

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

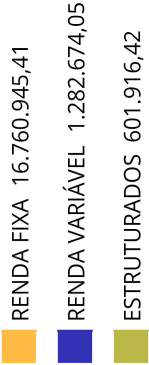
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	363.267,76	1,95%	862	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.281.575,44	12,24%	792	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	839.090,70	4,50%	638	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.074.259,62	5,76%	1.141	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	637.369,99	3,42%	635	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	D+0	Não há	1.390.130,77	7,46%	109.004	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	3.711.011,97	19,90%	370	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	130.841,27	0,70%	248	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.095.168,13	5,87%	903	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.674.214,80	19,71%	1.155	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	102.367,55	0,55%	430	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.884,57	0,21%	738	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	391.084,25	2,10%	1.148	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.030.678,59	5,53%	453	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	294.684,02	1,58%	16.298	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	43.188,99	0,23%	8.478	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	84.688,59	0,45%	5.672	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	190.470,94	1,02%	2.254	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	241.199,93	1,29%	16.155	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	90.319,75	0,48%	4.917	0,01%	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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF FIAÇÕES	D+3 du	Não há	75.671,87	0,41%	3.640	0,08%	Artigo 8º, Inciso II
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	D+4	Não há	262.449,96	1,41%	46	0,37%	Artigo 8º, Inciso II
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	94.648,95	0,51%	7.627	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	507.267,47	2,72%	2.281	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			18.645.535,88				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			155.634,02				Artigo 6º
PL Total			18.801.169,90				

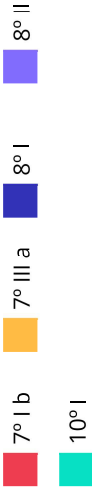
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	15.339.182,57	82,27%	0,00%	45,00%	0,00%	-15.339.182,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	1.421.762,84	7,63%	0,00%	20,00%	0,00%	-1.421.762,84
Total Renda Fixa	100,00%	16.760.945,41	89,89%	0,00%	80,00%	0,00%	



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%	944.552,22	5,07%	0,00%	5,00%	0,00%	-944.552,22
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	338.121,83	1,81%	0,00%	7,00%	0,00%	-338.121,83
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	601.916,42	3,23%	0,00%	2,00%	0,00%	-601.916,42
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	0,00%	0,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	1.884.590,47	10,11%	0,00%	15,00%	0,00%	



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%	5,00%	0,00%	0,00

Página 5 de 22

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.101.335,38	59,54	-
CAIXA DTVM	7.544.200,50	40,46	0,04

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)								
	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
	0,26%	3,11%	1,05%	3,11%	8,11%	18,30%	0,92%	1,71%
IRF-M 1 (Benchmark)								
	0,63%	4,51%	2,00%	4,51%	10,95%	26,28%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
	0,61%	4,40%	1,93%	4,40%	10,67%	25,58%	0,24%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA								
	0,61%	4,49%	1,97%	4,49%	10,79%	25,84%	0,25%	0,35%
IMA-B 5 (Benchmark)								
	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%	-	-
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%	-	-
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%	-	-
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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP								
	0,79%	5,24%	2,53%	5,24%	11,71%	26,83%	0,02%	0,07%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TESOIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,77%	5,09%	2,46%	5,09%	11,39%	26,20%	0,00%	0,06%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,77%	5,10%	2,47%	5,10%	11,44%	26,23%	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	5,00%	2,39%	5,00%	11,34%	26,39%	0,05%	0,11%
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%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,73%	2,86%	5,73%	11,35%	20,70%	0,48%	0,87%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,66%	4,26%	1,89%	4,26%	10,08%	24,99%	0,23%	0,40%

Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
CAIXA CONSUMO FIC AÇÕES	0,60%	-14,56%	-7,69%	-14,56%	-16,02%	-11,04%	9,56%	20,67%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIC AÇÕES	1,44%	-7,49%	-3,20%	-7,49%	4,86%	25,30%	5,71%	13,36%
CAIXA PETROBRAS FIC AÇÕES	1,86%	13,36%	15,88%	13,36%	40,12%	129,43%	11,44%	29,04%

