

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.524.417,94	2,95%	697	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	11.924.768,34	5,40%	862	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.437.691,65	1,10%	1.141	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	D+0	Não há	7.436.484,79	3,36%	190	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	7.157.339,46	3,24%	382	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	4.521.979,61	2,05%	219	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2028	10.142.716,60	4,59%	105	1,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	4.889.684,88	2,21%	370	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRASESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.341.736,16	2,42%	85	1,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	10.173.341,43	4,60%	308	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	2.652.769,50	1,20%	225	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	8.786.815,99	3,98%	86	2,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	5.559.381,73	2,52%	110	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.835.871,07	3,55%	777	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.342.258,72	5,58%	903	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.151.072,17	1,43%	1.155	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	13.019.987,20	5,89%	430	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	D+0	46524	4.179.286,01	1,89%	10	2,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.971.726,92	1,80%	65	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.613.106,73	4,80%	238	1,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

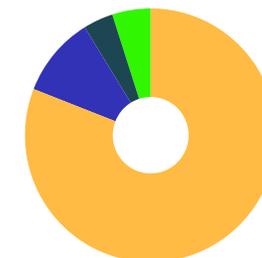
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	12.155.095,12	5,50%	1.148	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.407.377,95	1,09%	101	0,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.466.456,93	3,38%	488	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.869.435,24	1,75%	113	0,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.323.502,56	3,31%	1.011	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.006.373,59	1,36%	407	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.502.338,86	1,13%	1.174	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.111.630,42	0,50%	2.491	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.183.392,03	0,54%	1.088	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.571.455,18	1,62%	16.298	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	498.784,24	0,23%	371	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.108.431,72	0,95%	118	0,69%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	5.635.630,75	2,55%	200	0,74%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.092.902,97	0,95%	123	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	3.026.142,97	1,37%	338	0,66%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	616.486,81	0,28%	52	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	347.008,04	0,16%	112	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	739.529,97	0,33%	42	0,18%	Artigo 9º, Inciso II
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	2.967.317,09	1,34%	89	0,52%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.430.399,79	0,65%	155	0,09%	Artigo 9º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.459.151,29	1,11%	448	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	902.271,14	0,41%	326	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.269.524,06	1,48%	4.447	0,25%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	654.799,36	0,30%	7.627	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	255.641,95	0,12%	4.679	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	2.022.141,05	0,91%	565	0,42%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTI...	D+1	1185 dias	4.132.832,70	1,87%	12	7,35%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	606.236,06	0,27%	103	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			221.024.726,74				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.051.236,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	132.049.330,17	59,74%	30,00%	59,00%	90,00%	66.872.923,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	46.841.348,12	21,19%	10,00%	13,00%	60,00%	85.773.487,92
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	44.204.945,35
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.420.494,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.051.236,34
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.420.494,53
Total Renda Fixa	100,00%	178.890.678,29	80,94%	40,00%	74,00%	184,00%	



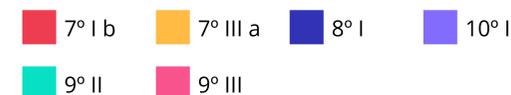
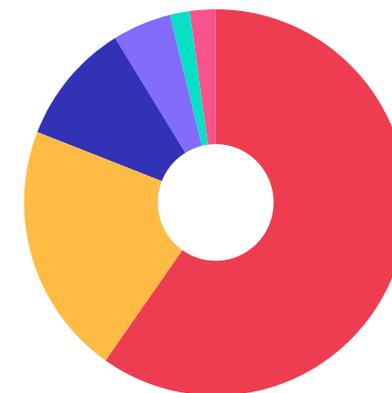
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	22.694.203,99	10,27%	5,00%	16,00%	30,00%	43.613.214,03
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.051.236,34
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.941.175,18	4,95%	2,00%	4,00%	10,00%	11.161.297,49
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	11.051.236,34
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	11.051.236,34
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	33.635.379,17	15,22%	7,00%	23,00%	55,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.706.847,06	1,68%	0,00%	1,50%	10,00%	18.395.625,61
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.791.822,22	2,17%	0,00%	1,50%	10,00%	17.310.650,45
Total Exterior	10,00%	8.498.669,28	3,85%	0,00%	3,00%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	132.049.330,17	59,74	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	46.841.348,12	21,19	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso I	22.694.203,99	10,27	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	3.706.847,06	1,68	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	4.791.822,22	2,17	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	10.941.175,18	4,95	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	91.309.348,46	41,31	-
CAIXA DTVM	89.082.085,99	40,30	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	17.822.787,00	8,06	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	11.773.873,33	5,33	-
BANCO J. SAFRA S/A	4.132.832,70	1,87	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.026.142,97	1,37	-
ICATU VANGUARDA	2.022.141,05	0,91	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	1.855.515,24	0,84	-

