

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			879.786,74	0,47%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	76.514,34	0,04%	862	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.405.513,61	0,76%	635	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	895.318,69	0,48%	140	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	10.245.938,24	5,51%	382	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA F...	D+0	Não há	4.010.010,25	2,16%	88	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	Não há	4.013.579,00	2,16%	116	0,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2028	3.527.161,69	1,90%	105	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	7.716.480,25	4,15%	370	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.708.281,47	3,61%	254	0,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.490.306,01	4,57%	225	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	15/05/2025	4.010.029,29	2,16%	48	1,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	Não há	4.013.622,84	2,16%	44	1,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	2.641.577,21	1,42%	86	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.880.798,94	1,01%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	3.388.790,38	1,82%	23	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	412.312,96	0,22%	777	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.041.837,38	1,10%	57	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.048.091,82	1,10%	903	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.544.136,11	4,60%	23	7,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

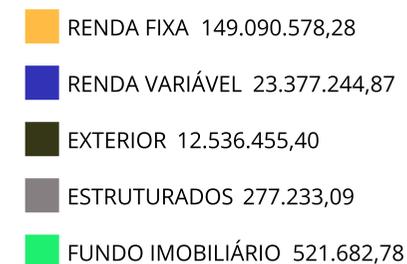
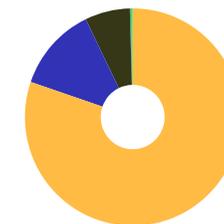
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	22.217.751,52	11,96%	1.148	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	29.845.192,58	16,06%	1.011	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	14.785.957,59	7,96%	468	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	324.266,86	0,17%	98	1,11%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	4.967.322,51	2,67%	90	2,61%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.319.508,85	1,79%	1.174	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.063.931,46	1,11%	22.759	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.740.080,11	1,47%	16.298	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.350.341,40	0,73%	5.597	0,74%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.320.780,90	1,25%	123	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.708.768,45	0,92%	1.804	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	3.571.431,76	1,92%	33	0,92%	Artigo 8º, Inciso I
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	1.315.051,35	0,71%	62	1,45%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.457.173,01	1,86%	783	5,75%	Artigo 8º, Inciso I
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.530.177,58	0,82%	137	3,36%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	2.854.785,10	1,54%	3.746	0,40%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	3.151.391,31	1,70%	215	0,83%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	6.530.278,99	3,51%	448	0,24%	Artigo 9º, Inciso III
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTR...	Não se ...	Não se aplica	277.233,09	0,15%	32	0,11%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	S/Info	Não se aplica	111.682,78	0,06%		0,00%	Artigo 11º

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	410.000,00	0,22%		0,29%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			185.803.194,42				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			200,00				Artigo 6º
		PL Total	185.803.394,42				

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

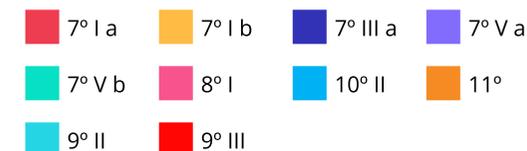
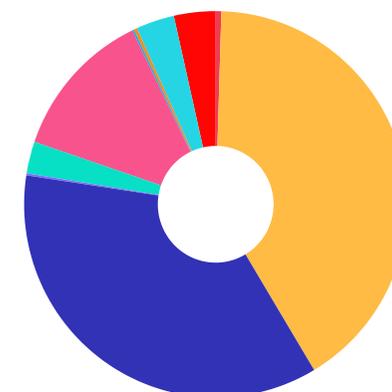
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	879.786,74	0,47%	0,00%	0,50%	10,00%	17.700.532,70
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	76.070.300,48	40,94%	25,00%	42,10%	75,00%	63.282.095,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	66.848.901,69	35,98%	5,00%	33,00%	58,00%	40.916.951,07
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.580.319,44
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	324.266,86	0,17%	0,00%	1,65%	2,00%	3.391.797,03
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	4.967.322,51	2,67%	0,00%	2,75%	5,00%	4.322.837,21
Total Renda Fixa	100,00%	149.090.578,28	80,24%	30,00%	80,00%	160,00%	



