

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

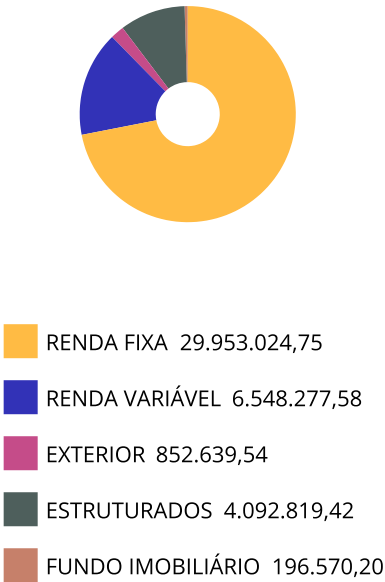
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	2.931.741,39	7,04%	697	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.079.650,05	4,99%	862	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	5.222.227,22	12,54%	382	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	2.032.116,51	4,88%	219	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	270.591,05	0,65%	656	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	2.030.741,61	4,88%	95	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.153.179,03	7,57%	254	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.652.326,26	6,37%	777	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.056.740,67	7,34%	820	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.932.674,48	4,64%	270	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.418.072,50	3,41%	753	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	459.112,08	1,10%	1.155	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	113.375,71	0,27%	1.007	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.600.476,19	6,24%	1.148	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	721.393,86	1,73%	20.809	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.537.279,41	3,69%	1.174	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.486.720,24	3,57%	510	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	515.123,37	1,24%	25	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.231.772,17	2,96%	864	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	694.878,61	1,67%	200	0,09%	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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	361.109,92	0,87%	4.917	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	852.639,54	2,05%	448	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.397.299,86	3,36%	165	0,42%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	831.244,66	2,00%	4.447	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.864.274,90	4,48%	102	0,37%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	196.570,20	0,47%		0,07%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			41.643.331,49				

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%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	12.492.999,45
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	27.239.172,85	65,41%	25,00%	54,00%	90,00%	10.239.825,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	2.713.851,90	6,52%	0,00%	10,00%	40,00%	13.943.480,70
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.164.333,15
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.082.166,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.082.166,57
Total Renda Fixa	100,00%	29.953.024,75	71,93%	25,00%	69,00%	180,00%	

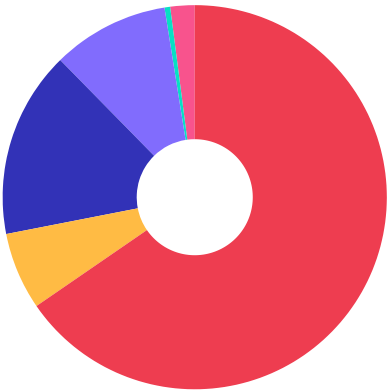


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	6.548.277,58	15,72%	5,00%	20,00%	30,00%	5.944.721,87
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.164.333,15
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.092.819,42	9,83%	4,00%	8,00%	10,00%	71.513,73
Artigo 11º	5,00%	196.570,20	0,47%	0,00%	1,00%	5,00%	1.885.596,37
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.837.667,20	26,02%	9,00%	29,00%	55,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	852.639,54	2,05%	0,00%	2,00%	5,00%	1.229.527,03
Total Exterior	10,00%	852.639,54	2,05%	0,00%	2,00%	5,00%	

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%	0,00%	5,00%	2.082.166,57



7º I b 7º III a 8º I 10º I
11º 9º III

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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	27.239.172,85	65,41	25,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	2.713.851,90	6,52	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	6.548.277,58	15,72	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	852.639,54	2,05	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	4.092.819,42	9,83	4,00	10,00
Artigo 11º	196.570,20	0,47	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	18.635.560,20	44,75	-
CAIXA DTVM	15.354.845,79	36,87	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	7.456.355,30	17,91	-
ZION INVEST	196.570,20	0,47	-

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 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02%	1,97%	0,22%	1,97%	6,11%	17,70%	1,37%	2,71%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	2,96%	0,86%	2,96%	8,08%	18,05%	0,98%	1,71%
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-B 5+ (Benchmark)	-2,25%	-5,04%	-3,58%	-5,04%	-1,43%	14,67%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,25%	-5,08%	-3,61%	-5,08%	-1,41%	14,09%	3,00%	5,98%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	4,51%	2,00%	4,51%	10,95%	26,28%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	4,49%	1,97%	4,49%	10,79%	25,84%	0,25%	0,35%
BRASESCO 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 (Benchmark)	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%	-	-
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%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,00%	-1,26%	-1,36%	-1,26%	2,73%	16,27%	1,89%	3,88%
Selic (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
BRASESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,78%	5,10%	2,47%	5,10%	11,39%	26,18%	0,01%	0,06%

