

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

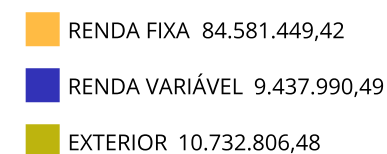
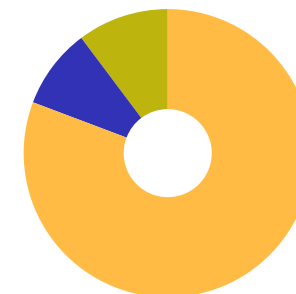
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	4.921.997,82	4,70%	697	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.407.694,91	2,30%	862	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.310.771,48	4,12%	638	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.541.547,70	3,38%	1.141	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	596.395,27	0,57%	140	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	10.256.290,02	9,79%	382	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA F...	D+0	15/05/2025	5.227.429,86	4,99%	88	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	4.695.360,51	4,48%	116	1,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	5.860.993,78	5,60%	219	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	15.562.971,69	14,86%	370	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.194.035,15	4,96%	254	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.404.227,71	1,34%	248	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.774.452,69	1,69%	777	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.305.401,91	6,02%	753	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.169.206,85	1,12%	1.155	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	303.657,11	0,29%	1.148	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.319.433,68	3,17%	30	1,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.019.363,52	1,93%	488	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.700.741,26	4,49%	1.011	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIX...	D+5 du	Não há	1.009.476,50	0,96%	115	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.309.009,41	2,20%	2.491	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.207.596,90	1,15%	22.759	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.517.834,97	2,40%	2.254	1,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.868.713,59	2,74%	123	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	534.835,62	0,51%	46	0,76%	Artigo 8º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.520.603,28	3,36%	10.421	0,41%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	7.212.203,20	6,89%	448	0,26%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			104.752.246,39				

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

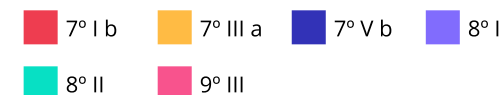
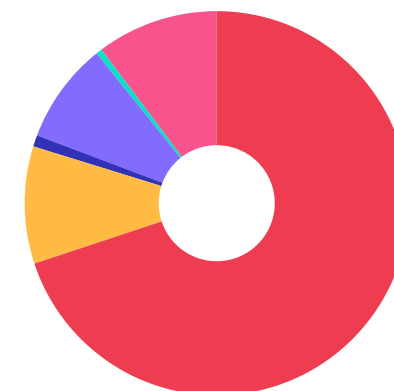
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	20.950.449,28
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	73.228.777,35	69,91%	15,00%	45,00%	95,00%	26.285.856,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	10.343.195,57	9,87%	10,00%	15,00%	55,00%	47.270.539,94
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	20.950.449,28
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.237.612,32
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	1.009.476,50	0,96%	0,00%	0,00%	5,00%	4.228.135,82
Total Renda Fixa	100,00%	84.581.449,42	80,74%	25,00%	75,00%	200,00%	



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%	8.903.154,87	8,50%	5,00%	10,00%	30,00%	22.522.519,05
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	534.835,62	0,51%	0,50%	2,00%	30,00%	30.890.838,30
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	10,00%	10.475.224,64
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.237.612,32
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.237.612,32
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	9.437.990,49	9,01%	10,50%	20,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	10.732.806,48	10,25%	3,00%	5,00%	10,00%	-257.581,84
Total Exterior	10,00%	10.732.806,48	10,25%	3,00%	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 '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	73.228.777,35	69,91	15,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	10.343.195,57	9,87	10,00	55,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	1.009.476,50	0,96	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	8.903.154,87	8,50	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	534.835,62	0,51	0,50	30,00
Artigo 9º, Inciso III	10.732.806,48	10,25	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB ASSET MANAGEMENT	64.722.319,74	61,79	-
CAIXA DTVM	28.487.617,80	27,20	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.542.308,85	11,02	-

