

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
TÍTULOS PÚBLICOS			42.369.279,60	16,21%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.758.836,23	1,44%	792	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.497.749,12	1,72%	638	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	1.218.568,79	0,47%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2028	10.042.924,29	3,84%	105	1,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	22.129.045,95	8,47%	308	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	15.895.437,30	6,08%	225	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	31.651.962,20	12,11%	85	7,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	11.792.732,41	4,51%	86	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	10.410.355,19	3,98%	17	15,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.752.205,40	2,20%	820	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	873.708,22	0,33%	903	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	279.083,86	0,11%	1.155	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	624.150,59	0,24%	430	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	7.403.962,20	2,83%	206	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	477.445,75	0,18%	1.007	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.207.345,52	1,61%	147	0,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	7.924.531,11	3,03%	361	0,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	7.273.746,91	2,78%	208	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	Não se ...	27 meses	297.717,83	0,11%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

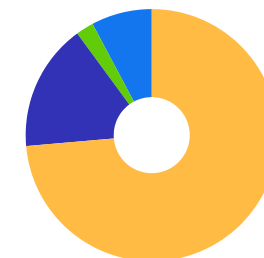
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.485.660,36	1,33%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.052.007,63	1,17%	1.174	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.171.466,49	1,98%	2.491	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.458.777,28	0,94%	16.298	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.013.540,02	1,15%	1.737	3,18%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	6.483.247,29	2,48%	1.852	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	4.022.723,69	1,54%	123	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.186.490,58	1,60%	2.110	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	3.502.839,78	1,34%	338	0,76%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.983.023,54	1,14%	11.978	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.382.755,32	0,91%	1.374	1,87%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.909.803,06	1,11%	26.943	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	2.466.813,12	0,94%	17	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	3.442.442,72	1,32%	21.756	0,54%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.523.519,45	0,97%	326	0,33%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.628.223,97	0,62%	4.447	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	3.590.127,00	1,37%	583	1,89%	Artigo 10º, Inciso I
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.891.437,67	2,64%	358	7,77%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	3.258.124,94	1,25%	103	0,40%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	3.390.426,39	1,30%	17	3,28%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.586.985,98	0,61%	28	2,32%	Artigo 10º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			261.311.224,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			8.903.471,21				Artigo 6º
PL Total			270.214.695,96				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	42.369.279,60	16,21%	0,00%	10,00%	50,00%	88.286.332,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	126.330.721,75	48,34%	8,00%	27,00%	70,00%	56.587.135,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	19.883.069,29	7,61%	2,00%	16,00%	60,00%	136.903.665,56
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	52.262.244,95
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	3.783.378,19	1,45%	0,00%	2,00%	3,00%	4.055.958,55
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.065.561,24
Total Renda Fixa	100,00%	192.366.448,83	73,62%	10,00%	60,00%	208,00%	

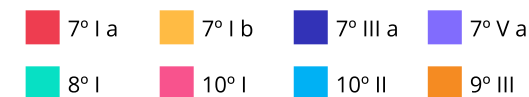
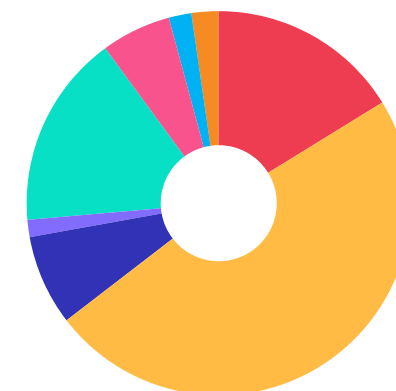


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	42.633.487,80	16,32%	5,00%	20,00%	30,00%	35.759.879,63
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	78.393.367,43
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	15.367.913,58	5,88%	1,00%	10,00%	10,00%	10.763.208,90
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	4.977.412,37	1,90%	1,00%	3,00%	5,00%	8.088.148,87
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.065.561,24
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	62.978.813,75	24,10%	7,00%	33,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	26.131.122,48
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.965.962,17	2,28%	0,00%	2,00%	10,00%	20.165.160,31
Total Exterior	10,00%	5.965.962,17	2,28%	0,00%	5,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	13.065.561,24