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,60%	4,97%	2,29%	5,01%	9,44%	18,54%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,02%	-0,87%	-2,58%	-0,87%	0,28%	-	1,37%	4,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,30%	0,57%	-0,45%	0,57%	4,43%	-	1,57%	3,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02%	1,97%	0,22%	1,97%	6,11%	17,70%	1,37%	2,71%
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,53%	1,33%	-0,45%	1,33%	7,78%	26,07%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,57%	0,97%	-0,63%	0,97%	7,13%	24,71%	1,99%	2,83%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	3,11%	1,05%	3,11%	8,11%	18,30%	0,92%	1,71%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	4,51%	2,00%	4,51%	10,95%	26,28%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	4,40%	1,93%	4,40%	10,67%	25,58%	0,24%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	4,49%	1,97%	4,49%	10,79%	25,84%	0,25%	0,35%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,37%	3,21%	1,18%	3,21%	8,00%	18,98%	0,81%	1,73%
IMA-B (Benchmark)	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,71%	-3,46%	-1,07%	-3,46%	-2,66%	2,10%	1,95%	5,42%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,08%	-2,42%	-2,13%	-2,42%	1,00%	13,67%	2,00%	4,27%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,03%	-1,38%	-1,48%	-1,38%	2,47%	16,13%	1,95%	3,92%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,98%	-1,28%	-1,34%	-1,28%	2,67%	16,26%	1,89%	3,89%
IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,32%	1,37%	-0,24%	1,37%	7,62%	25,50%	1,71%	2,51%
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	5,24%	2,53%	5,24%	11,71%	26,83%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,84%	5,69%	2,69%	5,69%	12,72%	28,36%	0,02%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83%	5,49%	2,62%	5,49%	12,54%	27,99%	0,02%	0,11%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	-0,02%	-0,95%	-2,66%	-0,95%	0,17%	-	1,37%	4,63%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	3,84%	1,40%	3,84%	9,79%	25,12%	0,47%	0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	5,20%	2,51%	5,20%	11,62%	26,72%	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	2,79%	2,86%	2,79%	5,46%	7,72%	0,48%	3,87%
IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,78%	2,89%	5,78%	11,46%	-	0,48%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,73%	2,86%	5,73%	11,35%	20,70%	0,48%	0,87%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,60%	3,80%	1,59%	3,80%	8,65%	23,59%	0,34%	0,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,17%	2,36%	0,55%	2,36%	7,39%	23,06%	0,88%	1,46%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	2,71%	2,88%	2,71%	5,17%	-	0,48%	4,11%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1,25%	1,20%	-0,03%	1,20%	9,30%	41,36%	3,60%	5,46%

CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3,12%	12,33%	3,12%	12,33%	22,76%	-	2,92%	9,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00%	1,90%	0,13%	1,90%	8,57%	23,52%	1,85%	3,17%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,27%	-1,91%	-1,97%	-1,91%	5,94%	21,72%	3,43%	4,88%

Global BDRX (Benchmark)	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,73%	39,52%	21,34%	39,52%	52,18%	72,57%	8,26%	13,94%

Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1,55%	-6,95%	-2,88%	-6,95%	5,04%	22,95%	5,95%	13,85%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	1,03%	-15,26%	-10,27%	-15,26%	-12,67%	-9,58%	7,12%	17,38%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,11%	-6,86%	-7,64%	-6,86%	4,76%	26,67%	8,59%	15,61%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	0,38%	-8,87%	-7,45%	-8,87%	1,55%	15,85%	6,71%	14,65%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	-0,13%	-13,33%	-10,63%	-13,33%	-7,64%	10,00%	7,28%	14,88%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,13%	-7,60%	-3,48%	-7,60%	3,60%	13,77%	5,36%	13,79%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,37%	-6,68%	-5,52%	-6,68%	4,80%	29,31%	6,88%	14,31%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

