

Relatório Analítico dos Investimentos

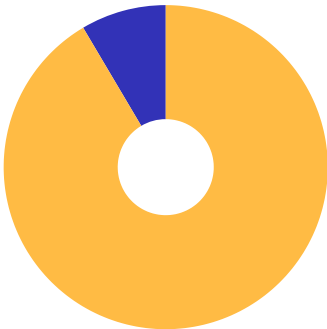
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			6.019.743,63	9,34%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.407.815,88	5,29%	697	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.052.874,14	9,39%	862	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.945.844,64	9,22%	792	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.082.645,77	3,23%	638	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.088.021,56	1,69%	635	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	Não há	5.516.047,75	8,56%	116	1,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	8.600.671,25	13,34%	777	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.766.475,35	7,39%	903	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.545.267,22	5,50%	753	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.174.506,36	3,37%	430	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.088.175,80	1,69%	53	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.196.287,90	3,41%	1.148	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	4.756.211,88	7,38%	208	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.748.432,26	2,71%	447	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.362.010,78	2,11%	19.541	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.589.962,82	4,02%	864	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	618.533,57	0,96%	5.597	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	916.199,02	1,42%	4.917	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			64.475.727,58				

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%	6.019.743,63	9,34%	0,00%	15,64%	40,00%	19.770.547,40
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	44.268.345,72	68,66%	0,00%	15,63%	90,00%	13.759.809,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	8.700.932,04	13,49%	0,00%	15,63%	40,00%	17.089.358,99
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,63%	20,00%	12.895.145,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,24%	5,00%	3.223.786,38
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,24%	5,00%	3.223.786,38
Total Renda Fixa	100,00%	58.989.021,39	91,49%	0,00%	63,01%	200,00%	

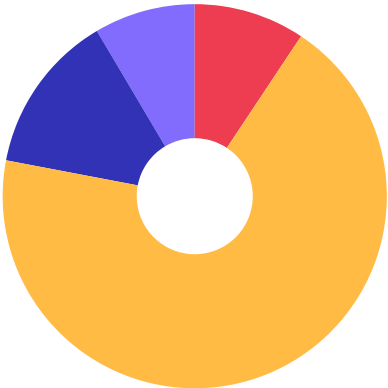


RENDA FIXA 58.989.021,39

RENDA VARIÁVEL 5.486.706,19

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	5.486.706,19	8,51%	0,00%	24,52%	30,00%	13.856.012,08
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	19.342.718,27
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,24%	10,00%	6.447.572,76
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,88%	5,00%	3.223.786,38
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,35%	5,00%	3.223.786,38
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	5.486.706,19	8,51%	0,00%	29,99%	80,00%	



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%	6,00%	10,00%	6.447.572,76
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	6,00%	10,00%	

7º I a 7º I b 7º III a 8º 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 '	6.019.743,63	9,34	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	44.268.345,72	68,66	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	8.700.932,04	13,49	0,00	40,00
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 '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	5.486.706,19	8,51	0,00	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	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
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	27.651.548,42	42,89	-
CAIXA DTVM	23.211.615,59	36,00	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	6.019.743,63	9,34	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	5.844.387,68	9,06	-
SICREDI	1.748.432,26	2,71	-

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%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,58%	4,57%	1,98%	4,57%	11,14%	26,56%	0,36%	0,41%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,37%	3,21%	1,18%	3,21%	8,00%	18,98%	0,81%	1,73%
BB 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%	-	-
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	-1,23%	-1,33%	-1,23%	2,76%	16,42%	1,89%	3,87%
IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	-0,32%	1,40%	-0,23%	1,40%	7,63%	25,27%	1,70%	2,50%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,32%	1,37%	-0,24%	1,37%	7,62%	25,50%	1,71%	2,51%
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%	-	-

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 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%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	5,11%	2,98%	5,11%	10,59%	25,04%	0,18%	0,79%
IPCA (Benchmark)	0,20%	2,47%	1,04%	2,47%	4,22%	7,51%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,17%	2,36%	0,55%	2,36%	7,39%	23,06%	0,88%	1,46%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,20%	-	-	-	-	-	0,97%	-

