

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	4.047.429,90	5,02%	697	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.075.555,57	1,33%	862	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.262.089,53	1,57%	792	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.422.208,39	1,76%	638	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	52.799,37	0,07%	1.141	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	608.466,15	0,76%	635	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	5.708.084,40	7,08%	382	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	Não há	1.203.767,76	1,49%	116	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	1.888.742,10	2,34%	219	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	1.091.431,55	1,35%	105	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	6.441.460,12	7,99%	370	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	4.036.953,37	5,01%	225	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	1.478.744,23	1,84%	86	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.682.756,59	4,57%	777	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.785.067,34	3,46%	820	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.729.546,36	2,15%	235	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.943.107,01	4,89%	430	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.451.412,14	3,04%	30	1,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	70.582,60	0,09%	206	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.095.540,71	1,36%	1.007	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

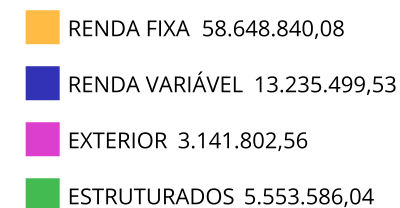
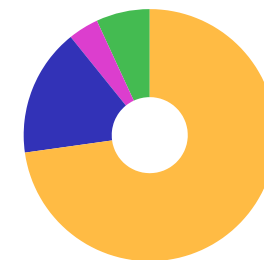
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.121.978,65	5,12%	189	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.189.314,29	6,44%	453	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.498.846,82	1,86%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	293.071,71	0,36%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	65.036,42	0,08%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.256.410,74	1,56%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	Não se ...	Não se aplica	43.997,59	0,05%	20	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	96.865,58	0,12%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	7.573,09	0,01%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.269.275,72	1,58%	2.491	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	742.507,85	0,92%	16.298	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.709.958,38	2,12%	200	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	205.948,80	0,26%	81	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.193.613,07	2,72%	2.110	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	1.593.677,33	1,98%	338	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	D+4	Não há	591.992,52	0,73%	5	2,06%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	D+3	Não há	616.377,98	0,76%	333	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	444.888,43	0,55%	7.487	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.620.528,61	2,01%	10	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	1.167.652,41	1,45%	17	0,17%	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
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	D+31	Não há	865.405,90	1,07%	319	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	545.736,00	0,68%	42	0,13%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	604.280,63	0,75%	19.477	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.254.545,70	1,56%	155	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	737.240,23	0,91%	448	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.991.665,31	2,47%	78	1,88%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.632.180,51	2,03%	4.447	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.119.188,07	1,39%	7.627	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	810.552,15	1,01%	599	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	213.672,53	0,27%		0,00%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			80.579.728,21				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	1,00%	10,00%	8.057.972,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	44.980.204,48	55,82%	20,00%	59,00%	90,00%	27.541.550,91
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	12.263.788,60	15,22%	5,00%	9,50%	60,00%	36.084.048,33
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	8.057.972,82
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.404.847,00	1,74%	0,00%	2,00%	3,00%	1.012.544,85
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	3,00%	2.417.391,85
Total Renda Fixa	100,00%	58.648.840,08	72,78%	25,00%	73,00%	176,00%	



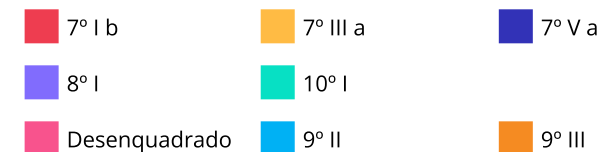
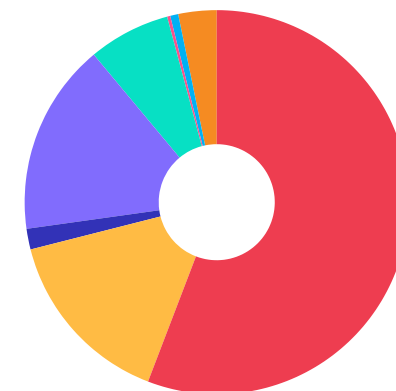
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	13.021.827,00	16,16%	0,00%	18,00%	30,00%	11.152.091,46
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.553.586,04	6,89%	0,00%	7,00%	10,00%	2.504.386,78
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,20%	5,00%	4.028.986,41
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,30%	5,00%	4.028.986,41
Desenquadrado - RV	0,00%	213.672,53	0,27%	0,00%	0,00%	0,00%	-213.672,53
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	18.789.085,57	23,32%	0,00%	25,50%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	545.736,00	0,68%	0,00%	0,50%	1,00%	260.061,28
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.596.066,56	3,22%	0,00%	1,00%	10,00%	5.461.906,26
Total Exterior	10,00%	3.141.802,56	3,90%	0,00%	1,50%	11,00%	