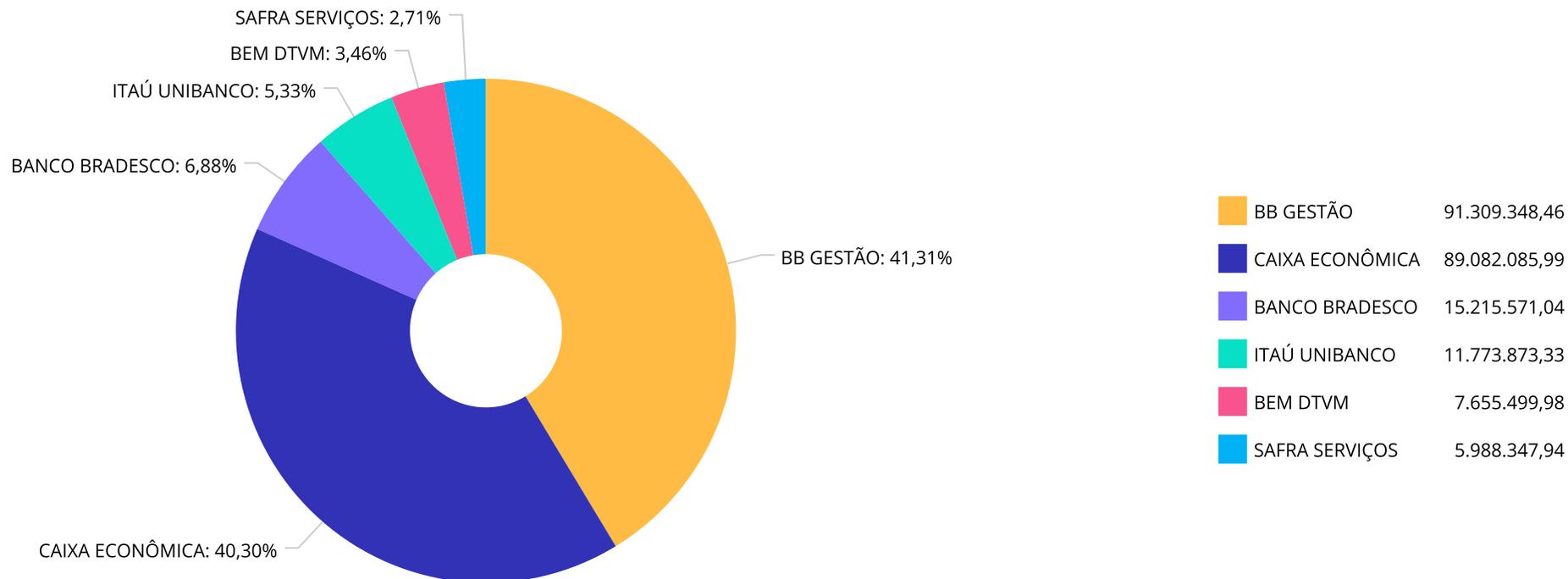
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,37%	-8,82%	-5,44%	-8,82%	2,40%	17,87%	5,99%	14,12%
IDIV (Benchmark)	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,09%	-5,85%	-7,70%	-5,85%	0,15%	28,15%	6,91%	14,69%
MSCI ACWI (Benchmark)	8,28%	26,67%	13,94%	26,67%	35,48%	42,62%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,90%	16,70%	5,01%	16,70%	29,37%	66,02%	2,97%	11,08%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,47%	14,48%	3,92%	14,48%	22,70%	44,25%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	3,84%	16,39%	4,89%	16,39%	28,95%	64,85%	2,95%	11,02%
SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-0,04%	-12,82%	-8,16%	-12,82%	-13,42%	-5,01%	8,45%	19,39%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

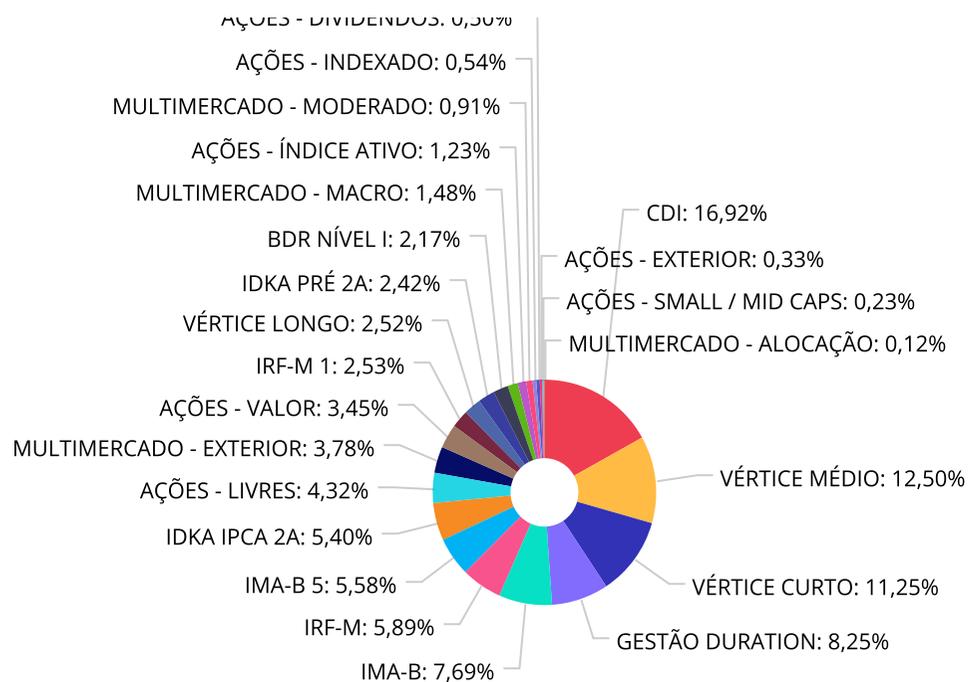
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,77%	30,18%	14,26%	30,18%	42,38%	57,22%	6,32%	13,607%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,45%	28,06%	16,10%	28,06%	39,91%	49,16%	6,55%	12,450%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,73%	39,52%	21,34%	39,52%	52,18%	72,57%	8,26%	13,945%

