

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

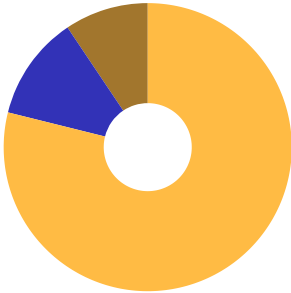
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			14.327.232,33	13,68%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	4.236.629,51	4,04%	697	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.078.712,47	7,71%	862	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	9.575.663,98	9,14%	792	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.281.919,82	3,13%	638	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	5.351.914,31	5,11%	1.141	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	7.494.750,02	7,15%	635	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	6.986.579,52	6,67%	777	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.839.028,09	5,57%	753	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	284.388,00	0,27%	1.155	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	630.517,64	0,60%	13.201	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	347.872,90	0,33%	1.007	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.625.822,95	1,55%	1.148	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.233.726,52	5,00%	453	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 14,56%	D+0	Não se aplica	155.831,47	0,15%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	D+0	Não se aplica	5.064.900,25	4,83%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA GENIAL	S/Info	Não se aplica	4.121.670,39	3,93%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.225.609,51	2,12%	1.174	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.733.834,87	2,61%	16.298	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	705.914,39	0,67%	8.478	0,30%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.925.090,33	2,79%	864	0,53%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	583.121,22	0,56%	338	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	1.038.508,21	0,99%	3.735	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.282.122,38	1,22%	10	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	779.323,29	0,74%	17	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.839.996,45	1,76%	165	0,56%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	892.954,42	0,85%	102	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.118.502,14	6,79%	4.679	1,49%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			104.762.137,38				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			93.503,65	Artigo 6º			
PL Total			104.855.641,03				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	14.327.232,33	13,68%	5,00%	20,00%	30,00%	17.101.408,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	51.760.103,36	49,41%	20,00%	27,00%	70,00%	21.573.392,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	60,00%	7.207.422,37	6,88%	7,00%	13,00%	50,00%	45.173.646,32
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	9.342.402,11	8,92%	0,00%	15,00%	20,00%	11.610.025,37
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.238.106,87
Total Renda Fixa	100,00%	82.637.160,17	78,88%	32,00%	75,00%	175,00%	



- RENTA FIXA 82.637.160,17
- RENTA VARIÁVEL 12.273.524,20
- ESTRUTURADOS 9.851.453,01

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%	12.273.524,20	11,72%	10,00%	15,00%	30,00%	19.155.117,01
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	31.428.641,21
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	9.851.453,01	9,40%	3,00%	4,00%	10,00%	624.760,73
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.238.106,87
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	22.124.977,21	21,12%	13,00%	19,00%	75,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	10.476.213,74
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	

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%	1,00%	5,00%	5.238.106,87



- 7º I a
- 7º I b
- 7º III a
- 7º IV
- 8º I
- 10º I

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'	14.327.232,33	13,68	5,00	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	51.760.103,36	49,41	20,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	7.207.422,37	6,88	7,00	50,00
Artigo 7º, Inciso IV	9.342.402,11	8,92	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	12.273.524,20	11,72	10,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	9.851.453,01	9,40	3,00	10,00
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	47.498.641,18	45,34	-
CAIXA DTVM	29.910.786,66	28,55	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	14.327.232,33	13,68	-
BANCO DAYCOVAL	5.064.900,25	4,83	-
BANCO GENIAL	4.121.670,39	3,93	-
TRÍGONO CAPITAL	2.061.445,67	1,97	-
GENIAL INVESTIMENTOS	1.038.508,21	0,99	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	583.121,22	0,56	-
BANCO BTG PACTUAL	155.831,47	0,15	-

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
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%	-	-
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%	-	-
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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,00%	-1,22%	-1,35%	-1,22%	2,87%	16,57%	1,90%	3,86%
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%	-	-
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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	5,24%	2,53%	5,24%	11,71%	26,83%	0,02%	0,07%