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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	44.980.204,48	55,82	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	12.263.788,60	15,22	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.404.847,00	1,74	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	13.021.827,00	16,16	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	545.736,00	0,68	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso III	2.596.066,56	3,22	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.553.586,04	6,89	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	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.427.565,41	45,21	-
CAIXA DTVM	28.250.005,18	35,06	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.777.435,32	4,69	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.859.696,23	3,55	-
TRÍGONO CAPITAL	2.788.181,02	3,46	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.193.613,07	2,72	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	1.593.677,33	1,98	-
ITAÚ UNIBANCO	1.208.370,50	1,50	-
VOKIN INVESTIMENTOS	865.405,90	1,07	-
RJI CORRETORA DE VALORES	293.071,71	0,36	-
CADENCE GESTORA	213.672,53	0,27	-
PLURAL	109.034,01	0,14	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,60%	4,97%	2,29%	5,01%	9,44%	18,54%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,02%	-0,87%	-2,58%	-0,87%	0,28%	-	1,37%	4,57%
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,75%	5,95%	2,78%	6,01%	11,52%	23,10%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,24%	-4,42%	-0,56%	-4,42%	-4,82%	-15,37%	0,07%	3,50%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,47%	-2,76%	-1,33%	-2,76%	-5,04%	-5,40%	0,09%	15,24%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,72%	0,22%	-1,14%	0,22%	6,61%	26,65%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,75%	0,08%	-1,20%	0,08%	6,33%	25,74%	2,38%	3,51%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,12%	-75,52%	-50,88%	-75,52%	-80,22%	-84,28%	0,06%	65,86%
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%

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
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,31%	-7,86%	-5,04%	-7,86%	-27,20%	-24,17%	0,01%	23,12%
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%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,34%	0,06%	-0,46%	0,06%	1,98%	7,78%	0,78%	1,00%
IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
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%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,06%
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 INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,82%	5,47%	2,54%	5,47%	12,24%	26,97%	0,03%	0,13%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-1,42%	-5,91%	-2,86%	-5,91%	-9,44%	-23,09%	-	-
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%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20%	1,91%	0,31%	1,91%	7,05%	20,92%	1,64%	2,72%
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 FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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 VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,30%	0,57%	-0,45%	0,57%	4,43%	-	1,57%	3,14%
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 XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,73%	2,86%	5,73%	11,35%	20,70%	0,48%	0,87%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,20%	-	-	-	-	-	0,97%	-

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,51%	-0,68%	0,75%	-0,68%	-7,59%	-6,82%	0,08%	4,95%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1,16%	2,70%	2,87%	2,70%	5,05%	-	0,48%	4,14%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	2,71%	2,88%	2,71%	5,17%	-	0,48%	4,11%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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 ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,21%	2,19%	0,26%	2,19%	7,75%	21,19%	1,27%	1,77%
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%	-	-
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	1,55%	-7,65%	-3,24%	-7,65%	5,17%	26,59%	5,86%	13,71%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,11%	-6,86%	-7,64%	-6,86%	4,76%	26,67%	8,59%	15,61%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	1,07%	-13,52%	-15,13%	-13,52%	-4,78%	-	11,26%	17,64%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,27%	-10,96%	-5,62%	-10,96%	-6,16%	22,36%	6,58%	16,05%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,92%	-12,41%	-6,66%	-12,41%	-8,09%	11,18%	6,48%	16,52%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,37%	-6,68%	-5,52%	-6,68%	4,80%	29,31%	6,88%	14,31%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,26%	-9,75%	-8,25%	-9,75%	-3,50%	12,92%	6,60%	13,84%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	1,44%	-7,24%	-3,26%	-7,24%	5,36%	24,80%	6,04%	13,88%
IBX-50 (Benchmark)	1,63%	-6,12%	-2,15%	-6,12%	7,39%	26,37%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1,58%	-7,39%	-3,39%	-7,39%	3,54%	20,07%	5,61%	13,59%