MSCI WORLD (Benchmark)	8,10%	27,24%	13,69%	27,24%	36,54%	46,37%	-	-
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	10,44%	31,18%	15,92%	31,18%	42,73%	51,86%	5,84%	12,987%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	6,01%	22,20%	10,70%	22,20%	26,37%	31,91%	6,58%	13,464%

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



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

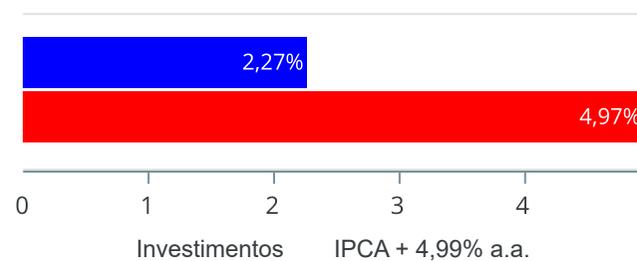


■ CDI	37.387.912,99	■ VÉRTICE MÉDIO	27.630.798,21	■ VÉRTICE CURTO	24.873.135,27	■ GESTÃO DURATION	18.229.724,25
■ IMA-B	16.992.211,60	■ IRF-M	13.019.987,20	■ IMA-B 5	12.342.258,72	■ IDKA IPCA 2A	11.924.768,34
■ AÇÕES - LIVRES	9.554.093,97	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	8.361.185,21	■ AÇÕES - VALOR	7.621.384,80	■ IRF-M 1	5.588.763,82
■ VÉRTICE LONGO	5.559.381,73	■ IDKA PRÉ 2A	5.341.736,16	■ BDR NÍVEL I	4.791.822,22	■ MULTIMERCADO - MACRO	3.269.524,06
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.724.918,53	■ MULTIMERCADO - MODERADO	2.022.141,05	■ AÇÕES - INDEXADO	1.183.392,03	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.111.630,42
■ AÇÕES - EXTERIOR	739.529,97	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	498.784,24	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	255.641,95		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

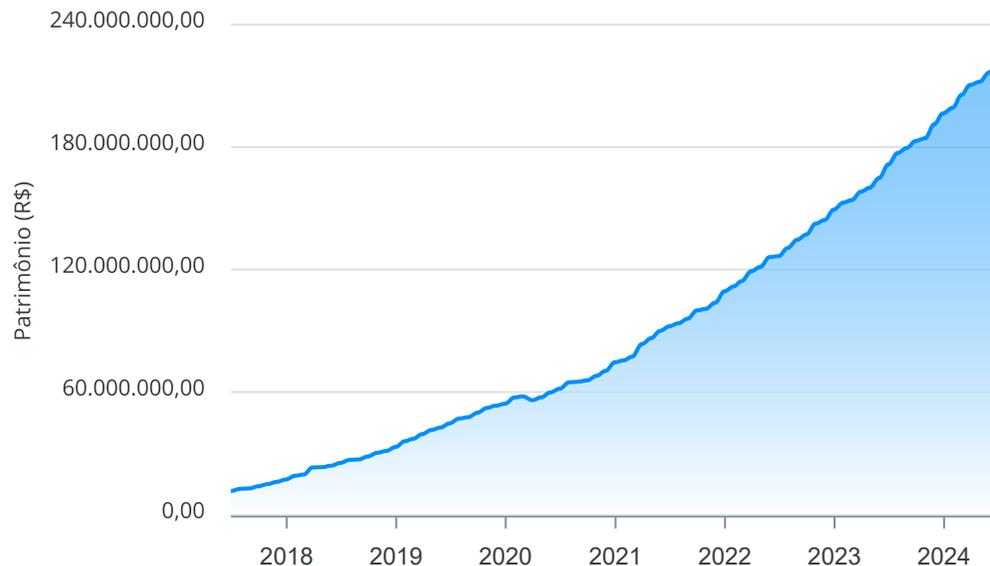
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	190.720.289,47	2.690.172,22	303.363,97	193.131.552,71	24.454,99	24.454,99	0,01%	0,01%	0,85%	0,85%	1,49%	1,55%
Fevereiro	193.131.552,71	5.453.268,00	1.161.385,35	199.269.550,25	1.846.114,89	1.870.569,88	0,94%	0,95%	1,20%	2,06%	46,04%	2,05%
Março	199.269.550,25	13.358.483,49	10.319.603,54	203.932.602,90	1.624.172,70	3.494.742,58	0,80%	1,76%	0,55%	2,62%	67,16%	1,42%
Abril	203.932.602,90	3.394.899,64	332.311,52	205.451.325,29	-1.543.865,73	1.950.876,85	-0,75%	1,00%	0,81%	3,45%	28,99%	1,96%
Mai	205.451.325,29	22.052.048,49	18.836.323,25	209.803.538,90	1.136.488,37	3.087.365,22	0,54%	1,55%	0,87%	4,35%	35,66%	1,81%
Junho	209.803.538,90	7.807.960,22	4.991.232,86	214.124.628,04	1.504.361,78	4.591.727,00	0,71%	2,27%	0,60%	4,97%	45,64%	1,83%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



