



R.I. Relatório de Investimentos

SETEMBRO/2024

JUSPREV 

Apresentação

A Lâmina de Rentabilidade consolida as informações enviadas pelas Gestoras de Ativos ICATU - Icatu Asset Management e Somma Investimentos S.A. e é disponibilizada mensalmente no site da JUSPREV para que os participantes possam acompanhar o desempenho dos fundos de investimentos. É destinado exclusivamente aos recursos aplicados pela JUSPREV e atende às exigências da Política de Investimentos e da Resolução CMN 4661.

Objetivo

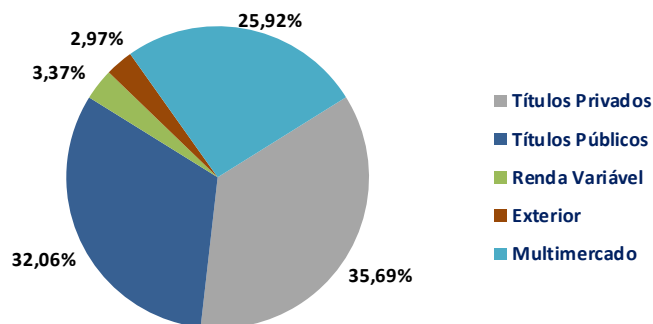
O objetivo do plano é proporcionar valorização superior ao INPC + 4,35% a.a. que é a meta atuarial. A aplicação dos recursos é realizada por meio de fundos de investimento que investem diretamente em títulos e/ou em fundo de renda fixa, renda variável, multimercado e estruturados. A alocação dos recursos respeita os critérios de composição e diversificação definidos na legislação em vigor e estabelecidos no regulamento de cada fundo.

Performance dos Investimentos

Fundos de Investimentos	Patrimônio		Gestor	Rentabilidade					
				1M	12M	24M	36M	48M	60M
ICATU VANG FC FI MULT CRED PRIV JUSPREV ¹	238.971.525,59	39,53%	Icatu Asset Management	0,66%	11,75%	23,40%	31,88%	38,31%	40,07%
SOMMA JUSPREV ATIVO FI MULT CRED PRIV ²	239.230.712,55	39,57%	Somma Investimentos S.A.	0,72%	11,53%	21,12%	31,30%	36,81%	37,52%
SOMMA JUSPREV ALM FI MULT	76.056.964,73	12,58%	Somma Investimentos S.A.	0,65%	10,07%	22,19%	39,07%	61,53%	75,88%
BTG JUSPREV FIMULTIMERCADO CRED PRIV	50.307.126,31	8,32%	BTG Pactual Gestão de Recursos LTDA	0,46%	-	-	-	-	-
TOTAL JUSPREV	604.566.329,18	100%		0,60%	10,55%	20,73%	31,06%	40,35%	43,41%

¹O Icatu Vanguarda assumiu a Gestão do Fundo a partir de 02/10/2017. Anterior a esta data, a Gestão do Fundo era de responsabilidade do Bradesco Asset Management.

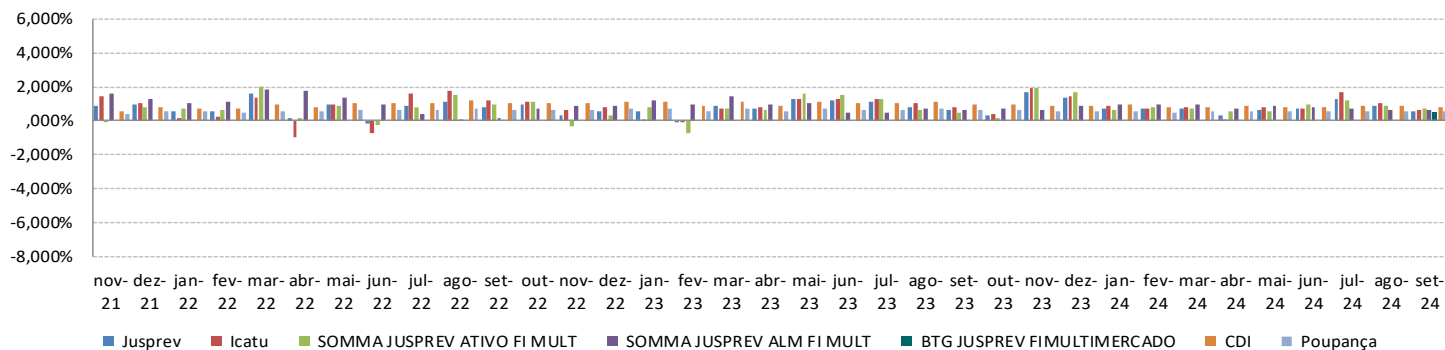
Composição



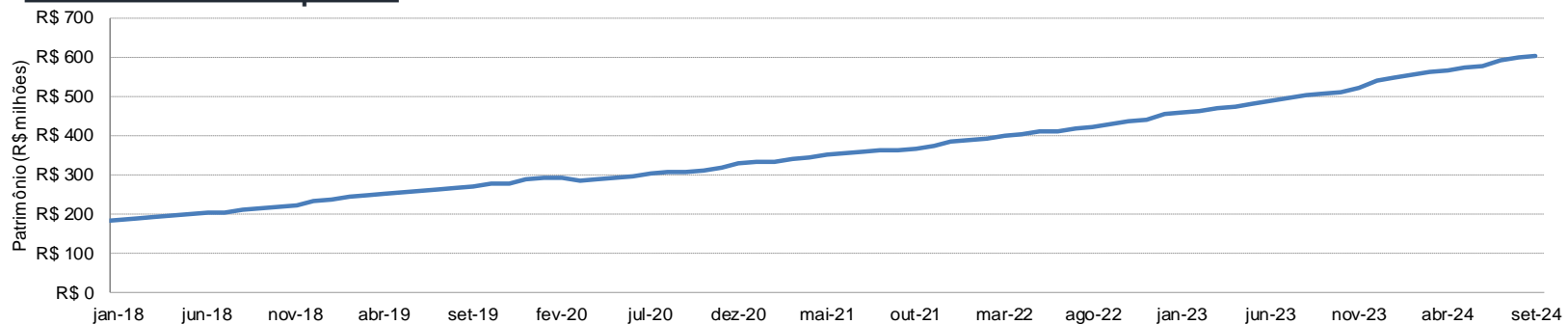
Rentabilidade Mensal Consolidada

%POUPANÇA	211,33%	127,94%	153,23%	130,99%	84,71%	173,80%	193,00%	147,22%	107,62%	220,77%	113,41%	128,64%	151,18%
2019	0,91%	0,47%	0,58%	0,76%	0,76%	0,62%	0,58%	0,32%	0,62%	0,61%	0,19%	0,93%	7,60%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,46%	0,48%	0,38%	0,37%	5,96%
%CDI	168,00%	94,56%	122,91%	147,28%	139,19%	132,62%	101,48%	63,31%	133,93%	127,73%	50,01%	248,56%	127,41%
POUPANÇA	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,34%	0,34%	0,32%	0,29%	0,29%	4,26%
%POUPANÇA	245,57%	125,63%	155,11%	205,48%	203,47%	167,36%	155,11%	92,84%	180,87%	194,15%	66,26%	324,40%	178,40%
2020	0,46%	-0,39%	-3,41%	1,05%	0,83%	0,87%	1,16%	0,38%	-0,44%	0,16%	1,57%	1,53%	3,74%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,23%	0,21%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	2,76%
%CDI	122,33%	-133,26%	-1006,90%	368,67%	392,49%	407,64%	599,25%	237,71%	-277,49%	103,71%	1053,37%	929,08%	135,70%
POUPANÇA	0,26%	0,26%	0,26%	0,22%	0,22%	0,17%	0,13%	0,13%	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	2,11%
%POUPANÇA	178,02%	-151,25%	-1316,48%	485,86%	424,69%	499,45%	893,77%	291,70%	-375,82%	140,46%	1358,67%	1318,29%	177,07%
2021	0,43%	-0,10%	0,88%	0,94%	0,89%	0,57%	-0,03%	-0,01%	-0,02%	-0,21%	0,91%	0,95%	5,33%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	4,42%
%CDI	286,43%	-70,64%	437,15%	452,76%	330,82%	186,66%	-8,28%	-2,32%	-3,74%	-43,25%	155,72%	123,34%	120,53%
POUPANÇA	0,12%	0,12%	0,12%	0,16%	0,16%	0,20%	0,24%	0,24%	0,30%	0,36%	0,44%	0,56%	3,06%
%POUPANÇA	369,45%	-82,00%	758,46%	591,71%	562,43%	284,54%	-12,03%	-4,06%	-5,48%	-58,79%	207,09%	169,15%	174,32%
2022	0,54%	0,59%	1,65%	0,12%	0,99%	-0,14%	0,92%	1,13%	0,80%	0,97%	0,29%	0,60%	8,79%
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	1,03%	1,02%	1,12%	12,40%
%CDI	74,03%	78,28%	177,69%	14,67%	95,82%	-14,11%	88,70%	97,01%	74,76%	94,22%	28,87%	53,30%	70,90%
POUPANÇA	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,65%	0,65%	0,66%	0,74%	0,68%	0,65%	0,65%	0,71%	7,90%
%POUPANÇA	96,67%	118,21%	275,65%	22,01%	152,73%	-22,07%	138,26%	152,86%	117,62%	149,28%	45,19%	84,29%	111,26%
2023	0,55%	-0,10%	0,85%	0,71%	1,30%	1,20%	1,10%	0,77%	0,61%	0,29%	1,69%	1,41%	10,86%
CDI	1,12%	0,92%	1,14%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,01%
%CDI	49,32%	-11,33%	74,21%	77,39%	115,64%	112,18%	102,79%	67,46%	62,70%	28,87%	183,36%	156,80%	83,48%
POUPANÇA	0,71%	0,58%	0,74%	0,58%	0,72%	0,68%	0,66%	0,72%	0,61%	0,61%	0,58%	0,57%	8,04%
%POUPANÇA	77,91%	-17,83%	114,27%	122,23%	180,94%	176,64%	167,23%	107,18%	99,60%	47,51%	291,91%	246,87%	135,11%
2024	0,73%	0,75%	0,73%	0,32%	0,64%	0,76%	1,31%	0,85%	0,60%				6,90%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%				7,99%
%CDI	75,80%	93,26%	88,09%	36,00%	76,92%	96,59%	144,60%	98,43%	72,08%				86,41%
POUPANÇA	0,59%	0,51%	0,53%	0,60%	0,59%	0,54%	0,57%	0,57%	0,57%				5,18%

Rentabilidade Mensal



Patrimônio Líquido



Histórico de Desempenho

Histórico de Desempenho

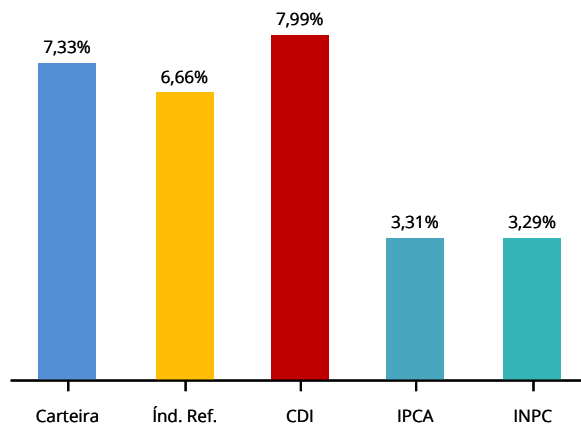
Início Período Considerado	6-ago-08	
	12 meses	Desde o Início
Melhor Mês da JUSPREV	1,69%	2,10%
Melhor Mês do INPC + 4,35%	1,13%	2,09%
Melhor Mês do INPC + 6%	1,25%	2,23%
Pior Mês da JUSPREV	0,29%	-3,41%
Pior Mês do INPC + 4,35%	0,23%	-0,25%
Pior Mês do INPC + 6%	0,37%	-0,12%
% de meses acima de INPC + 4,35%	53,85%	40,41%
% de meses acima de INPC + 6%	53,85%	35,75%
% de meses acima de CDI	23,08%	37,82%

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: No panorama global, o movimento dos mercados foi praticamente afetado pelos desdobramentos nos EUA. O país apresentou indicadores mais fracos do emprego que fizeram o mercado aumentar as chances de uma recessão. Essa dinâmica teve como consequência um movimento de aversão ao risco e provocou um fechamento da curva de juros. Todavia, as revisões no PIB e o crescimento forte do varejo mostraram que a economia segue resiliente. Nesse sentido, a desaceleração no mercado de trabalho passou a ser interpretada como uma moderação “saudável” e afastou os temores de uma recessão. O alívio no mercado de trabalho e a inflação em linha com o esperado permitiram o presidente do FED a deixar claro que o início do ciclo de cortes está próximo.

Economia Brasileira: O principal destaque foi a condução da política monetária. A ata da última reunião do Copom e, principalmente, a comunicação em tom exacerbado dos diretores da autarquia fizeram com que o mercado aumentasse a probabilidade de uma trajetória de forte alta da Selic. Aliado a isso, um IPCA não tão bom, as expectativas de inflação desancoradas e o câmbio estacionado em um patamar incômodo reforçaram as apostas de um ciclo de alta da Selic. Da nossa parte, seguimos esperando manutenção dos juros no patamar atual até o fim do ano. Encontramos valor em manter as taxas estáveis, dado que já estão restritivas. Por fim, também houve a indicação de Gabriel Galpôlo à presidência do BC.