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%	23.377.244,87	12,58%	5,00%	14,20%	23,50%	20.286.505,82
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.290.159,72
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	277.233,09	0,15%	0,00%	0,20%	0,50%	651.782,88
Artigo 11º	5,00%	521.682,78	0,28%	0,00%	0,60%	1,00%	1.336.349,16
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	24.176.160,74	13,01%	5,00%	15,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	6.006.176,41	3,23%	0,00%	2,50%	4,00%	1.425.951,37
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.530.278,99	3,51%	0,00%	2,50%	6,00%	4.617.912,68
Total Exterior	10,00%	12.536.455,40	6,75%	0,00%	5,00%	10,00%	



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 '	879.786,74	0,47	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	76.070.300,48	40,94	25,00	75,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	66.848.901,69	35,98	5,00	58,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	324.266,86	0,17	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	4.967.322,51	2,67	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	23.377.244,87	12,58	5,00	23,50
Artigo 9º, Inciso II	6.006.176,41	3,23	0,00	4,00
Artigo 9º, Inciso III	6.530.278,99	3,51	0,00	6,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso II	277.233,09	0,15	0,00	0,50
Artigo 11º	521.682,78	0,28	0,00	1,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ASSET	74.351.283,21	40,02	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.231.788,01	33,49	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	29.642.051,81	15,95	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.708.281,47	3,61	-
ITAÚ DTVM	3.571.431,76	1,92	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.151.391,31	1,70	-
ICATU VANGUARDA	1.708.768,45	0,92	-
WESTERN ASSET	1.530.177,58	0,82	-
MOS CAPITAL	1.315.051,35	0,71	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	879.786,74	0,47	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	324.266,86	0,17	-
BRZ INVESTIMENTOS	277.233,09	0,15	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	111.682,78	0,06	-

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 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,20%	-	-	-	-	-	0,97%	-
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,62%	-	-	-	-	-	0,42%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,20%	-	-	-	-	-	0,97%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,62%	-	-	-	-	-	0,42%	-
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%
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,53%	1,33%	-0,45%	1,33%	7,78%	26,07%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	-0,56%	1,07%	-0,56%	1,07%	7,32%	-	1,94%	2,85%
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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,67%	5,46%	2,54%	5,51%	10,48%	20,81%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,28%	2,87%	0,84%	2,87%	8,28%	19,62%	0,89%	1,90%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	2,79%	2,56%	2,79%	4,73%	8,56%	0,08%	3,81%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	4,51%	2,00%	4,51%	10,95%	26,28%	-	-
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	0,62%	4,41%	1,95%	4,41%	10,74%	25,89%	0,25%	0,36%

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
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	4,44%	1,94%	4,44%	10,74%	25,79%	0,24%	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 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,72%	-3,52%	-1,08%	-3,52%	-2,64%	4,06%	1,95%	5,41%
IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,32%	1,37%	-0,24%	1,37%	7,50%	25,11%	1,71%	2,50%
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,82%	5,48%	2,62%	5,48%	12,39%	27,67%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
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%
IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,70%	2,85%	5,70%	11,31%	21,59%	0,48%	0,87%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,17%	2,36%	0,55%	2,36%	7,39%	23,06%	0,88%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,78%	2,89%	5,78%	11,46%	-	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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,73%	2,86%	5,73%	11,35%	20,70%	0,48%	0,87%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,51%	-0,68%	0,75%	-0,68%	-7,59%	-6,82%	0,08%	4,95%
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
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%	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	0,91%	-17,47%	-11,56%	-17,47%	-9,88%	29,25%	10,12%	24,80%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,13%	-7,60%	-3,48%	-7,60%	3,60%	13,77%	5,36%	13,79%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,54%	-12,65%	-6,03%	-12,65%	-0,46%	5,66%	6,32%	14,36%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1,39%	-13,55%	-10,22%	-13,55%	-7,32%	2,70%	6,43%	15,07%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	1,60%	-10,39%	-4,96%	-10,39%	-4,12%	7,18%	5,99%	13,84%
QLZ MOS FI AÇÕES	-1,17%	-10,53%	-9,87%	-10,53%	-3,49%	-	10,64%	18,72%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	1,11%	-10,19%	-6,16%	-10,19%	-0,28%	18,71%	6,26%	13,72%
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%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,04%	-7,97%	-4,03%	-7,97%	2,88%	18,78%	5,72%	12,35%