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 '	42.369.279,60	16,21	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	126.330.721,75	48,34	8,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	19.883.069,29	7,61	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	3.783.378,19	1,45	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	42.633.487,80	16,32	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	5.965.962,17	2,28	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	15.367.913,58	5,88	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	4.977.412,37	1,90	1,00	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
CAIXA DTVM	116.574.286,89	44,61	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	42.369.279,60	16,21	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.120.218,30	13,06	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	17.660.732,65	6,76	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	6.891.437,67	2,64	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	6.483.247,29	2,48	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	5.781.644,39	2,21	-
TRÍGONO CAPITAL	5.376.616,18	2,06	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	4.207.345,52	1,61	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.186.490,58	1,60	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.502.839,78	1,34	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.485.660,36	1,33	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.390.426,39	1,30	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.013.540,02	1,15	-
PERFIN EQUITIES ADMINISTRAÇÃO ...	2.382.755,32	0,91	-
KPTL	1.586.985,98	0,61	-
GENIAL GESTÃO LTDA	297.717,83	0,11	-

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%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,30%	0,57%	-0,45%	0,57%	4,43%	-	1,57%	3,14%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,02%	-0,87%	-2,58%	-0,87%	0,28%	-	1,37%	4,57%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,02%	-0,91%	-2,61%	-0,91%	0,23%	5,10%	1,37%	4,57%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	2,96%	0,86%	2,96%	8,08%	18,05%	0,98%	1,71%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,75%	5,95%	2,78%	6,01%	11,52%	23,10%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,24%	-4,42%	-0,56%	-4,42%	-4,82%	-15,37%	0,07%	3,50%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	4,51%	2,00%	4,51%	10,95%	26,28%	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	5,70%	2,85%	5,70%	11,29%	21,47%	0,48%	0,87%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	3,20%	1,18%	3,20%	7,97%	18,82%	0,81%	1,74%
IMA-B (Benchmark)	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%	-	-

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	-1,23%	-1,33%	-1,23%	2,76%	16,42%	1,89%	3,87%
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%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	5,11%	2,98%	5,11%	10,59%	25,04%	0,18%	0,79%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,71%	4,70%	2,27%	4,70%	10,59%	23,51%	0,00%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,06%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	-0,76%	-2,82%	-1,57%	-2,82%	-5,27%	12,80%	0,54%	0,52%
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%	-	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20%	1,81%	0,27%	1,81%	7,18%	22,58%	1,24%	1,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20%	1,91%	0,31%	1,91%	7,05%	20,92%	1,64%	2,72%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,71%	-3,40%	-1,07%	-3,40%	-2,72%	-	1,95%	5,45%
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
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00%	1,90%	0,13%	1,90%	8,57%	23,52%	1,85%	3,17%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	0,89%	3,42%	1,91%	3,42%	7,25%	21,64%	0,23%	0,98%

Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	1,24%	-5,37%	-3,75%	-5,37%	6,95%	-	5,81%	9,87%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,92%	-12,41%	-6,66%	-12,41%	-8,09%	11,18%	6,48%	16,52%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,19%	-9,30%	-9,62%	-9,30%	-1,88%	11,90%	7,12%	16,50%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,37%	-8,82%	-5,44%	-8,82%	2,40%	17,87%	5,99%	14,12%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,80%	-0,81%	-2,22%	-0,81%	12,30%	27,30%	5,15%	12,90%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,37%	-6,68%	-5,52%	-6,68%	4,80%	29,31%	6,88%	14,31%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,26%	-9,75%	-8,25%	-9,75%	-3,50%	12,92%	6,60%	13,84%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,15%	-9,73%	-9,00%	-9,73%	-1,98%	14,83%	6,95%	15,40%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,13%	-7,60%	-3,48%	-7,60%	3,60%	13,77%	5,36%	13,79%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2,26%	-10,97%	-6,10%	-10,97%	-4,49%	8,52%	5,91%	13,76%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%

IDIV (Benchmark)	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2,30%	-10,90%	-5,62%	-10,90%	-6,28%	21,39%	6,63%	16,16%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,09%	-5,85%	-7,70%	-5,85%	0,15%	28,15%	6,91%	14,69%

