



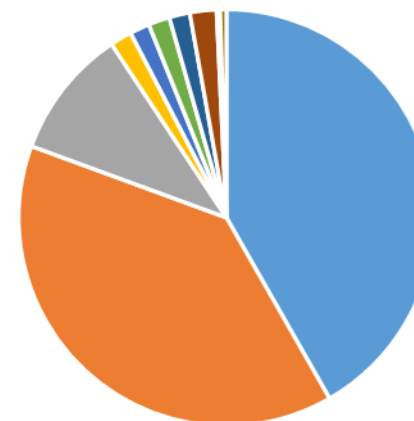
# Desempenho Mensal Camprev

Agosto/2024

# Composição da Carteira - Estratégia

Agosto/2024

Estratégia	Percentual (%)
CDI	41,74%
IPCA	38,84%
Ibovespa	10,09%
IMA-B 5	1,69%
IMA-B	1,54%
S&P 500	1,66%
IPCA + 6%	1,61%
MSCI ACWI	2,07%
Global BDRX	0,27%



■ CDI ■ IPCA ■ Ibovespa ■ IMA-B 5 ■ IMA-B  
■ S&P 500 ■ IPCA + 6% ■ MSCI ACWI ■ Global BDRX ■ SMALL CAP

Fonte: LDB Consultoria (2024)

# Enquadramento Geral da Carteira

Agosto/2024

Enquadramento por artigo	Tipo de Ativo	%	Limite Legislação	Limite Inferior	Alocação Atual	Alocação Objetivo	Limite Superior
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos	100%	100%	0%	38,23%	50,00%	100%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100% Títulos Públicos		100%	0%	1,88%	16,04%	100%
Art. 7º, I, "c"	Fundos de Índice 100% Títulos Públicos		100%	0%	0,00%	0,00%	100%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas		5%	0%	0,00%	0,00%	5%
Art. 7º, III, "a"	Fundos Renda Fixa		65%	0%	39,20%	11,72%	65%
Art. 7º, III, "b"	Fundos de Índice Renda Fixa		65%	0%	0,02%	0,00%	65%
Art. 7º, IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)		20%	0%	0,00%	0,00%	20%
Art. 7º, V, "a"	Cota Sênior de FIDC		5%	0%	0,02%	0,16%	5%
Art. 7º, V, "b"	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"		5%	0%	1,60%	1,53%	5%
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures Incentivadas		5%	0%	0,00%	0,00%	5%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35%	35%	0%	10,23%	12,00%	35%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações		35%	0%	0,00%	0,00%	35%
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	10%	10%	0%	0,00%	0,00%	10%
Art. 9º, II	Fundos de Investimento no Exterior		10%	0%	3,95%	3,00%	10%
Art. 9º, III	Fundos de Ações - BDR Nível I		10%	0%	0,27%	0,00%	10%
Art. 10, I	Fundos Multimercados	15%	10%	0%	4,34%	5,24%	10%
Art. 10, II	Fundo de Participação		5%	0%	0,22%	0,31%	5%
Art. 10, III	Fundos de Ações - Mercado de Acesso		5%	0%	0,00%	0,00%	5%
Art. 11	Fundo de Investimento Imobiliário	5%	5%	0%	0,06%	0,00%	5%
Art. 12, II	Empréstimos Consignado - Com Pró Gestão	10%	10%	0%	0,00%	0,00%	10%
<b>Enquadramento geral</b>	<b>Conjunto de artigos</b>	<b>%</b>	<b>Limite Legislação</b>	<b>Limite Inferior</b>	<b>Alocação Atual</b>	<b>Alocação Objetivo</b>	<b>Limite Superior</b>
Art. 14º	Art. 8º + Art. 10 + Art. 11	35%	35%	0%	14,85%	17,55%	35%

Fonte: LDB Consultoria e Res. BC CMN 4.963/21.