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 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,62%	-	-	-	-	-	0,42%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02%	1,97%	0,22%	1,97%	6,11%	17,70%	1,37%	2,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,20%	-	-	-	-	-	0,97%	-
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%
IMA Geral (Benchmark)	0,05%	2,42%	0,77%	2,42%	8,23%	23,40%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	-0,02%	2,14%	0,64%	2,14%	7,35%	21,95%	0,95%	1,99%
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%
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%
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 (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%

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
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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,77%	5,10%	2,47%	5,10%	11,44%	26,23%	0,00%	0,06%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,84%	5,69%	2,69%	5,69%	12,72%	28,36%	0,02%	0,11%
IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
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%
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%
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)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRDESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO...	0,87%	6,05%	2,80%	6,05%	13,54%	-	0,03%	0,18%

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%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,54%	-12,65%	-6,03%	-12,65%	-0,46%	5,66%	6,32%	14,36%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1,44%	-7,49%	-3,20%	-7,49%	4,86%	25,30%	5,71%	13,36%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,37%	-8,82%	-5,44%	-8,82%	2,40%	17,87%	5,99%	14,12%

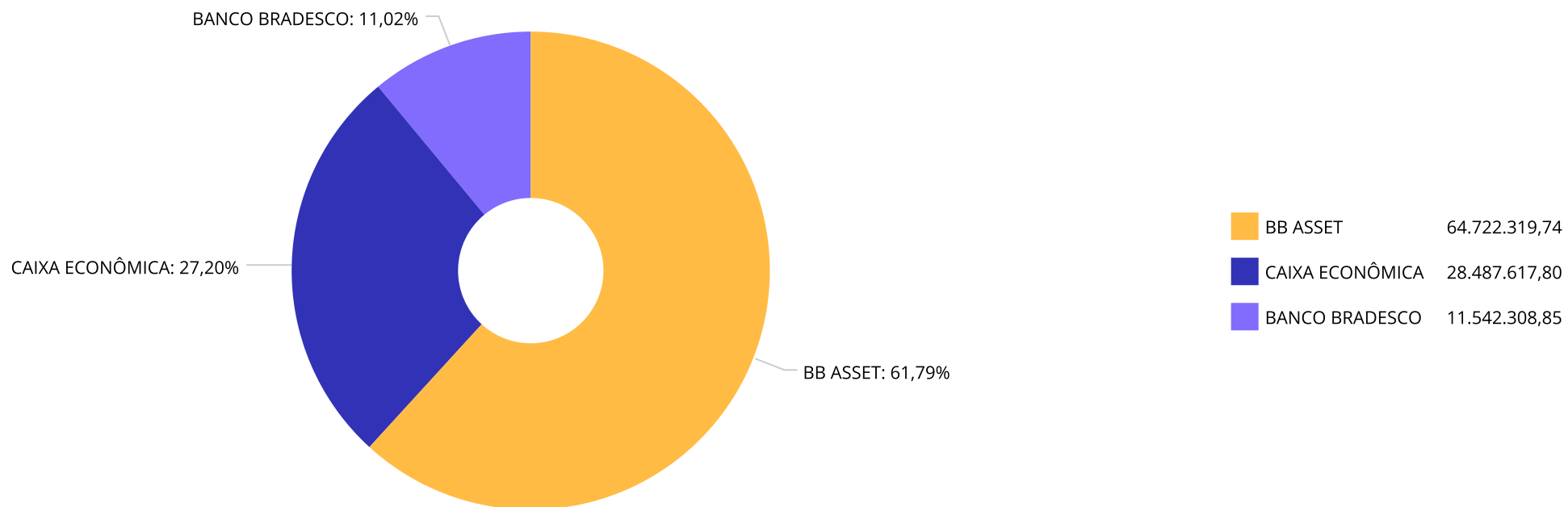
IDIV (Benchmark)	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,09%	-5,85%	-7,70%	-5,85%	0,15%	28,15%	6,91%	14,69%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,90%	-3,86%	0,13%	-3,86%	10,80%	28,70%	5,25%	11,91%

MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	9,63%	30,52%	15,29%	30,52%	41,00%	50,92%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	9,68%	29,54%	13,97%	29,54%	40,97%	54,12%	6,32%	13,61%

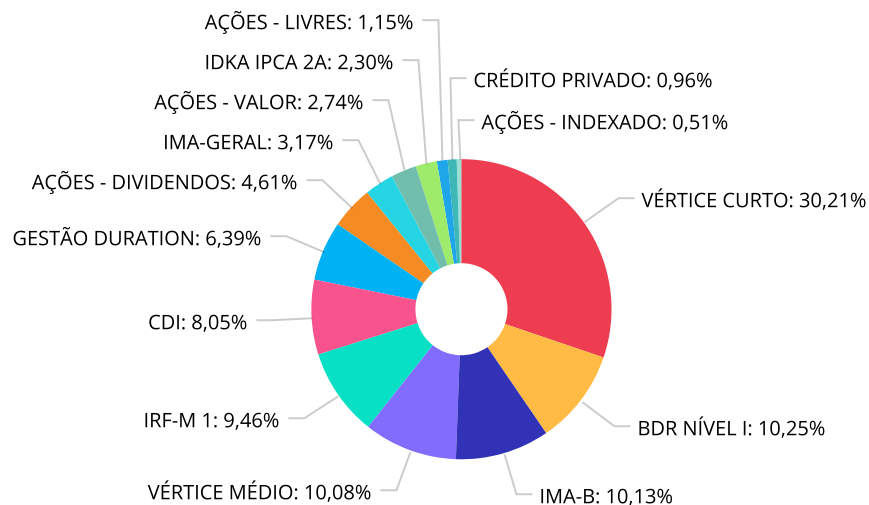
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	9,63%	30,52%	15,29%	30,52%	41,00%	50,92%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	9,68%	29,53%	13,97%	29,53%	40,96%	54,12%	6,32%	13,608%
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%

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



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

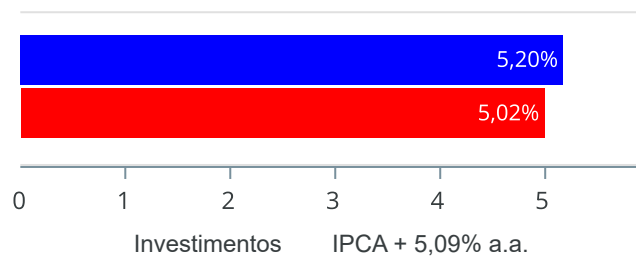


■ VÉRTICE CURTO	31.643.086,84	■ BDR NÍVEL I	10.732.806,48	■ IMA-B	10.616.173,39	■ VÉRTICE MÉDIO	10.556.354,29
■ IRF-M 1	9.904.789,70	■ CDI	8.427.989,60	■ GESTÃO DURATION	6.696.450,51	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	4.826.844,38
■ IMA-GERAL	3.319.433,68	■ AÇÕES - VALOR	2.868.713,59	■ IDKA IPCA 2A	2.407.694,91	■ AÇÕES - LIVRES	1.207.596,90
■ CRÉDITO PRIVADO	1.009.476,50	■ AÇÕES - INDEXADO	534.835,62				

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	92.141.841,35	1.415.755,11	1.130.000,00	93.002.168,15	574.571,69	574.571,69	0,62%	0,62%	0,86%	0,86%	72,61%	1,38%
Fevereiro	93.002.168,15	5.289.293,95	4.964.766,14	94.494.979,61	1.168.283,65	1.742.855,34	1,25%	1,88%	1,21%	2,07%	90,68%	1,74%
Março	94.494.979,61	2.844.614,81	4.362.646,00	93.720.327,82	743.379,40	2.486.234,74	0,79%	2,68%	0,56%	2,64%	101,56%	1,34%
Abril	93.720.327,82	3.483.875,07	3.220.346,26	93.703.726,53	-280.130,10	2.206.104,64	-0,30%	2,38%	0,82%	3,48%	68,31%	1,95%
Mai	93.703.726,53	15.864.331,82	14.988.285,16	95.605.978,94	1.026.205,75	3.232.310,39	1,09%	3,49%	0,88%	4,39%	79,51%	1,51%
Junho	95.605.978,94	6.079.538,32	1.167.851,36	102.178.811,83	1.661.145,93	4.893.456,32	1,65%	5,20%	0,61%	5,02%	103,57%	1,89%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