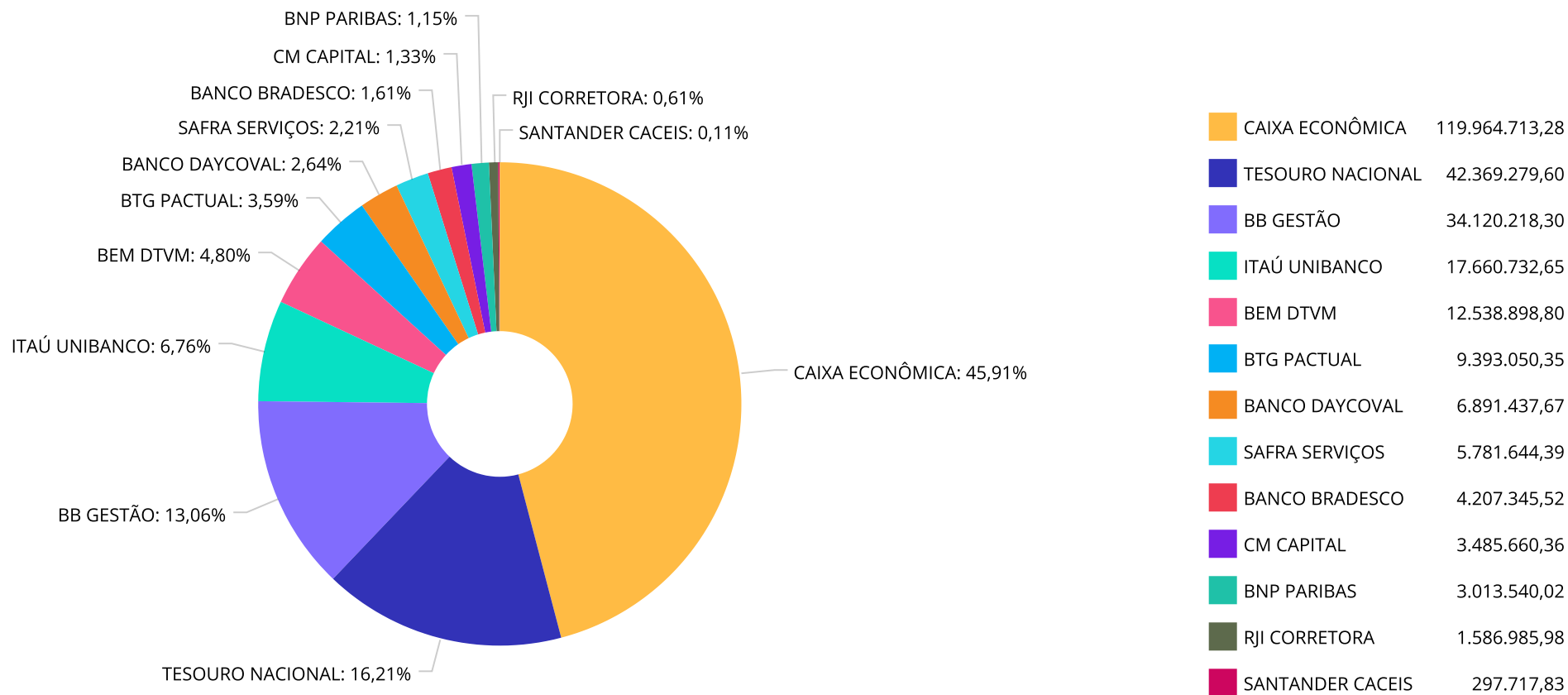
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,01%	7,64%	3,61%	7,73%	15,17%	31,29%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,13%	-44,18%	-0,40%	-44,18%	-44,66%	-49,35%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,82%	6,44%	3,02%	6,50%	12,57%	25,41%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,18%	7,36%	-0,60%	7,36%	7,16%	11,08%	0,01%	8,24%