# Enquadramento da Carteira – Art. 21 Res. CMN nº 4.963/21

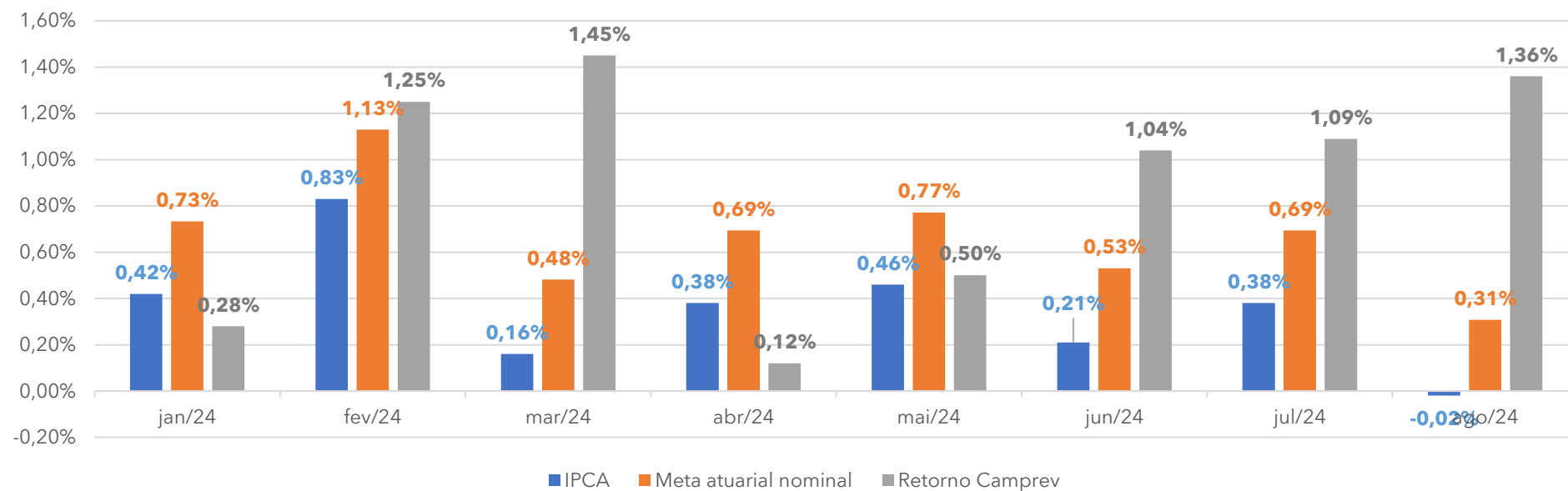
Agosto/2024

Gestora	Montante Camprev (R\$)	Montante Anbima (R\$)	Percentual Camprev (%)	Limite Legal (%)
AZ QUEST	R\$ 9.207.541,56	R\$ 29.333.856.490,34	0,03%	5,00%
BB	R\$ 294.739.010,85	R\$ 1.675.867.708.232,46	0,02%	5,00%
BRABESCO	R\$ 220.497.061,12	R\$ 744.478.036.890,64	0,03%	5,00%
BTG PACTUAL	R\$ 36.955.131,29	R\$ 430.296.775.858,76	0,01%	5,00%
CAIXA DTVM	R\$ 109.219.376,43	R\$ 517.453.190.374,42	0,02%	5,00%
GUEPARDO	R\$ 22.852.483,60	R\$ 4.782.280.946,61	0,48%	5,00%
ICATU	R\$ 19.109.660,04	R\$ 47.934.346.087,36	0,04%	5,00%
ITAÚ	R\$ 32.608.985,95	R\$ 994.245.383.170,29	0,00%	5,00%
MONGERAL	R\$ 23.448.270,15	R\$ 15.283.196.777,87	0,15%	5,00%
NAVI	R\$ 7.041.606,64	R\$ 5.416.129.025,69	0,13%	5,00%
PLURAL	R\$ 7.006.445,75	R\$ 64.255.348.951,09	0,01%	5,00%
PORTO SEGURO	R\$ 60.151.063,33	R\$ 30.570.161.641,08	0,20%	5,00%
RIO BRAVO	R\$ 38.645.258,32	R\$ 1.667.573.876,54	2,32%	5,00%
RJI	R\$ 3.821.875,26	R\$ 238.779.847,55	1,60%	5,00%
SAFRA	R\$ 22.104.882,02	R\$ 151.506.769.771,64	0,01%	5,00%
SANTANDER	R\$ 50.051.495,87	R\$ 349.810.210.253,73	0,01%	5,00%
SCHRODER	R\$ 28.507.019,48	R\$ 7.212.997.942,40	0,40%	5,00%
TARPON	R\$ 141.415.702,14	R\$ 5.624.172.238,06	2,51%	5,00%
TESOURO NACIONAL	R\$ 719.927.742,90	N/A	-	-
VILA RICA	R\$ 438.894,77	R\$ 903.039.523,77	0,05%	5,00%
WESTERN	R\$ 5.011.082,66	R\$ 40.505.781.380,76	0,01%	5,00%
XP	R\$ 30.284.787,93	R\$ 149.918.831.856,63	0,02%	5,00%