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 FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,06%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,61%	4,01%	1,94%	4,01%	8,98%	20,57%	0,00%	0,05%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,80%	5,23%	2,47%	5,23%	12,03%	27,30%	0,04%	0,12%
IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA GENIAL	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 14,56%	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,17%	2,36%	0,55%	2,36%	7,39%	23,06%	0,88%	1,46%

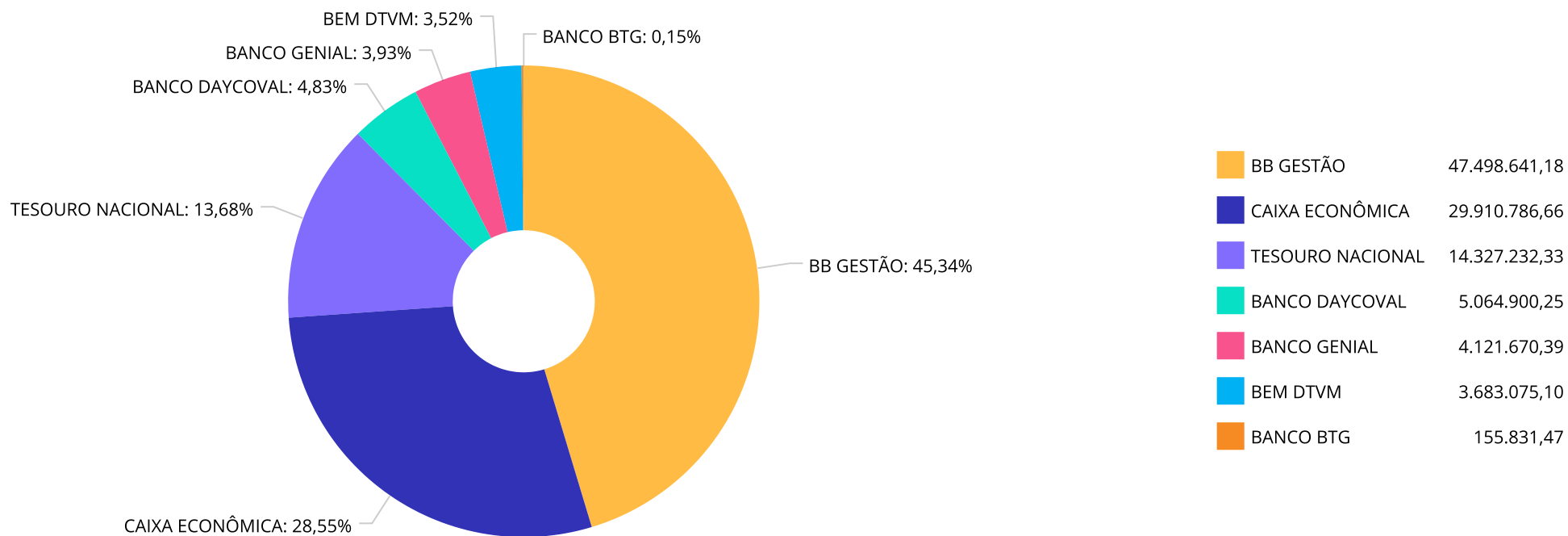
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	-0,89%	-1,94%	-0,89%	6,09%	21,55%	3,30%	4,15%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,27%	-1,91%	-1,97%	-1,91%	5,94%	21,72%	3,43%	4,88%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,36%	2,78%	0,48%	2,78%	9,19%	23,96%	1,07%	1,49%