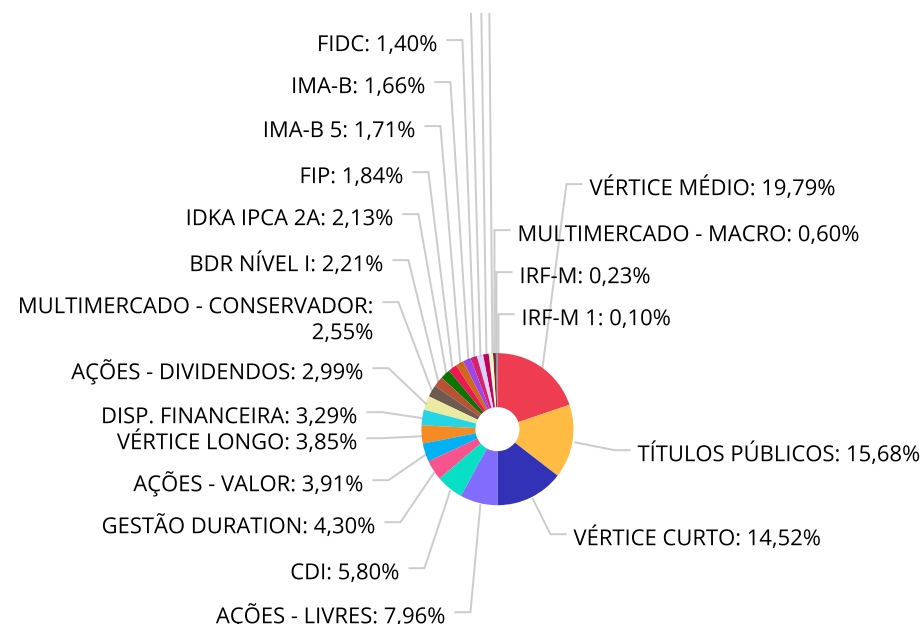
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,21%	26,41%	8,96%	26,41%	43,70%	89,86%	5,16%	14,922%
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%

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



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



■ VÉRTICE MÉDIO	53.487.618,90	■ TÍTULOS PÚBLICOS	42.369.279,60	■ VÉRTICE CURTO	39.243.052,04
■ ACÇÕES - LIVRES	21.507.834,03	■ CDI	15.675.723,77	■ GESTÃO DURATION	11.611.307,72
■ ACÇÕES - VALOR	10.577.571,10	■ VÉRTICE LONGO	10.410.355,19	■ DISP. FINANCEIRA	8.903.471,21
■ ACÇÕES - DIVIDENDOS	8.081.269,55	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	6.891.437,67	■ BDR NÍVEL I	5.965.962,17
■ IDKA IPCA 2A	5.752.205,40	■ FIP	4.977.412,37	■ IMA-B 5	4.632.544,45
■ IMA-B	4.497.749,12	■ FIDC	3.783.378,19	■ MULTIMERCADO - OUTROS	3.590.127,00
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.258.124,94	■ ACÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.466.813,12	■ MULTIMERCADO - MACRO	1.628.223,97
■ IRF-M	624.150,59	■ IRF-M 1	279.083,86		

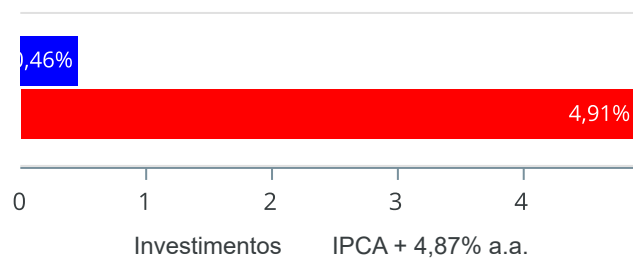
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	26/06/2024	2.539	4.292,963338	4.295,545345	10.899.833,92	10.906.389,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	26/06/2024	2.485	4.341,924875	4.344,516815	10.789.683,31	10.796.124,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	26/06/2024	2.435	4.310,371980	4.312,964583	10.495.755,77	10.502.068,75	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	26/06/2024	2.401	4.230,974313	4.233,519113	10.158.569,33	10.164.679,39	Curva

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	262.588.417,28	13.304.514,97	9.901.084,94	264.939.005,41	-1.052.841,90	-1.052.841,90	-0,40%	-0,40%	0,84%	0,84%	-47,25%	1,99%
Fevereiro	264.939.005,41	30.502.448,14	30.033.713,68	266.775.669,17	1.367.929,30	315.087,40	0,52%	0,12%	1,19%	2,04%	5,76%	2,95%
Março	266.775.669,17	7.687.942,07	7.244.174,87	268.904.957,09	1.685.520,72	2.000.608,12	0,63%	0,75%	0,54%	2,59%	28,93%	1,70%
Abril	268.904.957,09	6.028.079,58	5.119.710,95	266.522.435,27	-3.290.890,45	-1.290.282,33	-1,22%	-0,48%	0,80%	3,41%	-14,08%	2,26%
Mai	266.522.435,27	17.982.545,57	19.254.977,39	265.880.981,16	630.977,71	-659.304,62	0,24%	-0,24%	0,86%	4,30%	-5,68%	2,42%
Junho	265.880.981,16	75.259.481,15	81.692.827,99	261.311.224,75	1.863.590,43	1.204.285,81	0,70%	0,46%	0,59%	4,91%	9,27%	2,27%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