Fonte: LDB Consultoria, Anbima e Res. BC CMN 4.963/21

# Desempenho mês a mês vs Meta Atuarial

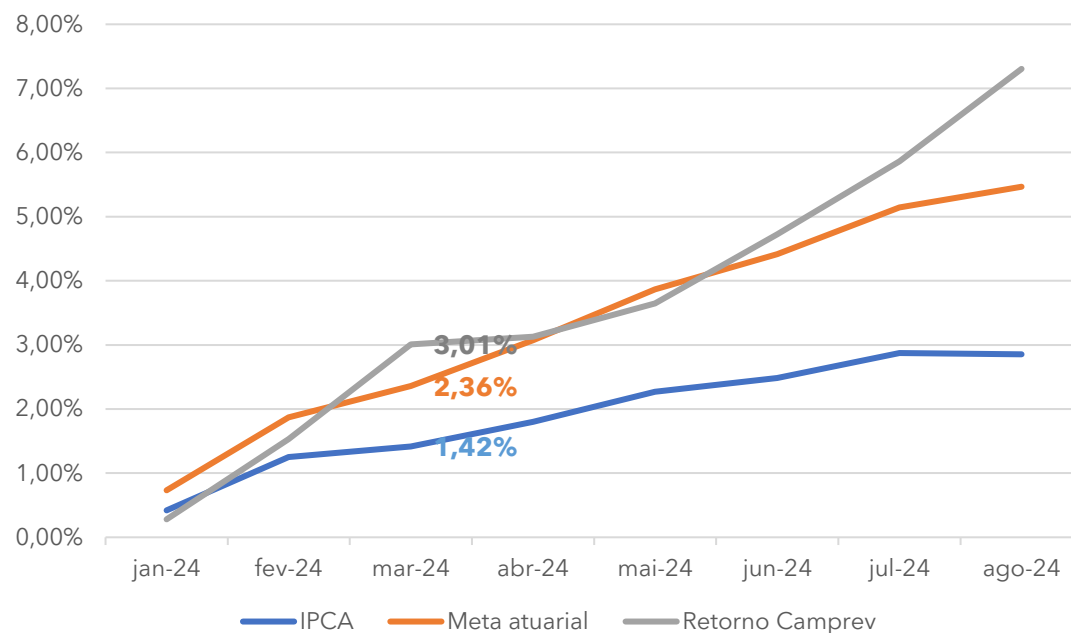
Agosto/2024



Fonte: LDB Consultoria e IBGE (2024)

# Desempenho no ano vs Meta Atuarial

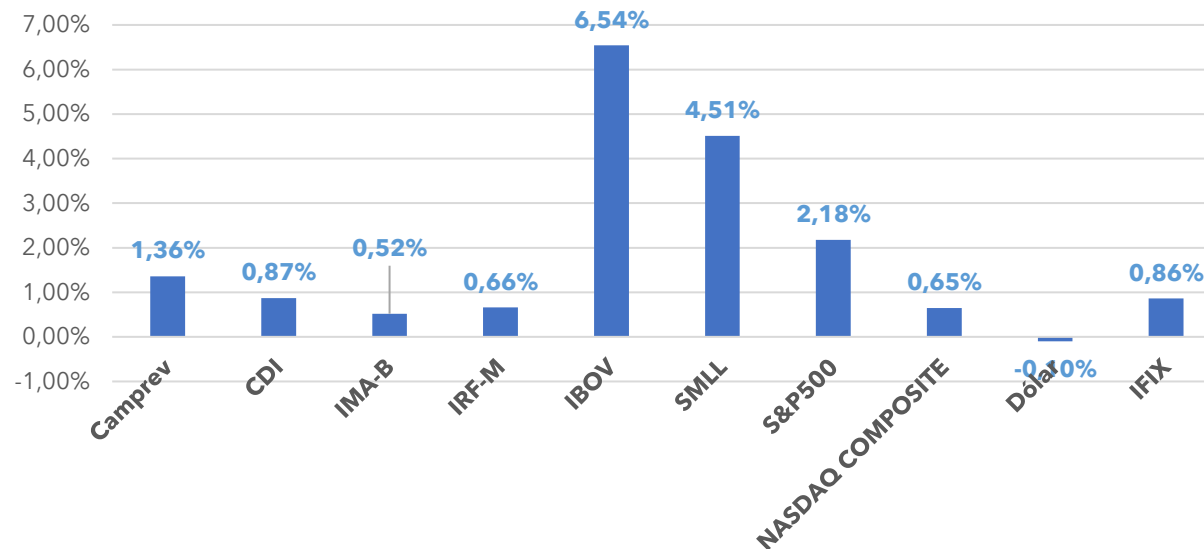
Agosto/2024



Fonte: LDB Consultoria e IBGE (2024)