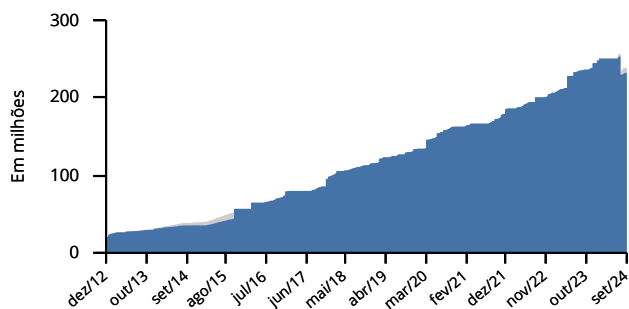
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



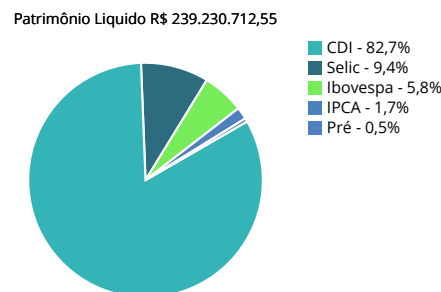
Mês	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	Mai-24	Jun-24	Jul-24	Ago-24	Set-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev Ativo	0,18	1,97	1,72	0,67	0,82	0,71	0,54	0,58	0,93	1,24	0,89	0,72	7,33	11,53	21,12
Índ. Ref.	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,53	0,74	0,82	0,59	0,65	0,23	0,84	6,66	8,60	18,28
CDI	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	0,91	0,87	0,83	7,99	11,06	25,99
IPCA	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	0,38	0,46	0,21	0,38	(0,02)	0,44	3,31	4,42	9,84

Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

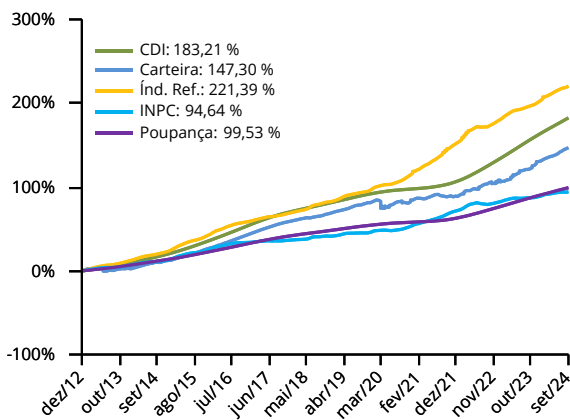
EVOLUÇÃO PATRIMONIAL



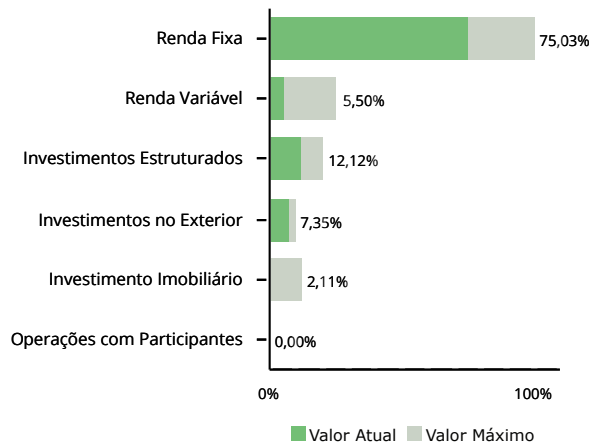
DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





SOMMA JUSPREV ATIVO FIM CRED PRIV
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
SETEMBRO DE 2024



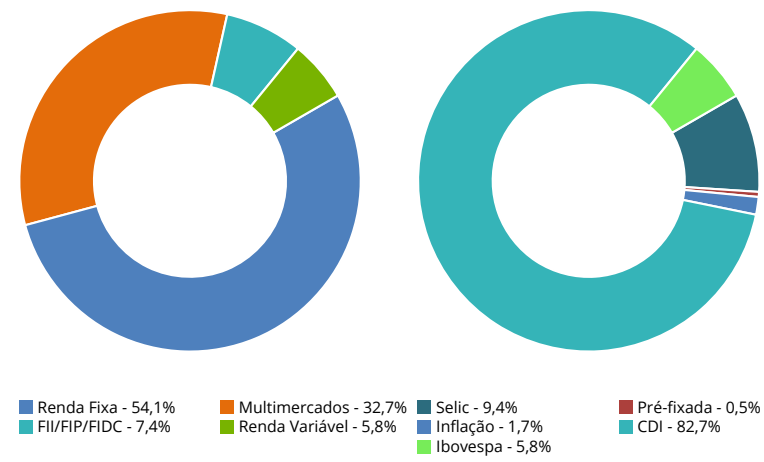
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	4
Política de Investimento	5
Análise de Rentabilidade.....	6
Retorno da Carteira (R\$)	7
Rentabilidade da Carteira (%).....	9
Relatório de Movimentações	10

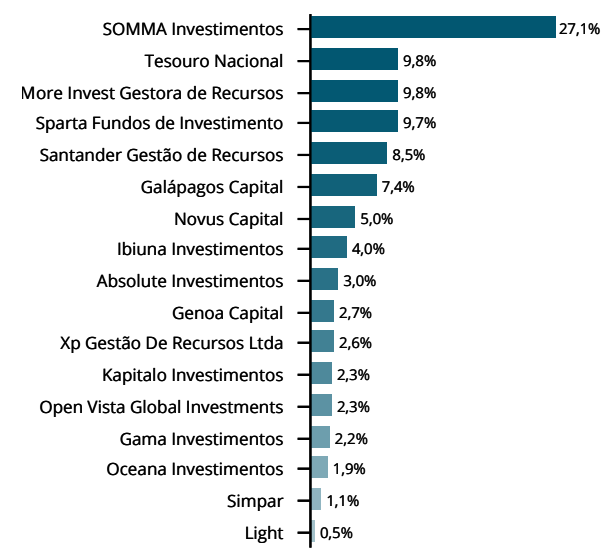


ATIVOS	SETEMBRO-24	%	AGOSTO-24	%
RENDA FIXA	27.541.074,46	11,5%	28.967.470,04	12,2%
Compromissada - Títulos Públicos	1.145.280,81	0,5%	20.799.733,78	8,8%
Debênture - JSL (JSMLB5)	-	0,0%	2.866.942,36	1,2%
Debênture - Light (LIGHD7)	1.246.275,00	0,5%	1.289.340,00	0,5%
Debênture - Simpar (JSMLB5)	2.743.283,09	1,1%	-	0,0%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	2.227.814,41	0,9%	4.011.453,90	1,7%
Letras Financeiras do Tesouro Nacional	20.178.421,15	8,4%	-	0,0%
FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555	193.972.013,47	81,1%	191.095.420,35	80,5%
Absolute Vertex II FIC FIM	7.249.190,93	3,0%	5.205.869,58	2,2%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	6.346.860,96	2,7%	6.251.131,01	2,6%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	4.814.534,27	2,0%	4.790.271,32	2,0%
IBIUNA LS FP FICM	4.822.519,29	2,0%	4.787.536,21	2,0%
Kapitalo K10 FIC FIM	5.574.007,55	2,3%	5.447.807,11	2,3%
MCA Institucional FIC FIM CP	23.454.257,71	9,8%	23.173.580,90	9,8%
Novus Institucional FI RF LP	11.848.193,79	5,0%	11.722.971,45	4,9%
OAKTREE Global Credit IE FIM	5.335.443,55	2,2%	5.277.694,61	2,2%
Oceana Valor 30 FIC FIA	4.639.130,89	1,9%	4.762.728,12	2,0%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	5.492.173,17	2,3%	5.579.237,93	2,3%
Santander Bancos RF CP	20.214.924,02	8,4%	20.031.394,52	8,4%
SOMMA Firenze RF CP	23.313.167,77	9,7%	23.089.537,01	9,7%
SOMMA Fundamental FIA	3.043.698,23	1,3%	3.280.948,50	1,4%
SOMMA Institucional FIM	7.605.911,58	3,2%	7.540.360,26	3,2%
SOMMA Positano FIC FIM CP	2.136.054,10	0,9%	2.116.812,18	0,9%
SOMMA Real Estate FIC FIM	5.363.672,79	2,2%	5.512.471,41	2,3%
SOMMA Torino RF CP	23.303.732,15	9,7%	23.075.576,91	9,7%
Sparta Top Renda Fixa FICFI	23.292.585,65	9,7%	23.053.979,62	9,7%
XP Investor FIA	6.121.955,07	2,6%	6.395.511,70	2,7%
OUTROS FUNDOS DE INVESTIMENTO (FII/FIP/FIDC)	17.677.821,58	7,4%	17.522.099,71	7,4%
Galapagos Sea Lion FIC FIDC	17.677.821,58	7,4%	17.522.099,71	7,4%
DERIVATIVOS	(9.102.440,18)	-3,8%	(12.309.966,36)	-5,2%
Futuros WDO ¹	-	0,0%	-	0,0%
Futuros WIN ¹	(11.083.771,60)	-4,6%	(14.310.475,20)	-6,0%
Futuros WSP ¹	1.981.331,42	0,8%	2.000.508,84	0,8%
TESOURARIA	39.803,03	0,0%	(64.794,40)	0,0%
Caixa	-	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	39.803,03	0,0%	(65.794,40)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	239.230.712,54	100%	237.520.195,70	100%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



INSTITUIÇÃO²



¹O saldo deste item não é considerado no somatório do PL.

²Não estão incluídas ações e opções

RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Compromissada - Títulos Públicos	Curva	30/09/2024	01/10/2024	10,64% a.a.	1.145.280,81	1.145.280,81	-	1.145.280,81	0,48%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	18/09/2024	15/10/2026	IPCA + 5,25%	-	467.950,00	-	467.950,00	0,20%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	18/09/2024	15/10/2026	IPCA + 5,25%	-	467.950,00	-	467.950,00	0,20%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	18/09/2024	15/10/2026	IPCA + 5,25%	-	467.950,00	-	467.950,00	0,20%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	18/09/2024	15/10/2026	IPCA + 5,25%	-	467.950,00	-	467.950,00	0,20%
Debênture - Simpar (JSMLB5)	Mercado	18/09/2024	15/09/2031	IPCA + 9,43%	-	243.346,67	-	243.346,67	0,10%
Debênture - Simpar (JSMLB5)	Mercado	18/09/2024	15/09/2031	IPCA + 9,43%	-	243.346,67	-	243.346,67	0,10%
Debênture - Simpar (JSMLB5)	Mercado	18/09/2024	15/09/2031	IPCA + 9,43%	-	243.346,67	-	243.346,67	0,10%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	18/09/2024	01/03/2026	100% Selic	214.780,96	215.696,52	-	215.696,52	0,09%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	18/09/2024	01/03/2028	100% Selic	2.002.954,92	2.012.117,89	-	2.012.117,89	0,84%
Letras Financeiras do Tesouro Nacional	Mercado	18/09/2024	01/03/2030	100% Selic	20.078.898,48	20.178.421,15	-	20.178.421,15	8,44%
TOTAL						27.541.074,46	-	27.541.074,46	11,51 %

FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555									
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL		
Absolute Vertex II FIC FIM	Absolute Investimentos	D+29	2.529.258,7323096	2,8661326	-	7.249.190,93	3,03%		
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	Genoa Capital	D+31	3.888.478,5895897	1,6322222	-	6.346.860,96	2,65%		
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	Ibiuna	D+31	35.831,2085760	134,3670633	-	4.814.534,27	2,01%		
IBIUNA LS FP FICM	Ibiuna	D+31	42.956,1041370	112,2662165	-	4.822.519,29	2,02%		
Kapitalo K10 FIC FIM	Kapitalo Investimentos	D+30	2.609.841,1044542	2,1357651	-	5.574.007,55	2,33%		
MCA Institucional FIC FIM CP	More Invest Gestora de Recursos	D+90	19.905.874,3649340	1,1782581	-	23.454.257,71	9,81%		
Novus Institucional FI RF LP	Novus Capital	D+4	7.930.986,1488155	1,4939118	-	11.848.193,79	4,95%		
OAKTREE Global Credit IE FIM	Gama Investimentos	D+12	3.117.553,9475597	1,7114198	-	5.335.443,55	2,23%		
Oceana Valor 30 FIC FIA	Oceana Investimentos	D+30	724.021,6332701	6,4074479	-	4.639.130,89	1,94%		
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	SOMMA Investimentos	D+6	29.043,4841458	189,1017324	-	5.492.173,17	2,30%		
Santander Bancos RF CP	Santander Gestão de Recursos	D+31	1.885.783,1141040	10,7196442	-	20.214.924,02	8,45%		
SOMMA Firenze RF CP	SOMMA Investimentos	D+32	18.290.061,9672660	1,2746358	-	23.313.167,77	9,75%		
SOMMA Fundamental FIA	SOMMA Investimentos	D+5	21.784,5419010	139,7182575	-	3.043.698,23	1,27%		
SOMMA Institucional FIM	SOMMA Investimentos	D+5	2.224.635,1209972	3,4189479	-	7.605.911,58	3,18%		
SOMMA Positano FIC FIM CP	SOMMA Investimentos	D+360	1.332,3973746	1.603,1659455	-	2.136.054,10	0,89%		
SOMMA Real Estate FIC FIM	SOMMA Investimentos	D+60	4.166,9687883	1.287,1881375	-	5.363.672,79	2,24%		
SOMMA Torino RF CP	SOMMA Investimentos	D+1	14.316.970,0474360	1,6277000	-	23.303.732,15	9,74%		
Sparta Top Renda Fixa FICFI	Sparta Fundos de Investimento	D+32	6.942.833,5257248	3,3549106	-	23.292.585,65	9,74%		
XP Investor FIA	Xp Gestão De Recursos Ltda	D+3	450.411,0523329	13,5919291	-	6.121.955,07	2,56%		
TOTAL					-	193.972.013,47	81,10 %		