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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,06%
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%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00%	1,90%	0,13%	1,90%	8,57%	23,52%	1,85%	3,17%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,36%	2,78%	0,48%	2,78%	9,19%	23,96%	1,07%	1,49%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	-0,89%	-1,94%	-0,89%	6,09%	21,55%	3,30%	4,15%

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 AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1,00%	-9,38%	-6,70%	-9,38%	-1,76%	13,42%	6,71%	14,21%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,11%	-6,86%	-7,64%	-6,86%	4,76%	26,67%	8,59%	15,61%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,13%	-7,60%	-3,48%	-7,60%	3,60%	13,77%	5,36%	13,79%

IBX (Benchmark)	1,51%	-7,20%	-3,03%	-7,20%	5,59%	24,17%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	1,27%	-8,79%	-4,43%	-8,79%	1,58%	18,44%	5,96%	14,08%

IDIV (Benchmark)	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,90%	-7,95%	-4,99%	-7,95%	3,15%	21,06%	5,47%	13,37%

IFIX (Benchmark)	-1,04%	1,08%	-1,78%	1,08%	6,09%	19,73%	-	-
-------------------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------	---	---

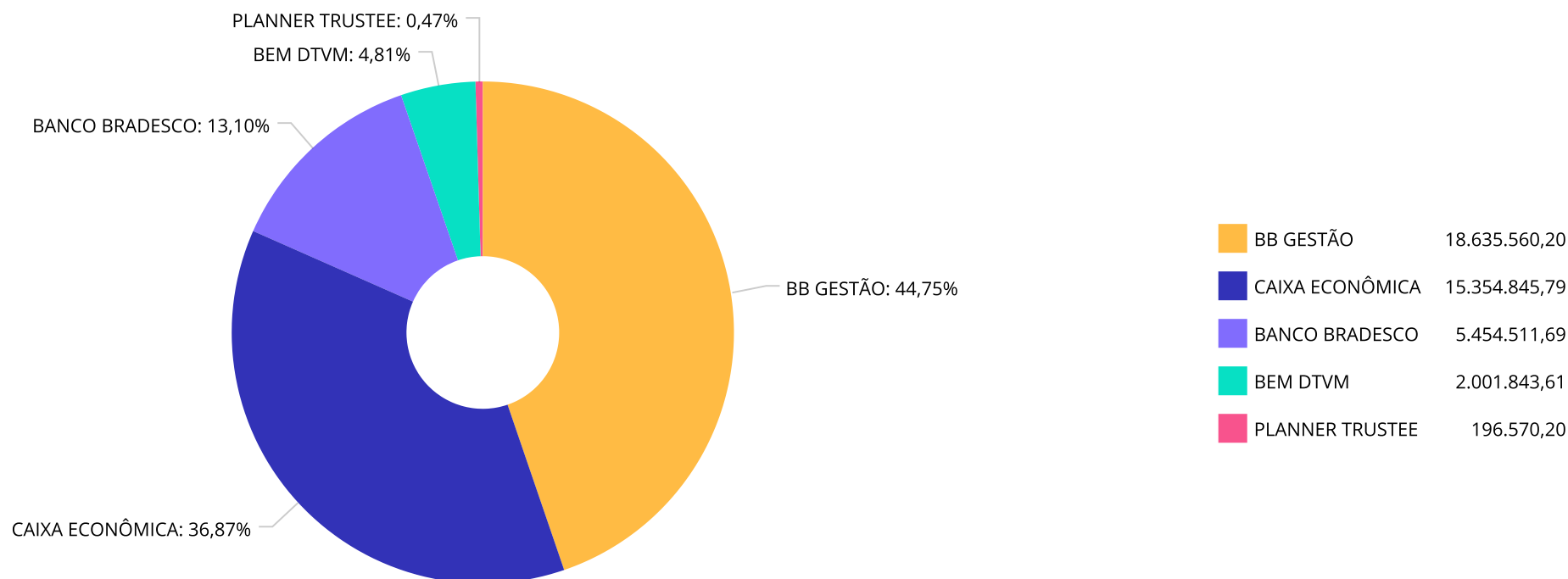
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-7,53%	25,55%	-19,63%	25,55%	-16,51%	-58,65%	27,25%	40,93%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,47%	14,48%	3,92%	14,48%	22,70%	44,25%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,95%	16,24%	5,15%	16,24%	27,39%	56,34%	3,30%	11,16%
SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-0,44%	-15,12%	-11,33%	-15,12%	-12,55%	3,94%	9,06%	19,37%