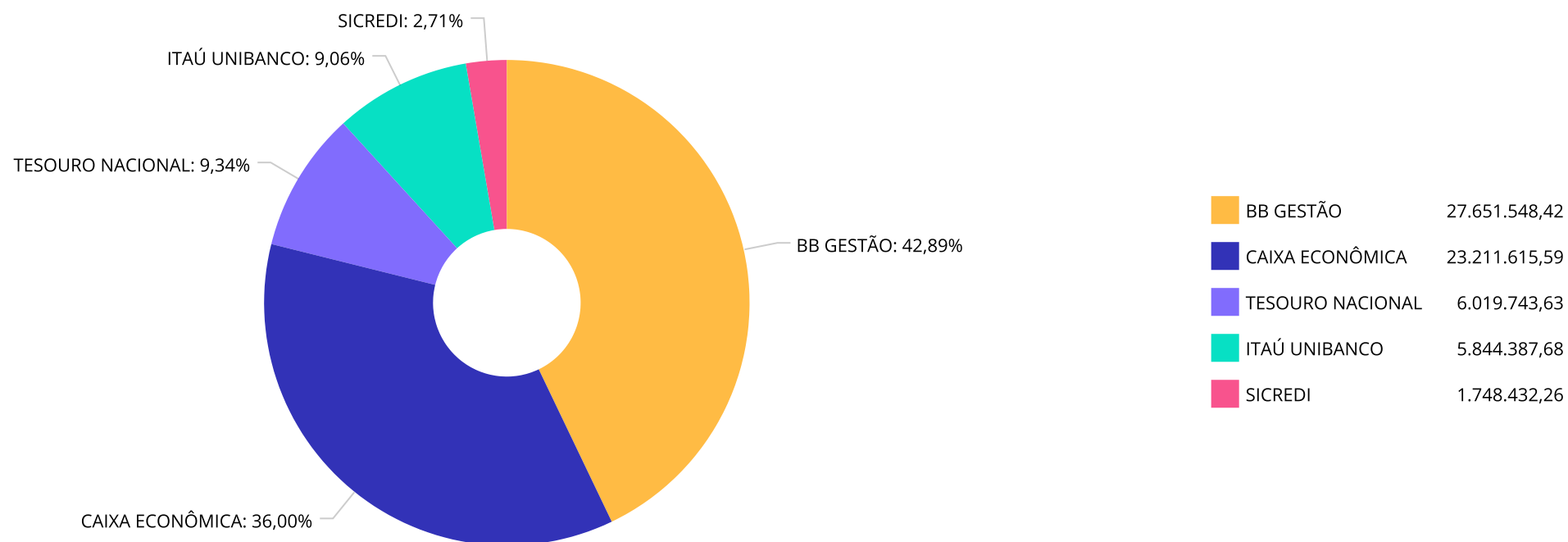
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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 CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	0,91%	-17,47%	-11,56%	-17,47%	-9,88%	29,25%	10,12%	24,80%

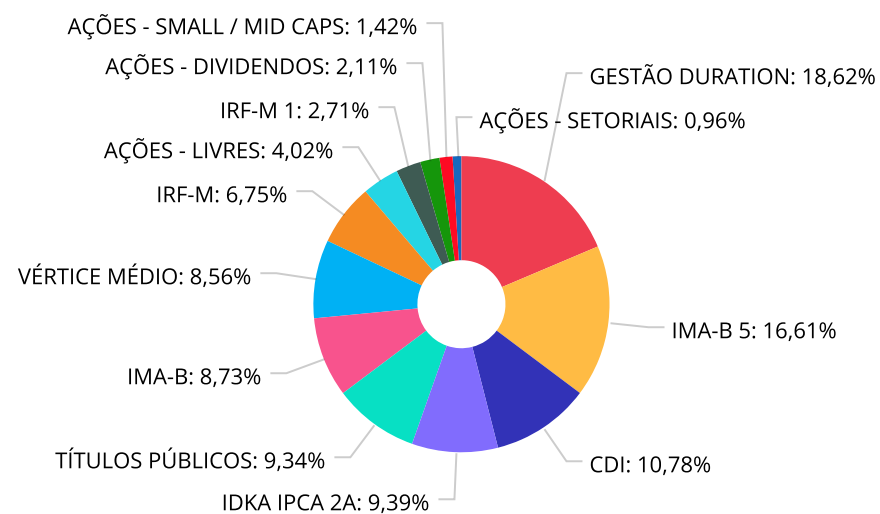
IDIV (Benchmark)	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1,59%	-6,31%	-2,19%	-6,31%	5,99%	21,37%	5,69%	12,81%