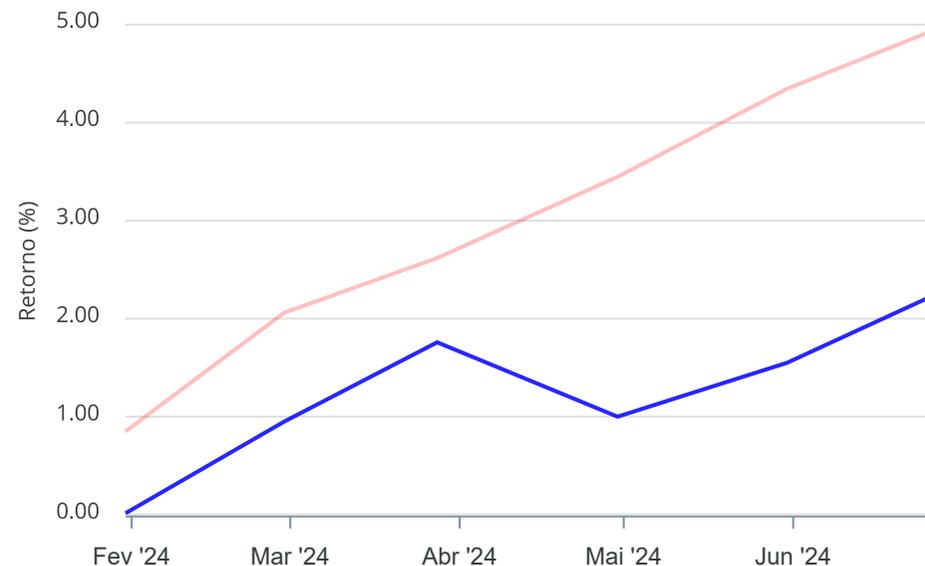
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	7.074.752,58	0,00	0,00	7.157.339,46	82.586,88	1,17%	1,17%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.622.187,98	0,00	0,00	2.652.769,50	30.581,52	1,17%	1,17%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.833.613,83	0,00	0,00	4.889.684,88	56.071,05	1,16%	1,16%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.056.745,15	0,00	0,00	10.173.341,43	116.596,28	1,16%	1,16%	0,48%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.404.639,68	0,00	0,00	7.466.456,93	61.817,25	0,83%	0,83%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.981.766,41	0,00	0,00	3.006.373,59	24.607,18	0,83%	0,83%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.126.017,82	245.193,40	106.416,07	7.323.502,56	58.707,41	0,80%	0,82%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	7.378.426,67	0,00	0,00	7.436.484,79	58.058,12	0,79%	0,79%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.132.016,38	0,00	0,00	3.151.072,17	19.055,79	0,61%	0,61%	0,25%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.423.021,52	0,00	0,00	2.437.691,65	14.670,13	0,61%	0,61%	0,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	8.318.421,75	4.420.587,51	660.477,54	12.155.095,12	76.563,40	0,60%	0,79%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.846.398,76	0,00	0,00	3.869.435,24	23.036,48	0,60%	0,60%	0,34%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.499.528,54	0,00	0,00	6.524.417,94	24.889,40	0,38%	0,38%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.296.471,41	0,00	0,00	12.342.258,72	45.787,31	0,37%	0,37%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.894.335,04	0,00	0,00	11.924.768,34	30.433,30	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.822.537,29	0,00	0,00	7.835.871,07	13.333,78	0,17%	0,17%	0,88%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.788.227,15	0,00	0,00	8.786.815,99	-1.411,16	-0,02%	-0,02%	1,37%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	4.180.110,18	0,00	0,00	4.179.286,01	-824,17	-0,02%	-0,02%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.857.673,53	665.437,91	0,00	4.521.979,61	-1.131,83	-0,03%	-0,02%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	7.452.314,79	2.717.310,60	0,00	10.142.716,60	-26.908,79	-0,26%	-0,30%	1,57%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.061.583,99	0,00	0,00	13.019.987,20	-41.596,79	-0,32%	-0,32%	1,71%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	5.372.593,05	0,00	0,00	5.341.736,16	-30.856,89	-0,57%	-0,57%	1,99%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.599.343,26	0,00	0,00	5.559.381,73	-39.961,53	-0,71%	-0,71%	1,95%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.718.242,05	0,00	0,00	10.613.106,73	-105.135,32	-0,98%	-0,98%	1,89%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.432.474,14	0,00	0,00	2.407.377,95	-25.096,19	-1,03%	-1,03%	1,95%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.015.099,69	0,00	0,00	3.971.726,92	-43.372,77	-1,08%	-1,08%	2,00%
Total Renda Fixa	171.188.542,64	8.048.529,42	766.893,61	178.890.678,29	420.499,84	0,24%		0,91%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	630.218,15	0,00	0,00	654.799,36	24.581,21	3,90%	3,90%	2,97%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	583.819,22	0,00	0,00	606.236,06	22.416,84	3,84%	3,84%	2,95%
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIME...	4.007.737,32	0,00	0,00	4.132.832,70	125.095,38	3,12%	3,12%	2,92%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.505.006,52	0,00	0,00	3.571.455,18	66.448,66	1,90%	1,90%	5,03%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.165.277,94	0,00	0,00	1.183.392,03	18.114,09	1,55%	1,55%	5,95%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.064.540,81	0,00	0,00	2.092.902,97	28.362,16	1,37%	1,37%	5,99%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.985.405,67	0,00	0,00	3.026.142,97	40.737,30	1,36%	1,36%	6,88%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	1.997.149,66	0,00	0,00	2.022.141,05	24.991,39	1,25%	1,25%	3,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.474.321,15	0,00	0,00	2.502.338,86	28.017,71	1,13%	1,13%	5,36%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.099.604,46	0,00	0,00	1.111.630,42	12.025,96	1,09%	1,09%	6,91%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	610.198,71	0,00	0,00	616.486,81	6.288,10	1,03%	1,03%	7,12%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	345.708,04	0,00	0,00	347.008,04	1.300,00	0,38%	0,38%	6,71%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.269.420,59	