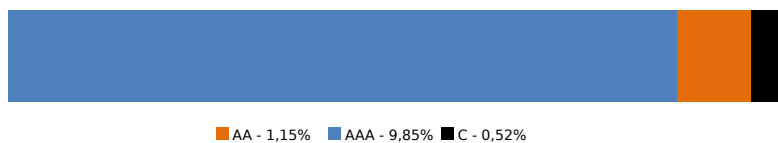
OUTROS FUNDOS DE INVESTIMENTO (FII/FIP/FIDC)									
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL		
Galapagos Sea Lion FIC FIDC	Galápagos Capital	D+91	17.391.707,1290270	1,0164512	-	17.677.821,58	7,39%		
TOTAL					-	17.677.821,58	7,39 %		

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano			
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	75,03%	24,97%
Títulos Públicos Federais	100,00%	29,56%	70,44%
CDI/CDBs	80,00%	0,62%	79,38%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	9,16%	70,84%
Debêntures	80,00%	16,18%	63,82%
DPGE	20,00%	0,23%	19,77%
FIDC	20,00%	19,04%	0,96%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,24%	19,76%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	5,50%	19,50%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	5,50%	19,50%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	10,01%	9,99%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	10,01%	4,99%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	7,35%	2,65%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	7,35%	2,65%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	2,11%	7,89%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	2,11%	7,89%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

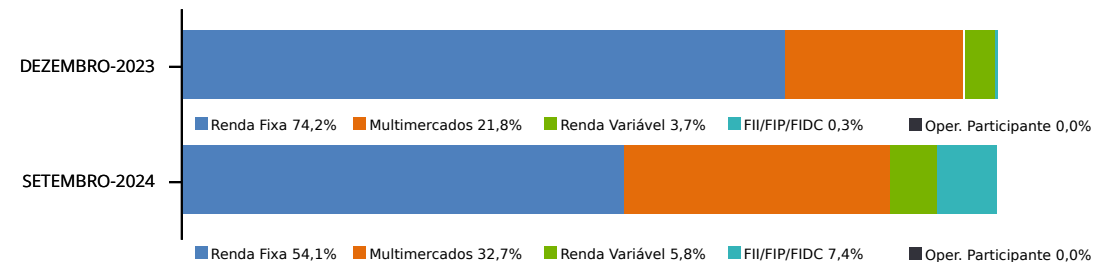
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹			
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	9,85%	FITCH MOODY'S S&P AUSTIN
Tesouro Nacional	100,00%	9,85%	- - brAAA -
Alta Segurança (AA)	100,00%	1,15%	FITCH MOODY'S S&P AUSTIN
Debênture - Simpar (JSMLB5)	25,00%	1,15%	AA+(bra) AA+.br brAA+ -
Risco Substancial (C)	0,00%	0,52%	FITCH MOODY'S S&P AUSTIN
Debênture - Light (LIGHD7)	25,00%	0,52%	D(bra) - brD -

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Compromissada - Títulos Públicos	6,71	801,6%	14,28	214,4%	-	-
Debênture - Light (LIGHD7)	-3,34	-	-21,94	-	-11,73	-
Letra Financeira do Tesouro Nacional	0,88	105,1%	-	-	-	-
Novus Institucional FI RF LP	1,07	127,6%	-	-	-	-
Santander Bancos RF CP	0,92	109,4%	-	-	-	-
SOMMA Firenze RF CP	0,97	115,7%	9,58	143,8%	13,16	153,0%
SOMMA Torino RF CP	0,99	118,1%	9,45	141,9%	13,06	151,9%
Sparta Top Renda Fixa FICFI	1,04	123,6%	-	-	-	-

Multimercados	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
	Absolute Vertex II FIC FIM	0,51	51,0%	-	-	-
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	1,53	151,8%	-	-	-	-
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	0,51	50,2%	-1,39	-	4,84	44,7%
IBIUNA LS FP FICM	0,73	72,4%	3,29	39,5%	-	-
Kapitalo K10 FIC FIM	2,32	229,7%	5,37	64,5%	10,70	98,8%
MCA Institucional FIC FIM CP	1,21	120,1%	-	-	-	-
OAKTREE Global Credit IE FIM	1,09	108,5%	10,86	130,5%	17,45	161,1%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	-1,56	-	24,04	361,0%	26,18	304,4%
SOMMA Institucional FIM	0,87	86,2%	2,45	29,4%	7,55	69,7%
SOMMA Positano FIC FIM CP	0,91	90,1%	10,05	120,8%	13,84	127,8%
SOMMA Real Estate FIC FIM	-2,70	-	1,37	20,6%	4,17	48,5%

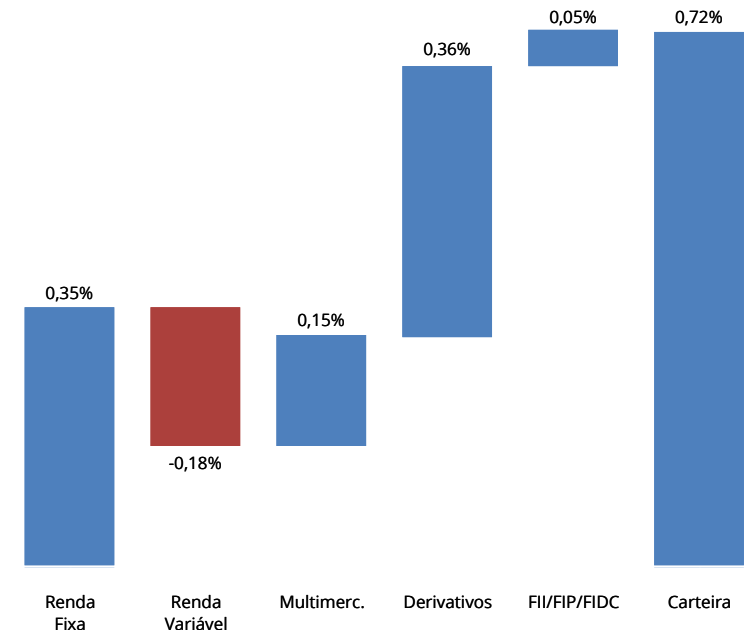
FII/FIP/FIDC	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
	Galapagos Sea Lion FIC FIDC	0,89	106,2%	-	-	-

Renda Variável	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench
	Oceana Valor 30 FIC FIA	-2,60	-3,4	-4,06	-10,7	10,63
SOMMA Fundamental FIA	-7,23	-8,1	-13,66	-20,3	-1,22	-9,8
XP Investor FIA	-4,28	-5,1	-	-	-	-

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS	NO ANO	EM 12 MESES
	%	%	%
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,84	6,66	8,60
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,84	6,66	8,60
Renda Variável (INPC + 4.35% a.a.)	0,84	6,66	8,60
Estruturados (INPC + 6.50% a.a.)	1,01	8,32	10,83
Op. com Participante (CDI)	0,83	7,99	11,06
CDI	0,83	7,99	11,06
IPCA	0,44	3,31	4,42
INPC	0,48	3,29	4,09
Ibovespa	-3,08	-1,77	13,08
Dólar	-3,68	12,53	8,80

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,78	7,67	11,22
Renda Variável	-4,70	-9,39	1,41
Investimentos Estruturados	1,12	6,10	10,69
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA

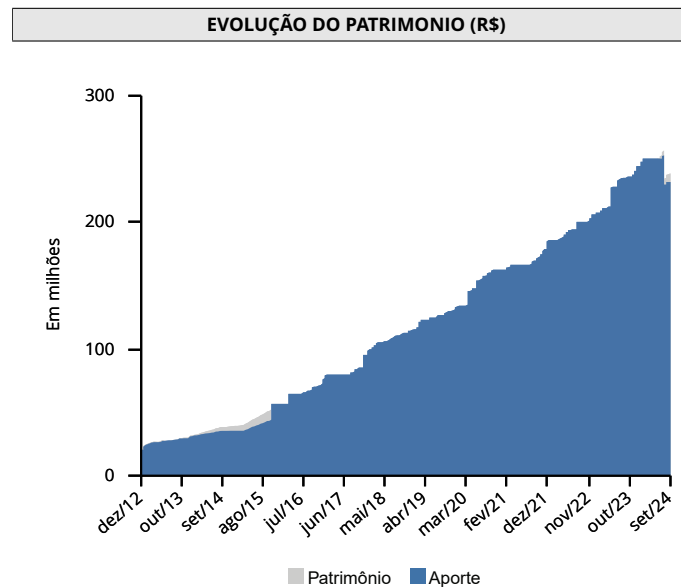
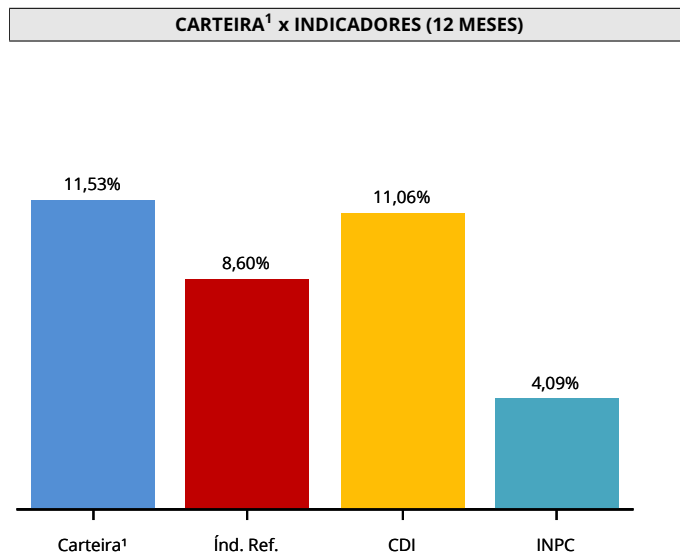
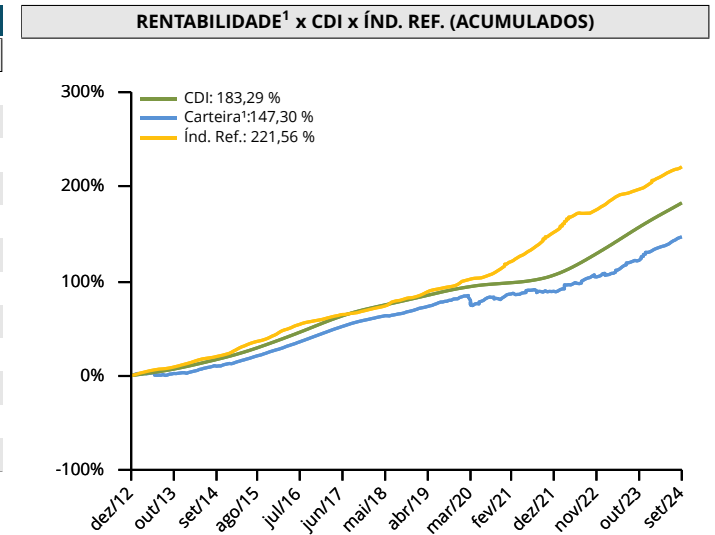


RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	1º SEM	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	NO ANO
RENDA FIXA	7.851.801,31	1.834.832,11	1.388.350,36	1.201.526,55	-	-	-	12.276.510,33
Augme Institucional FI RF CP	146.725,43	-	-	-	-	-	-	146.725,43
CDB - Banco BR Partners	36.351,56	10.810,72	10.805,33	-	-	-	-	57.967,61
Compromissada - Títulos Públicos	1.341.576,36	187.072,64	98.310,84	60.204,58	-	-	-	1.687.164,42
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	89.286,90	-	-	-	-	-	-	89.286,90
Debênture - Aegea Saneamento (AEGPA3)	5.347,05	-	-	-	-	-	-	5.347,05
Debênture - Assaí (ASAI14)	3.539,40	-	-	-	-	-	-	3.539,40
Debênture - CIA Siderúrgica (CSNAA1)	24.137,62	-	-	-	-	-	-	24.137,62
Debênture - CM Hospitalar (VVEO15)	2.468,99	-	-	-	-	-	-	2.468,99
Debênture - Cosan (CSAN33)	56.337,72	-	-	-	-	-	-	56.337,72
Debênture - JSL (JSMLB5)	59.651,60	49.147,08	23.233,83	-	-	-	-	132.032,51
Debênture - Light (LIGHD7)	(348.110,74)	76.212,00	(35.235,00)	(43.065,00)	-	-	-	(350.198,74)
Debênture - Localiza (LORTA7)	51.447,14	-	-	-	-	-	-	51.447,14
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	60.867,00	-	-	-	-	-	-	60.867,00
Debênture - Qualicorp Saúde (QUAL16)	24.013,14	-	-	-	-	-	-	24.013,14
Debênture - Rede DOr (RDORD9)	8.161,87	-	-	-	-	-	-	8.161,87
Debênture - Simpar (JSMLB5)	-	-	-	812,02	-	-	-	812,02
Debênture - Stone (MNL11)	2.161,28	-	-	-	-	-	-	2.161,28
Debênture - TIM Telefonia (TBSP11)	7.736,22	-	-	-	-	-	-	7.736,22
Debênture - Vamos (VAMO24)	21.245,03	-	-	-	-	-	-	21.245,03
Debênture - Vamos (VAMO34)	(2.880,59)	11.465,31	-	-	-	-	-	8.584,72
Debênture - Vix Logística (VIXL35)	6.136,89	-	-	-	-	-	-	6.136,89
Galápagos Albatroz FI RF LP	27.105,32	17.746,43	11.216,36	-	-	-	-	56.068,11
Letra Financeira - Banco ABC	87.690,98	25.043,89	17.223,85	-	-	-	-	129.958,72
Letra Financeira - Banco Bradesco	242.256,28	45.249,53	38.062,61	-	-	-	-	325.568,42
Letra Financeira - Banco CNH	18.270,75	4.742,14	4.982,69	-	-	-	-	27.995,58
Letra Financeira - Banco Industrial	64.225,90	22.730,45	20.938,75	-	-	-	-	107.895,10
Letra Financeira - Banco NBC	38.395,59	11.453,67	11.014,23	-	-	-	-	60.863,49
Letra Financeira - Banco Panamericano	88.265,19	25.922,33	19.471,65	-	-	-	-	133.659,17
Letra Financeira - Banco Rodobens	17.171,33	5.138,14	6.769,53	-	-	-	-	29.079,00
Letra Financeira - Banco Sicredi	28.435,71	10.417,25	10.100,61	-	-	-	-	48.953,57
Letra Financeira - Banco XP	105.713,26	22.612,95	23.459,25	-	-	-	-	151.785,46
Letra Financeira - BTG Pactual	310.450,68	119.734,03	50.048,62	-	-	-	-	480.233,33
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	121.705,27	38.226,58	16.592,43	-	-	-	-	176.524,28
Letra Financeira - Nubank	99.602,01	20.526,05	20.884,40	-	-	-	-	141.012,46
Letra Financeira - Paraná Banco	58.211,11	20.716,52	26.263,52	-	-	-	-	105.191,15
Letra Financeira do Tesouro Nacional	1.341.747,56	206.891,64	95.004,31	22.444,58	-	-	-	1.666.088,09
Letras Financeiras do Tesouro Nacional	-	-	-	161.986,50	-	-	-	161.986,50
Notas do Tesouro Nacional - Série B	490.001,80	55.321,26	28.535,72	-	-	-	-	573.858,78
Novus Institucional FI RF LP	203.617,84	87.115,17	132.238,44	125.222,34	-	-	-	548.193,79
Santander Bancos RF CP	-	-	31.394,52	183.529,50	-	-	-	214.924,02
SOMMA Firenze RF CP	1.731.097,21	233.514,71	242.844,47	223.630,76	-	-	-	2.431.087,15
SOMMA Torino RF CP	1.108.265,40	248.098,77	236.487,71	228.155,24	-	-	-	1.821.007,12
Sparta Top Renda Fixa FICFI	27.355,08	278.922,85	247.701,69	238.606,03	-	-	-	792.585,65
Valora Horizon HY FIM CP	46.017,17	-	-	-	-	-	-	46.017,17
RENDA VARIÁVEL	(1.120.424,85)	502.194,26	729.605,51	(634.404,13)	-	-	-	(523.029,21)

RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	1º SEM	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	NO ANO
Ibiúna Equities 30 FIC FIA	(70.009,91)	-	-	-	-	-	-	(70.009,91)
Oceana Valor 30 FIC FIA	(296.843,86)	114.761,70	212.228,12	(123.597,23)	-	-	-	(93.451,27)
SOMMA Fundamental FIA	(501.861,40)	90.199,15	167.389,42	(237.250,27)	-	-	-	(481.523,10)
XP Investor FIA	(251.709,68)	297.233,41	349.987,97	(273.556,63)	-	-	-	121.955,07
MULTIMERCADOS	2.366.922,14	1.114.023,20	635.078,71	511.853,38	-	-	-	4.627.877,43
Absolute Vertex II FIC FIM	-	43.533,49	62.336,09	43.321,35	-	-	-	149.190,93
Galápagos Dragon FIC FIM CP	141.230,69	28.319,29	21.663,78	-	-	-	-	191.213,76
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	175.055,38	23.226,58	52.849,05	95.729,95	-	-	-	346.860,96
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	(150.657,17)	24.488,97	33.994,17	24.262,95	-	-	-	(67.911,08)
IBIUNA LS FP FICM	(177.477,33)	357.963,68	(61.916,60)	34.983,08	-	-	-	153.552,83
Kapitalo K10 FIC FIM	81.144,92	62.686,82	14.097,05	126.200,44	-	-	-	284.129,23
KP Crédito Privado FIC FIM	53.028,07	-	-	-	-	-	-	53.028,07
MCA Institucional FIC FIM CP	840.150,70	277.540,57	261.889,63	280.676,81	-	-	-	1.660.257,71
OAKTREE Global Credit IE FIM	293.968,19	96.407,86	74.367,07	57.748,94	-	-	-	522.492,06
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	714.449,61	104.969,09	93.621,20	(87.064,76)	-	-	-	825.975,14
SOMMA Institucional FIM	7.707,74	48.770,90	61.266,68	65.551,32	-	-	-	183.296,64
SOMMA Positano FIC FIM CP	127.158,21	26.269,82	22.409,01	19.241,92	-	-	-	195.078,96
SOMMA Real Estate FIC FIM	194.764,49	27.944,34	(1.498,42)	(148.798,62)	-	-	-	72.411,79
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	94.433,71	(8.098,21)	-	-	-	-	-	86.335,50
Vista Hedge Institucional FIC FIM	(28.035,07)	-	-	-	-	-	-	(28.035,07)
FII/FIP/FIDC	126.034,32	-	122.099,71	155.721,87	-	-	-	403.855,90
FIDC Credz Sênior 8	126.034,32	-	-	-	-	-	-	126.034,32
Galapagos Sea Lion FIC FIDC	-	-	122.099,71	155.721,87	-	-	-	277.821,58
DERIVATIVOS	1.379.122,42	(298.295,14)	(697.850,63)	416.544,78	-	-	-	799.521,43
Futuros DAP	730.929,69	(82.128,12)	-	-	-	-	-	648.801,57
Futuros WDO	(5.765,40)	29.315,40	(42.860,00)	179.694,41	-	-	-	160.384,41
Futuros WIN	660.794,23	(271.840,80)	(750.580,00)	456.512,60	-	-	-	94.886,03
Futuros WSP	(6.836,10)	26.358,38	95.589,37	(219.662,23)	-	-	-	(104.550,58)
TOTAL	10.603.455,34	3.152.754,43	2.177.283,66	1.651.242,45	-	-	-	17.584.735,88

RESULTADOS DE 2024			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	0,67	0,94	70,73%
Fevereiro	0,82	1,13	72,42%
Março	0,71	0,53	134,89%
Abril	0,54	0,74	72,87%
Mai	0,58	0,82	70,67%
Junho	0,93	0,59	157,85%
Julho	1,24	0,65	190,85%
Agosto	0,89	0,23	381,74%
Setembro	0,72	0,84	86,02%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	7,33	6,66	109,93%

INDICADORES DE MERCADO				
CDI	IPCA	INPC	Ibovespa	Dólar
0,97	0,42	0,57	(4,79)	2,32
0,80	0,83	0,81	0,99	0,60
0,83	0,16	0,19	(0,71)	0,26
0,89	0,38	0,37	(1,70)	3,51
0,83	0,46	0,46	(3,04)	1,35
0,79	0,21	0,25	1,48	6,05
0,91	0,38	0,26	3,02	1,86
0,87	(0,02)	(0,14)	6,54	(0,10)
0,83	0,44	0,48	(3,08)	(3,68)
7,99	3,31	3,29	(1,77)	12,53



RESULTADOS DE 2023			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	0,84	0,83	100,94%
Fevereiro	(0,69)	1,08	-
Março	0,74	1,03	72,06%
Abril	0,66	0,84	79,01%
Mai	1,60	0,73	217,76%
Junho	1,54	0,26	603,32%
Julho	1,25	0,27	472,62%
Agosto	0,67	0,59	113,39%
Setembro	0,52	0,45	116,51%
Outubro	0,18	0,48	38,12%
Novembro	1,97	0,44	449,26%
Dezembro	1,72	0,89	193,49%
Total	11,56	8,16	141,57%

¹A rentabilidade da carteira é baseado na cota Bruta

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
03/09/2024	20.016.434,65	Compra	Letras Financeiras do Tesouro Nacional
05/09/2024	-1.806.084,07	Resgate	Letra Financeira do Tesouro Nacional
05/09/2024	2.000.000,00	Aplicação	Absolute Vertex II FIC FIM
16/09/2024	-115.585,00	Juros	Debênture - Simpar (JSMLB5)

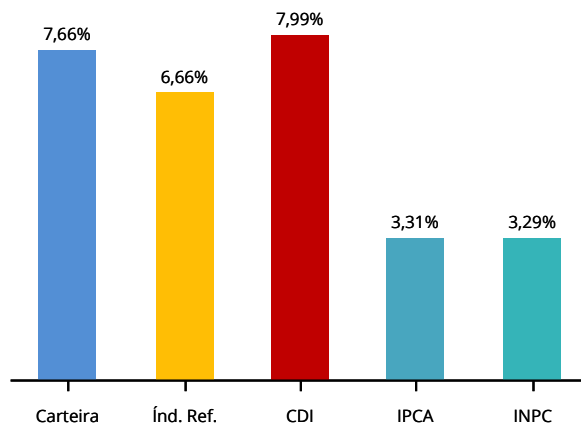
RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: No panorama global, o movimento dos mercados foi praticamente afetado pelos desdobramentos nos EUA. O país apresentou indicadores mais fracos do emprego que fizeram o mercado aumentar as chances de uma recessão. Essa dinâmica teve como consequência um movimento de aversão ao risco e provocou um fechamento da curva de juros. Todavia, as revisões no PIB e o crescimento forte do varejo mostraram que a economia segue resiliente. Nesse sentido, a desaceleração no mercado de trabalho passou a ser interpretada como uma moderação “saudável” e afastou os temores de uma recessão. O alívio no mercado de trabalho e a inflação em linha com o esperado permitiram o presidente do FED a deixar claro que o início do ciclo de cortes está próximo.

Economia Brasileira: O principal destaque foi a condução da política monetária. A ata da última reunião do Copom e, principalmente, a comunicação em tom exacerbado dos diretores da autarquia fizeram com que o mercado aumentasse a probabilidade de uma trajetória de forte alta da Selic. Aliado a isso, um IPCA não tão bom, as expectativas de inflação desancoradas e o câmbio estacionado em um patamar incômodo reforçaram as apostas de um ciclo de alta da Selic. Da nossa parte, seguimos esperando manutenção dos juros no patamar atual até o fim do ano. Encontramos valor em manter as taxas estáveis, dado que já estão restritivas. Por fim, também houve a indicação de Gabriel Galpôlo à presidência do BC.

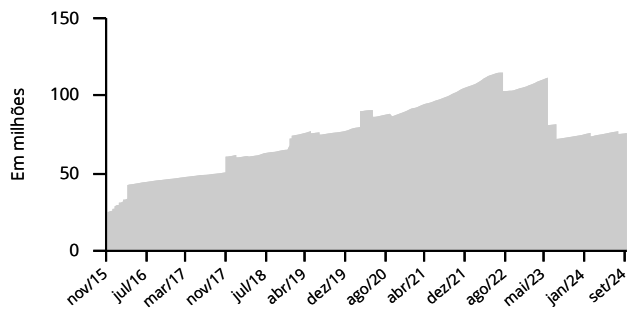
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	Mai-24	Jun-24	Jul-24	Ago-24	Set-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev ALM CP	0,69	0,67	0,86	1,01	0,98	0,98	0,70	0,85	0,81	0,75	0,68	0,65	7,66	10,07	22,19
Índ. Ref.	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,53	0,74	0,82	0,59	0,65	0,23	0,84	6,66	8,60	18,39
CDI	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	0,91	0,87	0,83	7,99	11,06	25,99
IPCA	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	0,38	0,46	0,21	0,38	(0,02)	0,44	3,31	4,42	9,84

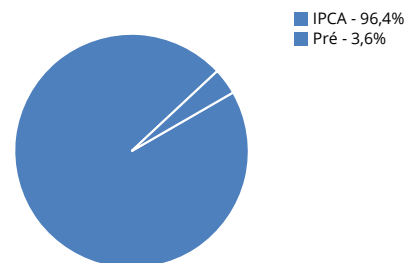
Índice de Referência INPC + 4,35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

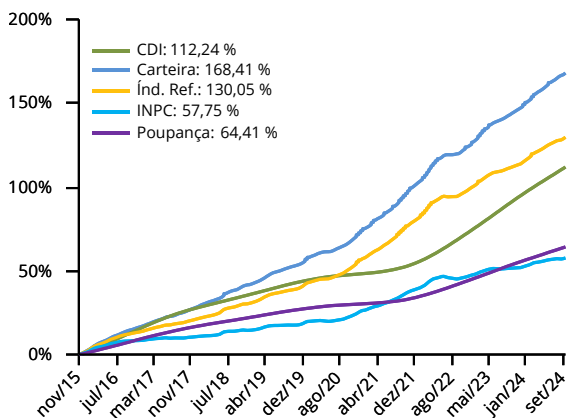


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

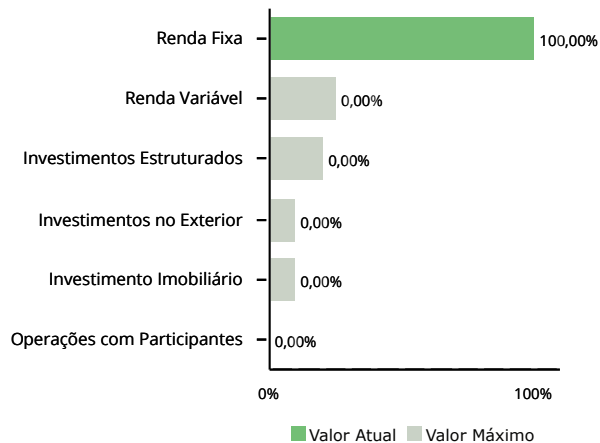
Patrimônio Líquido R\$ 76.056.964,73



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





SOMMA JUSPREV ALM CP
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
SETEMBRO DE 2024