IBX-50 (Benchmark)	1,63%	-6,12%	-2,15%	-6,12%	7,39%	26,37%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF FIC AÇÕES	0,75%	-8,38%	-2,94%	-8,38%	1,56%	21,07%	4,81%	14,03%

IDIV (Benchmark)	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1,90%	-3,86%	0,13%	-3,86%	10,80%	28,70%	5,25%	11,91%

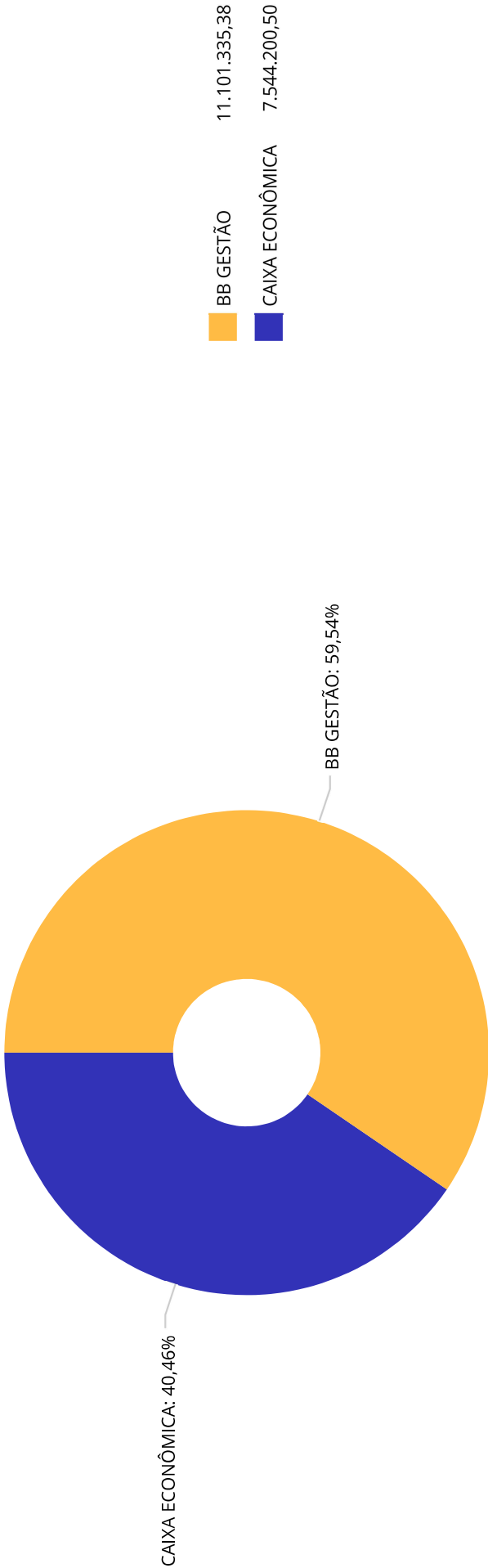
MSCI ACWI (Benchmark)	8,28%	26,67%	13,94%	26,67%	35,48%	42,62%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,90%	16,70%	5,01%	16,70%	29,37%	66,02%	2,97%	11,08%

SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIC AÇÕES	-0,44%	-15,12%	-11,33%	-15,12%	-12,55%	3,94%	9,06%	19,37%