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%

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



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



■ GESTÃO DURATION	12.008.487,13	■ IMA-B 5	10.712.319,99	■ CDI	6.952.499,78	■ IDKA IPCA 2A	6.052.874,14
■ TÍTULOS PÚBLICOS	6.019.743,63	■ IMA-B	5.627.912,99	■ VÉRTICE MÉDIO	5.516.047,75	■ IRF-M	4.350.703,72
■ AÇÕES - LIVRES	2.589.962,82	■ IRF-M 1	1.748.432,26	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.362.010,78	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	916.199,02
■ AÇÕES - SETORIAIS	618.533,57						

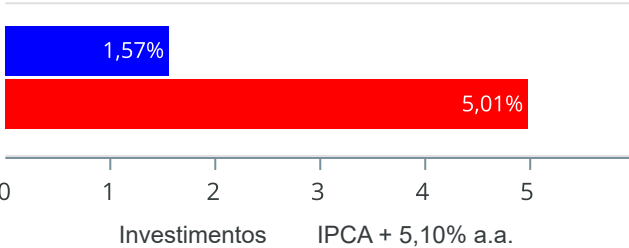
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	14/06/2024	1.423	4.213,651442	4.230,318784	5.996.026,00	6.019.743,62	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	63.237.292,92	657.000,00	838.000,00	63.084.013,77	27.720,85	27.720,85	0,04%	0,04%	0,86%	0,86%	5,11%	1,11%
Fevereiro	63.084.013,77	724.694,84	887.000,00	63.303.057,34	381.348,73	409.069,58	0,60%	0,65%	1,21%	2,08%	31,24%	1,05%
Março	63.303.057,34	1.014.000,00	642.000,00	64.087.994,18	412.936,84	822.006,42	0,65%	1,30%	0,56%	2,64%	49,22%	0,89%
Abril	64.087.994,18	1.032.000,00	900.000,00	63.828.270,63	-391.723,55	430.282,87	-0,61%	0,68%	0,82%	3,48%	19,62%	1,44%
Maiο	63.828.270,63	10.727.192,94	10.838.095,53	64.089.945,73	372.577,69	802.860,56	0,58%	1,27%	0,88%	4,39%	28,95%	1,09%
Junho	64.089.945,73	7.153.026,00	6.954.000,00	64.475.727,58	186.755,85	989.616,41	0,29%	1,57%	0,60%	5,01%	31,22%	1,51%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