0,00	0,00	3.269.524,06	103,47	0,00%	0,00%	1,85%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	498.960,98	0,00	0,00	498.784,24	-176,74	-0,04%	-0,04%	8,45%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.641.816,29	0,00	0,00	5.635.630,75	-6.185,54	-0,11%	-0,11%	8,59%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.111.139,34	0,00	0,00	2.108.431,72	-2.707,62	-0,13%	-0,13%	7,28%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	256.330,51	0,00	0,00	255.641,95	-688,56	-0,27%	-0,27%	3,43%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.340.260,61	0,00	2.301.855,13	0,00	-38.405,48	-1,64%	2,27%	6,58%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	2.078.421,29	0,00	2.029.500,19	0,00	-48.921,10	-2,35%	1,92%	6,48%
Total Renda Variável	37.665.337,26	0,00	4.331.355,32	33.635.379,17	301.397,23	0,80%		5,48%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.181.405,09	0,00	0,00	2.459.151,29	277.746,20	12,73%	12,73%	8,26%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	816.931,67	0,00	0,00	902.271,14	85.339,47	10,45%	10,45%	6,55%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	2.686.862,76	0,00	0,00	2.967.317,09	280.454,33	10,44%	10,44%	5,84%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.303.075,86	0,00	0,00	1.430.399,79	127.323,93	9,77%	9,77%	6,32%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	697.587,15	0,00	0,00	739.529,97	41.942,82	6,01%	6,01%	6,58%
Total Exterior	7.685.862,53	0,00	0,00	8.498.669,28	812.806,75	10,58%		6,76%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.890.355,91	0,00	0,00	10.173.341,43	282.985,52	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.140.686,64	4.043.240,78	9.114.165,13	7.323.502,56	253.740,27	1,57%	2,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	8.234.162,42	8.044.733,73	4.328.472,00	12.155.095,12	204.670,97	1,26%	2,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	9.135.246,74	0,00	1.900.000,00	7.436.484,79	201.238,05	2,20%	2,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	6.956.650,15	0,00	0,00	7.157.339,46	200.689,31	2,88%	2,88%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.271.135,08	0,00	0,00	7.466.456,93	195.321,85	2,69%	2,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.198.292,49	0,00	0,00	12.342.258,72	143.966,23	1,18%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.753.622,67	0,00	0,00	4.889.684,88	136.062,21	2,86%	2,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.300.181,07	0,00	2.500.000,00	11.924.768,34	124.587,27	0,87%	1,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.434.640,08	0,00	0,00	6.524.417,94	89.777,86	1,40%	1,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.929.737,63	0,00	0,00	3.006.373,59	76.635,96	2,62%	2,62%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.578.420,89	0,00	0,00	2.652.769,50	74.348,61	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.090.323,99	0,00	0,00	3.151.072,17	60.748,18	1,97%	1,97%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.808.823,43	0,00	0,00	3.869.435,24	60.611,81	1,59%	1,59%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	8.983.192,14	246.357,66	8.786.815,99	49.981,51	0,56%	-2,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.391.641,80	0,00	0,00	2.437.691,65	46.049,85	1,93%	1,93%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.792.927,68	0,00	0,00	7.835.871,07	42.943,39	0,55%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	10.117.310,60	0,00	10.142.716,60	25.406,00	0,25%	-0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.962.187,24	665.437,91	113.804,68	4.521.979,61	8.159,14	0,18%	0,22%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.051.765,69	0,00	0,00	13.019.987,20	-31.778,49	-0,24%	-0,24%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	5.375.569,06	0,00	0,00	5.341.736,16	-33.832,90	-0,63%	-0,63%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.443.437,61	0,00	0,00	2.407.377,95	-36.059,66	-1,48%	-1,48%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.619.614,29	0,00	0,00	5.559.381,73	-60.232,56	-1,07%	-1,07%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.058.277,43	0,00	0,00	3.971.726,92	-86.550,51	-2,13%	-2,13%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	4.170.217,36	119.961,30	0,00	4.179.286,01	-110.892,65	-2,58%	-2,66%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.757.722,37	0,00	0,00	10.613.106,73	-144.615,64	-1,34%	-1,34%