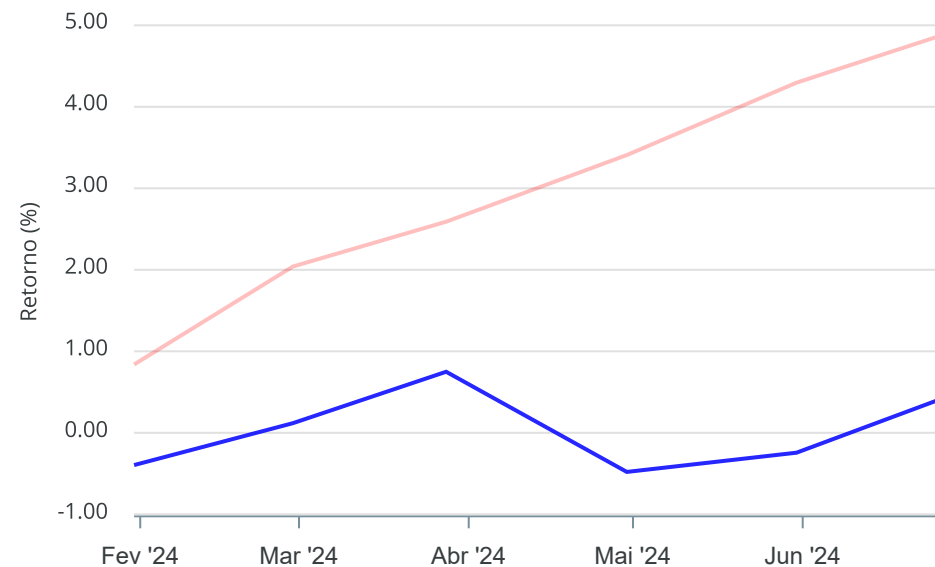


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.712.192,35	0,00	0,00	15.895.437,30	183.244,95	1,17%	1,17%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.875.425,82	0,00	0,00	22.129.045,95	253.620,13	1,16%	1,16%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.204.661,73	0,00	0,00	1.218.568,79	13.907,06	1,15%	1,15%	0,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	7.209.180,33	0,00	0,00	7.273.746,91	64.566,58	0,90%	0,90%	0,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.528.007,22	0,00	10.300.000,00	279.083,86	51.076,64	0,49%	0,61%	0,25%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.744.835,95	0,00	0,00	3.758.836,23	14.000,28	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	870.466,94	0,00	0,00	873.708,22	3.241,28	0,37%	0,37%	0,81%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	7.060.844,48	0,00	7.084.035,92	0,00	23.191,44	0,33%	0,03%	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.112.610,24	5.104.624,08	10.508.799,25	5.752.205,40	43.770,33	0,27%	0,20%	0,98%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	7.650,73	17.333.125,62	9.444.541,48	7.924.531,11	28.296,24	0,16%	0,71%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	448.593,47	10.123.968,95	10.105.425,92	477.445,75	10.309,25	0,10%	0,71%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	42.343.842,33	0,00	42.369.279,60	25.437,27	0,06%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.016.058,59	353.920,17	6.750.025,42	624.150,59	4.197,25	0,06%	-0,32%	1,71%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.794.626,33	0,00	0,00	11.792.732,41	-1.893,92	-0,02%	-0,02%	1,37%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.709.527,76	0,00	7.500.000,00	4.207.345,52	-2.182,24	-0,02%	-0,20%	1,24%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.658.535,99	0,00	0,00	31.651.962,20	-6.573,79	-0,02%	-0,02%	1,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	14.932.219,87	0,00	7.500.000,00	7.403.962,20	-28.257,67	-0,19%	-0,20%	1,64%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.493.978,91	0,00	0,00	3.485.660,36	-8.318,55	-0,24%	-0,24%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	10.073.304,58	0,00	0,00	10.042.924,29	-30.380,29	-0,30%	-0,30%	1,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.547.077,91	0,00	3.000.000,00	4.497.749,12	-49.328,79	-0,65%	-0,99%	1,89%