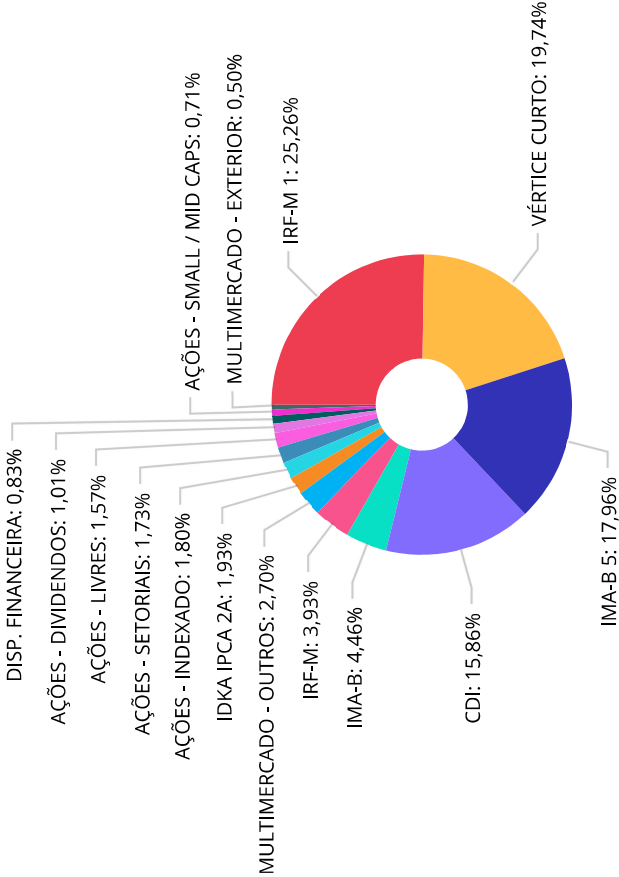
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-3,41%	-19,71%	-16,08%	-19,71%	-17,97%	-1,96%	12,11%	21,45%

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



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

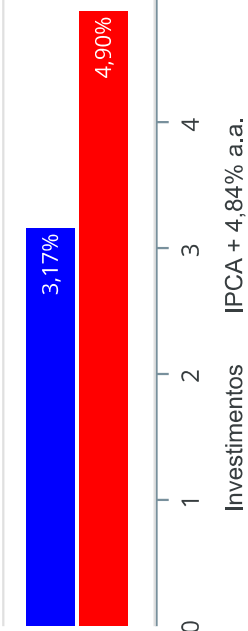


IRF-M 1	4.748.474,42	VÉRTICE CURTO	3.711.011,97	IMA-B 5	3.376.743,57	CDI	2.982.619,45
IMA-B	839.090,70	IRF-M	739.737,54	MULTIMERCADO - OUTROS	507.267,47	IDKA IPCA 2A	363.267,76
AÇÕES - INDEXADO	338.121,83	AÇÕES - SETORIAIS	325.888,52	AÇÕES - LIVRES	294.684,02	AÇÕES - DIVIDENDOS	190.470,94
DISP. FINANCEIRA	155.634,02	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	133.508,74	MULTIMERCADO - EXTERIOR	94.648,95		