# Desempenho no mês vs Benchmarks

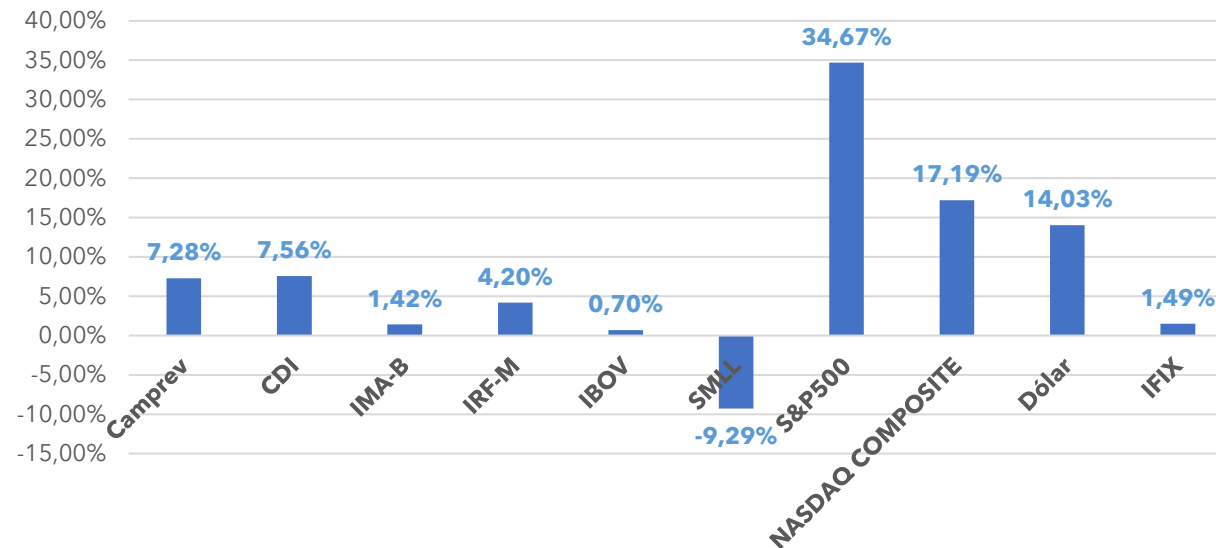
Agosto/2024



Fonte: LDB Consultoria e Quantum (2024)

# Desempenho no ano vs Benchmarks

Agosto/2024



Fonte: LDB Consultoria e Quantum (2024)