IFIX (Benchmark)	-1,04%	1,08%	-1,78%	1,08%	6,09%	19,73%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-7,57%	-13,38%	-11,67%	-13,38%	-23,61%	-17,56%	7,70%	18,63%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,61%	2,37%	2,19%	2,37%	4,22%	29,58%	9,73%	38,90%

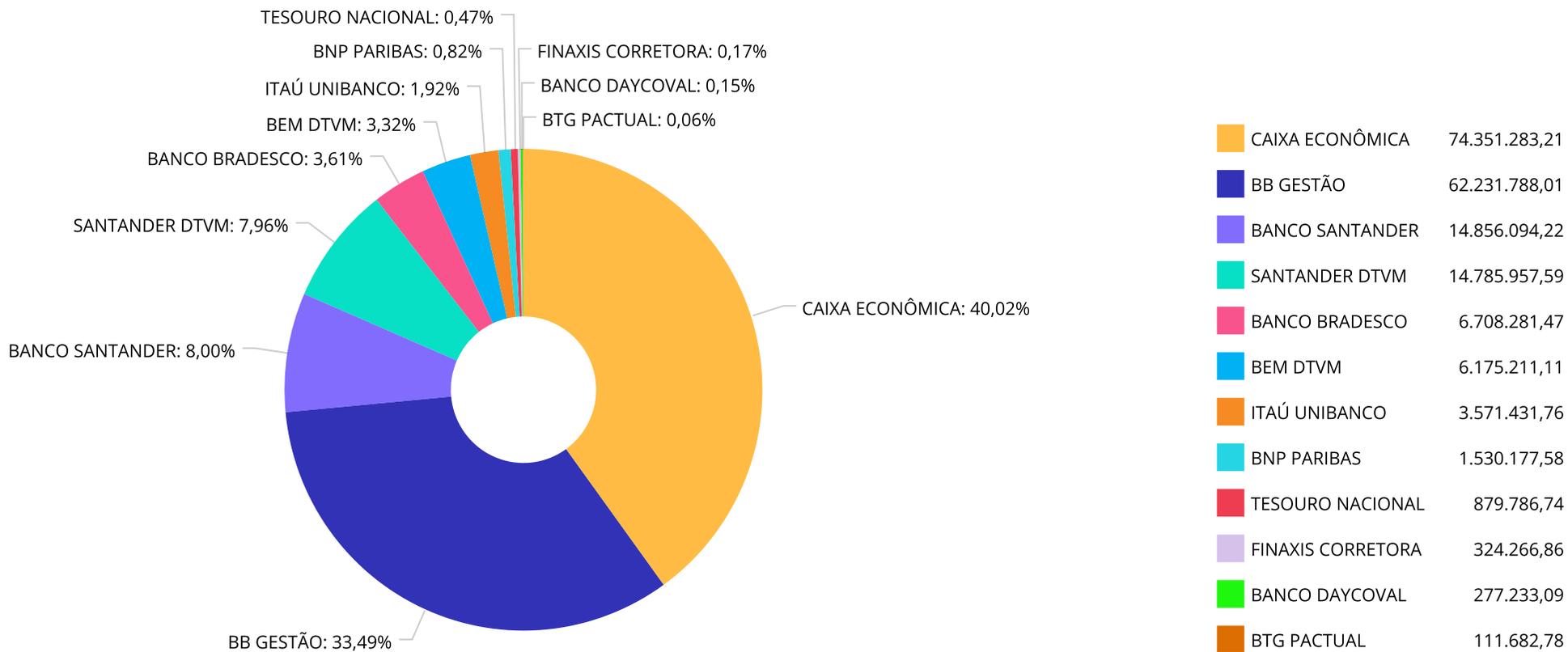
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	0,93%	7,16%	3,37%	7,24%	14,13%	28,92%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉGIA	0,20%	-4,07%	0,11%	-4,07%	-4,24%	37,37%	15,57%	9,91%