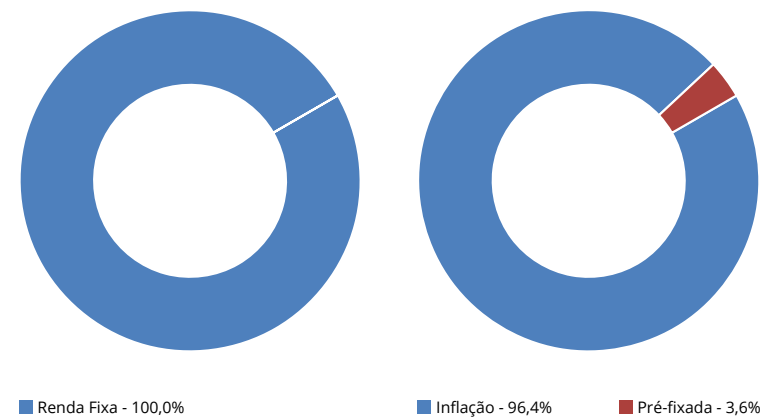
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	4
Política de Investimento	5
Análise de Rentabilidade	6
Retorno da Carteira (R\$)	7
Rentabilidade da Carteira (%)	8
Relatório de Movimentações	9

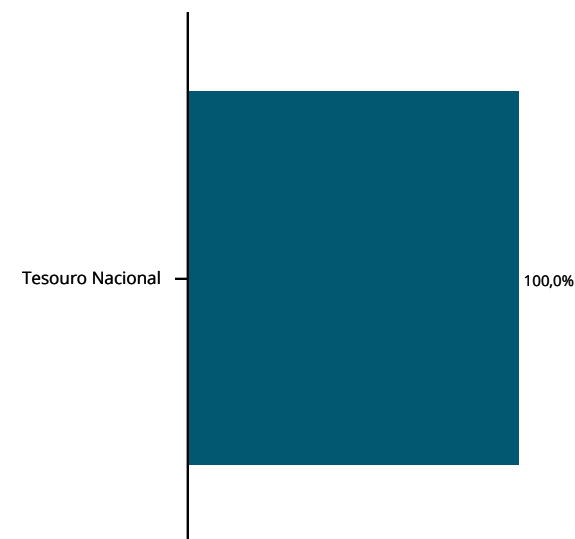


ATIVOS	SETEMBRO-24	%	AGOSTO-24	%
RENDA FIXA	76.059.153,56	100,0%	75.577.241,11	100,0%
Compromissada - Títulos Públicos	2.753.817,10	3,6%	2.749.338,35	3,6%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	73.305.336,46	96,4%	72.827.902,76	96,4%
TESOURARIA	(2.188,84)	0,0%	(8.908,92)	0,0%
Caixa	-	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(2.188,84)	0,0%	(9.908,92)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	76.056.964,72	100%	75.568.332,19	100%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



INSTITUIÇÃO²



¹O saldo deste item não é considerado no somatório do PL.

²Não estão inclusas ações e opções

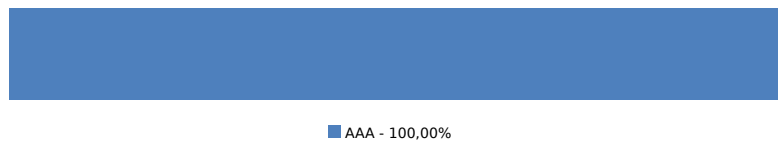
RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Compromissada - Títulos Públicos	Curva	30/09/2024	01/10/2024		2.753.817,10	2.753.817,10	-	2.753.817,10	3,62%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	07/03/2006	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	14.019.181,65	-	14.019.181,65	18,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	07/03/2006	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	14.019.181,65	-	14.019.181,65	18,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	07/03/2006	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	14.019.181,65	-	14.019.181,65	18,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	07/03/2006	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	14.019.181,65	-	14.019.181,65	18,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	07/03/2006	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	14.019.181,65	-	14.019.181,65	18,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/09/2004	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.602.285,90	-	2.602.285,90	3,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/09/2004	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.602.285,90	-	2.602.285,90	3,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/09/2004	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.602.285,90	-	2.602.285,90	3,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/09/2004	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.602.285,90	-	2.602.285,90	3,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/09/2004	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.602.285,90	-	2.602.285,90	3,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/09/2004	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.602.285,90	-	2.602.285,90	3,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	06/01/2016	15/08/2026	IPCA + 5,65%	1.493.159,87	2.095.008,55	-	2.095.008,55	2,75%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/01/2015	15/05/2055	IPCA + 5,92%	1.261.769,06	1.795.299,80	-	1.795.299,80	2,36%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/01/2015	15/05/2055	IPCA + 5,92%	1.261.769,06	1.795.299,80	-	1.795.299,80	2,36%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	10/02/2010	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.452.526,73	-	1.452.526,73	1,91%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	10/02/2010	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.452.526,73	-	1.452.526,73	1,91%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	10/02/2010	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.452.526,73	-	1.452.526,73	1,91%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	10/02/2010	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.452.526,73	-	1.452.526,73	1,91%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	10/02/2010	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.452.526,73	-	1.452.526,73	1,91%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	10/02/2010	15/08/2030	IPCA + 5,65%	2.048.893,74	2.808.541,96	-	2.808.541,96	3,69%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	07/03/2006	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	14.019.181,65	-	14.019.181,65	18,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	07/03/2006	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	14.019.181,65	-	14.019.181,65	18,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	07/03/2006	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	14.019.181,65	-	14.019.181,65	18,43%
TOTAL						76.059.153,56	-	76.059.153,56	100,00 %

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano			
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	100,00%	0,00%
Títulos Públicos Federais	100,00%	100,00%	0,00%
CDI/CDBs	80,00%	0,00%	80,00%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	0,00%	80,00%
Debêntures	20,00%	0,00%	20,00%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	0,00%	20,00%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,00%	20,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	0,00%	25,00%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	0,00%	25,00%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	0,00%	20,00%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	0,00%	15,00%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	0,00%	10,00%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	0,00%	10,00%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	0,00%	10,00%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

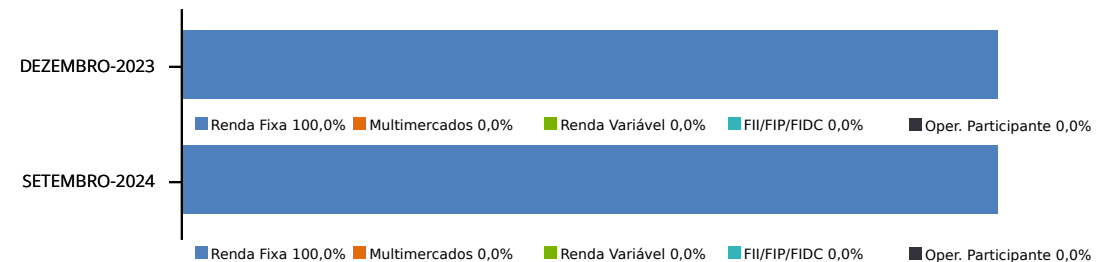
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹			
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	100,00%	FITCH MOODY'S S&P AUSTIN
Tesouro Nacional	100,00%	100,00%	- - brAAA -

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



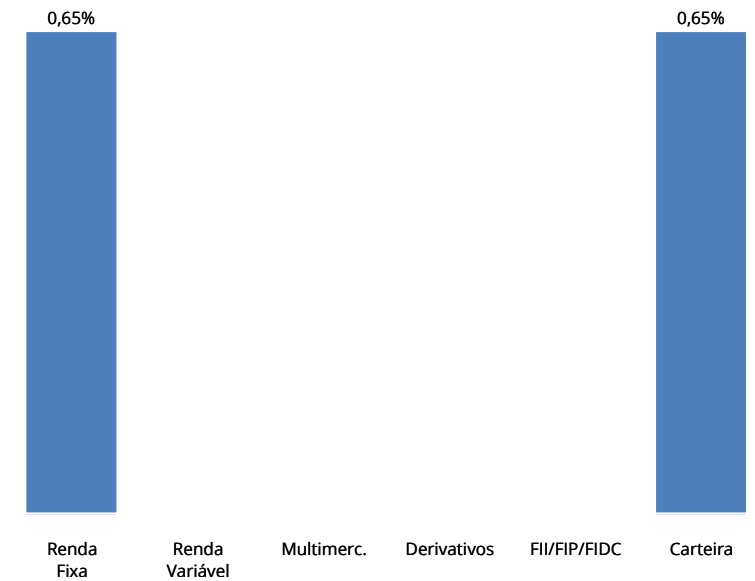
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Compromissada - Títulos Públicos	0,83	99,4%	7,98	119,8%	11,04	128,4%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	0,66	78,3%	7,78	116,8%	10,22	118,8%

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,84	6,66	8,60
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,84	6,66	8,60
Op. com Participante (0% CDI)	0,00	0,00	0,00
CDI	0,83	7,99	11,06
IPCA	0,44	3,31	4,42
INPC	0,48	3,29	4,09
Ibovespa	-3,08	-1,77	13,08
Dólar	-3,68	12,53	8,80

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,66	7,69	10,12
Renda Variável	0,00	0,00	0,00
Investimentos Estruturados	0,00	0,00	0,00
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

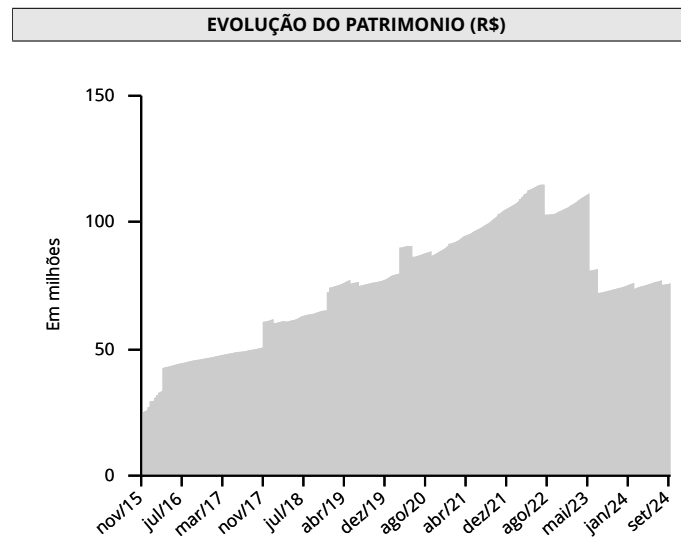
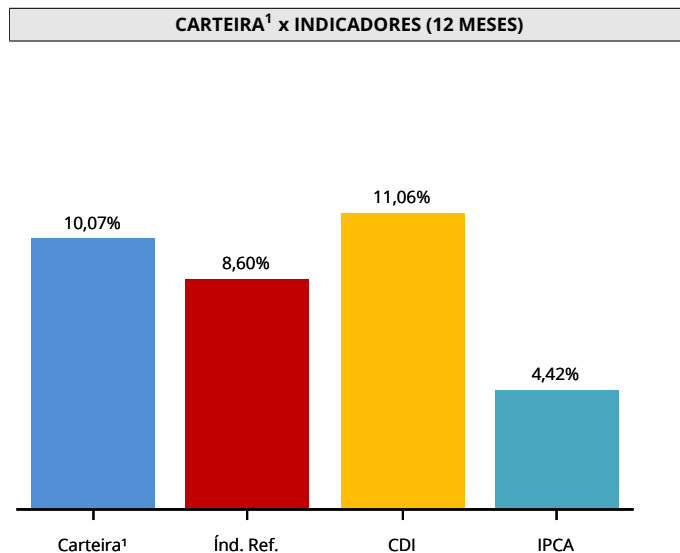
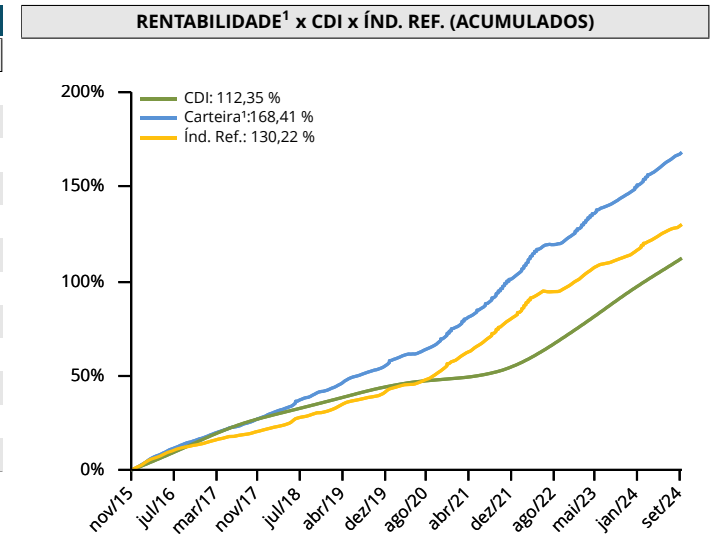
COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA



RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	1º SEM	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	NO ANO
RENDA FIXA	4.052.340,59	584.150,74	530.978,43	500.245,35	-	-	-	5.667.715,11
Compromissada - Títulos Públicos	95.342,76	21.203,86	21.983,52	22.811,65	-	-	-	161.341,79
Notas do Tesouro Nacional - Série B	3.956.997,83	562.946,88	508.994,91	477.433,70	-	-	-	5.506.373,32
TOTAL	4.052.340,59	584.150,74	530.978,43	500.245,35	-	-	-	5.667.715,11