Total Renda Fixa	163.345.639,72	31.973.876,46	18.202.799,47	178.890.678,29	1.773.961,58	1,00%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIME...	4.007.639,88	0,00	0,00	4.132.832,70	125.192,82	3,12%	3,12%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	623.543,88	0,00	0,00	654.799,36	31.255,48	5,01%	5,01%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	577.994,58	0,00	0,00	606.236,06	28.241,48	4,89%	4,89%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	2.004.443,49	0,00	2.022.141,05	17.697,56	0,88%	-0,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.265.359,20	0,00	0,00	3.269.524,06	4.164,86	0,13%	0,13%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	260.768,63	0,00	0,00	255.641,95	-5.126,68	-1,97%	-1,97%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.009.590,01	0,00	2.004.443,49	0,00	-5.146,52	-0,26%	-1,94%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	374.934,29	0,00	0,00	347.008,04	-27.926,25	-7,45%	-7,45%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.218.518,76	0,00	0,00	1.183.392,03	-35.126,73	-2,88%	-2,88%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	543.091,95	0,00	0,00	498.784,24	-44.307,71	-8,16%	-8,16%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	687.065,87	0,00	0,00	616.486,81	-70.579,06	-10,27%	-10,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.592.584,41	0,00	0,00	2.502.338,86	-90.245,55	-3,48%	-3,48%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.204.370,58	0,00	0,00	1.111.630,42	-92.740,16	-7,70%	-7,70%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.213.323,43	0,00	0,00	2.092.902,97	-120.420,46	-5,44%	-5,44%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.718.271,06	0,00	0,00	3.571.455,18	-146.815,88	-3,95%	-3,95%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.202.848,29	0,00	0,00	3.026.142,97	-176.705,32	-5,52%	-5,52%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.535.846,62	0,00	2.301.855,13	0,00	-233.991,49	-9,23%	-5,62%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕE...	2.269.457,31	0,00	2.029.500,19	0,00	-239.957,12	-10,57%	-6,66%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.359.222,10	0,00	0,00	2.108.431,72	-250.790,38	-10,63%	-10,63%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6.102.025,48	0,00	0,00	5.635.630,75	-466.394,73	-7,64%	-7,64%
Total Renda Variável	39.766.456,33	2.004.443,49	6.335.798,81	33.635.379,17	-1.799.721,84	-4,31%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.026.683,38	0,00	0,00	2.459.151,29	432.467,91	21,34%	21,34%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	2.559.803,53	0,00	0,00	2.967.317,09	407.513,56	15,92%	15,92%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.251.894,66	0,00	0,00	1.430.399,79	178.505,13	14,26%	14,26%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	777.133,59	0,00	0,00	902.271,14	125.137,55	16,10%	16,10%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	668.030,08	0,00	0,00	739.529,97	71.499,89	10,70%	10,70%
Total Exterior	7.283.545,24	0,00	0,00	8.498.669,28	1.215.124,04	16,68%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	13.691.484,04	10.175.860,88	12.271.154,80	12.155.095,12	558.905,00	4,31%	5,24%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.897.524,94	0,00	279.372,23	10.173.341,43	555.188,72	5,73%	2,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	10.863.395,62	0,00	3.900.000,00	7.436.484,79	473.089,17	4,93%	5,20%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.128.512,99	13.837.127,26	11.090.121,97	7.323.502,56	447.984,28	4,11%	5,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.013.391,49	0,00	2.500.000,00	11.924.768,34	411.376,85	2,98%	3,11%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.064.769,54	0,00	0,00	7.466.456,93	401.687,39	5,69%	5,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	6.963.403,38	0,00	199.893,83	7.157.339,46	393.829,91	5,77%	5,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.368.399,53	599.359,97	0,00	12.342.258,72	374.499,22	3,20%	3,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.757.021,61	0,00	134.206,39	4.889.684,88	266.869,66	5,73%	5,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.337.513,38	3.000.000,00	0,00	6.524.417,94	186.904,56	3,73%	3,84%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.844.372,31	0,00	0,00	13.019.987,20	175.614,89	1,36%	1,37%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	6.166.673,93	1.508.449,84	0,00	7.835.871,07	160.747,30	2,30%	2,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.849.898,99	0,00	0,00	3.006.373,59	156.474,60	5,49%	5,49%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.582.750,70	0,00	75.921,87	2.652.769,50	