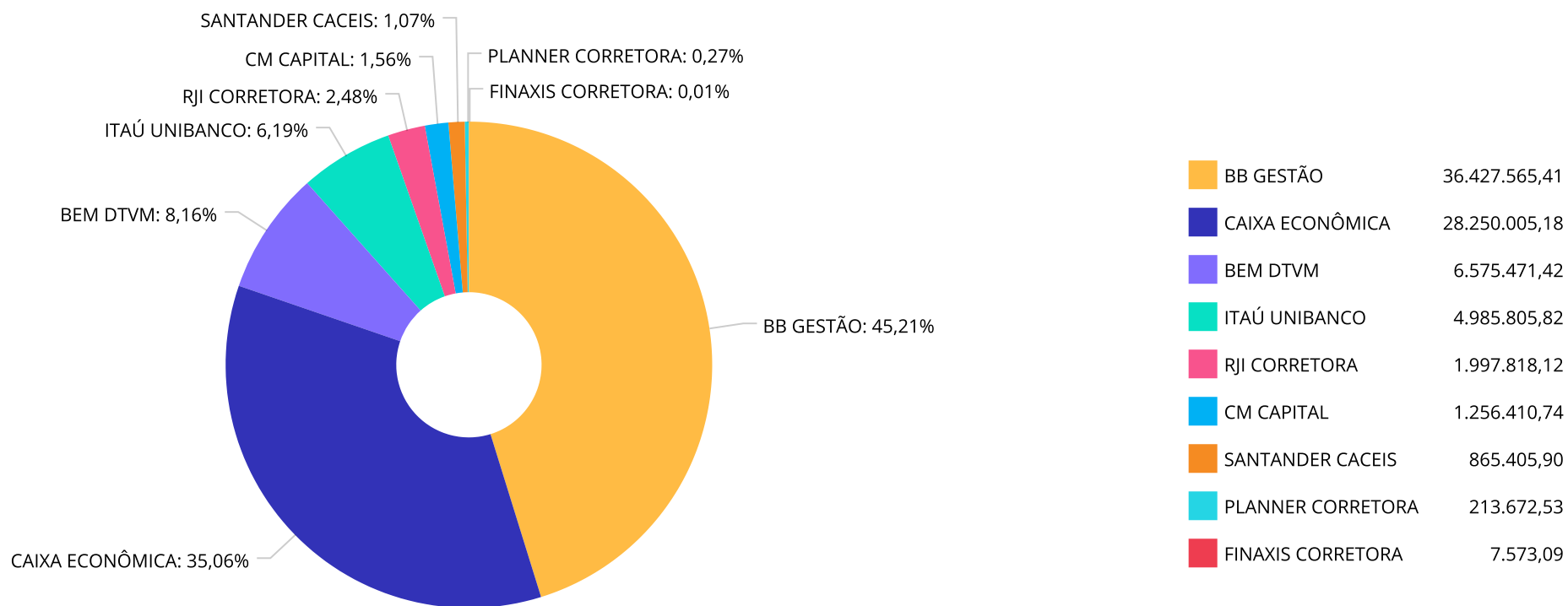
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IFIX (Benchmark)	-1,04%	1,08%	-1,78%	1,08%	6,09%	19,73%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-	-	-	-	-	-	-	-
MSCI ACWI (Benchmark)	8,28%	26,67%	13,94%	26,67%	35,48%	42,62%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,90%	16,70%	5,01%	16,70%	29,37%	66,02%	2,97%	11,08%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,47%	14,48%	3,92%	14,48%	22,70%	44,25%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3,96%	16,75%	5,07%	16,75%	29,39%	66,04%	2,95%	11,07%
SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	0,09%	-12,64%	-9,61%	-12,64%	-9,60%	6,31%	8,13%	18,15%

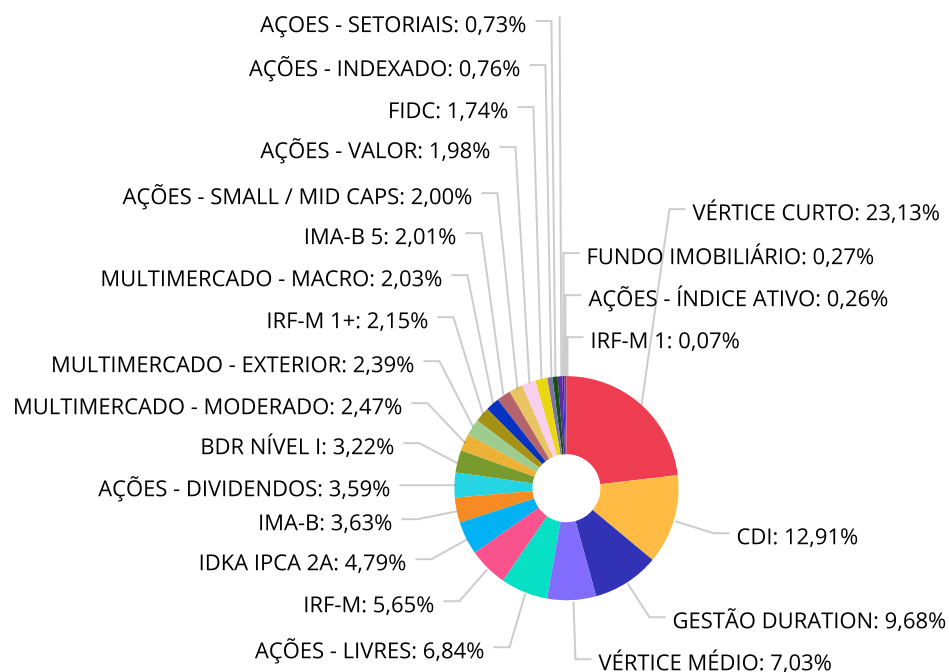
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,77%	30,18%	14,26%	30,18%	42,38%	57,22%	6,32%	13,607%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,73%	39,52%	21,34%	39,52%	52,18%	72,57%	8,26%	13,945%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,19%	11,40%	2,93%	11,40%	18,06%	37,05%	3,35%	13,467%
MSCI WORLD (Benchmark)	8,10%	27,24%	13,69%	27,24%	36,54%	46,37%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	6,01%	22,20%	10,70%	22,20%	26,37%	31,91%	6,58%	13,464%