# Indicadores de Risco e Retorno e de Liquidez

Agosto/2024

Indicadores de Risco e Retorno no ano

Volatilidade	VaR para 5% e 21 dias	Índice de Sharpe
2,14%	0,85%	0,23

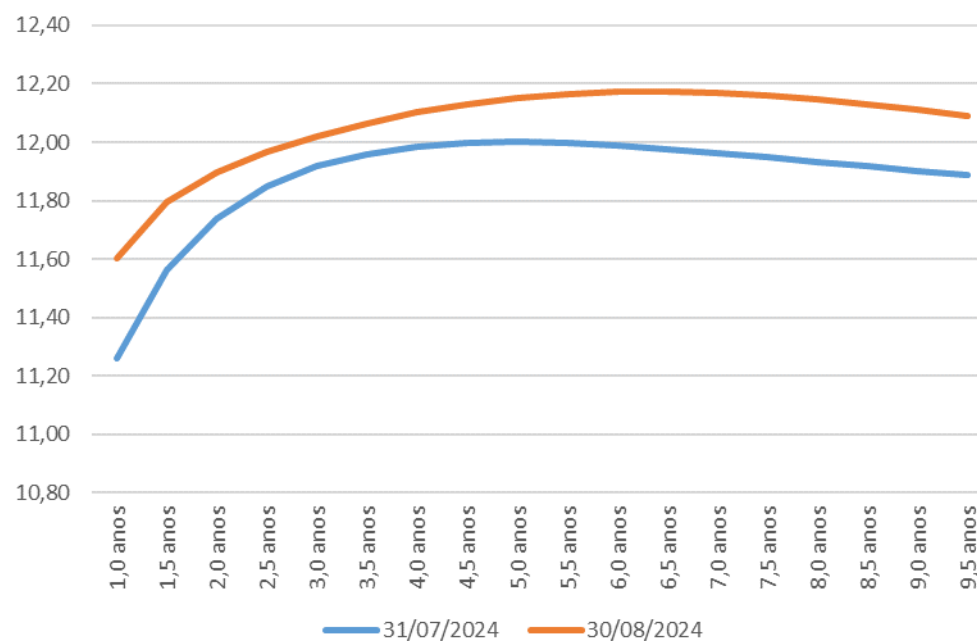
Indicadores de Liquidez

Período	Valor (R\$)	Percentual (%)
De 0 a 30 dias	R\$ 952.954.764,07	50,61%
De 31 a 365 dias	R\$ 230.580.987,07	12,25%
Acima de 365 dias	R\$ 699.509.626,92	37,15%

Fonte: LDB Consultoria (2024)

# Curva de juros nominais ao longo do mês

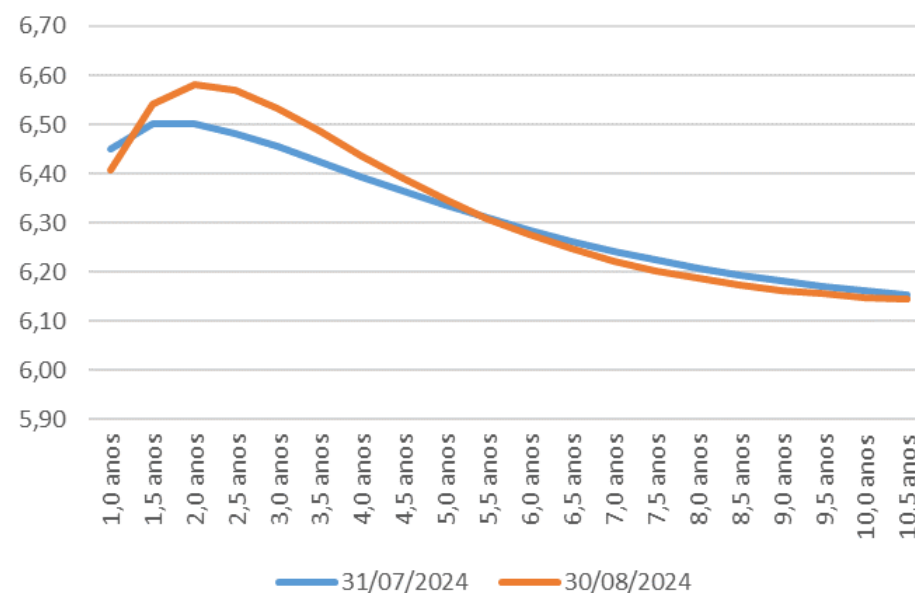
ETTJ dos papéis prefixados (LTN e NTN-F)  
Agosto/2024



Fonte: Anbima (2024)