RESULTADOS DE 2024			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	1,01	0,94	106,57%
Fevereiro	0,98	1,13	86,76%
Março	0,98	0,53	184,39%
Abril	0,70	0,74	94,68%
Mai	0,85	0,82	104,36%
Junho	0,81	0,59	137,22%
Julho	0,75	0,65	115,30%
Agosto	0,68	0,23	294,60%
Setembro	0,65	0,84	77,24%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	7,66	6,66	114,94%

INDICADORES DE MERCADO				
CDI	IPCA	INPC	Ibovespa	Dólar
0,97	0,42	0,57	(4,79)	2,32
0,80	0,83	0,81	0,99	0,60
0,83	0,16	0,19	(0,71)	0,26
0,89	0,38	0,37	(1,70)	3,51
0,83	0,46	0,46	(3,04)	1,35
0,79	0,21	0,25	1,48	6,05
0,91	0,38	0,26	3,02	1,86
0,87	(0,02)	(0,14)	6,54	(0,10)
0,83	0,44	0,48	(3,08)	(3,68)
7,99	3,31	3,29	(1,77)	12,53



RESULTADOS DE 2023			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	1,20	0,83	144,42%
Fevereiro	1,00	1,08	92,83%
Março	1,46	1,03	141,72%
Abril	0,93	0,84	110,81%
Mai	1,03	0,73	140,24%
Junho	0,50	0,26	195,38%
Julho	0,48	0,27	180,58%
Agosto	0,72	0,59	121,37%
Setembro	0,68	0,45	150,75%
Outubro	0,69	0,48	145,45%
Novembro	0,67	0,44	152,79%
Dezembro	0,86	0,89	96,92%
Total	10,71	8,16	131,14%

¹A rentabilidade da carteira é baseado na cota Bruta

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
Rent. Líquida	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%
Índice Ref.	0,73%	0,88%	1,09%	0,96%	0,52%	0,33%	0,49%	0,49%	0,31%	0,43%	0,88%	1,58%	9,04%

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,53%	0,76%	0,37%	0,04%	0,47%	0,86%	0,75%	0,87%	1,29%	1,25%	1,64%	10,61%
Rent. Líquida	1,30%	0,53%	0,76%	0,37%	0,04%	0,47%	0,86%	0,75%	0,87%	1,29%	1,25%	1,64%	10,61%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,77%
Índice Ref.	0,56%	0,48%	0,55%	0,11%	0,09%	0,66%	0,83%	0,72%	1,23%	1,25%	1,29%	1,84%	10,02%

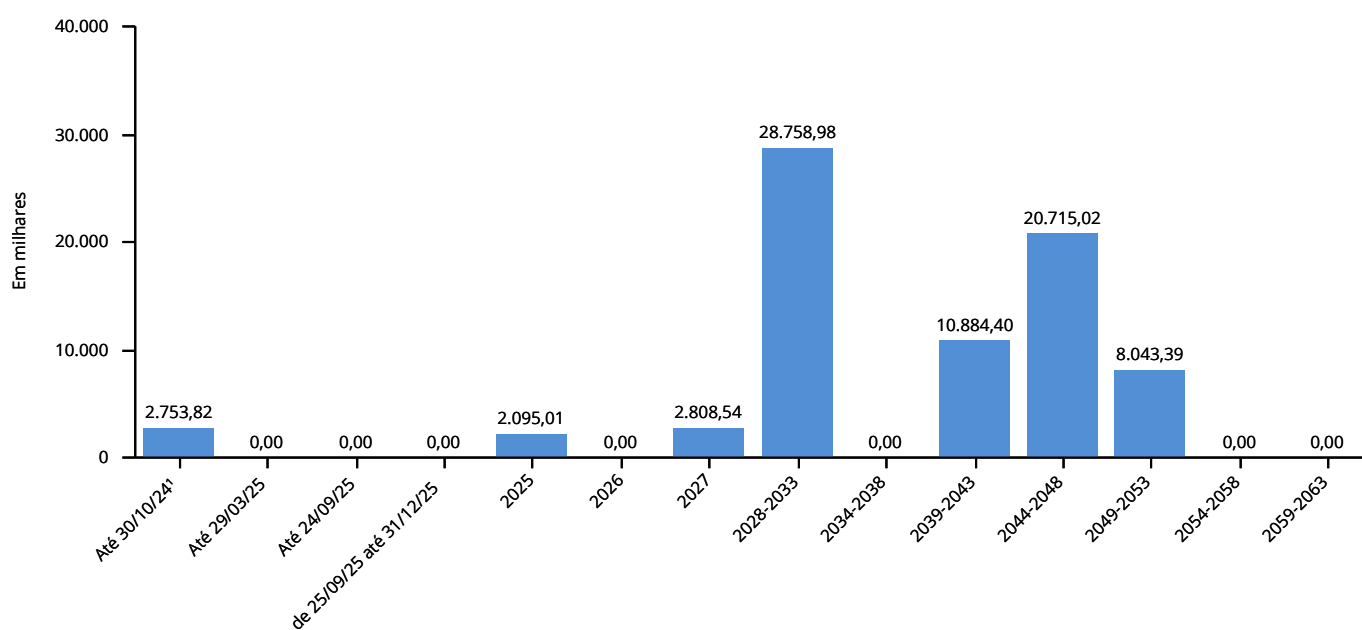
2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
Rent. Líquida	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,39%
Índice Ref.	0,61%	1,13%	1,25%	0,72%	1,32%	0,96%	1,40%	1,26%	1,56%	1,50%	1,18%	1,12%	14,93%

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%	0,00%	0,16%	0,69%	0,92%	0,89%	11,75%
Rent. Líquida	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%	0,00%	0,16%	0,69%	0,92%	0,89%	11,75%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,37%
Índice Ref.	1,03%	1,32%	2,09%	1,36%	0,82%	0,98%	-0,25%	0,08%	0,03%	0,81%	0,72%	1,06%	10,52%

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,20%	1,00%	1,46%	0,93%	1,03%	0,50%	0,48%	0,72%	0,68%	0,69%	0,67%	0,86%	10,71%
Rent. Líquida	1,20%	1,00%	1,46%	0,93%	1,03%	0,50%	0,48%	0,72%	0,68%	0,69%	0,67%	0,86%	10,71%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%
Índice Ref.	0,83%	1,08%	1,03%	0,84%	0,73%	0,26%	0,27%	0,59%	0,45%	0,48%	0,44%	0,89%	8,16%

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,01%	0,98%	0,98%	0,70%	0,85%	0,81%	0,75%	0,68%	0,65%				7,66%
Rent. Líquida	1,01%	0,98%	0,98%	0,70%	0,85%	0,81%	0,75%	0,68%	0,65%				7,66%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%				7,99%
Índice Ref.	0,94%	1,13%	0,53%	0,74%	0,82%	0,59%	0,65%	0,23%	0,84%				6,66%

MAPA DE VENCIMENTOS DOS ATIVOS DA CARTEIRA



¹ São considerados títulos e fundos categorizados como a negociação

² Dados de referência calculados com mês anterior

Cenário

O comportamento positivo dos ativos de risco em setembro refletiu o início do ciclo de corte de juros nos EUA. A confiança na sustentabilidade da desinflação em direção à meta do Fed, os dados recentes – que corroboram a ausência de pressão inflacionária advinda do mercado de trabalho – e o grau de restrição elevado levaram a autoridade monetária a iniciar o processo de normalização monetária com um corte de 50 pontos-base.

O tamanho do ajuste foi uma sinalização de que o Fed não quer ficar atrás da curva e reagirá a deteriorações inesperadas do mercado de trabalho. Apesar de não ter se comprometido com nenhum ritmo de cortes, o cenário base da autoridade monetária aparenta ser de ajustes de menor magnitude nas próximas reuniões. A atividade aquecida permite que o banco central seja cauteloso no processo. A combinação de um crescimento robusto nos EUA e o início do ciclo de cortes pelo Fed produz um ambiente positivo para os ativos de risco.

No caso brasileiro, a combinação entre atividade econômica e política monetária pode ser mais nociva. No atual regime monetário, de metas para inflação, o Banco Central se orienta pela projeção da inflação no horizonte relevante de política monetária, dada a trajetória de juros da pesquisa Focus e inputs como o hiato do produto, as expectativas para inflação, o câmbio, entre outros fatores. A projeção do Banco Central tem sido revisada por conta da atividade econômica mais aquecida, o que motivou o início de um ciclo de alta da Selic de forma gradual em 25 pontos-base.

O crescimento tem sido enfrentado pelo mercado como uma faca de dois gumes. A expectativa de PIB medida pela pesquisa Focus para este ano era de 1,6% em janeiro. Atualmente, está próxima de 3%. O problema consiste na razão da força da atividade, creditada aos estímulos fiscais dos últimos anos, que têm efeito também sobre a situação das contas públicas e, conseqüentemente, no prêmio de risco exigido pelos investidores para financiar o déficit público. A composição de crescimento mais forte, sustentado parcialmente pela política fiscal expansionista, com o Banco Central perseguindo a meta para inflação resulta em um equilíbrio onde os juros sobe, o câmbio aprecia e a bolsa cai, movimento observado ao longo de setembro.

Um questionamento importante a essa leitura se deve à dinâmica corrente da economia. Os modelos que sugerem uma inflação mais elevada à frente também indicariam uma inflação corrente maior do que a observada. Uma possível inferência é que o crescimento potencial brasileiro, isto é, o nível de crescimento que não gera pressão inflacionária, é maior. A divergência entre as projeções iniciais e o PIB realizado também apontam nessa direção, ainda que o componente fiscal seja relevante e preocupante.

No cenário doméstico, o hiato do produto deve continuar a ter um peso importante nas discussões relacionadas à política monetária. Na política fiscal, o cumprimento do arcabouço será o foco dos próximos meses. Apesar do sentimento pior no último mês, o crescimento econômico brasileiro, que tem impacto na sustentabilidade fiscal, motivou uma elevação do rating da Moody's.

Os ventos externos são favoráveis. Além do ambiente melhor nos EUA, o governo chinês deu indícios de que estimulará a economia. Até o momento, as medidas adotadas não parecem ter grande impacto sobre o crescimento, mas dão sinais de que há uma preocupação do governo com o estado da economia, o que provocou uma onda de otimismo nos ativos ligados ao desempenho da atividade chinesa. A sustentabilidade do movimento dependerá de novas rodadas de estímulos.

O início do ciclo de alta de juros no Brasil motivou a redução das posições over na renda variável, que estão neutras atualmente. Apesar dos desafios enfrentados, os prêmios de risco, especialmente na curva de juro real, justificam as posições otimistas em inflação longa, sobretudo se considerarmos os ventos externos favoráveis. Na classe de inflação curta, continuamos a operar taticamente. Neutralizamos as posições under por conta do comportamento da inflação, mais alta no curto prazo, e pela abertura de juros.

Rentabilidade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2023
Fundo	0,03%	-0,04%	0,74%	0,79%	1,32%	1,29%	1,32%	1,03%	0,82%	0,39%	1,90%	1,45%	11,61%
INPC + 4,35%	0,83%	1,08%	1,03%	0,84%	0,73%	0,26%	0,27%	0,59%	0,45%	0,48%	0,44%	0,89%	8,16%
Bench 2023	1,32%	0,51%	0,97%	0,97%	1,25%	1,43%	1,23%	0,90%	0,89%	0,73%	1,61%	1,20%	13,81%

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Fundo	0,85%	0,74%	0,82%	0,11%	0,78%	0,72%	1,71%	1,05%	0,66%				7,68%
INPC + 4,35%	0,94%	1,13%	0,53%	0,74%	0,82%	0,59%	0,65%	0,23%	0,84%				6,66%
Bench 2024	0,79%	0,94%	0,87%	0,78%	0,79%	1,05%	1,08%	1,21%	0,61%				8,41%

	12m	24m	36m
Fundo	11,75%	23,40%	31,88%
INPC + 4,35%	8,60%	18,39%	32,43%
Bench 2024	12,29%	27,45%	39,84%