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



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

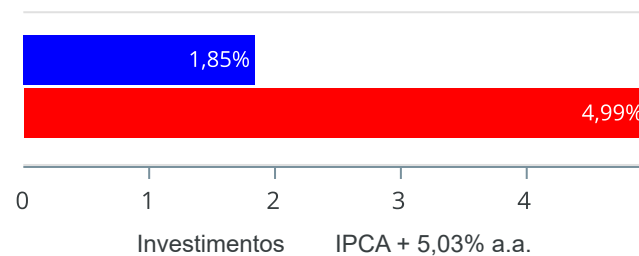


■ VÉRTICE CURTO	18.637.910,03	■ CDI	10.406.833,65	■ GESTÃO DURATION	7.800.769,09	■ VÉRTICE MÉDIO	5.662.685,64
■ AÇÕES - LIVRES	5.511.485,20	■ IRF-M	4.551.573,16	■ IDKA IPCA 2A	3.860.622,91	■ IMA-B	2.921.055,21
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.889.804,33	■ BDR NÍVEL I	2.596.066,56	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.991.665,31	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.929.740,22
■ IRF-M 1+	1.729.546,36	■ MULTIMERCADO - MACRO	1.632.180,51	■ IMA-B 5	1.620.197,66	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.612.540,84
■ AÇÕES - VALOR	1.593.677,33	■ FIDC	1.404.847,00	■ AÇÕES - INDEXADO	616.377,98	■ AÇÕES - SETORIAIS	591.992,52
■ AÇÕES - EXTERIOR	545.736,00	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	213.672,53	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	205.948,80	■ IRF-M 1	52.799,37

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

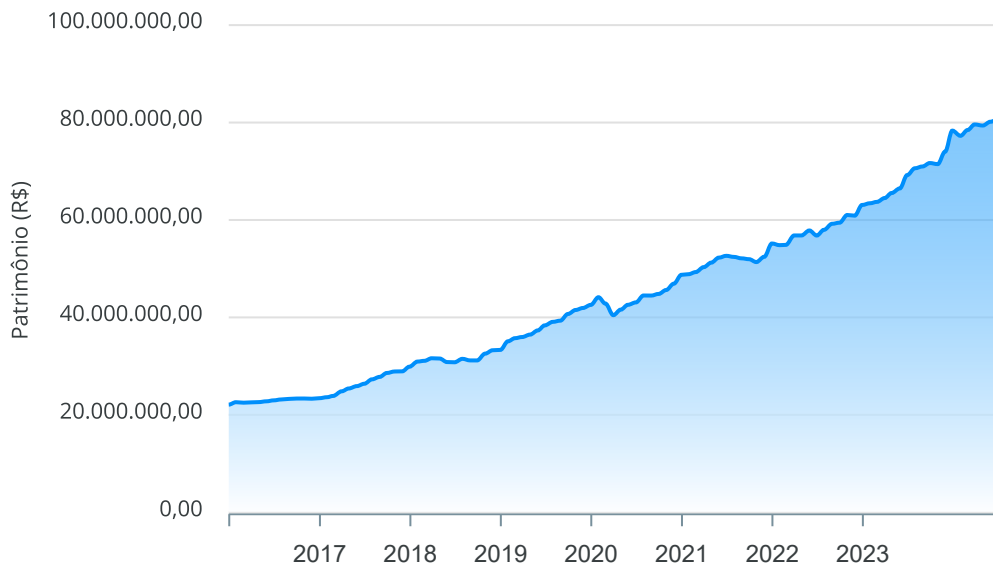
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	78.339.301,28	174.577,22	966.684,11	77.277.707,78	-269.486,61	-269.486,61	-0,34%	-0,34%	0,85%	0,85%	-40,42%	2,03%
Fevereiro	77.277.707,78	2.216.264,40	1.766.285,57	78.471.595,28	743.908,67	474.422,06	0,96%	0,61%	1,20%	2,07%	29,53%	2,29%
Março	78.471.595,28	10.143.739,99	9.632.986,14	79.605.791,84	623.442,71	1.097.864,77	0,79%	1,40%	0,55%	2,63%	53,43%	1,72%
Abril	79.605.791,84	3.787.128,65	3.313.627,20	79.389.618,63	-689.674,66	408.190,11	-0,86%	0,53%	0,81%	3,46%	15,34%	2,26%
Mai	79.389.618,63	2.616.020,71	2.136.767,61	80.170.816,84	301.945,11	710.135,22	0,38%	0,91%	0,87%	4,36%	20,88%	1,85%
Junho	80.170.816,84	1.702.077,74	2.039.941,87	80.579.728,21	746.775,50	1.456.910,72	0,93%	1,85%	0,60%	4,99%	37,10%	2,07%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