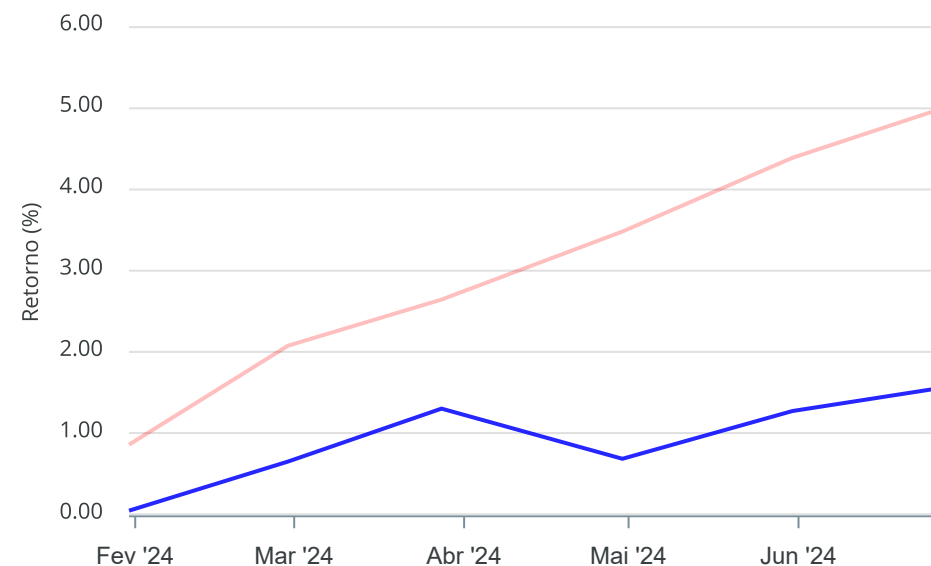
Evolução do Patrimônio



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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	4.713.992,60	0,00	0,00	4.756.211,88	42.219,28	0,90%	0,90%	0,18%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.738.279,38	0,00	0,00	1.748.432,26	10.152,88	0,58%	0,58%	0,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.954.990,66	1.157.000,00	6.954.000,00	2.196.287,90	38.297,24	0,42%	0,79%	0,02%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	5.996.026,00	0,00	6.019.743,63	23.717,63	0,40%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.394.815,71	0,00	0,00	3.407.815,88	13.000,17	0,38%	0,38%	0,47%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.923.698,55	0,00	0,00	5.945.844,64	22.146,09	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.748.792,67	0,00	0,00	4.766.475,35	17.682,68	0,37%	0,37%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.037.426,55	0,00	0,00	6.052.874,14	15.447,59	0,26%	0,26%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	5.504.893,47	0,00	0,00	5.516.047,75	11.154,28	0,20%	0,20%	0,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.586.036,06	0,00	0,00	8.600.671,25	14.635,19	0,17%	0,17%	0,88%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.091.468,31	0,00	0,00	1.088.021,56	-3.446,75	-0,32%	-0,32%	1,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	1.091.624,77	0,00	0,00	1.088.175,80	-3.448,97	-0,32%	-0,32%	1,70%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.181.453,57	0,00	0,00	2.174.506,36	-6.947,21	-0,32%	-0,32%	1,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.103.369,34	0,00	0,00	2.082.645,77	-20.723,57	-0,99%	-0,99%	1,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.580.900,63	0,00	0,00	3.545.267,22	-35.633,41	-1,00%	-1,00%	1,90%
Total Renda Fixa	58.651.742,27	7.153.026,00	6.954.000,00	58.989.021,39	138.253,12	0,23%		0,92%

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 DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.340.640,47	0,00	0,00	1.362.010,78	21.370,31	1,59%	1,59%	5,69%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.564.348,42	0,00	0,00	2.589.962,82	25.614,40	1,00%	1,00%	6,71%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	612.931,77	0,00	0,00	618.533,57	5.601,80	0,91%	0,91%	10,12%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	920.282,80	0,00	0,00	916.199,02	-4.083,78	-0,44%	-0,44%	9,06%
Total Renda Variável	5.438.203,46	0,00	0,00	5.486.706,19	48.502,73	0,89%		7,23%