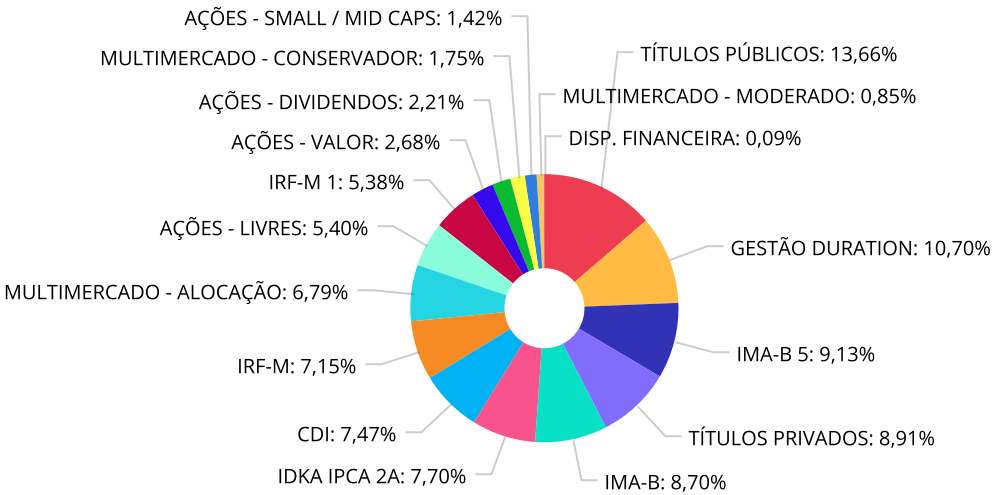
Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,13%	-7,60%	-3,48%	-7,60%	3,60%	13,77%	5,36%	13,79%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1,00%	-9,38%	-6,70%	-9,38%	-1,76%	13,42%	6,71%	14,21%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,92%	-12,41%	-6,66%	-12,41%	-8,09%	11,18%	6,48%	16,52%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,27%	-10,96%	-5,62%	-10,96%	-6,16%	22,36%	6,58%	16,05%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,37%	-6,68%	-5,52%	-6,68%	4,80%	29,31%	6,88%	14,31%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,00%	-8,72%	-4,73%	-8,72%	2,83%	25,86%	6,10%	12,82%

SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-3,41%	-19,71%	-16,08%	-19,71%	-17,97%	-1,96%	12,11%	21,45%

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



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



TÍTULOS PÚBLICOS	14.327.232,33	GESTÃO DURATION	11.223.209,03	IMA-B 5	9.575.663,98	TÍTULOS PRIVADOS	9.342.402,11
IMA-B	9.120.947,91	IDKA IPCA 2A	8.078.712,47	CDI	7.837.940,01	IRF-M	7.494.750,02
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	7.118.502,14	AÇÕES - LIVRES	5.658.925,20	IRF-M 1	5.636.302,31	AÇÕES - VALOR	2.808.730,73
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.320.630,59	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.839.996,45	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.485.237,68	MULTIMERCADO - MODERADO	892.954,42
DISP. FINANCEIRA	93.503,65						

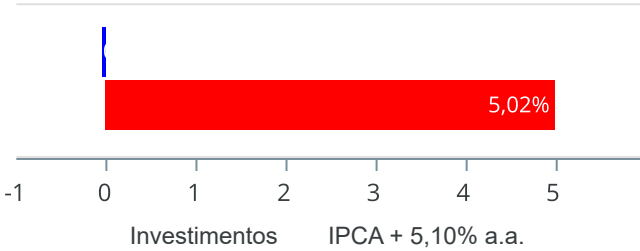
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2024)

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	31/05/2023	238	4.056,43256146	4.377,048476	965.430,95	1.041.737,54	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	26/08/2022	1.236	4.045,052738	4.260,049621	4.999.685,18	5.265.421,33	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2033	24/06/2024	235	4.233,535985	4.190,905343	994.880,96	984.862,76	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/04/2023	1.210	4.090,06144118	4.219,274429	4.948.974,34	5.105.322,06	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	28/02/2024	6	4.455,089202	4.106,146039	26.730,54	24.636,88	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	08/04/2024	464	4.395,237357	4.106,146039	2.039.390,13	1.905.251,76	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	103.405.759,03	41.723,26	895.169,31	101.958.075,22	-594.237,76	-594.237,76	-0,57%	-0,57%	0,86%	0,86%	-67,05%	1,43%
Fevereiro	101.958.075,22	1.316.141,46	1.266.651,06	102.644.171,14	636.605,52	42.367,76	0,62%	0,05%	1,21%	2,08%	2,21%	1,51%
Março	102.644.171,14	8.326.191,66	7.919.983,01	103.484.505,42	434.125,63	476.493,39	0,42%	0,47%	0,56%	2,64%	17,67%	1,31%
Abril	103.484.505,42	2.121.679,94	1.763.704,70	102.821.489,36	-1.020.991,30	-544.497,91	-0,98%	-0,52%	0,82%	3,48%	-14,95%	2,04%
Maiο	102.821.489,36	879.574,99	436.850,58	103.703.194,98	438.981,21	-105.516,70	0,43%	-0,10%	0,88%	4,39%	-2,22%	1,49%
Junho	103.703.194,98	2.946.986,03	1.947.323,01	104.762.137,38	59.279,38	-46.237,32	0,06%	-0,04%	0,61%	5,02%	-0,82%	2,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