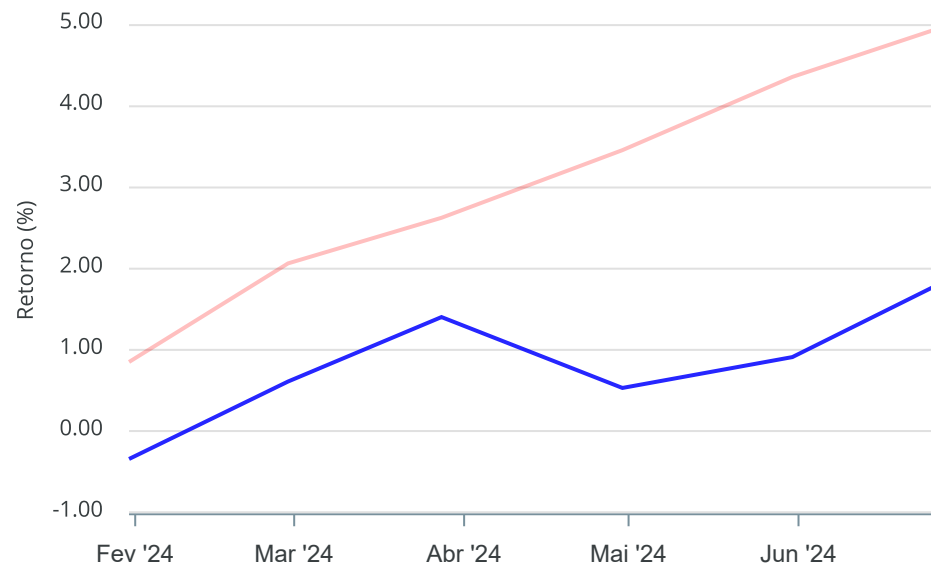
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	5.642.220,14	0,00	0,00	5.708.084,40	65.864,26	1,17%	1,17%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.990.414,78	0,00	0,00	4.036.953,37	46.538,59	1,17%	1,17%	0,48%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	2.423.254,97	0,00	0,00	2.451.412,14	28.157,17	1,16%	1,16%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.367.594,54	0,00	0,00	6.441.460,12	73.865,58	1,16%	1,16%	0,48%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	4.286.875,34	0,00	200.000,00	4.121.978,65	35.103,31	0,82%	0,82%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.148.391,42	0,00	0,00	5.189.314,29	40.922,87	0,79%	0,79%	0,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	52.481,62	0,00	0,00	52.799,37	317,75	0,61%	0,61%	0,24%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.416.427,96	1.502.077,74	1.839.941,87	1.095.540,71	16.976,88	0,58%	0,71%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.031.989,73	0,00	0,00	4.047.429,90	15.440,17	0,38%	0,38%	0,47%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.257.388,71	0,00	0,00	1.262.089,53	4.700,82	0,37%	0,37%	0,81%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	292.178,24	0,00	0,00	293.071,71	893,47	0,31%	0,31%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.072.810,63	0,00	0,00	1.075.555,57	2.744,94	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.779.642,62	0,00	0,00	2.785.067,34	5.424,72	0,20%	0,20%	0,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.676.489,90	0,00	0,00	3.682.756,59	6.266,69	0,17%	0,17%	0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	1.001.737,99	200.000,00	0,00	1.203.767,76	2.029,77	0,17%	0,20%	0,97%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.478.981,72	0,00	0,00	1.478.744,23	-237,49	-0,02%	-0,02%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.889.131,17	0,00	0,00	1.888.742,10	-389,07	-0,02%	-0,02%	1,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	70.724,67	0,00	0,00	70.582,60	-142,07	-0,20%	-0,20%	1,64%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.259.409,17	0,00	0,00	1.256.410,74	-2.998,43	-0,24%	-0,24%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.094.733,18	0,00	0,00	1.091.431,55	-3.301,63	-0,30%	-0,30%	1,57%