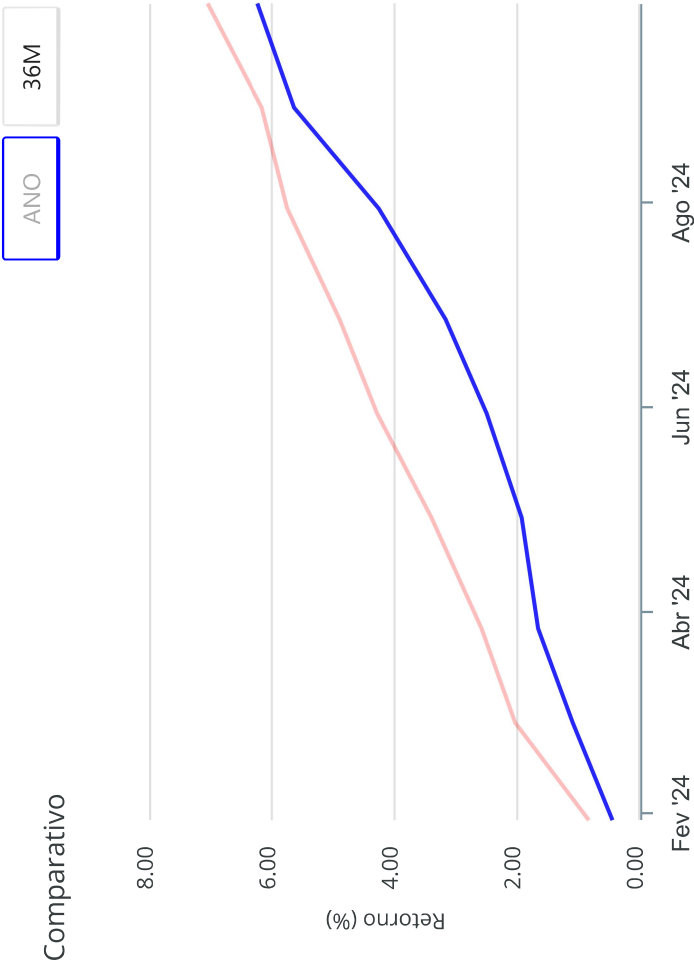
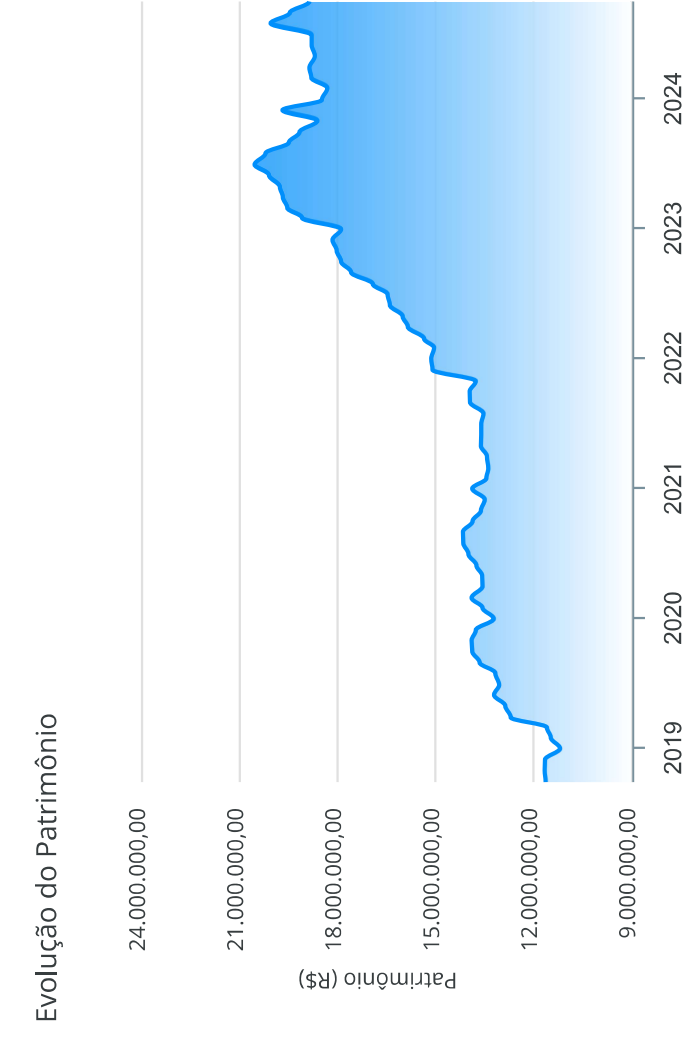
Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	14.881.245,73	4.264.283,13	5.117.068,98	14.095.365,62	66.905,74	66.905,74	0,45%	0,45%	0,84%	0,84%	53,83%	0,85%
Fevereiro	14.095.365,62	1.492.497,77	257.415,29	15.429.280,31	98.832,21	165.737,95	0,64%	1,10%	1,19%	2,04%	53,91%	0,80%
Março	15.429.280,31	977.426,76	998.029,48	15.494.702,87	86.025,28	251.763,23	0,56%	1,66%	0,54%	2,58%	64,31%	0,79%
Abril	15.494.702,87	798.342,46	1.156.098,00	15.177.889,85	40.942,52	292.705,75	0,26%	1,93%	0,80%	3,40%	56,78%	1,00%
Mai	15.177.889,85	575.270,61	1.098.511,61	14.739.478,88	84.830,03	377.535,78	0,56%	2,50%	0,86%	4,28%	58,34%	0,92%
Junho	14.739.478,88	967.618,47	832.795,46	14.971.321,08	97.019,19	474.554,97	0,65%	3,17%	0,59%	4,90%	64,71%	1,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- ☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1
- ☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV
- ☐ CDI