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 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.485.100,86	0,00	0,00	10.410.355,19	-74.745,67	-0,71%	-0,71%	1,95%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	299.995,25	0,00	0,00	297.717,83	-2.277,42	-0,76%	-0,76%	0,54%
Total Renda Fixa	188.784.895,31	75.259.481,15	72.192.827,99	192.366.448,83	514.900,36	0,27%		1,02%

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
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	3.137.648,97	0,00	0,00	3.258.124,94	120.475,97	3,84%	3,84%	2,95%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.946.835,72	0,00	0,00	3.013.540,02	66.704,30	2,26%	2,26%	5,91%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.346.584,74	0,00	0,00	6.483.247,29	136.662,55	2,15%	2,15%	6,95%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	2.420.315,52	0,00	0,00	2.466.813,12	46.497,60	1,92%	1,92%	6,48%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.413.030,53	0,00	0,00	2.458.777,28	45.746,75	1,90%	1,90%	5,03%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.930.288,21	0,00	0,00	2.983.023,54	52.735,33	1,80%	1,80%	5,15%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	5.332.050,19	0,00	2.500.000,00	2.909.803,06	77.752,87	1,46%	2,30%	6,63%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.968.209,39	0,00	0,00	4.022.723,69	54.514,30	1,37%	1,37%	5,99%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.455.685,30	0,00	0,00	3.502.839,78	47.154,48	1,36%	1,36%	6,88%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	3.546.216,00	0,00	0,00	3.590.127,00	43.911,00	1,24%	1,24%	5,81%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.354.698,41	0,00	0,00	2.382.755,32	28.056,91	1,19%	1,19%	7,12%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.017.835,50	0,00	0,00	3.052.007,63	34.172,13	1,13%	1,13%	5,36%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.115.519,99	0,00	0,00	5.171.466,49	55.946,50	1,09%	1,09%	6,91%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	6.830.562,88	0,00	0,00	6.891.437,67	60.874,79	0,89%	0,89%	0,23%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.593.167,64	0,00	7.000.000,00	1.628.223,97	35.056,33	0,41%	0,00%	1,85%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.175.629,67	0,00	0,00	4.186.490,58	10.860,91	0,26%	0,26%	6,60%
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	1.589.008,49	0,00	0,00	1.586.985,98	-2.022,51	-0,13%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.396.691,95	0,00	0,00	3.390.426,39	-6.265,56	-0,18%	-0,18%	0,01%
Total Renda Variável	71.569.979,10	0,00	9.500.000,00	62.978.813,75	908.834,65	1,27%		4,98%

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.284.837,53	0,00	0,00	2.523.519,45	238.681,92	10,45%	10,45%	6,55%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.241.269,22	0,00	0,00	3.442.442,72	201.173,50	6,21%	6,21%	5,16%
Total Exterior	5.526.106,75	0,00	0,00	5.965.962,17	439.855,42	7,96%		5,75%

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...	21.513.496,04	0,00	0,00	22.129.045,95	615.549,91	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.449.939,25	0,00	0,00	15.895.437,30	445.498,05	2,88%	2,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	7.063.090,00	0,00	0,00	7.273.746,91	210.656,91	2,98%	2,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.446.042,28	0,00	10.358.832,48	279.083,86	191.874,06	1,84%	1,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.041.304,58	10.090.408,79	12.488.499,25	5.752.205,40	108.991,28	0,60%	0,86%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	7.012.159,74	0,00	7.084.035,92	0,00	71.876,18	1,03%	0,72%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.498.806,31	0,00	916.974,99	31.651.962,20	70.130,88	0,22%	-2,61%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.653.719,48	0,00	7.500.000,00	4.207.345,52	53.626,04	0,46%	0,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	14.856.084,30	0,00	7.500.000,00	7.403.962,20	47.877,90	0,32%	0,31%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.715.102,10	0,00	0,00	3.758.836,23	43.734,13	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	368.675,72	26.029.592,96	18.517.262,44	7.924.531,11	43.524,87	0,16%	2,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	10.000.000,00	0,00	10.042.924,29	42.924,29	0,43%	-0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.184.821,29	0,00	0,00	1.218.568,79	33.747,50	2,85%	2,85%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.105.278,09	0,00	340.166,73	11.792.732,41	27.621,05	0,23%	-2,58%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	42.343.842,33	0,00	42.369.279,60	25.437,27	0,06%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	406.527,65	10.203.121,15	10.148.762,40	477.445,75	16.559,35	0,16%	2,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	866.405,84	0,00	2.905,86	873.708,22	10.208,24	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.921.520,69	603.141,07	6.910.076,26	624.150,59	9.565,09	0,13%	-0,24%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	302.463,34	0,00	0,00	297.717,83	-4.745,51	-1,57%	-1,57%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.505.118,67	0,00	0,00	3.485.660,36	-19.458,31	-0,56%	-0,56%