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	610.393,72	0,00	0,00	608.466,15	-1.927,57	-0,32%	-0,32%	1,71%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.955.704,64	0,00	0,00	3.943.107,01	-12.597,63	-0,32%	-0,32%	1,71%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.503.943,35	0,00	0,00	1.498.846,82	-5.096,53	-0,34%	-0,34%	0,78%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	97.319,41	0,00	0,00	96.865,58	-453,83	-0,47%	-0,47%	0,09%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	7.611,81	0,00	0,00	7.573,09	-38,72	-0,51%	-0,51%	0,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.742.552,00	0,00	0,00	1.729.546,36	-13.005,64	-0,75%	-0,75%	2,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.436.360,22	0,00	0,00	1.422.208,39	-14.151,83	-0,99%	-0,99%	1,89%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	65.772,01	0,00	0,00	65.036,42	-735,59	-1,12%	-1,12%	0,06%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	44.631,44	0,00	0,00	43.997,59	-633,85	-1,42%	-	-
Total Renda Fixa	58.697.167,10	1.702.077,74	2.039.941,87	58.648.840,08	289.537,11	0,49%		0,73%

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	779.651,29	0,00	0,00	810.552,15	30.900,86	3,96%	3,96%	2,95%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.077.173,68	0,00	0,00	1.119.188,07	42.014,39	3,90%	3,90%	2,97%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.584.530,14	0,00	0,00	1.620.528,61	35.998,47	2,27%	2,27%	6,58%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.145.643,03	0,00	0,00	1.167.652,41	22.009,38	1,92%	1,92%	6,48%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	728.693,12	0,00	0,00	742.507,85	13.814,73	1,90%	1,90%	5,03%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	202.755,05	0,00	0,00	205.948,80	3.193,75	1,58%	1,58%	5,61%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	606.961,09	0,00	0,00	616.377,98	9.416,89	1,55%	1,55%	5,86%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	583.575,33	0,00	0,00	591.992,52	8.417,19	1,44%	1,44%	6,04%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.572.223,58	0,00	0,00	1.593.677,33	21.453,75	1,36%	1,36%	6,88%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.255.544,30	0,00	0,00	1.269.275,72	13.731,42	1,09%	1,09%	6,91%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	856.212,99	0,00	0,00	865.405,90	9.192,91	1,07%	1,07%	11,26%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.187.922,24	0,00	0,00	2.193.613,07	5.690,83	0,26%	0,26%	6,60%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.987.532,16	0,00	0,00	1.991.665,31	4.133,15	0,21%	0,21%	1,27%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	444.479,09	0,00	0,00	444.888,43	409,34	0,09%	0,09%	8,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.632.128,85	0,00	0,00	1.632.180,51	51,66	0,00%	0,00%	1,85%
OSASCO PROPERTIES FII	213.797,80	0,00	0,00	213.672,53	-125,27	-0,06%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.711.835,18	0,00	0,00	1.709.958,38	-1.876,80	-0,11%	-0,11%	8,59%
Total Renda Variável	18.570.658,92	0,00	0,00	18.789.085,57	218.426,65	1,18%		5,59%

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	653.973,41	0,00	0,00	737.240,23	83.266,82	12,73%	12,73%	8,26%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.142.875,04	0,00	0,00	1.254.545,70	111.670,66	9,77%	9,77%	6,32%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	514.784,30	0,00	0,00	545.736,00	30.951,70	6,01%	6,01%	6,58%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	591.358,07	0,00	0,00	604.280,63	12.922,56	2,19%	2,19%	3,35%
Total Exterior	2.902.990,82	0,00	0,00	3.141.802,56	238.811,74	8,23%		6,25%

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...	6.262.217,65	0,00	0,00	6.441.460,12	179.242,47	2,86%	2,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	4.392.090,38	1.160.000,00	0,00	5.708.084,40	155.994,02	2,81%	2,88%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.064.269,51	0,00	0,00	5.189.314,29	125.044,78	2,47%	2,47%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.923.810,54	0,00	0,00	4.036.953,37	113.142,83	2,88%	2,88%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	4.214.932,27	0,00	200.000,00	4.121.978,65	107.046,38	2,54%	2,54%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	2.383.071,00	0,00	0,00	2.451.412,14	68.341,14	2,87%	2,87%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.549.280,75	4.303.767,26	5.815.758,44	1.095.540,71	58.251,14	0,85%	2,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.991.736,11	0,00	0,00	4.047.429,90	55.693,79	1,40%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.761.395,21	0,00	0,00	2.785.067,34	23.672,13	0,86%	0,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.662.573,78	0,00	0,00	3.682.756,59	20.182,81	0,55%	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.247.405,10	0,00	0,00	1.262.089,53	14.684,43	1,18%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.064.427,16	0,00	0,00	1.075.555,57	11.128,41	1,05%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.837.650,81	100.000,00	52.782,28	1.888.742,10	3.873,57	0,20%	0,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	1.200.000,00	0,00	1.203.767,76	3.767,76	0,31%	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.475.402,59	41.459,84	41.459,84	1.478.744,23	3.341,64	0,22%	-2,58%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	308.625,52	0,00	17.860,42	293.071,71	2.306,61	0,75%	-5,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	51.801,95	0,00	0,00	52.799,37	997,42	1,93%	1,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	70.364,06	0,00	0,00	70.582,60	218,54	0,31%	0,31%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	7.516,90	0,00	0,00	7.573,09	56,19	0,75%	0,75%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	45.292,73	0,00	0,00	43.997,59	-1.295,14	-2,86%	-2,86%