Performance Individuais

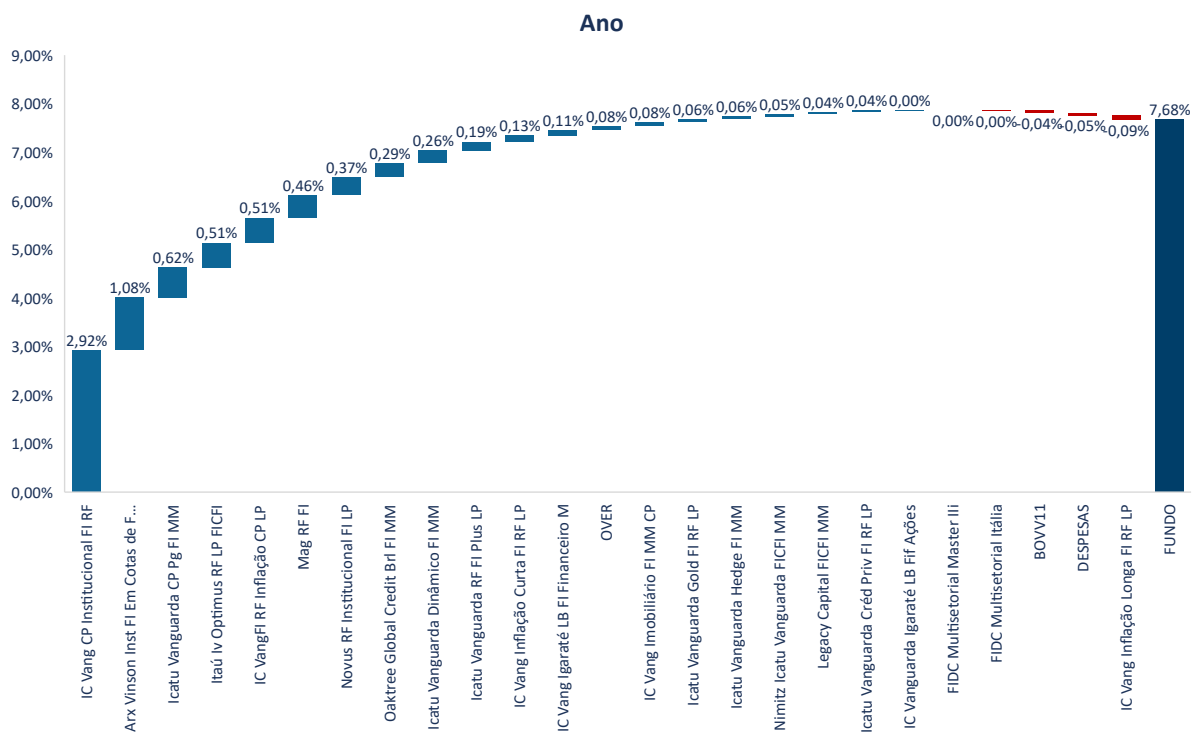
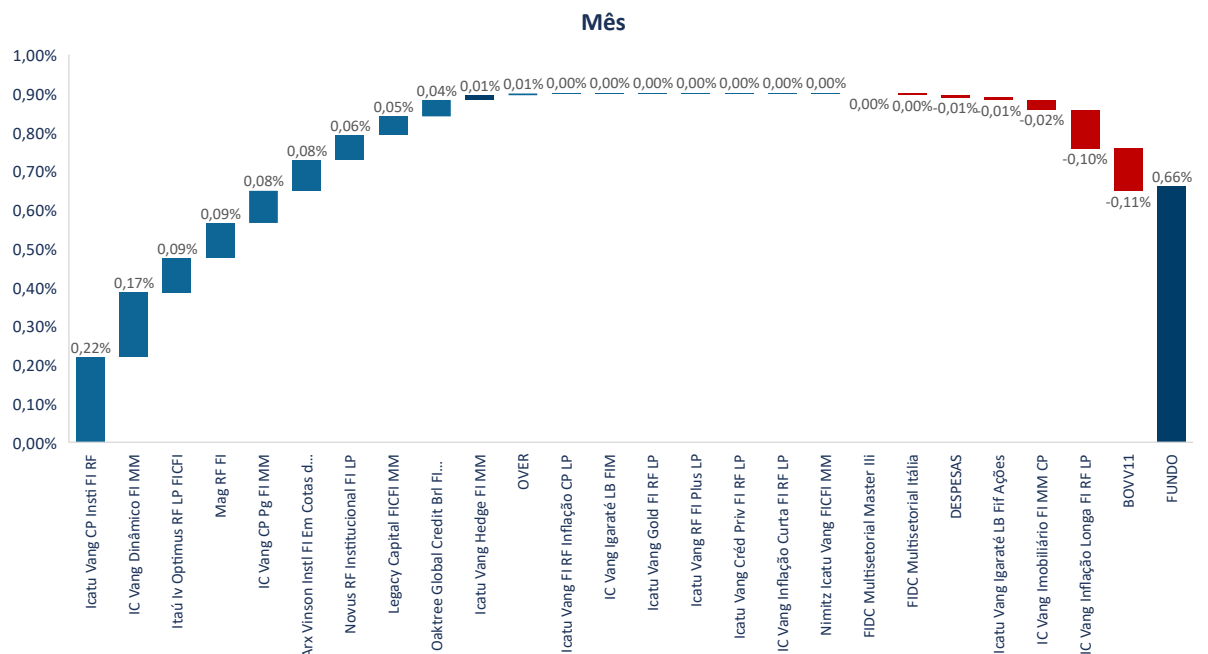
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	1,04%	0,85%	0,91%	0,71%	0,87%	0,83%	0,97%	0,87%	0,86%	-	-	-	8,18%
Icatu Vanguarda CP Institucional FIRF	1,62%	1,10%	1,13%	1,06%	0,97%	0,98%	2,00%	0,54%	1,07%	-	-	-	10,97%
Nc Red Institucional FIRF	0,67%	0,33%	0,63%	-0,33%	1,17%	0,85%	0,85%	1,23%	1,07%	-	-	-	6,66%
Icatu Vanguarda PG FIM CP	1,78%	1,08%	1,17%	1,03%	0,93%	0,89%	1,66%	0,71%	1,14%	-	-	-	10,88%
Arx Vinson FIC FIRF CP	1,23%	0,94%	1,16%	0,93%	0,90%	1,07%	1,22%	1,05%	1,00%	-	-	-	9,91%
Itaú Iv Optimus RF LP Ficf	0,88%	0,68%	0,95%	0,99%	1,09%	1,16%	0,74%	0,96%	1,06%	-	-	-	8,84%
Legacy Capital FICFI MM	0,46%	-0,40%	1,22%	-2,37%	0,45%	-0,29%	1,74%	-0,99%	3,68%	-	-	-	3,45%
Nimitz IV FIC FIM	0,32%	0,41%	1,31%	-1,02%	-0,40%	1,59%	2,42%	1,38%	1,87%	-	-	-	8,11%
Icatu Vanguarda Hedge FIM	0,80%	-0,75%	0,11%	-1,43%	0,64%	0,64%	2,01%	1,44%	0,85%	-	-	-	4,36%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%	-	-	-	7,99%
Icatu Vanguarda Inflação CP FIRF LP	1,23%	0,89%	0,91%	-0,66%	1,20%	0,11%	1,93%	0,40%	0,42%	-	-	-	6,59%
IMAB-5	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	1,05%	0,39%	0,91%	0,59%	0,40%	-	-	-	5,30%
Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	-1,49%	0,47%	-0,57%	-2,94%	1,56%	-2,25%	3,20%	0,73%	-1,47%	-	-	-	-2,87%
IMAB-5+	-1,47%	0,51%	-0,55%	-2,91%	1,59%	-2,25%	3,24%	0,77%	-1,42%	-	-	-	-2,62%
Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	1,02%	0,66%	0,53%	-0,19%	-1,33%	2,57%	0,38%	2,46%	-1,28%	-	-	-	4,85%
IFIX	0,66%	0,81%	1,43%	-0,79%	0,03%	-1,03%	0,51%	0,86%	-2,59%	-	-	-	-0,18%
BOVV11	-4,80%	1,04%	-0,84%	-1,67%	-3,00%	1,55%	3,03%	6,66%	-3,03%	-	-	-	-1,54%
Icatu Vanguarda Long Biased FIM	-0,96%	0,89%	1,32%	-1,51%	0,25%	1,25%	2,23%	2,19%	-0,18%	-	-	-	5,53%
IBOV	-4,79%	0,99%	-0,71%	-1,70%	-3,04%	1,48%	3,02%	6,54%	-3,08%	-	-	-	-1,77%
IBX	-4,51%	0,96%	-0,73%	-1,34%	-3,18%	1,51%	2,90%	6,59%	-2,97%	-	-	-	-1,23%
Oaktree Global Credit Br FI MM Ie	1,13%	0,63%	1,25%	0,17%	1,37%	1,42%	1,89%	1,43%	1,09%	-	-	-	10,86%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%	-	-	-	7,99%

Alocação

ESTRATÉGIA	FUNDOS	% PL	
CDI	Nc Red Institucional FIRF	5,9%	
	Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	10,6%	26,5%
	Itaú IV Optimus FICR	10,0%	
Inflação Longa	Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	6,7%	6,7%
Crédito Privado	Icatu Vanguarda Crédito Privado Institucional FIRF	19,1%	
	Arx Vinson FIC FIRF CP	7,4%	33,6%
	Icatu Vanguarda PG FIM CP	7,1%	
Multimercado	ICATU VANGUARDA IPCA DINÂMICO FIM	17,5%	17,5%
Investimento Estruturado	Legacy Capital FICFI MM	1,4%	2,8%
	Icatu Vanguarda Hedge FIM	1,4%	
Imobiliário	Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	1,9%	1,9%
Renda Variável	Icatu Vanguarda Igaraté LB FIM	2,2%	5,2%
	BOVV11	3,0%	
FIDC	FIDC Mult. Italia	0,1%	0,1%
Investimento Exterior	Oaktree Global Credit Brl FI MM Ie	3,9%	3,9%
Caixa	-	2,0%	2,0%

Alocação	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	set/24
CDI	17,2%	20,5%	14,7%	16,9%	18,0%	23,4%	24,8%	21,8%	26,5%
Crédito Privado	42,8%	42,8%	42,6%	49,7%	48,6%	42,9%	42,5%	38,1%	33,6%
Inflação Curta	17,3%	10,0%	9,9%	9,7%	10,0%	9,8%	9,8%	-	-
Inflação Longa	1,8%	3,0%	4,9%	6,7%	6,6%	6,7%	6,8%	6,7%	6,7%
Multimercado	13,6%	13,5%	14,0%	6,5%	4,9%	3,8%	2,5%	20,3%	20,2%
Renda Variável	5,0%	5,9%	6,0%	4,9%	5,0%	6,0%	6,0%	6,1%	5,2%
FIDC's	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%
Imobiliário	2,0%	2,0%	2,0%	1,9%	1,9%	1,9%	1,9%	2,1%	1,9%
Exterior	-	-	2,7%	2,7%	4,0%	4,0%	3,9%	3,9%	3,9%
Caixa	0,2%	2,2%	3,2%	0,9%	1,2%	1,5%	1,8%	1,0%	2,0%

P&L



Movimentações

Fundo	CDI	Inflação	Classe Fundo			Data	% Fin.	Data Cotização (Resgates)	Data Liquidação (Resgates)
			Estruturado	Renda Variável	Invest. Exterior				
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP		235.000,00				03/09/2024	0,10%	-	-
Mag RF FI	7.000.000,00					13/09/2024	2,97%	-	-
Itaú Iv Optimus RF LP FICFI	9.535.000,00					16/09/2024	4,02%	-	-
Mag RF FI	-5.185.000,00					16/09/2024	-2,19%	16/09/2024	16/09/2024
BOVV11				-1.661.630,99		19/09/2024	-0,70%	19/09/2024	23/09/2024
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP		600.000,00				25/09/2024	0,25%	-	-
Legacy Capital FICFI MM			-3.165.175,24			27/09/2024	-1,33%	28/10/2024	29/10/2024
Oaktree Global Credit FI MM IE					-2.927.500,00	30/09/2024	-1,23%	09/10/2024	15/10/2024

Patrimônio e Rentabilidades

Patrimônio

 R\$ **50,307,126.31**

Valor da Cota em 30/09/2024

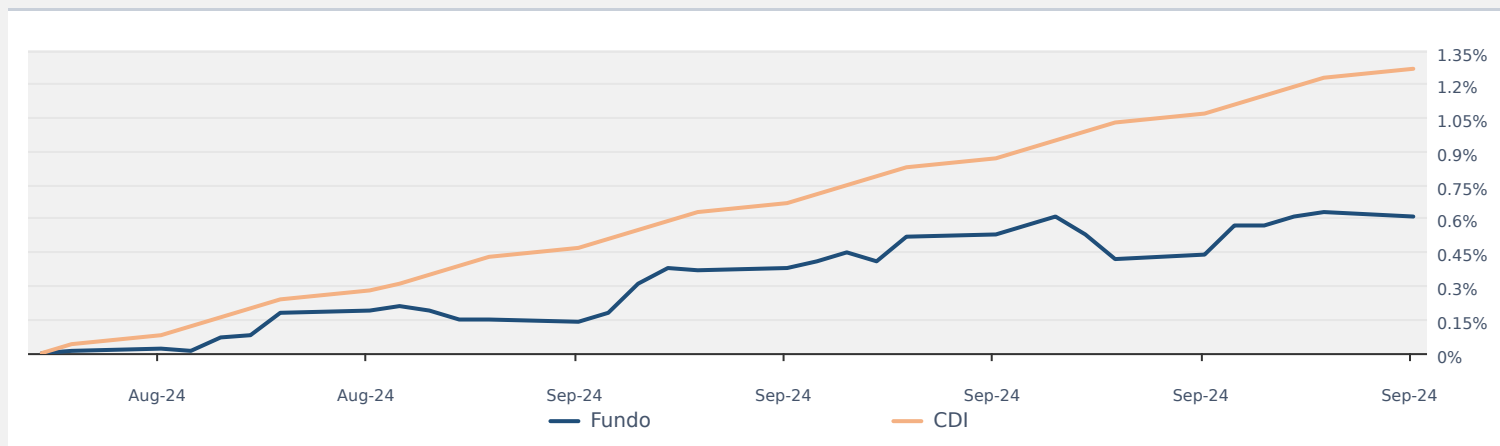
 R\$ **1.0061425**

Rentabilidade nos Últimos 3 Dias Úteis

Data	Patrimônio	Cota	Dia		Mês		Ano		Desde o Início (15/08/2024)	
			%	%CDI	%	%CDI	%	%CDI	%	%CDI
30/09/2024	50,307,126.31	1.006142500000	-0.02	-40.35	0.46	55.67	0.61	48.34	0.61	48.34
27/09/2024	50,315,282.26	1.006305600000	0.02	61.67	0.48	60.56	0.63	51.26	0.63	51.26
26/09/2024	50,302,821.56	1.006056400000	0.04	93.38	0.46	60.51	0.61	50.92	0.61	50.92

Data	Patrimônio	Cota	3 Meses		6 Meses		12 Meses		24 Meses	
			%	%CDI	%	%CDI	%	%CDI	%	%CDI
30/09/2024	50,307,126.31	1.006142500000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
27/09/2024	50,315,282.26	1.006305600000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
26/09/2024	50,302,821.56	1.006056400000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