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 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.522.963,62	0,00	0,00	10.410.355,19	-112.608,43	-1,07%	-1,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	17.704.795,50	0,00	13.000.000,00	4.497.749,12	-207.046,38	-1,17%	-1,33%
Total Renda Fixa	186.138.314,49	99.270.106,30	94.767.516,33	192.366.448,83	1.725.544,37	0,91%	

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 S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	3.106.345,32	0,00	0,00	3.258.124,94	151.779,62	4,89%	4,89%
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	6.762.232,04	0,00	0,00	6.891.437,67	129.205,63	1,91%	1,91%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.582.492,90	0,00	7.000.000,00	1.628.223,97	45.731,07	0,53%	0,13%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	1.593.366,98	0,00	0,00	1.586.985,98	-6.381,00	-0,40%	-0,40%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.410.733,52	0,00	0,00	3.390.426,39	-20.307,13	-0,60%	-0,60%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.050.734,28	0,00	0,00	2.983.023,54	-67.710,74	-2,22%	-2,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.559.853,04	0,00	0,00	2.458.777,28	-101.075,76	-3,95%	-3,95%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.162.076,69	0,00	0,00	3.052.007,63	-110.069,06	-3,48%	-3,48%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	3.729.948,00	0,00	0,00	3.590.127,00	-139.821,00	-3,75%	-3,75%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.209.214,20	0,00	0,00	3.013.540,02	-195.674,18	-6,10%	-6,10%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.707.380,82	0,00	0,00	3.502.839,78	-204.541,04	-5,52%	-5,52%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	4.254.181,27	0,00	0,00	4.022.723,69	-231.457,58	-5,44%	-5,44%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.636.319,64	0,00	0,00	2.382.755,32	-253.564,32	-9,62%	-9,62%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	4.599.225,98	0,00	1.800.000,00	2.466.813,12	-332.412,86	-7,23%	-6,66%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	5.779.205,36	0,00	2.500.000,00	2.909.803,06	-369.402,30	-6,39%	-5,62%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.563.138,23	0,00	0,00	4.186.490,58	-376.647,65	-8,25%	-8,25%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.602.907,19	0,00	0,00	5.171.466,49	-431.440,70	-7,70%	-7,70%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.124.431,99	0,00	0,00	6.483.247,29	-641.184,70	-9,00%	-9,00%
Total Renda Variável	77.433.787,45	0,00	11.300.000,00	62.978.813,75	-3.154.973,70	-4,07%	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.173.528,16	0,00	0,00	2.523.519,45	349.991,29	16,10%	16,10%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.159.326,99	0,00	0,00	3.442.442,72	283.115,73	8,96%	8,96%
Total Exterior	5.332.855,15	0,00	0,00	5.965.962,17	633.107,02	11,87%	