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
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	98.172,71	0,00	0,00	96.865,58	-1.307,13	-1,33%	-1,33%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	609.916,86	0,00	0,00	608.466,15	-1.450,71	-0,24%	-0,24%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	132.391,23	0,00	62.475,70	65.036,42	-4.879,11	-3,69%	-50,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.096.392,82	0,00	0,00	1.091.431,55	-4.961,27	-0,45%	-0,45%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.505.761,20	0,00	0,00	1.498.846,82	-6.914,38	-0,46%	-0,46%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.263.424,52	0,00	0,00	1.256.410,74	-7.013,78	-0,56%	-0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.952.731,15	0,00	0,00	3.943.107,01	-9.624,14	-0,24%	-0,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.441.380,87	0,00	0,00	1.422.208,39	-19.172,48	-1,33%	-1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.750.553,67	0,00	0,00	1.729.546,36	-21.007,31	-1,20%	-1,20%
Total Renda Fixa	57.164.589,05	6.805.227,10	6.190.336,68	58.648.840,08	869.360,61	1,50%	

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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.065.765,97	0,00	0,00	1.119.188,07	53.422,10	5,01%	5,01%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	771.447,67	0,00	0,00	810.552,15	39.104,48	5,07%	5,07%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.986.456,70	0,00	0,00	1.991.665,31	5.208,61	0,26%	0,26%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.630.101,36	0,00	0,00	1.632.180,51	2.079,15	0,13%	0,13%
OSASCO PROPERTIES FII	214.063,14	0,00	0,00	213.672,53	-390,61	-0,18%	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	213.175,88	0,00	0,00	205.948,80	-7.227,08	-3,39%	-3,39%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	611.960,68	0,00	0,00	591.992,52	-19.968,16	-3,26%	-3,26%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	636.986,12	0,00	0,00	616.377,98	-20.608,14	-3,24%	-3,24%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	1.300.000,00	0,00	1.269.275,72	-30.724,28	-2,36%	-7,70%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	492.184,47	0,00	0,00	444.888,43	-47.296,04	-9,61%	-9,61%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.116.676,81	0,00	1.300.000,00	742.507,85	-74.168,96	-3,50%	-3,95%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	1.250.943,67	0,00	0,00	1.167.652,41	-83.291,26	-6,66%	-6,66%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.686.736,80	0,00	0,00	1.593.677,33	-93.059,47	-5,52%	-5,52%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.716.956,40	0,00	0,00	1.620.528,61	-96.427,79	-5,62%	-5,62%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.851.471,47	0,00	0,00	1.709.958,38	-141.513,09	-7,64%	-7,64%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	1.019.665,91	0,00	0,00	865.405,90	-154.260,01	-15,13%	-15,13%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.390.966,73	0,00	0,00	2.193.613,07	-197.353,66	-8,25%	-8,25%
Total Renda Variável	19.655.559,78	1.300.000,00	1.300.000,00	18.789.085,57	-866.474,21	-4,13%	

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
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.097.986,08	0,00	0,00	1.254.545,70	156.559,62	14,26%	14,26%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	607.588,69	0,00	0,00	737.240,23	129.651,54	21,34%	21,34%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	492.972,67	0,00	0,00	545.736,00	52.763,33	10,70%	10,70%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	587.095,57	0,00	0,00	604.280,63	17.185,06	2,93%	2,93%
Total Exterior	2.785.643,01	0,00	0,00	3.141.802,56	356.159,55	12,79%	