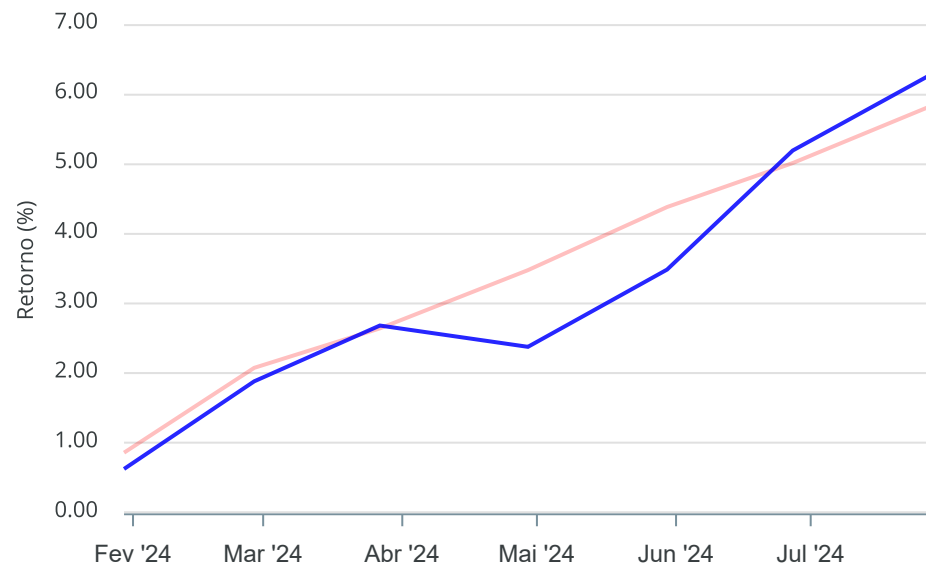
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	10.137.945,07	0,00	0,00	10.256.290,02	118.344,95	1,17%	1,17%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	15.384.507,83	0,00	0,00	15.562.971,69	178.463,86	1,16%	1,16%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	589.580,29	0,00	0,00	596.395,27	6.814,98	1,16%	1,16%	0,48%
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA ...	1.000.769,73	0,00	0,00	1.009.476,50	8.706,77	0,87%	0,87%	0,03%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.002.644,55	0,00	0,00	2.019.363,52	16.718,97	0,83%	0,83%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.662.574,24	0,00	0,00	4.700.741,26	38.167,02	0,82%	0,82%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	301.279,66	0,00	0,00	303.657,11	2.377,45	0,79%	0,79%	0,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.465.818,52	0,00	72.667,89	1.404.227,71	11.077,08	0,76%	0,77%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	5.195.093,16	0,00	0,00	5.227.429,86	32.336,70	0,62%	0,62%	0,42%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.162.380,86	0,00	0,00	5.194.035,15	31.654,29	0,61%	0,61%	0,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.162.136,19	0,00	0,00	1.169.206,85	7.070,66	0,61%	0,61%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.671.963,72	0,00	4.695.360,51	23.396,79	0,50%	0,20%	0,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.279.601,52	1.407.574,60	1.167.851,36	3.541.547,70	22.222,94	0,47%	0,61%	0,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.903.221,34	0,00	0,00	4.921.997,82	18.776,48	0,38%	0,38%	0,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.401.550,21	0,00	0,00	2.407.694,91	6.144,70	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.771.433,23	0,00	0,00	1.774.452,69	3.019,46	0,17%	0,17%	0,88%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.320.039,11	0,00	0,00	3.319.433,68	-605,43	-0,02%	-0,02%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	5.862.201,10	0,00	0,00	5.860.993,78	-1.207,32	-0,02%	-0,02%	1,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.353.666,24	0,00	0,00	4.310.771,48	-42.894,76	-0,99%	-0,99%	1,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.368.777,36	0,00	0,00	6.305.401,91	-63.375,45	-1,00%	-1,00%	1,90%