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
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.529.090,10	0,00	607.690,30	22.129.045,95	1.207.646,15	5,73%	2,79%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.475.883,55	0,00	454.925,08	15.895.437,30	874.478,83	5,76%	2,71%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.940.969,79	0,00	916.974,99	31.651.962,20	627.967,40	1,96%	-0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.101.067,62	3.196.012,08	10.458.832,48	279.083,86	440.836,64	4,29%	4,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	6.920.401,62	0,00	0,00	7.273.746,91	353.345,29	5,10%	5,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	14.367.677,36	17.656.281,58	26.623.013,68	5.752.205,40	351.260,14	2,48%	2,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	14.622.997,31	0,00	7.500.000,00	7.403.962,20	280.964,89	1,93%	1,91%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.895.962,97	0,00	340.166,73	11.792.732,41	236.936,17	1,99%	-0,87%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.478.158,27	0,00	7.500.000,00	4.207.345,52	229.187,25	1,99%	1,81%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	6.902.460,67	0,00	7.084.035,92	0,00	181.575,25	2,63%	2,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.953.705,65	2.276.700,51	8.724.671,15	624.150,59	118.415,58	1,66%	1,37%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.642.239,62	0,00	0,00	3.758.836,23	116.596,61	3,21%	3,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.186.956,82	0,00	34.572,34	1.218.568,79	66.184,31	5,68%	5,70%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.446.448,66	48.057.097,35	42.642.015,32	7.924.531,11	63.000,42	0,79%	4,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	10.000.000,00	0,00	10.042.924,29	42.924,29	0,00%	0,57%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	305.638,86	13.218.615,60	13.073.532,68	477.445,75	26.723,97	2,92%	4,71%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	42.343.842,33	0,00	42.369.279,60	25.437,27	0,00%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	206.612,35	650.000,00	2.905,86	873.708,22	20.001,73	2,85%	3,21%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	306.356,41	0,00	0,00	297.717,83	-8.638,58	-2,81%	-2,82%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.647.002,37	0,00	116.691,26	3.485.660,36	-44.650,75	-1,25%	-4,42%

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
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.500.000,00	0,00	10.410.355,19	-89.644,81	0,00%	-3,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	14.800.690,93	2.866.462,03	13.000.000,00	4.497.749,12	-169.403,84	-1,33%	-1,23%
Total Renda Fixa	175.730.320,93	150.765.011,48	139.080.027,79	192.366.448,83	4.951.144,21	2,64%	

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 S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2.799.391,73	0,00	0,00	3.258.124,94	458.733,21	16,39%	16,39%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.157.929,87	0,00	0,00	3.390.426,39	232.496,52	7,37%	7,36%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	6.663.658,89	0,00	0,00	6.891.437,67	227.778,78	3,43%	3,42%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.433.242,49	0,00	7.000.000,00	1.628.223,97	194.981,48	2,32%	1,90%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.007.454,91	0,00	0,00	2.983.023,54	-24.431,37	-0,82%	-0,81%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	3.793.704,00	0,00	0,00	3.590.127,00	-203.577,00	-5,37%	-5,37%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.627.042,48	0,00	0,00	2.382.755,32	-244.287,16	-9,30%	-9,30%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.753.729,13	0,00	0,00	3.502.839,78	-250.889,35	-6,69%	-6,68%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.303.002,43	0,00	0,00	3.052.007,63	-250.994,80	-7,61%	-7,60%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.765.970,55	0,00	0,00	2.458.777,28	-307.193,27	-11,10%	-11,11%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.492.596,17	0,00	0,00	5.171.466,49	-321.129,68	-5,84%	-5,85%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.384.764,24	0,00	0,00	3.013.540,02	-371.224,22	-10,97%	-10,97%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	4.411.754,33	0,00	0,00	4.022.723,69	-389.030,64	-8,82%	-8,82%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.638.715,67	0,00	0,00	4.186.490,58	-452.225,09	-9,74%	-9,75%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	4.901.304,32	0,00	1.800.000,00	2.466.813,12	-634.491,20	-12,24%	-12,41%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.182.139,64	0,00	0,00	6.483.247,29	-698.892,35	-9,73%	-9,73%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	6.121.418,47	0,00	2.500.000,00	2.909.803,06	-711.615,41	-11,62%	-10,90%
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	2.842.944,96	0,00	0,00	1.586.985,98	-1.255.958,98	-44,17%	-44,18%
Total Renda Variável	79.280.764,28	0,00	11.300.000,00	62.978.813,75	-5.001.950,53	-6,31%	

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 TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.723.282,51	0,00	0,00	3.442.442,72	719.160,21	26,41%	26,41%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.970.524,18	0,00	0,00	2.523.519,45	552.995,27	28,07%	28,06%
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	2.883.525,38	0,00	2.866.462,03	0,00	-17.063,35	-0,59%	28,71%
Total Exterior	7.577.332,07	0,00	2.866.462,03	5.965.962,17	1.255.092,13	16,56%	

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 & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