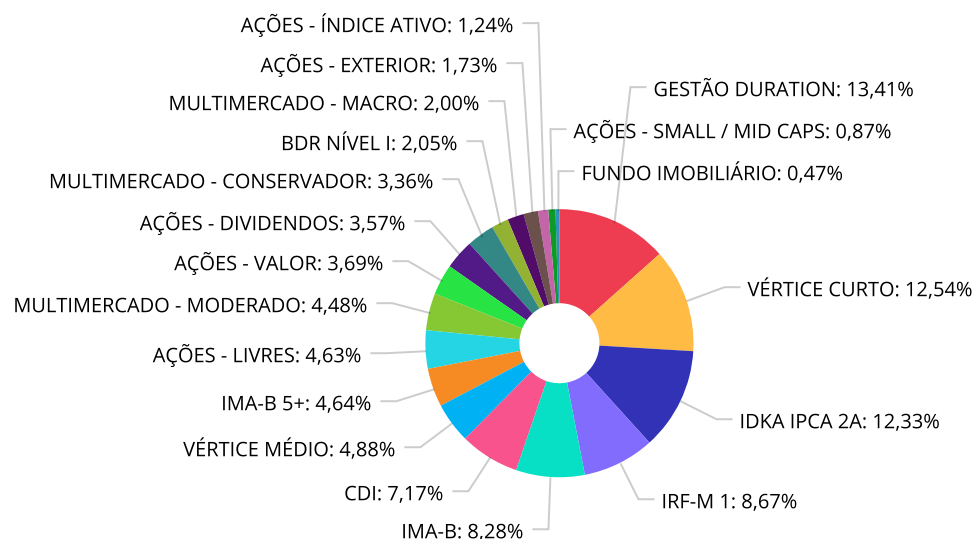
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%

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



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

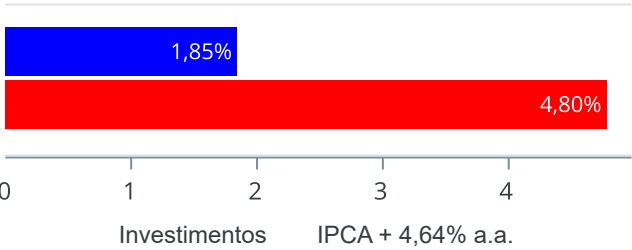


■ GESTÃO DURATION	5.584.067,65	■ VÉRTICE CURTO	5.222.227,22	■ IDKA IPCA 2A	5.136.390,72	■ IRF-M 1	3.612.291,11
■ IMA-B	3.448.814,11	■ CDI	2.984.442,95	■ VÉRTICE MÉDIO	2.032.116,51	■ IMA-B 5+	1.932.674,48
■ AÇÕES - LIVRES	1.926.650,78	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.864.274,90	■ AÇÕES - VALOR	1.537.279,41	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.486.720,24
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.397.299,86	■ BDR NÍVEL I	852.639,54	■ MULTIMERCADO - MACRO	831.244,66	■ AÇÕES - EXTERIOR	721.393,86
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	515.123,37	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	361.109,92	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	196.570,20		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