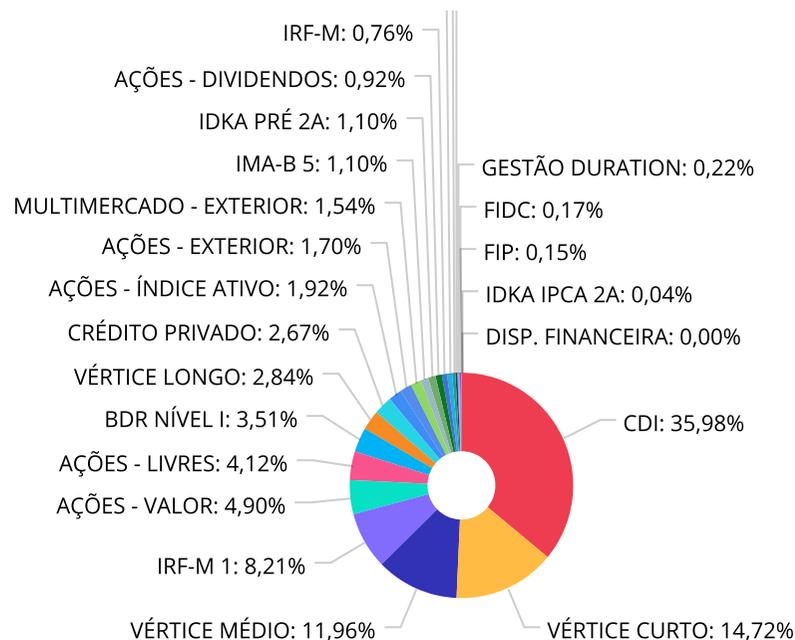
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
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%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	8,44%	26,69%	13,22%	26,69%	37,16%	47,09%	5,69%	10,586%
MSCI ACWI (Benchmark)	8,28%	26,67%	13,94%	26,67%	35,48%	42,62%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	9,06%	24,34%	13,76%	24,34%	35,34%	48,92%	5,80%	13,504%

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



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



■ CDI	66.848.901,69	■ VÉRTICE CURTO	27.348.043,19	■ VÉRTICE MÉDIO	22.215.980,28	■ IRF-M 1	15.252.417,58
■ AÇÕES - VALOR	9.097.462,76	■ AÇÕES - LIVRES	7.649.240,50	■ BDR NÍVEL I	6.530.278,99	■ VÉRTICE LONGO	5.269.589,32
■ CRÉDITO PRIVADO	4.967.322,51	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.571.431,76	■ AÇÕES - EXTERIOR	3.151.391,31	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.854.785,10
■ IMA-B 5	2.048.091,82	■ IDKA PRÉ 2A	2.041.837,38	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.708.768,45	■ IRF-M	1.405.513,61
■ AÇÕES - SETORIAIS	1.350.341,40	■ TÍTULOS PÚBLICOS	879.786,74	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	521.682,78	■ GESTÃO DURATION	412.312,96
■ FIDC	324.266,86	■ FIP	277.233,09	■ IDKA IPCA 2A	76.514,34	■ DISP. FINANCEIRA	200,00

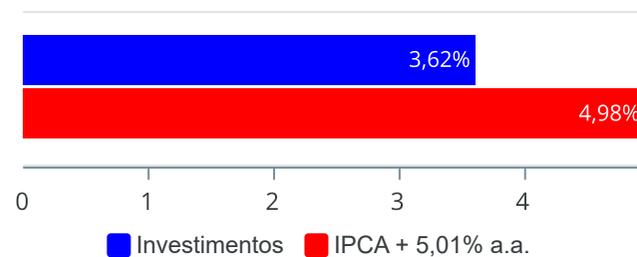
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/06/2004	201	1.451,706521	4.377,048476	291.793,01	879.786,74	Mercado

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	177.773.979,10	1.701.970,77	1.518.803,50	178.283.254,48	326.108,11	326.108,11	0,18%	0,18%	0,85%	0,85%	21,57%	1,47%
Fevereiro	178.283.254,48	2.623.438,90	2.424.400,43	180.251.365,25	1.769.072,30	2.095.180,41	0,99%	1,18%	1,20%	2,06%	57,04%	2,53%
Março	180.251.365,25	1.761.408,46	1.519.472,51	181.672.535,23	1.179.234,03	3.274.414,44	0,65%	1,84%	0,55%	2,62%	70,05%	1,38%
Abril	181.672.535,23	1.836.018,61	1.544.202,34	181.610.852,24	-353.499,26	2.920.915,18	-0,19%	1,64%	0,81%	3,45%	47,47%	1,69%
Mai	181.610.852,24	1.776.485,89	1.616.899,80	182.838.402,11	1.067.963,78	3.988.878,96	0,59%	2,24%	0,87%	4,35%	51,38%	1,39%
Junho	182.838.402,11	26.140.089,07	25.659.645,01	185.803.194,42	2.484.348,25	6.473.227,21	1,36%	3,62%	0,60%	4,98%	72,75%	1,65%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