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.952.984,24	7.416.192,94	13.354.000,00	2.196.287,90	181.110,72	1,18%	2,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	4.618.465,99	0,00	0,00	4.756.211,88	137.745,89	2,98%	2,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.876.664,62	0,00	0,00	5.945.844,64	69.180,02	1,18%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.990.247,11	0,00	0,00	6.052.874,14	62.627,03	1,05%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.710.876,82	0,00	0,00	4.766.475,35	55.598,53	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.553.536,50	0,00	0,00	8.600.671,25	47.134,75	0,55%	0,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.360.923,36	0,00	0,00	3.407.815,88	46.892,52	1,40%	1,40%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.714.569,14	0,00	0,00	1.748.432,26	33.863,12	1,98%	1,98%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	5.996.026,00	0,00	6.019.743,63	23.717,63	0,40%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	5.500.000,00	0,00	5.516.047,75	16.047,75	0,29%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	1.090.645,90	0,00	0,00	1.088.175,80	-2.470,10	-0,23%	-0,23%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.090.615,63	0,00	0,00	1.088.021,56	-2.594,07	-0,24%	-0,24%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.179.813,78	0,00	0,00	2.174.506,36	-5.307,42	-0,24%	-0,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.110.721,45	0,00	0,00	2.082.645,77	-28.075,68	-1,33%	-1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.593.732,25	0,00	0,00	3.545.267,22	-48.465,03	-1,35%	-1,35%
Total Renda Fixa	52.843.796,79	18.912.218,94	13.354.000,00	58.989.021,39	587.005,66	1,01%	

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 ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.709.283,25	0,00	2.715.902,59	0,00	6.619,34	0,24%	0,26%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.633.918,90	0,00	2.622.192,94	0,00	-11.725,96	-0,45%	-0,74%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.392.476,05	0,00	0,00	1.362.010,78	-30.465,27	-2,19%	-2,19%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	699.387,67	0,00	0,00	618.533,57	-80.854,10	-11,56%	-11,56%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.033.269,72	0,00	0,00	916.199,02	-117.070,70	-11,33%	-11,33%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.775.861,80	0,00	0,00	2.589.962,82	-185.898,98	-6,70%	-6,70%
Total Renda Variável	11.244.197,39	0,00	5.338.095,53	5.486.706,19	-419.395,67	-3,73%	

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.718.365,34	9.811.887,78	15.721.000,00	2.196.287,90	387.034,78	4,27%	5,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	4.525.163,83	0,00	0,00	4.756.211,88	231.048,05	5,10%	5,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.402.435,88	0,00	0,00	8.600.671,25	198.235,37	2,36%	2,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.761.408,48	0,00	0,00	5.945.844,64	184.436,16	3,21%	3,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.870.112,94	0,00	0,00	6.052.874,14	182.761,20	3,11%	3,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.618.213,35	0,00	0,00	4.766.475,35	148.262,00	3,21%	3,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.281.885,03	0,00	0,00	3.407.815,88	125.930,85	3,83%	3,84%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.672.064,02	0,00	0,00	1.748.432,26	76.368,24	4,56%	4,57%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.145.176,40	0,00	0,00	2.174.506,36	29.329,96	1,36%	1,37%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	5.996.026,00	0,00	6.019.743,63	23.717,63	0,00%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	5.500.000,00	0,00	5.516.047,75	16.047,75	0,29%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	1.073.195,91	0,00	0,00	1.088.175,80	14.979,89	1,39%	1,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.073.356,64	0,00	0,00	1.088.021,56	14.664,92	1,36%	1,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.108.484,05	0,00	0,00	2.082.645,77	-25.838,28	-1,22%	-1,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.589.165,00	0,00	0,00	3.545.267,22	-43.897,78	-1,23%	-1,22%
Total Renda Fixa	58.651.742,27	7.153.026,00	6.954.000,00	58.989.021,39	138.253,12	0,23%	

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 ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.658.190,78	0,00	2.715.902,59	0,00	57.711,81	2,18%	2,19%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.599.516,80	0,00	2.622.192,94	0,00	22.676,14	0,88%	0,57%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.453.665,16	0,00	0,00	1.362.010,78	-91.654,38	-6,31%	-6,31%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	749.464,24	0,00	0,00	618.533,57	-130.930,67	-17,47%	-17,47%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.079.345,90	0,00	0,00	916.199,02	-163.146,88	-15,12%	-15,12%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.858.083,17	0,00	0,00	2.589.962,82	-268.120,35	-9,39%	-9,38%
Total Renda Variável	10.758.279,16	0,00	5.338.095,53	5.486.706,19	66.522,56	0,62%	

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.