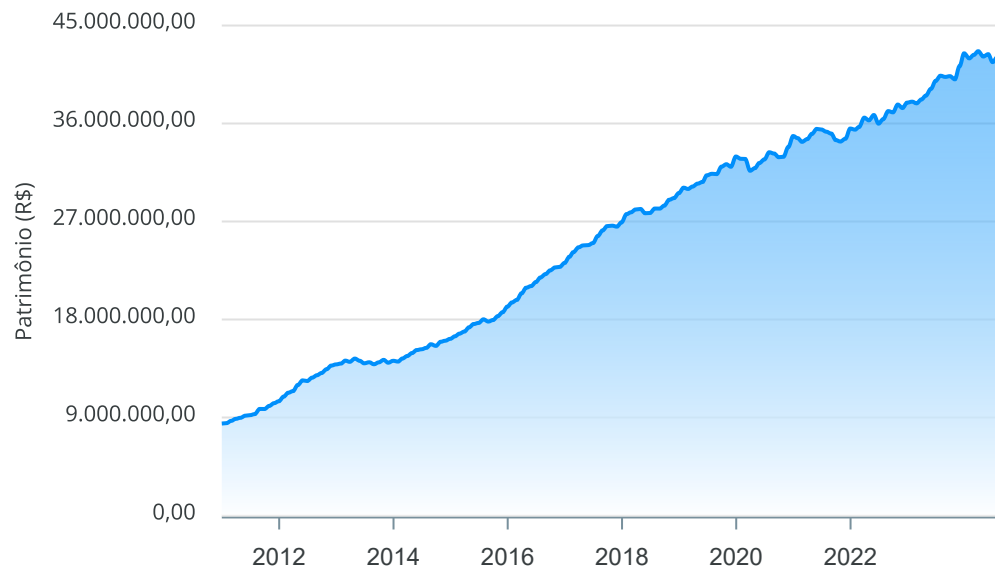
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	42.442.491,61	117.336,75	593.644,39	41.984.954,11	18.770,14	18.770,14	0,04%	0,04%	0,82%	0,82%	5,40%	1,50%
Fevereiro	41.984.954,11	460.196,32	520.708,92	42.301.214,77	376.773,26	395.543,40	0,90%	0,94%	1,18%	2,00%	47,02%	1,66%
Março	42.301.214,77	3.108.676,89	3.107.056,04	42.638.528,18	335.692,56	731.235,96	0,79%	1,74%	0,52%	2,54%	68,76%	1,41%
Abril	42.638.528,18	457.358,37	550.158,84	42.154.343,35	-391.384,36	339.851,60	-0,92%	0,81%	0,78%	3,33%	24,28%	2,02%
Maio	42.154.343,35	2.610.146,23	2.615.982,97	42.366.196,04	217.689,43	557.541,03	0,52%	1,33%	0,84%	4,20%	31,65%	1,63%
Junho	42.366.196,04	458.426,07	1.398.429,96	41.643.331,49	217.139,34	774.680,37	0,51%	1,85%	0,57%	4,80%	38,55%	2,12%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