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...	6.266.695,25	0,00	176.797,71	6.441.460,12	351.562,58	5,73%	5,73%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.817.344,26	115.537,01	0,00	5.189.314,29	256.433,02	5,23%	5,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.891.730,66	2.660.000,00	83.011,01	5.708.084,40	239.364,75	5,43%	5,78%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.930.399,60	0,00	115.537,01	4.036.953,37	222.090,78	5,76%	2,71%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.636.821,91	1.500.000,00	200.000,00	4.121.978,65	185.156,74	5,19%	5,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.149.808,93	10.034.113,35	14.272.457,20	1.095.540,71	184.075,63	3,72%	4,71%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	2.387.080,72	0,00	69.756,01	2.451.412,14	134.087,43	5,73%	2,69%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.329.514,53	2.618.942,50	0,00	4.047.429,90	98.972,87	3,50%	3,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.597.873,38	0,00	0,00	3.682.756,59	84.883,21	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.705.121,65	0,00	0,00	2.785.067,34	79.945,69	2,97%	2,96%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.889.921,99	0,00	0,00	3.943.107,01	53.185,02	1,36%	1,37%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.222.940,35	0,00	0,00	1.262.089,53	39.149,18	3,21%	3,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.806.052,79	100.000,00	52.782,28	1.888.742,10	35.471,59	1,91%	1,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.043.080,11	0,00	0,00	1.075.555,57	32.475,46	3,11%	3,11%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.449.891,06	41.459,84	41.459,84	1.478.744,23	28.853,17	1,96%	-0,87%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.050.723,00	0,00	1.062.960,03	0,00	12.237,03	1,16%	-0,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	600.264,93	0,00	0,00	608.466,15	8.201,22	1,36%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.116.169,74	0,00	31.078,27	1.091.431,55	6.340,08	0,56%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	1.200.000,00	0,00	1.203.767,76	3.767,76	0,34%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	50.573,92	0,00	0,00	52.799,37	2.225,45	4,39%	4,40%

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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.728.087,09	0,00	0,00	1.729.546,36	1.459,27	0,08%	0,08%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.497.887,75	0,00	0,00	1.498.846,82	959,07	0,06%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	69.756,01	0,00	70.582,60	826,59	1,19%	1,91%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	7.625,20	0,00	0,00	7.573,09	-52,11	-0,70%	-0,68%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	99.618,32	0,00	0,00	96.865,58	-2.752,74	-2,77%	-2,76%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	46.762,77	0,00	0,00	43.997,59	-2.765,18	-5,91%	-5,91%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	318.075,55	0,00	17.860,42	293.071,71	-7.143,42	-2,20%	-7,86%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.018.172,29	0,00	1.006.416,31	0,00	-11.755,98	-1,15%	-5,21%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.314.566,67	0,00	42.061,51	1.256.410,74	-16.094,42	-1,25%	-4,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.439.852,98	0,00	0,00	1.422.208,39	-17.644,59	-1,22%	-1,23%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	265.630,51	0,00	62.475,70	65.036,42	-138.118,39	-52,58%	-75,52%
Total Renda Fixa	60.764.727,28	1.702.077,74	4.109.318,21	58.648.840,08	291.353,27	0,47%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	959.047,02	0,00	0,00	1.119.188,07	160.141,05	16,71%	16,70%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	694.262,31	0,00	0,00	810.552,15	116.289,84	16,74%	16,75%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.948.995,51	0,00	0,00	1.991.665,31	42.669,80	2,20%	2,19%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.601.753,74	0,00	0,00	1.632.180,51	30.426,77	1,90%	1,90%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.309.516,59	0,00	1.321.639,20	0,00	12.122,61	0,93%	0,57%
OSASCO PROPERTIES FII	214.446,14	0,00	0,00	213.672,53	-773,61	-0,36%	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	222.376,44	0,00	0,00	205.948,80	-16.427,64	-7,39%	-7,39%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	1.300.000,00	0,00	1.269.275,72	-30.724,28	-2,36%	-5,85%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	638.205,42	0,00	0,00	591.992,52	-46.212,90	-7,25%	-7,24%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	667.435,35	0,00	0,00	616.377,98	-51.057,37	-7,64%	-7,65%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	509.280,08	0,00	0,00	444.888,43	-64.391,65	-12,65%	-12,64%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.707.823,76	0,00	0,00	1.593.677,33	-114.146,43	-6,69%	-6,68%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.835.907,87	0,00	0,00	1.709.958,38	-125.949,49	-6,86%	-6,86%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	865.405,90	-134.594,10	-13,46%	-13,52%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	1.333.105,97	0,00	0,00	1.167.652,41	-165.453,56	-12,41%	-12,41%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.820.005,39	0,00	0,00	1.620.528,61	-199.476,78	-10,96%	-10,96%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.430.567,36	0,00	0,00	2.193.613,07	-236.954,29	-9,74%	-9,75%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.287.110,09	0,00	1.300.000,00	742.507,85	-244.602,24	-11,29%	-11,11%
Total Renda Variável	19.886.932,80	0,00	1.321.639,20	18.789.085,57	223.791,97	1,13%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	963.720,41	0,00	0,00	1.254.545,70	290.825,29	30,18%	30,18%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	528.425,32	0,00	0,00	737.240,23	208.814,91	39,52%	39,52%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	446.587,77	0,00	0,00	545.736,00	99.148,23	22,20%	22,20%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	542.440,83	0,00	0,00	604.280,63	61.839,80	11,41%	11,40%
Total Exterior	2.902.990,82	0,00	0,00	3.141.802,56	238.811,74	8,23%	

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.