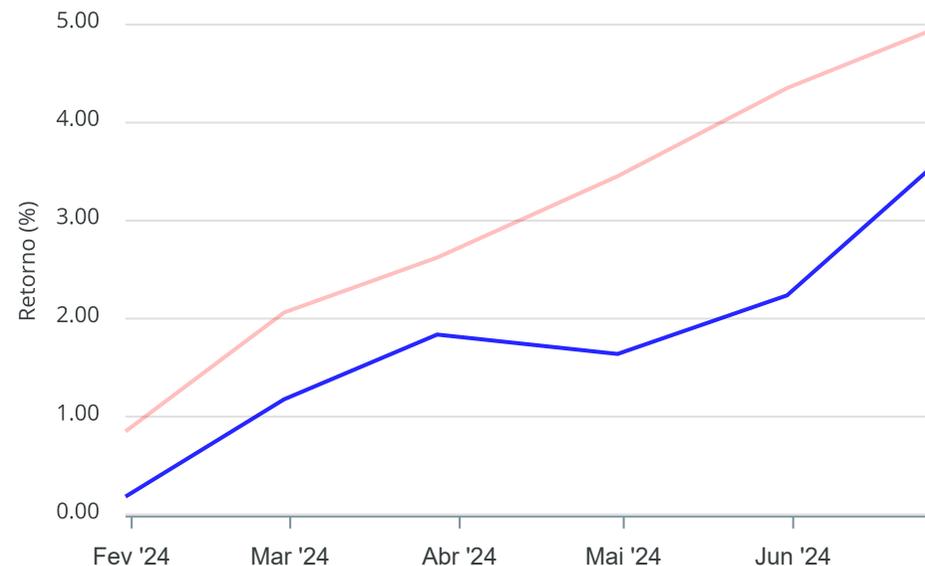
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	869.544,85	0,00	0,00	879.786,74	10.241,89	1,18%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	10.127.712,74	0,00	0,00	10.245.938,24	118.225,50	1,17%	1,17%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.392.428,51	0,00	0,00	8.490.306,01	97.877,50	1,17%	1,17%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	7.627.993,75	0,00	0,00	7.716.480,25	88.486,50	1,16%	1,16%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	885.087,93	0,00	0,00	895.318,69	10.230,76	1,16%	1,16%	0,48%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.864.647,39	0,00	0,00	1.880.798,94	16.151,55	0,87%	0,87%	0,08%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	14.666.120,06	0,00	0,00	14.785.957,59	119.837,53	0,82%	0,82%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.637.262,86	6.140.089,07	1.149.313,31	29.845.192,58	217.153,96	0,71%	0,82%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	22.045.368,55	4.000.000,00	4.000.000,00	22.217.751,52	172.382,97	0,66%	0,79%	0,02%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	8.491.392,75	0,00	0,00	8.544.136,11	52.743,36	0,62%	0,62%	0,25%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.667.398,83	0,00	0,00	6.708.281,47	40.882,64	0,61%	0,61%	0,24%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	2.653.863,51	0,00	2.669.831,92	0,00	15.968,41	0,60%	0,93%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.040.493,80	0,00	0,00	2.048.091,82	7.598,02	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.013.622,84	13.622,84	0,34%	0,20%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.013.579,00	13.579,00	0,34%	0,20%	0,97%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.953.639,27	0,00	0,00	4.967.322,51	13.683,24	0,28%	0,28%	0,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	76.319,07	0,00	0,00	76.514,34	195,27	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.010.029,29	10.029,29	0,25%	0,62%	0,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.010.010,25	10.010,25	0,25%	0,62%	0,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.452.685,12	0,00	10.047.423,72	412.312,96	7.051,56	0,07%	0,17%	0,88%