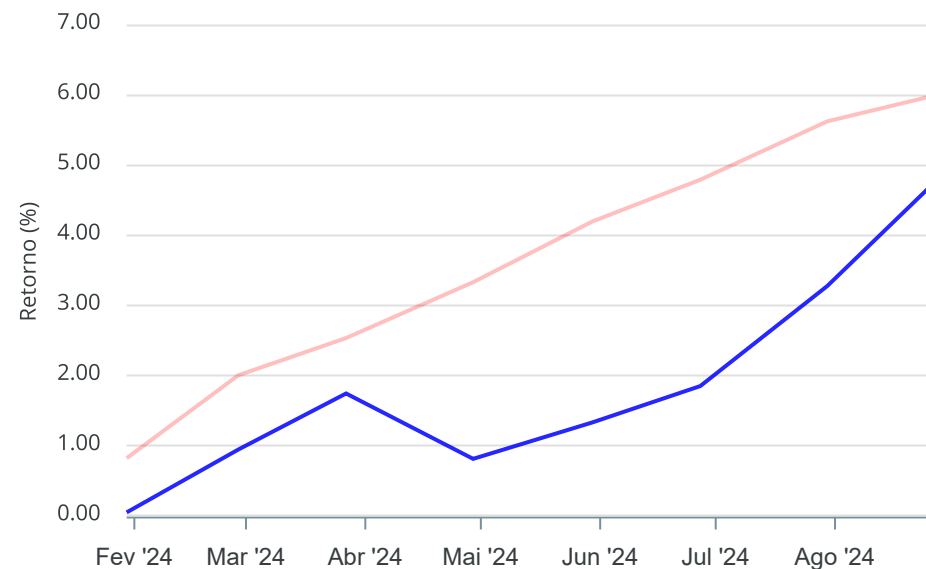
Evolução do Patrimônio



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...	5.161.969,15	0,00	0,00	5.222.227,22	60.258,07	1,17%	1,17%	0,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.580.116,00	0,00	0,00	2.600.476,19	20.360,19	0,79%	0,79%	0,02%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	268.494,15	0,00	0,00	270.591,05	2.096,90	0,78%	0,78%	0,01%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.133.962,44	0,00	0,00	3.153.179,03	19.216,59	0,61%	0,61%	0,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	456.335,64	0,00	0,00	459.112,08	2.776,44	0,61%	0,61%	0,25%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.920.557,36	0,00	0,00	2.931.741,39	11.184,03	0,38%	0,38%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.048.365,39	458.426,07	1.398.429,96	113.375,71	5.014,21	0,33%	0,71%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.074.342,56	0,00	0,00	2.079.650,05	5.307,49	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.050.786,77	0,00	0,00	3.056.740,67	5.953,90	0,20%	0,20%	0,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.647.812,98	0,00	0,00	2.652.326,26	4.513,28	0,17%	0,17%	0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.032.535,11	0,00	0,00	2.032.116,51	-418,60	-0,02%	-0,02%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.432.325,52	0,00	0,00	1.418.072,50	-14.253,02	-1,00%	-1,00%	1,90%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.051.223,79	0,00	0,00	2.030.741,61	-20.482,18	-1,00%	-1,00%	1,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.977.106,77	0,00	0,00	1.932.674,48	-44.432,29	-2,25%	-2,25%	3,00%
Total Renda Fixa	30.835.933,63	458.426,07	1.398.429,96	29.953.024,75	57.095,01	0,19%		0,91%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	694.014,87	0,00	0,00	721.393,86	27.378,99	3,95%	3,95%	3,30%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.458.998,05	0,00	0,00	1.486.720,24	27.722,19	1,90%	1,90%	5,47%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	508.678,25	0,00	0,00	515.123,37	6.445,12	1,27%	1,27%	5,96%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.520.067,10	0,00	0,00	1.537.279,41	17.212,31	1,13%	1,13%	5,36%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.219.590,10	0,00	0,00	1.231.772,17	12.182,07	1,00%	1,00%	6,71%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.392.254,79	0,00	0,00	1.397.299,86	5.045,07	0,36%	0,36%	1,07%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	831.218,36	0,00	0,00	831.244,66	26,30	0,00%	0,00%	1,85%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	695.641,29	0,00	0,00	694.878,61	-762,68	-0,11%	-0,11%	8,59%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	362.719,50	0,00	0,00	361.109,92	-1.609,58	-0,44%	-0,44%	9,06%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.878.170,92	0,00	0,00	1.864.274,90	-13.896,02	-0,74%	-0,74%	3,30%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	212.570,10	0,00	0,00	196.570,20	-15.999,90	-7,53%	-7,53%	27,25%
Total Renda Variável	10.773.923,33	0,00	0,00	10.837.667,20	63.743,87	0,59%		4,97%

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	756.339,08	0,00	0,00	852.639,54	96.300,46	12,73%	12,73%	8,26%
Total Exterior	756.339,08	0,00	0,00	852.639,54	96.300,46	12,73%		8,26%

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 VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	3.098.471,73	2.000.000,00	0,00	5.222.227,22	123.755,49	2,43%	2,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.477.181,69	59.961,53	0,00	2.600.476,19	63.332,97	2,50%	2,53%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.093.141,08	0,00	0,00	3.153.179,03	60.037,95	1,94%	1,94%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.891.399,79	0,00	0,00	2.931.741,39	40.341,60	1,40%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.020.549,97	0,00	2.000.000,00	3.056.740,67	36.190,70	0,72%	0,86%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.126.847,02	1.465.969,14	2.504.610,24	113.375,71	25.169,79	0,97%	2,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.058.132,62	0,00	0,00	2.079.650,05	21.517,43	1,05%	1,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.637.790,57	0,00	0,00	2.652.326,26	14.535,69	0,55%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	450.261,05	0,00	0,00	459.112,08	8.851,03	1,97%	1,97%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	264.057,69	0,00	0,00	270.591,05	6.533,36	2,47%	2,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.087.601,40	0,00	59.961,53	2.032.116,51	4.476,64	0,21%	0,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.437.458,04	0,00	0,00	1.418.072,50	-19.385,54	-1,35%	-1,35%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.058.706,56	0,00	0,00	2.030.741,61	-27.964,95	-1,36%	-1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.005.128,83	0,00	0,00	1.932.674,48	-72.454,35	-3,61%	-3,61%
Total Renda Fixa	30.706.728,04	3.525.930,67	4.564.571,77	29.953.024,75	284.937,81	0,83%	