145.940,67	5,76%	2,71%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.727.904,05	0,00	0,00	3.869.435,24	141.531,19	3,80%	3,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.015.819,18	0,00	0,00	3.151.072,17	135.252,99	4,48%	4,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.334.944,85	0,00	0,00	2.437.691,65	102.746,80	4,39%	4,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.894.058,26	665.437,91	113.804,68	4.521.979,61	76.288,12	1,95%	1,97%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	5.290.607,48	0,00	0,00	5.341.736,16	51.128,68	0,97%	0,97%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	8.983.192,14	246.357,66	8.786.815,99	49.981,51	-0,02%	-0,87%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	10.117.310,60	0,00	10.142.716,60	25.406,00	-0,26%	0,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	444.404,18	2.000.000,00	0,00	2.407.377,95	-37.026,23	-1,48%	-1,38%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	4.098.317,47	119.961,30	0,00	4.179.286,01	-38.992,76	-0,89%	-0,95%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.758.721,34	0,00	153.155,74	5.559.381,73	-46.183,87	-0,84%	-3,46%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.070.154,88	0,00	0,00	3.971.726,92	-98.427,96	-2,42%	-2,42%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.754.907,67	2.000.000,00	0,00	10.613.106,73	-141.800,94	-1,31%	-1,28%
Total Renda Fixa	171.188.542,64	8.048.529,42	766.893,61	178.890.678,29	420.499,84	0,24%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIME...	3.679.289,31	0,00	0,00	4.132.832,70	453.543,39	12,32%	12,33%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	561.106,21	0,00	0,00	654.799,36	93.693,15	16,71%	16,70%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	520.880,03	0,00	0,00	606.236,06	85.356,03	16,39%	16,39%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.208.574,27	0,00	0,00	3.269.524,06	60.949,79	1,90%	1,90%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	2.004.443,49	0,00	2.022.141,05	17.697,56	0,89%	1,20%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.988.168,98	0,00	2.004.443,49	0,00	16.274,51	0,83%	-0,89%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	260.624,22	0,00	0,00	255.641,95	-4.982,27	-1,92%	-1,91%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	380.784,59	0,00	0,00	347.008,04	-33.776,55	-8,87%	-8,87%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.180.658,72	0,00	0,00	1.111.630,42	-69.028,30	-5,84%	-5,85%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	572.151,13	0,00	0,00	498.784,24	-73.366,89	-12,83%	-12,82%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.271.707,88	0,00	0,00	1.183.392,03	-88.315,85	-6,96%	-6,94%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	727.534,10	0,00	0,00	616.486,81	-111.047,29	-15,26%	-15,26%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.183.819,83	2.000.000,00	0,00	3.026.142,97	-157.676,86	-6,62%	-6,68%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.295.303,99	0,00	0,00	2.092.902,97	-202.401,02	-8,82%	-8,82%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.708.129,32	0,00	0,00	2.502.338,86	-205.790,46	-7,61%	-7,60%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.432.714,40	0,00	0,00	2.108.431,72	-324.282,68	-13,33%	-13,33%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.688.044,10	0,00	2.301.855,13	0,00	-386.188,97	-14,36%	-10,96%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	2.418.515,86	0,00	2.029.500,19	0,00	-389.015,67	-16,08%	-12,41%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6.050.731,38	0,00	0,00	5.635.630,75	-415.100,63	-6,86%	-6,86%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4.017.663,54	0,00	0,00	3.571.455,18	-446.208,36	-11,10%	-11,11%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Variável	39.648.657,30	0,00	6.335.798,81	33.635.379,17	322.520,68	0,81%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	2.262.043,49	0,00	0,00	2.967.317,09	705.273,60	31,18%	31,18%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.762.624,67	0,00	0,00	2.459.151,29	696.526,62	39,52%	39,52%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.098.808,50	0,00	0,00	1.430.399,79	331.591,29	30,18%	30,18%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	704.550,58	0,00	0,00	902.271,14	197.720,56	28,07%	28,06%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	605.173,64	0,00	0,00	739.529,97	134.356,33	22,20%	22,20%
Total Exterior	7.685.862,53	0,00	0,00	8.498.669,28	812.806,75	10,58%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