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 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.642.001,45	0,00	0,00	2.641.577,21	-424,24	-0,02%	-0,02%	1,37%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.413.822,59	0,00	4.000.000,00	1.405.513,61	-8.308,98	-0,15%	-0,32%	1,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	3.537.831,51	0,00	0,00	3.527.161,69	-10.669,82	-0,30%	-0,30%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	5.355.206,99	0,00	3.288.590,95	2.041.837,38	-24.778,66	-0,46%	-0,56%	1,94%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	325.924,92	0,00	0,00	324.266,86	-1.658,06	-0,51%	-0,51%	0,08%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.413.255,40	0,00	0,00	3.388.790,38	-24.465,02	-0,72%	-0,72%	1,95%
Total Renda Fixa	147.140.001,85	26.140.089,07	25.155.159,90	149.090.578,28	965.647,26	0,65%		0,39%

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
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	276.690,95	0,00	17.786,38	277.233,09	18.328,52	6,62%	0,20%	15,57%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	391.950,00	0,00	2.950,00	410.000,00	21.000,00	5,36%	5,40%	9,73%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.674.633,51	0,00	0,00	1.708.768,45	34.134,94	2,04%	2,04%	5,72%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.689.099,58	0,00	0,00	2.740.080,11	50.980,53	1,90%	1,90%	5,03%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	3.402.768,06	0,00	0,00	3.457.173,01	54.404,95	1,60%	1,60%	5,99%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.032.732,73	0,00	0,00	2.063.931,46	31.198,73	1,53%	1,53%	6,32%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.509.147,39	0,00	0,00	1.530.177,58	21.030,19	1,39%	1,39%	6,43%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.289.330,63	0,00	0,00	2.320.780,90	31.450,27	1,37%	1,37%	5,99%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.282.341,61	0,00	0,00	3.319.508,85	37.167,24	1,13%	1,13%	5,36%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	3.532.309,18	0,00	0,00	3.571.431,76	39.122,58	1,11%	1,11%	6,26%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.338.111,94	0,00	0,00	1.350.341,40	12.229,46	0,91%	0,91%	10,12%
CENESP FII - CNES11	8.528,00	0,00	8.465,35	0,00	-62,65	-0,73%	-5,03%	13,21%
QLZ MOS FI AÇÕES	1.330.551,47	0,00	0,00	1.315.051,35	-15.500,12	-1,16%	-1,16%	10,64%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	338.353,84	0,00	318.892,15	0,00	-19.461,69	-5,75%	-1,74%	9,12%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	287.040,00	0,00	156.391,23	111.682,78	-18.965,99	-6,61%	-6,72%	7,70%
Total Renda Variável	24.383.588,89	0,00	504.485,11	24.176.160,74	297.056,96	1,22%		6,54%

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	5.792.723,59	0,00	0,00	6.530.278,99	737.555,40	12,73%	12,73%	8,26%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	2.889.508,12	0,00	0,00	3.151.391,31	261.883,19	9,06%	9,06%	5,80%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.632.579,66	0,00	0,00	2.854.785,10	222.205,44	8,44%	8,44%	5,69%
Total Exterior	11.314.811,37	0,00	0,00	12.536.455,40	1.221.644,03	10,80%		7,05%

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	22.893.895,68	9.306.517,57	2.975.912,49	29.845.192,58	620.691,82	1,93%	2,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	21.671.499,39	4.000.000,00	4.000.000,00	22.217.751,52	546.252,13	2,13%	2,53%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	14.408.667,47	0,00	0,00	14.785.957,59	377.290,12	2,62%	2,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	9.958.645,69	0,00	0,00	10.245.938,24	287.292,55	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.252.350,00	0,00	0,00	8.490.306,01	237.956,01	2,88%	2,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	7.501.758,59	0,00	0,00	7.716.480,25	214.721,66	2,86%	2,86%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	8.380.635,44	0,00	0,00	8.544.136,11	163.500,67	1,95%	1,95%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.580.552,77	0,00	0,00	6.708.281,47	127.728,70	1,94%	1,94%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	2.601.068,40	0,00	2.669.831,92	0,00	68.763,52	2,64%	2,98%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.833.795,20	0,00	0,00	1.880.798,94	47.003,74	2,56%	2,56%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.749.258,48	0,00	10.383.191,09	412.312,96	46.245,57	0,43%	0,55%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.925.997,28	0,00	0,00	4.967.322,51	41.325,23	0,84%	0,84%
TÍTULOS PÚBLICOS	854.842,03	0,00	0,00	879.786,74	24.944,71	2,92%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	870.479,49	0,00	0,00	895.318,69	24.839,20	2,85%	2,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.024.201,85	0,00	0,00	2.048.091,82	23.889,97	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.013.622,84	13.622,84	0,34%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.013.579,00	13.579,00	0,34%	-
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.010.029,29	10.029,29	0,25%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.010.010,25	10.010,25	0,25%	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.711.587,58	0,00	76.197,50	2.641.577,21	6.187,13	0,23%	-2,58%