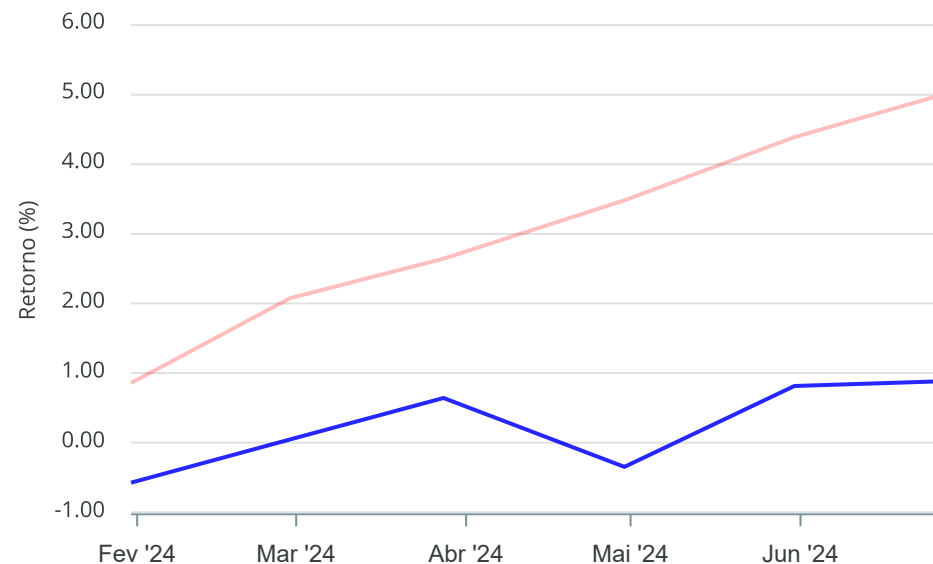
Evolução do Patrimônio



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

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
LETRA FINANCEIRA GENIAL	4.083.807,80	0,00	0,00	4.121.670,39	37.862,59	0,93%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 14,56%	154.442,31	0,00	0,00	155.831,47	1.389,16	0,90%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	4.174.908,57	847.300,00	0,00	5.064.900,25	42.691,68	0,85%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6.129.820,35	0,00	944.504,17	5.233.726,52	48.410,34	0,79%	0,79%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.616.913,52	0,00	3.822,88	1.625.822,95	12.732,31	0,79%	0,79%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	318.209,56	27.412,47	11,72	347.872,90	2.262,59	0,65%	0,71%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	282.668,20	0,00	0,00	284.388,00	1.719,80	0,61%	0,61%	0,25%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	575.413,72	55.485,97	4.103,28	630.517,64	3.721,23	0,59%	0,61%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.293.169,37	1.021.906,64	994.880,96	5.351.914,31	31.719,26	0,50%	0,61%	0,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.220.467,59	0,00	0,00	4.236.629,51	16.161,92	0,38%	0,38%	0,47%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.539.998,15	0,00	0,00	9.575.663,98	35.665,83	0,37%	0,37%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.058.094,72	0,00	0,00	8.078.712,47	20.617,75	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	6.974.690,94	0,00	0,00	6.986.579,52	11.888,58	0,17%	0,17%	0,88%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.518.492,67	0,00	0,00	7.494.750,02	-23.742,65	-0,32%	-0,32%	1,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.314.574,90	0,00	0,00	3.281.919,82	-32.655,08	-0,99%	-0,99%	1,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.897.716,04	0,00	0,00	5.839.028,09	-58.687,95	-1,00%	-1,00%	1,90%
TÍTULOS PÚBLICOS	13.556.766,08	994.880,95	0,00	14.327.232,33	-224.414,70	-1,54%	-	-
Total Renda Fixa	81.710.154,49	2.946.986,03	1.947.323,01	82.637.160,17	-72.657,34	-0,09%		0,93%