☐ IMA-B

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 XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.668.457,02	0,00	0,00	3.711.011,97	42.554,95	1,16%	1,16%	0,48%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.577,75	0,00	0,00	39.884,57	306,82	0,78%	0,78%	0,05%
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	1.379.509,78	0,00	0,00	1.390.130,77	10.620,99	0,77%	0,77%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.067.794,69	0,00	0,00	1.074.259,62	6.464,93	0,61%	0,61%	0,24%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	771.777,46	407.428,03	155.559,74	1.030.678,59	7.032,84	0,60%	0,79%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.518.909,37	155.559,74	21.981,94	3.674.214,80	21.727,63	0,59%	0,61%	0,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	71.449,80	317.790,27	0,00	391.084,25	1.844,18	0,47%	0,79%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	868.751,90	222.196,09	0,00	1.095.168,13	4.220,14	0,39%	0,37%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.273.077,41	0,00	0,00	2.281.575,44	8.498,03	0,37%	0,37%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	342.131,48	20.204,08	0,00	363.267,76	932,20	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	806.042,23	0,00	677.235,72	130.841,27	2.034,76	0,25%	0,77%	0,00%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	639.389,12	0,00	0,00	637.369,99	-2.019,13	-0,32%	-0,32%	1,71%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	102.694,60	0,00	0,00	102.367,55	-327,05	-0,32%	-0,32%	1,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	847.440,16	0,00	0,00	839.090,70	-8.349,46	-0,99%	-0,99%	1,89%
Total Renda Fixa	16.397.002,77	1.123.178,21	854.777,40	16.760.945,41	95.541,83	0,57%		0,53%

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 (%)	(%) Insit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	91.095,82	0,00	0,00	94.648,95	3.553,13	3,90%	3,90%	2,97%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	186.917,23	0,00	0,00	190.470,94	3.553,71	1,90%	1,90%	5,25%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	289.201,28	0,00	0,00	294.684,02	5.482,74	1,90%	1,90%	5,03%
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	236.805,91	0,00	0,00	241.199,93	4.394,02	1,86%	1,86%	11,44%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	258.714,52	0,00	0,00	262.449,96	3.735,44	1,44%	1,44%	5,71%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF FIAÇÕES	75.111,29	0,00	0,00	75.671,87	560,58	0,75%	0,75%	4,81%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	503.920,03	0,00	0,00	507.267,47	3.347,44	0,66%	0,66%	0,23%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	84.181,66	0,00	0,00	84.688,59	506,93	0,60%	0,60%	9,56%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	90.722,33	0,00	0,00	90.319,75	-402,58	-0,44%	-0,44%	9,06%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	44.715,41	0,00	0,00	43.188,99	-1.526,42	-3,41%	-3,41%	12,11%
Total Renda Variável	1.861.385,48	0,00	0,00	1.884.590,47	23.204,99	1,25%		5,12%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.607.747,97	0,00	0,00	3.711.011,97	103.264,00	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.363.546,82	311.173,85	68.922,46	3.674.214,80	68.416,59	1,86%	1,97%
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	1.346.497,70	10.276,69	0,00	1.390.130,77	33.356,38	2,46%	2,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.255.029,27	0,00	0,00	2.281.575,44	26.546,17	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1.924.967,82	1.493.581,35	2.410.169,35	1.030.678,59	22.298,77	0,65%	2,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.053.966,04	0,00	0,00	1.074.259,62	20.293,58	1,93%	1,93%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	711.875,94	81.437,56	677.235,72	130.841,27	14.763,49	1,86%	2,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	861.815,51	222.196,09	0,00	1.095.168,13	11.156,53	1,03%	1,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	70.238,07	317.790,27	0,00	391.084,25	3.055,91	0,79%	2,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	144.380,74	215.949,58	0,00	363.267,76	2.937,44	0,82%	1,05%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.955,17	0,00	0,00	39.884,57	929,40	2,39%	2,39%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	102.617,40	0,00	0,00	102.367,55	-249,85	-0,24%	-0,24%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	638.889,61	0,00	0,00	637.369,99	-1.519,62	-0,24%	-0,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	850.402,30	0,00	0,00	839.090,70	-11.311,60	-1,33%	-1,33%
Total Renda Fixa	16.970.930,36	2.652.405,39	3.156.327,53	16.760.945,41	293.937,19	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 PETROBRAS FIAÇÕES	208.148,07	0,00	0,00	241.199,93	33.051,86	15,88%	15,88%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	497.866,65	0,00	0,00	507.267,47	9.400,82	1,89%	1,89%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	90.131,08	0,00	0,00	94.648,95	4.517,87	5,01%	5,01%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	190.226,67	0,00	0,00	190.470,94	244,27	0,13%	0,13%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF FIAÇÕES	77.961,11	0,00	0,00	75.671,87	-2.289,24	-2,94%	-2,94%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	91.748,03	0,00	0,00	84.688,59	-7.059,44	-7,69%	-7,69%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	51.466,39	0,00	0,00	43.188,99	-8.277,40	-16,08%	-16,08%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	271.112,71	0,00	0,00	262.449,96	-8.662,75	-3,20%	-3,20%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	101.860,69	0,00	0,00	90.319,75	-11.540,94	-11,33%	-11,33%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	306.797,93	0,00	0,00	294.684,02	-12.113,91	-3,95%	-3,95%
Total Renda Variável	1.887.319,33	0,00	0,00	1.884.590,47	-2.728,86	-0,14%	