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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	321.860,94	0,00	0,00	324.266,86	2.405,92	0,75%	0,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	75.722,67	0,00	0,00	76.514,34	791,67	1,05%	1,05%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.409.593,18	0,00	4.000.000,00	1.405.513,61	-4.079,57	-0,08%	-0,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	3.543.194,95	0,00	0,00	3.527.161,69	-16.033,26	-0,45%	-0,45%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	5.812.416,75	435.000,00	4.178.776,39	2.041.837,38	-26.802,98	-0,43%	-0,56%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.425.763,46	0,00	0,00	3.388.790,38	-36.973,08	-1,08%	-1,08%
Total Renda Fixa	144.807.787,29	29.741.517,57	28.283.909,39	149.090.578,28	2.825.182,81	1,93%	

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
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	276.918,04	0,00	17.786,38	277.233,09	18.101,43	6,54%	0,11%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	401.200,00	0,00	8.800,00	410.000,00	17.600,00	4,39%	2,19%
CENESP FII - CNES11	0,00	11.076,00	8.548,41	0,00	-2.527,59	-22,82%	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	300.352,00	0,00	177.087,23	111.682,78	-11.581,99	-3,86%	-11,67%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	356.264,40	0,00	324.615,74	0,00	-31.648,66	-8,88%	-7,43%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.780.476,96	0,00	0,00	1.708.768,45	-71.708,51	-4,03%	-4,03%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.852.719,70	0,00	0,00	2.740.080,11	-112.639,59	-3,95%	-3,95%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.439.225,21	0,00	0,00	3.319.508,85	-119.716,36	-3,48%	-3,48%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.196.250,24	0,00	0,00	2.063.931,46	-132.318,78	-6,02%	-6,02%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.454.312,90	0,00	0,00	2.320.780,90	-133.532,00	-5,44%	-5,44%
QLZ MOS FI AÇÕES	1.459.091,10	0,00	0,00	1.315.051,35	-144.039,75	-9,87%	-9,87%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.704.364,39	0,00	0,00	1.530.177,58	-174.186,81	-10,22%	-10,22%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.526.856,72	0,00	0,00	1.350.341,40	-176.515,32	-11,56%	-11,56%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	3.637.420,82	0,00	0,00	3.457.173,01	-180.247,81	-4,96%	-4,96%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	3.805.789,42	0,00	0,00	3.571.431,76	-234.357,66	-6,16%	-6,16%
Total Renda Variável	26.191.241,90	11.076,00	536.837,76	24.176.160,74	-1.489.319,40	-5,68%	

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	5.381.859,96	0,00	0,00	6.530.278,99	1.148.419,03	21,34%	21,34%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	2.770.096,92	0,00	0,00	3.151.391,31	381.294,39	13,76%	13,76%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.521.549,16	0,00	0,00	2.854.785,10	333.235,94	13,22%	13,22%
Total Exterior	10.673.506,04	0,00	0,00	12.536.455,40	1.862.949,36	17,45%	