Rentabilidade Histórica



Retornos Mensais e Anuais

Retorno Mensal	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	no Ano
2024	PORTFÓLIO							0.15%	0.46%				0.61%
	%CDI							34.46%	55.67%				48.34%
	CDI							0.43%	0.83%				1.27%
2023	PORTFÓLIO												0.00%
	%CDI												-
	CDI												0.00%

Retorno Anual	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024	Desde o início
PORTFÓLIO												0.61%	0.61%
%CDI												48.34%	48.34%
CDI												1.27%	1.27%

Análise Detalhada

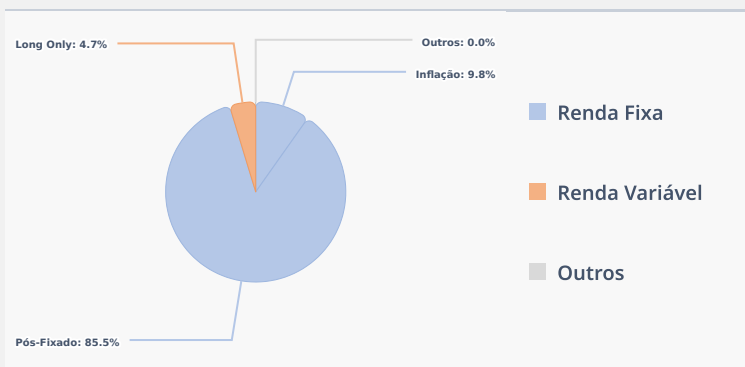
Liquidez

Liquidez	% Fundo	Financeiro (R\$)	Acumulado % Fundo	Acumulado Financeiro (R\$)
D+0	0.00	0.00	0.00	0.00
D+1	0.00	0.00	0.00	0.00
D+2 a D+15	1.43	717,817.26	1.43	717,817.26
D+16 a D+35	0.00	0.00	1.43	717,817.26
D+36 a D+65	3.29	1,656,929.47	4.72	2,374,746.73
D+66 a D+1450	0.00	0.00	4.72	2,374,746.73
D>1450	0.00	0.00	4.72	2,374,746.73
Total de fundos	4.72	2,374,746.73	4.72	2,374,746.73
Total ativos	95.30	47,944,341.72	95.30	47,944,341.72
Outros	-0.02	-11,962.14	-0.02	-11,962.14
Total geral	100.00	50,307,126.31	100.00	50,307,126.31

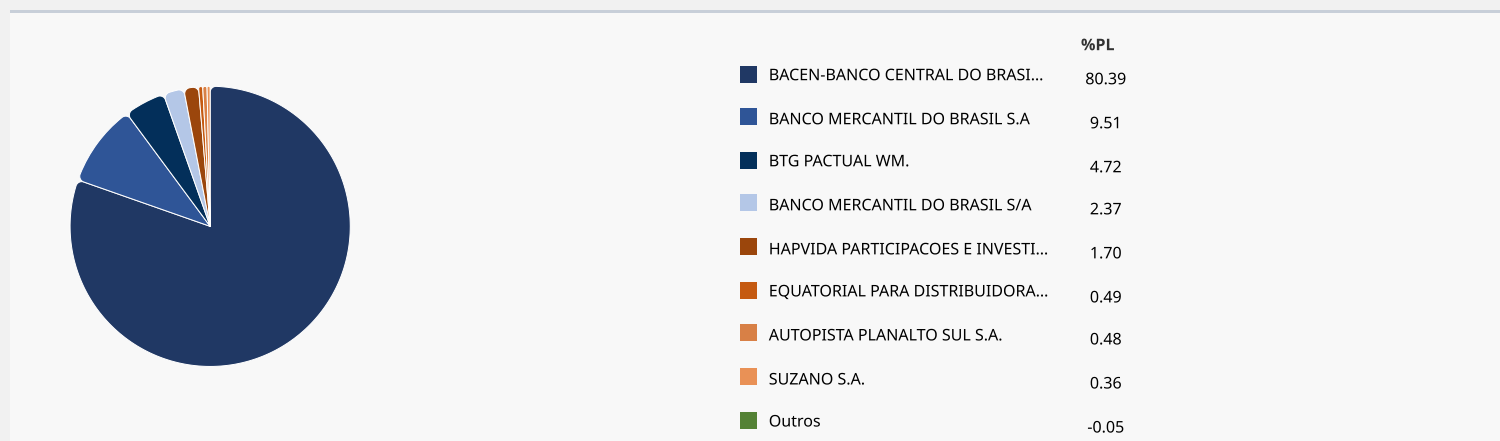
Alocação por Classe

■	95.30%	Renda Fixa	R\$	47,944,341.72
■	4.72%	Renda Variável	R\$	2,374,746.73
■	-0.02%	Outros	R\$	-11,962.14
	100.00%	TOTAL	R\$	50,307,126.31

Por Subclasse



Alocação por Gestor | Emissor



Carteira

Renda Fixa: TÍTULOS PÚBLICOS

79.4% | R\$ 39,946,893.78

Carteira				Rentabilidade							Indexador	Quantidade	Cupom/Taxa	PU Médio	Emissor
%PL	Financeiro (R\$)	Liquidez/Vencimento		Dia	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	Desde 1ª Aquisição						
LFT REF	12.56	6,316,826.54	01/03/2026	%	0.04	0.82	-	-	-	1.27	CDI	410	0.02	15,406.8939910	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ
				% CDI	99.75	98.38	-	-	-	100.15					
LFT REF	57.10	28,723,261.56	01/06/2030	%	0.05	0.91	-	-	-	1.38	CDI	1880	0.17	15,278.3306190	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ
				% CDI	115.58	109.32	-	-	-	108.27					
NTNB IPCA	4.87	2,449,006.98	15/08/2030	%	-0.14	-0.54	-	-	-	-1.79	IPCA	575	5.94	4,259.1425800	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ
				% IPCA	-	-	-	-	-	-					
NTNB IPCA	4.89	2,457,798.70	15/05/2035	%	-0.48	-1.18	-	-	-	-3.30	IPCA	575	5.94	4,274.4325180	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ
				% IPCA	-	-	-	-	-	-					

Renda Fixa: TÍTULOS PRIVADOS

14.9% | R\$ 7,503,407.92

Carteira				Rentabilidade							Indexador	Quantidade	Cupom/Taxa	PU Médio	Emissor
%PL	Financeiro (R\$)	Liquidez/Vencimento		Dia	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	Desde 1ª Aquisição						
APPSB2 CDIE	0.48	241,675.23	15/09/2028	%	0.05	-	-	-	-	0.16	CDI	239	1.82	1,011.1934190	AUTOPISTA PLANALTO SUL S.A.
				% CDI	131.86	-	-	-	-	97.16					
DPGE CDIE	2.38	1,196,633.86	04/11/2025	%	0.04	0.87	-	-	-	1.20	CDI	1	0.32	1,196,633.8559617	BANCO MERCANTIL DO BRASIL S.A.
				% CDI	103.19	104.87	-	-	-	104.48					
DPGE CDIE	2.38	1,196,633.86	04/11/2025	%	0.04	0.87	-	-	-	1.20	CDI	1	0.32	1,196,633.8559617	BANCO MERCANTIL DO BRASIL S.A.
				% CDI	103.19	104.87	-	-	-	104.48					
DPGE CDIE	2.38	1,196,103.04	07/11/2025	%	0.04	0.88	-	-	-	1.20	CDI	1	0.32	1,196,103.0413542	BANCO MERCANTIL DO BRASIL S.A.
				% CDI	103.19	104.89	-	-	-	104.49					
DPGE CDIE	2.38	1,196,103.04	07/11/2025	%	0.04	0.88	-	-	-	1.20	CDI	1	0.32	1,196,103.0413542	BANCO MERCANTIL DO BRASIL S.A.
				% CDI	103.19	104.89	-	-	-	104.49					
DPGE CDIE	2.37	1,193,523.26	11/11/2025	%	0.04	0.88	-	-	-	1.20	CDI	1	0.32	1,193,523.2626424	BANCO MERCANTIL DO BRASIL S.A.
				% CDI	103.19	104.90	-	-	-	104.50					
EQPA17 CDIE	0.49	247,512.28	05/08/2030	%	0.07	-	-	-	-	0.84	CDI	243	0.87	1,018.5690700	EQUATORIAL PARA DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.
				% CDI	171.83	-	-	-	-	117.38					
HAPV17 CDIE	1.70	852,995.53	10/05/2031	%	0.03	-	-	-	-	0.12	CDI	806	1.31	1,058.3071090	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S/A
				% CDI	72.73	-	-	-	-	154.54					
SUZBB1 CDIE	0.36	182,227.82	15/05/2034	%	0.04	-	-	-	-	0.34	CDI	174	0.84	1,047.2863130	SUZANO S.A.
				% CDI	111.26	-	-	-	-	168.74					

Renda Fixa: COMPROMISSADA

1.0% | R\$ 494,040.02

Carteira				Rentabilidade							Indexador	Quantidade	PU Médio	Emissor
%PL	Financeiro (R\$)	Volta		Dia	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	Desde 1ª Aquisição					
LFT REF	0.98	494,040.02	01/10/2024	%	-	-	-	-	-	-	FCDIE	33.00	14,970.9096971	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ
				% CDI	-	-	-	-	-	-				

Renda Variável: FUNDOS

4.7% | R\$ 2,374,746.73

Carteira				Rentabilidade						Data 1ª Aquisição	Vol. em 3 Meses	Quantidade de Cotas	Valor Cota	Gestor	Subclasse	
%PL	Financeiro (R\$)	Liquidez/Vencimento		Dia	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	Desde 1ª Aquisição							
PS ALPHA PREV FC FIA	3.29	1,656,929.47	D+62	%	-0.56	-3.81	-	-	-	-6.10	20/08/2024	0.00	1,621,605.08	1.02	BTG PACTUAL WM.	Long Only
				% CDI	-	-	-	-	-	-						
PS EQ INFLATION FIA	1.43	717,817.26	D+3	%	-0.31	-3.25	-	-	-	-4.11	22/08/2024	0.00	583,410.17	1.23	BTG PACTUAL WM.	Long Only
				% CDI	-	-	-	-	-	-						

Carteira

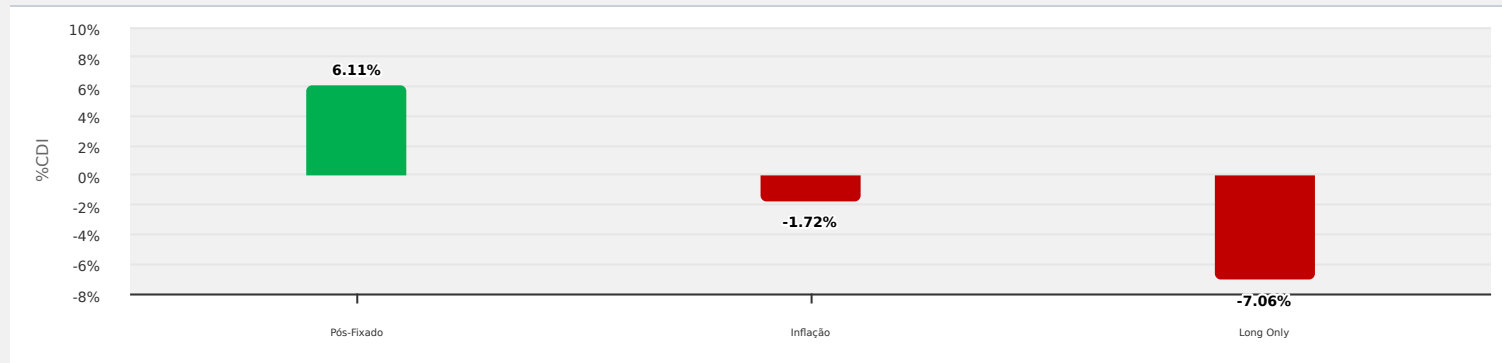
Outros

0.0% | R\$ -11,962.14

Ativo	%PL	Financeiro(R\$)	Subclasse
A PAGAR TX.ADM.	-0.02	-12,535.80	Outros
DESPESA AUDITORIA	0.00	-229.90	Outros
DESPESA CETIP	0.00	795.56	Outros
DESPESA SELIC	0.00	8.01	Outros

Contribuição e Movimentações

Contribuição por Subclasse no Mês



Histórico de Movimentação

Data	Liquidação	Aquisição / Resgate	Portfólio	Financeiro (R\$)
22/08/2024	21/08/2024	AQUISIÇÃO	PS EQ INFLATION FIA	250,000.00
22/08/2024	22/08/2024	AQUISIÇÃO	PS ALPHA PREV FC FIA	437,500.00
26/08/2024	23/08/2024	AQUISIÇÃO	PS EQ INFLATION FIA	250,000.00
26/08/2024	26/08/2024	AQUISIÇÃO	PS ALPHA PREV FC FIA	437,500.00
28/08/2024	27/08/2024	AQUISIÇÃO	PS EQ INFLATION FIA	250,000.00
28/08/2024	28/08/2024	AQUISIÇÃO	PS ALPHA PREV FC FIA	437,500.00
20/08/2024	20/08/2024	AQUISIÇÃO	PS ALPHA PREV FC FIA	437,500.00

* Últimas 10 movimentações

Agendamento de Movimentação

Data	Liquidação	Aquisição / Resgate	Portfólio	Financeiro (R\$)

Aportes e Retiradas dos Cotistas

Data	Aporte/Retirada	Financeiro (R\$)
15/08/2024	APORTE	2,000,000.00
15/08/2024	APORTE	2,000,000.00
15/08/2024	APORTE	2,000,000.00
15/08/2024	APORTE	48,000,000.00
15/08/2024	APORTE	48,000,000.00
15/08/2024	APORTE	48,000,000.00

* Últimas 10 movimentações