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
Total Renda Fixa	79.325.220,21	6.079.538,32	1.240.519,25	84.581.449,42	417.210,14	0,50%		0,70%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.470.858,54	0,00	0,00	2.517.834,97	46.976,43	1,90%	1,90%	5,25%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.189.342,67	0,00	0,00	1.207.596,90	18.254,23	1,53%	1,53%	6,32%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	527.223,33	0,00	0,00	534.835,62	7.612,29	1,44%	1,44%	5,71%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.829.837,96	0,00	0,00	2.868.713,59	38.875,63	1,37%	1,37%	5,99%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.284.029,84	0,00	0,00	2.309.009,41	24.979,57	1,09%	1,09%	6,91%
Total Renda Variável	9.301.292,34	0,00	0,00	9.437.990,49	136.698,15	1,47%		6,04%

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	6.397.628,60	0,00	0,00	7.212.203,20	814.574,60	12,73%	12,73%	8,26%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.209.792,50	0,00	0,00	3.520.603,28	310.810,78	9,68%	9,68%	6,32%
Total Exterior	9.607.421,10	0,00	0,00	10.732.806,48	1.125.385,38	11,71%		7,62%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	15.129.910,63	0,00	0,00	15.562.971,69	433.061,06	2,86%	2,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	9.968.707,20	0,00	0,00	10.256.290,02	287.582,82	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.382.899,80	201.711,73	0,00	4.700.741,26	116.129,73	2,53%	2,57%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.095.138,38	0,00	0,00	5.194.035,15	98.896,77	1,94%	1,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.585.307,61	12.381.129,79	11.512.351,36	3.541.547,70	87.461,66	0,58%	1,93%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.854.269,72	0,00	0,00	4.921.997,82	67.728,10	1,40%	1,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	0,00	5.172.939,97	0,00	5.227.429,86	54.489,89	1,05%	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.506.759,42	0,00	138.667,89	1.404.227,71	36.136,18	2,40%	2,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.382.783,31	0,00	0,00	2.407.694,91	24.911,60	1,05%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.671.963,72	0,00	4.695.360,51	23.396,79	0,50%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.223.573,95	0,00	77.432,97	1.169.206,85	23.065,87	1,89%	1,97%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.298.184,58	0,00	0,00	3.319.433,68	21.249,10	0,64%	0,64%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	2.000.000,00	0,00	2.019.363,52	19.363,52	0,97%	2,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	579.849,22	0,00	0,00	596.395,27	16.546,05	2,85%	2,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	6.021.022,32	0,00	172.939,97	5.860.993,78	12.911,43	0,21%	0,22%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.764.728,06	0,00	0,00	1.774.452,69	9.724,63	0,55%	0,55%
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA ...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.009.476,50	9.476,50	0,95%	2,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	296.170,23	0,00	0,00	303.657,11	7.486,88	2,53%	2,53%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	2.006.305,90	0,00	2.006.846,26	0,00	540,36	0,03%	0,69%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.368.884,03	0,00	0,00	4.310.771,48	-58.112,55	-1,33%	-1,33%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.391.598,92	0,00	0,00	6.305.401,91	-86.197,01	-1,35%	-1,35%
Total Renda Fixa	71.856.093,28	25.427.745,21	13.908.238,45	84.581.449,42	1.205.849,38	1,45%	

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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	5.674.169,16	0,00	5.684.345,19	0,00	10.176,03	0,18%	1,06%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.514.606,00	0,00	0,00	2.517.834,97	3.228,97	0,13%	0,13%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	552.489,07	0,00	0,00	534.835,62	-17.653,45	-3,20%	-3,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.285.016,02	0,00	0,00	1.207.596,90	-77.419,12	-6,02%	-6,02%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.033.772,28	0,00	0,00	2.868.713,59	-165.058,69	-5,44%	-5,44%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.501.643,48	0,00	0,00	2.309.009,41	-192.634,07	-7,70%	-7,70%
Total Renda Variável	15.561.696,01	0,00	5.684.345,19	9.437.990,49	-439.360,33	-2,82%	