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.277.337,09	14.742.937,31	7.375.053,73	29.845.192,58	1.199.971,91	4,88%	5,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	20.473.023,95	4.648.797,03	4.000.000,00	22.217.751,52	1.095.930,54	5,08%	5,24%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	14.015.775,90	1.601,36	0,00	14.785.957,59	768.580,33	5,48%	5,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	9.968.313,13	0,00	286.153,79	10.245.938,24	563.778,90	5,77%	5,78%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.266.207,76	0,00	242.991,31	8.490.306,01	467.089,56	5,76%	2,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	7.507.122,50	0,00	211.792,99	7.716.480,25	421.150,74	5,73%	5,73%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	8.182.934,34	0,00	0,00	8.544.136,11	361.201,77	4,41%	4,41%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.422.877,48	0,00	0,00	6.708.281,47	285.403,99	4,44%	4,44%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.559.369,82	0,00	10.383.191,09	412.312,96	236.134,23	2,26%	2,36%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	2.522.423,02	0,00	2.669.831,92	0,00	147.408,90	5,84%	6,19%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.828.792,55	0,00	0,00	4.967.322,51	138.529,96	2,87%	2,87%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.829.673,47	0,00	53.143,78	1.880.798,94	104.269,25	5,79%	2,79%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.323.986,41	0,00	4.000.000,00	1.405.513,61	81.527,20	1,53%	1,37%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	5.718.590,31	435.000,00	4.178.776,39	2.041.837,38	67.023,46	1,11%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.984.385,58	0,00	0,00	2.048.091,82	63.706,24	3,21%	3,21%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.664.700,90	0,00	76.197,50	2.641.577,21	53.073,81	1,99%	-0,87%
TÍTULOS PÚBLICOS	855.022,74	0,00	25.031,86	879.786,74	49.795,86	0,06%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	872.007,72	0,00	25.383,26	895.318,69	48.694,23	5,69%	5,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	3.607.107,68	0,00	100.435,13	3.527.161,69	20.489,14	0,56%	0,57%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.013.622,84	13.622,84	0,00%	-

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 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.013.579,00	13.579,00	0,00%	-
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.010.029,29	10.029,29	0,00%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.010.010,25	10.010,25	0,00%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	74.204,06	0,00	0,00	76.514,34	2.310,28	3,11%	3,11%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	326.497,93	0,00	0,00	324.266,86	-2.231,07	-0,70%	-0,68%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.512.447,32	0,00	95.183,18	3.388.790,38	-28.473,76	-0,86%	-3,52%
Total Renda Fixa	140.792.801,66	35.828.335,70	33.723.165,93	149.090.578,28	6.192.606,85	4,33%	

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	400.500,00	0,00	17.550,00	410.000,00	27.050,00	6,75%	2,37%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	288.994,42	0,00	17.786,38	277.233,09	6.025,05	2,08%	-4,07%
CENESP FII - CNES11	0,00	11.076,00	8.548,41	0,00	-2.527,59	-22,85%	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	308.360,00	0,00	183.483,23	111.682,78	-13.193,99	-4,76%	-13,38%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	364.830,32	0,00	332.889,64	0,00	-31.940,68	-9,04%	-8,92%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.856.680,53	0,00	0,00	1.708.768,45	-147.912,08	-7,96%	-7,97%
QLZ MOS FI AÇÕES	1.469.853,79	0,00	0,00	1.315.051,35	-154.802,44	-10,52%	-10,53%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.545.219,61	0,00	0,00	2.320.780,90	-224.438,71	-8,82%	-8,82%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.769.940,61	0,00	0,00	1.530.177,58	-239.763,03	-13,55%	-13,55%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.592.502,76	0,00	0,00	3.319.508,85	-272.993,91	-7,61%	-7,60%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.636.180,57	0,00	0,00	1.350.341,40	-285.839,17	-17,47%	-17,47%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.362.722,97	0,00	0,00	2.063.931,46	-298.791,51	-12,65%	-12,65%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.082.418,62	0,00	0,00	2.740.080,11	-342.338,51	-11,10%	-11,11%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	3.857.922,77	0,00	0,00	3.457.173,01	-400.749,76	-10,38%	-10,39%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	3.976.580,40	0,00	0,00	3.571.431,76	-405.148,64	-10,19%	-10,19%
Total Renda Variável	27.512.707,37	11.076,00	560.257,66	24.176.160,74	-2.787.364,97	-10,13%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.680.651,79	0,00	0,00	6.530.278,99	1.849.627,20	39,52%	39,52%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	2.534.510,34	0,00	0,00	3.151.391,31	616.880,97	24,33%	24,34%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.253.307,94	0,00	0,00	2.854.785,10	601.477,16	26,69%	26,69%
Total Exterior	9.468.470,07	0,00	0,00	12.536.455,40	3.067.985,33	32,40%	

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.