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
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.253.641,28	0,00	0,00	1.282.122,38	28.481,10	2,27%	2,27%	6,58%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.018.169,66	0,00	0,00	1.038.508,21	20.338,55	2,00%	2,00%	6,10%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	764.633,62	0,00	0,00	779.323,29	14.689,67	1,92%	1,92%	6,48%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.682.970,54	0,00	0,00	2.733.834,87	50.864,33	1,90%	1,90%	5,03%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	575.271,37	0,00	0,00	583.121,22	7.849,85	1,36%	1,36%	6,88%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.200.690,23	0,00	0,00	2.225.609,51	24.919,28	1,13%	1,13%	5,36%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.896.161,54	0,00	0,00	2.925.090,33	28.928,79	1,00%	1,00%	6,71%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.833.352,98	0,00	0,00	1.839.996,45	6.643,47	0,36%	0,36%	1,07%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.137.675,54	0,00	0,00	7.118.502,14	-19.173,40	-0,27%	-0,27%	3,43%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	899.610,36	0,00	0,00	892.954,42	-6.655,94	-0,74%	-0,74%	3,30%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	730.863,37	0,00	0,00	705.914,39	-24.948,98	-3,41%	-3,41%	12,11%
Total Renda Variável	21.993.040,49	0,00	0,00	22.124.977,21	131.936,72	0,60%		4,84%

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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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 MATRIZ FI RENDA FIXA	7.448.542,94	701.758,44	3.066.575,77	5.233.726,52	150.000,91	1,84%	2,47%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	4.090.000,00	847.300,00	0,00	5.064.900,25	127.600,25	2,58%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.464.250,95	0,00	0,00	9.575.663,98	111.413,03	1,18%	1,18%
LETRA FINANCEIRA GENIAL	4.011.991,48	0,00	0,00	4.121.670,39	109.678,91	2,73%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.224.619,35	1.021.906,64	994.880,96	5.351.914,31	100.269,28	1,61%	1,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.995.124,79	0,00	0,00	8.078.712,47	83.587,68	1,05%	1,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.178.332,28	0,00	0,00	4.236.629,51	58.297,23	1,40%	1,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.495.323,07	95.300,32	3.822,88	1.625.822,95	39.022,44	2,45%	2,53%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	6.948.290,59	0,00	0,00	6.986.579,52	38.288,93	0,55%	0,55%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	458.578,58	166.457,91	4.933,74	630.517,64	10.414,89	1,67%	1,94%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	278.313,46	81.246,57	18.327,94	347.872,90	6.640,81	1,85%	2,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	278.905,41	0,00	0,00	284.388,00	5.482,59	1,97%	1,97%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 14,56%	151.999,00	0,00	0,00	155.831,47	3.832,47	2,52%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.512.619,04	0,00	0,00	7.494.750,02	-17.869,02	-0,24%	-0,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.326.160,63	0,00	0,00	3.281.919,82	-44.240,81	-1,33%	-1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.918.849,62	0,00	0,00	5.839.028,09	-79.821,53	-1,35%	-1,35%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.670.618,93	3.034.271,08	59.337,00	14.327.232,33	-318.320,68	-2,16%	-
Total Renda Fixa	80.452.520,12	5.948.240,96	4.147.878,29	82.637.160,17	384.277,38	0,47%	