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	5.943.860,54	0,00	0,00	7.212.203,20	1.268.342,66	21,34%	21,34%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.089.011,36	0,00	0,00	3.520.603,28	431.591,92	13,97%	13,97%
Total Exterior	9.032.871,90	0,00	0,00	10.732.806,48	1.699.934,58	18,82%	

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 XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	15.140.728,82	0,00	427.154,37	15.562.971,69	849.397,24	6,77%	5,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	9.978.384,41	0,00	286.442,90	10.256.290,02	564.348,51	6,81%	5,78%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.266.820,82	201.711,73	0,00	4.700.741,26	232.208,71	6,34%	5,36%
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.994.119,69	2.000.000,00	0,00	5.194.035,15	199.915,46	5,32%	4,44%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	5.727.908,50	0,00	1.000.000,00	4.921.997,82	194.089,32	4,85%	3,84%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.755.351,70	15.515.038,55	13.874.351,36	3.541.547,70	145.508,81	4,12%	4,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	5.917.492,11	0,00	172.939,97	5.860.993,78	116.441,64	2,77%	1,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.689.809,83	0,00	4.000.000,00	1.774.452,69	84.642,86	2,99%	2,36%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.688.164,11	0,00	361.102,81	1.404.227,71	77.166,41	5,96%	5,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.334.996,68	0,00	0,00	2.407.694,91	72.698,23	3,90%	3,11%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.249.993,45	0,00	0,00	3.319.433,68	69.440,23	3,48%	2,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	0,00	5.172.939,97	0,00	5.227.429,86	54.489,89	0,00%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	580.867,22	0,00	16.908,46	596.395,27	32.436,51	6,70%	5,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	1.216.646,00	77.432,97	1.169.206,85	29.993,82	0,00%	4,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	4.671.963,72	0,00	4.695.360,51	23.396,79	0,00%	-
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	2.000.000,00	0,00	2.019.363,52	19.363,52	0,00%	5,69%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	17.697,16	1.415.755,11	1.148.260,41	303.657,11	18.465,25	5,64%	5,24%
BRANCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA ...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.009.476,50	9.476,50	0,00%	6,05%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	0,00	2.000.000,00	2.006.846,26	0,00	6.846,26	0,00%	2,31%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.364.252,92	0,00	0,00	4.310.771,48	-53.481,44	0,82%	-1,23%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.383.475,88	0,00	0,00	6.305.401,91	-78.073,97	0,81%	-1,22%
Total Renda Fixa	70.090.063,30	35.194.055,08	23.371.439,51	84.581.449,42	2.668.770,55	3,26%	

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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	6.727.417,83	0,00	6.900.991,19	0,00	173.573,36	2,61%	3,63%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	578.155,20	0,00	0,00	534.835,62	-43.319,58	-4,75%	-7,49%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.618.871,90	0,00	0,00	2.517.834,97	-101.036,93	-2,19%	-3,86%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	329.649,63	1.000.000,00	0,00	1.207.596,90	-122.052,73	-9,84%	-12,65%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.452.390,68	0,00	0,00	2.309.009,41	-143.381,27	-4,05%	-5,85%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.146.141,91	0,00	0,00	2.868.713,59	-277.428,32	-5,94%	-8,82%
Total Renda Variável	15.852.627,15	1.000.000,00	6.900.991,19	9.437.990,49	-513.645,47	-3,05%	

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	5.169.428,72	0,00	0,00	7.212.203,20	2.042.774,48	40,23%	39,52%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.717.886,29	0,00	0,00	3.520.603,28	802.716,99	28,78%	29,53%
Total Exterior	7.887.315,01	0,00	0,00	10.732.806,48	2.845.491,47	36,08%	

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.