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 AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	686.046,54	0,00	0,00	721.393,86	35.347,32	5,15%	5,15%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.390.633,48	0,00	0,00	1.397.299,86	6.666,38	0,48%	0,48%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	830.185,79	0,00	0,00	831.244,66	1.058,87	0,13%	0,13%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	539.020,06	0,00	0,00	515.123,37	-23.896,69	-4,43%	-4,43%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.901.241,87	0,00	0,00	1.864.274,90	-36.966,97	-1,94%	-1,94%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	407.252,07	0,00	0,00	361.109,92	-46.142,15	-11,33%	-11,33%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	244.569,90	0,00	0,00	196.570,20	-47.999,70	-19,63%	-19,63%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.592.720,59	0,00	0,00	1.537.279,41	-55.441,18	-3,48%	-3,48%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	752.385,52	0,00	0,00	694.878,61	-57.506,91	-7,64%	-7,64%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.564.865,81	0,00	0,00	1.486.720,24	-78.145,57	-4,99%	-4,99%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.320.184,70	0,00	0,00	1.231.772,17	-88.412,53	-6,70%	-6,70%
Total Renda Variável	11.229.106,33	0,00	0,00	10.837.667,20	-391.439,13	-3,49%	

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	702.693,81	0,00	0,00	852.639,54	149.945,73	21,34%	21,34%
Total Exterior	702.693,81	0,00	0,00	852.639,54	149.945,73	21,34%	

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 2024 FI RENDA FIXA PRE...	3.101.479,60	2.000.000,00	89.032,13	5.222.227,22	209.779,75	7,66%	5,78%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.953.845,74	0,00	3.000.000,00	3.153.179,03	199.333,29	6,08%	4,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.918.237,83	0,00	2.000.000,00	3.056.740,67	138.502,84	4,27%	2,96%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.512.377,40	59.961,53	100.000,00	2.600.476,19	128.137,26	7,19%	5,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.823.403,18	0,00	0,00	2.931.741,39	108.338,21	5,90%	3,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.016.856,85	0,00	0,00	2.079.650,05	62.793,20	4,53%	3,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.591.193,26	0,00	0,00	2.652.326,26	61.133,00	4,04%	2,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.051.705,54	0,00	59.961,53	2.032.116,51	40.372,50	3,56%	1,97%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	465.216,96	3.152.179,10	3.536.987,46	113.375,71	32.967,11	3,51%	4,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	439.405,68	0,00	0,00	459.112,08	19.706,40	6,24%	4,48%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	257.462,88	0,00	0,00	270.591,05	13.128,17	6,96%	5,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.435.631,18	0,00	0,00	1.418.072,50	-17.558,68	1,32%	-1,22%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.056.716,97	0,00	0,00	2.030.741,61	-25.975,36	1,25%	-1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	2.000.000,00	0,00	1.932.674,48	-67.325,52	0,00%	-5,08%
Total Renda Fixa	30.623.533,07	7.212.140,63	8.785.981,12	29.953.024,75	903.332,17	2,39%	

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 AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	620.610,16	0,00	0,00	721.393,86	100.783,70	19,98%	16,24%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	156.570,45	0,00	0,00	196.570,20	39.999,75	19,71%	25,55%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.359.563,22	0,00	0,00	1.397.299,86	37.736,64	5,29%	2,78%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	815.748,77	0,00	0,00	831.244,66	15.495,89	4,64%	1,90%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.880.975,78	0,00	0,00	1.864.274,90	-16.700,88	1,86%	-0,89%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	564.784,16	0,00	0,00	515.123,37	-49.660,79	0,89%	-8,79%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	746.060,91	0,00	0,00	694.878,61	-51.182,30	2,74%	-6,86%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	425.412,50	0,00	0,00	361.109,92	-64.302,58	-10,14%	-15,12%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.663.704,11	0,00	0,00	1.537.279,41	-126.424,70	-0,27%	-7,60%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.359.288,74	0,00	0,00	1.231.772,17	-127.516,57	-2,60%	-9,38%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.615.100,65	0,00	0,00	1.486.720,24	-128.380,41	1,62%	-7,95%
Total Renda Variável	11.207.819,45	0,00	0,00	10.837.667,20	-370.152,25	-3,30%	

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	611.139,09	0,00	0,00	852.639,54	241.500,45	41,03%	39,52%
Total Exterior	611.139,09	0,00	0,00	852.639,54	241.500,45	39,52%	

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.