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...	3.610.327,58	0,00	101.855,55	3.711.011,97	202.539,94	7,50%	5,73%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.202.781,38	466.733,59	143.734,84	3.674.214,80	148.434,67	7,01%	4,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.210.802,48	0,00	0,00	2.281.575,44	70.772,96	4,92%	3,20%
BB TESOUREO FIC RENDA FIXA SELIC LP	887.476,56	439.866,69	0,00	1.390.130,77	62.787,52	7,18%	5,09%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	85.919,06	3.544.110,17	2.649.036,52	1.030.678,59	49.685,88	4,36%	5,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.028.980,42	0,00	0,00	1.074.259,62	45.279,20	6,97%	4,40%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	71.760,91	2.734.885,85	2.711.234,29	130.841,27	35.428,80	5,13%	5,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.641.913,52	317.790,27	3.600.000,00	391.084,25	31.380,46	6,90%	5,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	398.255,31	1.076.513,20	397.792,46	1.095.168,13	18.192,08	4,01%	3,21%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	628.779,19	0,00	0,00	637.369,99	8.590,80	4,07%	1,37%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	359.713,06	0,00	363.267,76	3.554,70	0,00%	3,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.985,63	0,00	0,00	39.884,57	1.898,94	6,83%	5,00%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	98.426,79	2.559,96	0,00	102.367,55	1.380,80	3,70%	1,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	244.974,73	600.000,00	0,00	839.090,70	-5.884,03	2,63%	-1,23%
Total Renda Fixa	16.148.383,56	9.542.172,79	9.603.653,66	16.760.945,41	674.042,72	2,62%	

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 PETROBRAS FIAÇÕES	212.780,55	0,00	0,00	241.199,93	28.419,38	12,68%	13,36%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	486.533,73	0,00	0,00	507.267,47	20.733,74	6,78%	4,26%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	81.105,93	0,00	0,00	94.648,95	13.543,02	24,08%	16,70%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF FIAÇÕES	82.592,68	0,00	0,00	75.671,87	-6.920,81	-8,83%	-8,38%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	198.114,26	0,00	0,00	190.470,94	-7.643,32	3,30%	-3,86%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	53.788,87	0,00	0,00	43.188,99	-10.599,88	-9,85%	-19,71%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	99.116,17	0,00	0,00	84.688,59	-14.427,58	-5,47%	-14,56%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	106.402,92	0,00	0,00	90.319,75	-16.083,17	-7,33%	-15,12%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	283.707,37	0,00	0,00	262.449,96	-21.257,41	-1,66%	-7,49%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	331.501,07	0,00	0,00	294.684,02	-36.817,05	-4,87%	-11,11%
Total Renda Variável	1.935.643,55	0,00	0,00	1.884.590,47	-51.053,08	-2,64%	

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 SERCONPREV - SERVIÇOS E CONSULTORIA EM PREVIDÊNCIA S/S LTDA.. 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.