# Curva de juros reais ao longo do mês

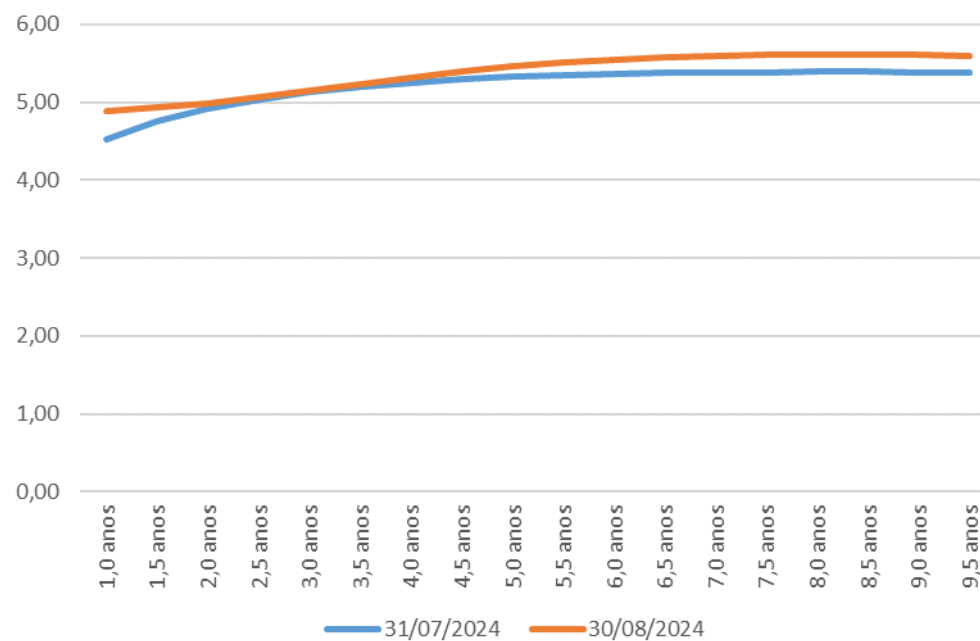
ETTJ das NTN-Bs  
Agosto/2024



Fonte: Anbima (2024)

# Curva de inflação implícita ao longo do mês

Agosto/2024



Fonte: Anbima (2024)

# Boletim Focus

Agosto/2024

Mediana - Agregado	2024							2025							2026							2027						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **				
IPCA (variação %)	4,12	4,25	4,26	▲ (7)	151	4,26	54	3,98	3,93	3,92	▼ (1)	150	3,85	54	3,60	3,60	3,60	== (13)	136	3,50	3,50	3,50	== (61)	124				
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,20	2,43	2,46	▲ (3)	114	2,47	30	1,92	1,86	1,85	▼ (3)	112	1,85	30	2,00	2,00	2,00	== (56)	84	2,00	2,00	2,00	== (58)	81				
Câmbio (R\$/US\$)	5,30	5,32	5,33	▲ (3)	124	5,32	34	5,30	5,30	5,30	== (4)	123	5,30	34	5,25	5,25	5,28	▲ (1)	95	5,25	5,27	5,30	▲ (2)	87				
Selic (% a.a)	10,50	10,50	10,50	== (11)	148	10,50	46	9,75	10,00	10,00	== (2)	145	10,00	45	9,00	9,50	9,50	== (1)	122	9,00	9,00	9,00	== (15)	114				
IGP-M (variação %)	3,70	3,77	3,68	▼ (1)	78	3,64	28	4,00	4,00	3,97	▼ (1)	72	4,00	27	4,00	4,00	4,00	== (5)	57	3,78	3,80	3,80	== (3)	51				
IPCA Administrados (variação %)	4,59	4,76	4,79	▲ (1)	93	4,79	29	3,90	3,87	3,85	▼ (2)	89	3,87	27	3,50	3,70	3,70	== (1)	61	3,50	3,50	3,50	== (48)	56				
Conta corrente (US\$ bilhões)	-38,20	-36,30	-36,30	== (1)	29	-33,50	7	-43,25	-43,50	-43,50	== (1)	27	-44,00	7	-44,60	-44,90	-44,90	== (2)	20	-46,35	-47,70	-47,70	== (1)	15				
Balança comercial (US\$ bilhões)	82,00	83,53	83,50	▼ (1)	27	83,55	4	78,00	79,50	79,00	▼ (1)	23	72,00	3	80,00	80,00	80,00	== (6)	17	80,11	80,11	80,11	== (2)	14				
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	69,59	70,25	71,00	▲ (4)	26	76,15	6	71,60	72,00	73,00	▲ (2)	25	80,00	6	79,41	80,00	80,00	== (1)	20	80,00	80,00	80,00	== (9)	17				
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,70	63,70	63,65	▼ (1)	28	63,85	8	66,00	66,55	66,45	▼ (1)	28	66,78	8	68,38	69,30	69,30	== (1)	25	70,20	71,65	71,50	▼ (1)	23				
Resultado primário (% do PIB)	-0,70	-0,65	-0,60	▲ (1)	43	-0,59	12	-0,70	-0,77	-0,76	▲ (1)	42	-0,73	12	-0,50	-0,50	-0,65	▼ (1)	34	-0,30	-0,40	-0,50	▼ (2)	29				
Resultado nominal (% do PIB)	-7,30	-7,35	-7,40	▼ (2)	29	-7,00	6	-6,50	-6,50	-6,79	▼ (1)	28	-6,69	6	-6,00	-6,00	-6,00	== (2)	25	-6,00	-6,00	-6,10	▼ (1)	21				

\* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento \*\* respondentes nos últimos 30 dias \*\*\* respondentes nos últimos 5 dias úteis

Fonte: BCB (2024)