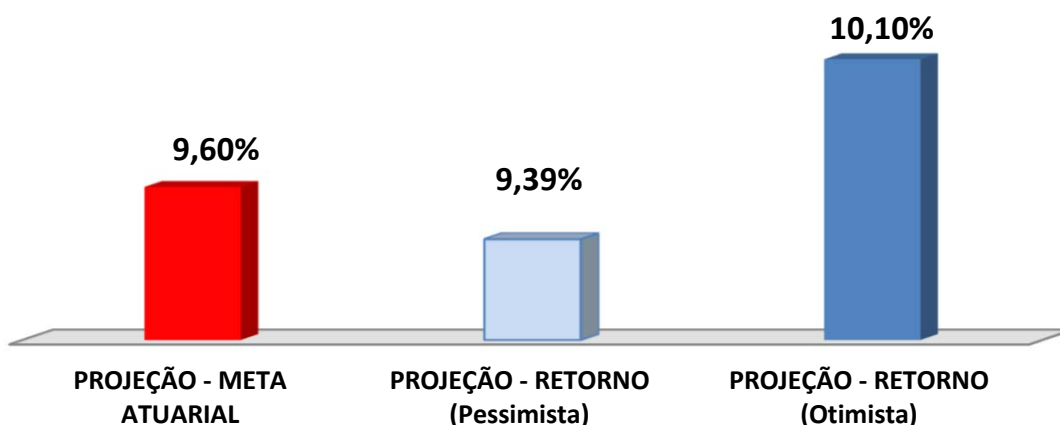
Em agosto, o cenário doméstico foi marcado pelo possível aumento na Taxa Selic durante o ano, impulsionada por uma taxa de câmbio desvalorizada, expectativas de inflação acima da meta e uma atividade econômica robusta. A balança comercial voltou a se estabilizar depois de ter perdido força no início do ano, embora menor se comparado ao final de 2023. No cenário fiscal, houve forte arrecadação, mas os riscos fiscais permanecem elevados devido ao crescimento dos gastos obrigatórios e dificuldades em melhorar os resultados primários. A taxa de juros ainda segue em destaque, tendo o Banco Central garantindo a possibilidade de aumento da Taxa Selic, caso seja necessário para a convergência da inflação para a meta, conforme a última reunião do COPOM em julho/2024. Essa decisão reflete o cenário mais cauteloso quanto às projeções da inflação e a desvalorização do câmbio diante das incertezas quanto ao cenário fiscal do país e o cenário econômico externo.

12-PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA

Conforme o último Boletim FOCUS, emitido pelo Banco Central em 06/09/2024, a inflação projetada para o final do ano deverá ficar em 4,30% e a Meta Atuarial aproximadamente em 9,60%.

Se não tivermos grandes oscilações no mercado e a distribuição permanecer nos mesmos índices, conforme demonstra a página 17, a carteira deverá rentabilizar entre 9,39% a 10,10% no final do ano, podendo encontrar dificuldades para alcançar a Meta Atuarial.

Projeção da Carteira



As recomendações e as análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Parecer.



Igor França Garcia
Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM

ANEXO I - RENTABILIDADE MENSAL DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

CNPJ	Fundos de Investimento	RETORNO MENSAL											
		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO				
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI	0,88%	0,73%	0,75%	0,80%	0,75%	0,71%	0,82%	0,79%				
13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,97%	0,80%	0,85%	0,88%	0,83%	0,79%	0,97%	0,89%				
42.592.315/0001-15	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	0,74%	0,61%	0,63%	0,66%	0,62%	0,58%	0,67%	0,64%				
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	0,71%	0,44%	0,88%	-0,26%	1,05%	0,26%	0,76%	0,64%				
03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	0,66%	0,58%	0,75%	-0,22%	1,03%	0,37%	0,89%	0,52%				
35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,85%	0,77%	0,77%	0,28%	0,72%	0,38%	1,04%	0,95%				
46.134.096/0001-81	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2027 FI	*	*	*	*	*	*	0,90%	0,67%				
44.345.590/0001-60	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,11%	0,73%	0,92%	0,79%	0,89%	1,16%	0,98%	0,92%				
49.963.751/0001-00	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	*	*	*	*	*	*	1,07%	0,68%				
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	0,66%	0,44%	0,50%	-0,56%	0,64%	-0,32%	1,32%	0,65%				
07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	-0,48%	0,53%	0,06%	-1,63%	1,31%	-0,99%	2,07%	0,46%				
19.196.599/0001-09	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	0,93%	0,77%	0,82%	0,62%	0,76%	0,58%	0,90%	0,77%				

*O AGUASPREV NÃO REALIZOU APLICAÇÃO NOS REFERIDOS MESES ACIMA.