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.831.218,00	0,00	0,00	1.839.996,45	8.778,45	0,48%	0,48%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	910.660,94	0,00	0,00	892.954,42	-17.706,52	-1,94%	-1,94%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	617.171,38	0,00	0,00	583.121,22	-34.050,16	-5,52%	-5,52%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.090.006,61	0,00	0,00	1.038.508,21	-51.498,40	-4,72%	-4,72%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	834.914,16	0,00	0,00	779.323,29	-55.590,87	-6,66%	-6,66%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.358.413,68	0,00	0,00	1.282.122,38	-76.291,30	-5,62%	-5,62%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.305.874,96	0,00	0,00	2.225.609,51	-80.265,45	-3,48%	-3,48%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.846.217,74	0,00	0,00	2.733.834,87	-112.382,87	-3,95%	-3,95%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	841.206,61	0,00	0,00	705.914,39	-135.292,22	-16,08%	-16,08%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.261.257,60	0,00	0,00	7.118.502,14	-142.755,46	-1,97%	-1,97%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.135.043,62	0,00	0,00	2.925.090,33	-209.953,29	-6,70%	-6,70%
Total Renda Variável	23.031.985,30	0,00	0,00	22.124.977,21	-907.008,09	-3,94%	

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 MATRIZ FI RENDA FIXA	13.960.643,82	701.758,44	9.924.902,82	5.233.726,52	496.227,08	4,87%	5,23%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.278.633,23	0,00	0,00	9.575.663,98	297.030,75	3,21%	3,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.834.782,87	0,00	0,00	8.078.712,47	243.929,60	3,11%	3,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.100.763,02	1.021.906,64	994.880,96	5.351.914,31	224.125,61	4,27%	4,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	6.705.423,52	1.016.029,47	893.877,65	6.986.579,52	159.004,18	2,35%	2,36%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.080.071,07	0,00	0,00	4.236.629,51	156.558,44	3,83%	3,84%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	0,00	4.937.300,00	0,00	5.064.900,25	127.600,25	0,00%	-
LETRA FINANCEIRA GENIAL	0,00	4.000.000,00	0,00	4.121.670,39	121.670,39	0,00%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.347.166,47	148.623,36	1.989.114,71	1.625.822,95	119.147,83	4,94%	5,24%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.393.731,91	0,00	0,00	7.494.750,02	101.018,11	1,36%	1,37%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	340.339,32	280.335,57	8.278,12	630.517,64	18.120,87	3,83%	4,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	272.181,26	0,00	0,00	284.388,00	12.206,74	4,48%	4,48%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	199.541,85	161.414,99	25.034,12	347.872,90	11.950,18	4,23%	4,71%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 14,56%	0,00	150.000,00	0,00	155.831,47	5.831,47	0,00%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.322.634,83	0,00	0,00	3.281.919,82	-40.715,01	-1,22%	-1,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.911.327,39	0,00	0,00	5.839.028,09	-72.299,30	-1,23%	-1,22%
TÍTULOS PÚBLICOS	12.189.087,33	3.061.001,61	393.593,29	14.327.232,33	-529.263,32	-0,03%	-
Total Renda Fixa	79.936.327,89	15.478.370,08	14.229.681,67	82.637.160,17	1.452.143,87	1,79%	

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.790.303,97	0,00	0,00	1.839.996,45	49.692,48	2,77%	2,78%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	900.953,84	0,00	0,00	892.954,42	-7.999,42	-0,88%	-0,89%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	466.413,60	153.927,26	0,00	583.121,22	-37.219,64	-6,66%	-6,68%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.133.722,14	0,00	0,00	1.038.508,21	-95.213,93	-8,39%	-8,72%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	889.751,53	0,00	0,00	779.323,29	-110.428,24	-12,41%	-12,41%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.257.236,50	0,00	0,00	7.118.502,14	-138.734,36	-1,92%	-1,91%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.439.943,50	0,00	0,00	1.282.122,38	-157.821,12	-10,96%	-10,96%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	879.166,97	0,00	0,00	705.914,39	-173.252,58	-19,71%	-19,71%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.408.641,96	0,00	0,00	2.225.609,51	-183.032,45	-7,61%	-7,60%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.227.904,00	0,00	0,00	2.925.090,33	-302.813,67	-9,39%	-9,38%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.075.393,13	0,00	0,00	2.733.834,87	-341.558,26	-11,10%	-11,11%
Total Renda Variável	23.469.431,14	153.927,26	0,00	22.124.977,21	-1.498.381,19	-6,34%	

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.

