

# Relatório Analítico dos Investimentos

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

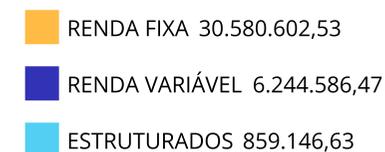
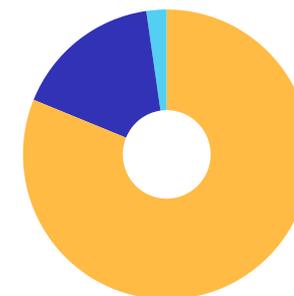


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.286.201,12	3,41%	2.254	0,53%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	972.373,56	2,58%	375	0,81%	Artigo 8º, Inciso I
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	415.148,17	1,10%	259	0,51%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	269.964,03	0,72%	4.447	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	25 Meses	589.182,60	1,56%	121	0,66%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>37.684.335,63</b>				

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

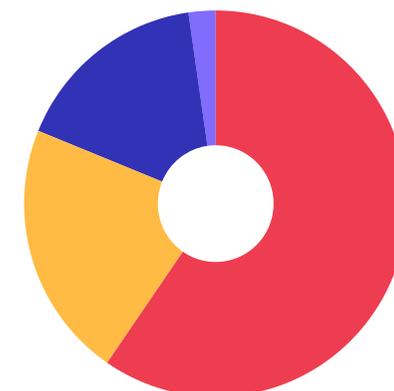
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	25,00%	9.421.083,91
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	22.455.229,88	59,59%	20,00%	35,00%	90,00%	11.460.672,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	8.125.372,65	21,56%	10,00%	15,00%	40,00%	6.948.361,60
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	7.536.867,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.884.216,78
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.884.216,78
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>30.580.602,53</b>	<b>81,15%</b>	<b>30,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>185,00%</b>	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	6.244.586,47	16,57%	10,00%	15,00%	35,00%	6.944.931,00
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	11.305.300,69
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	859.146,63	2,28%	2,00%	5,00%	10,00%	2.909.286,93
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	1.884.216,78
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	1.884.216,78
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>7.103.733,10</b>	<b>18,85%</b>	<b>12,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>85,00%</b>	

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%	5,00%	10,00%	3.768.433,56
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	



■ 7º I b   
 ■ 7º III a   
 ■ 8º I   
 ■ 10º 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 '	0,00	0,00	0,00	25,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	22.455.229,88	59,59	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	8.125.372,65	21,56	10,00	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	6.244.586,47	16,57	10,00	35,00
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	859.146,63	2,28	2,00	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	19.405.565,18	51,50	-
CAIXA DTVM	13.467.504,76	35,74	-
SICREDI	3.384.455,54	8,98	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	972.373,56	2,58	-
PRÓPIO CAPITAL	415.148,17	1,10	-
VANQUISH ASSET MANAGEMENT	39.288,42	0,10	-

**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
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
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%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-2,25%	-5,04%	-3,58%	-5,04%	-1,43%	14,67%	-	-
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,67%	-2,73%	-1,91%	-2,73%	-9,56%	-94,69%	0,17%	2,08%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	5,24%	2,53%	5,24%	11,71%	26,83%	0,02%	0,07%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	0,41%	2,13%	0,94%	2,13%	-7,37%	-86,99%	0,38%	8,30%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,79%	5,23%	2,53%	5,23%	11,67%	26,75%	0,01%	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
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	2,79%	2,86%	2,79%	5,46%	7,72%	0,48%	3,87%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,73%	2,86%	5,73%	11,35%	20,70%	0,48%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,78%	2,89%	5,78%	11,46%	-	0,48%	0,87%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	2,71%	2,88%	2,71%	5,17%	-	0,48%	4,11%

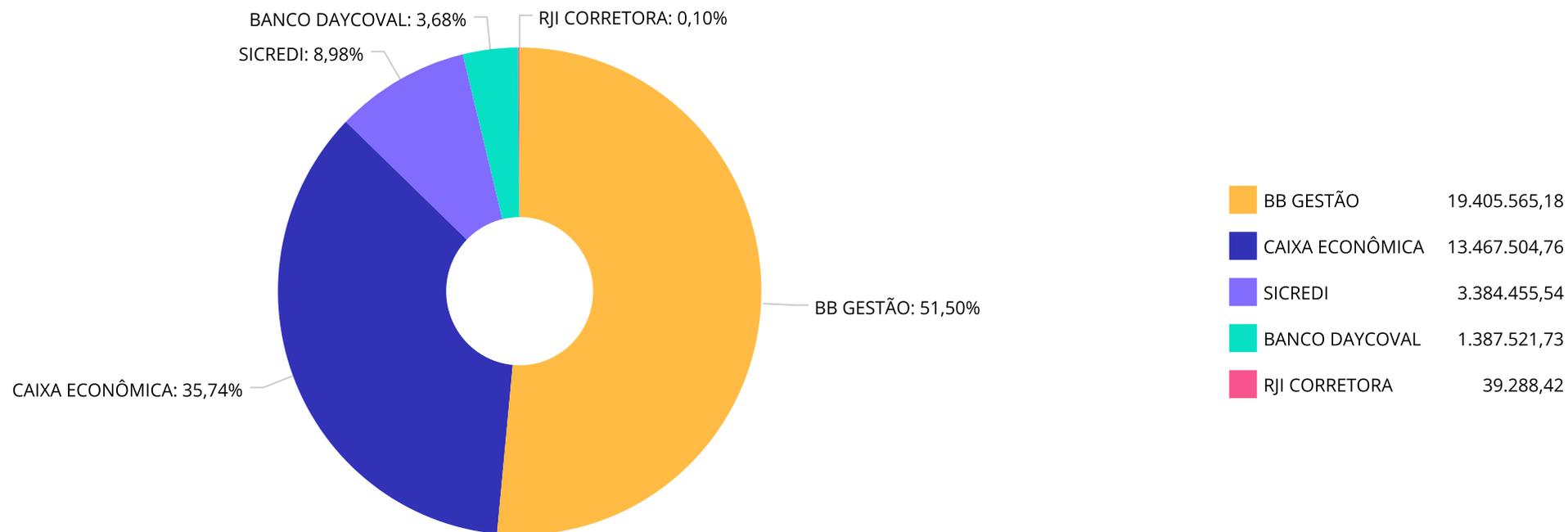
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	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%

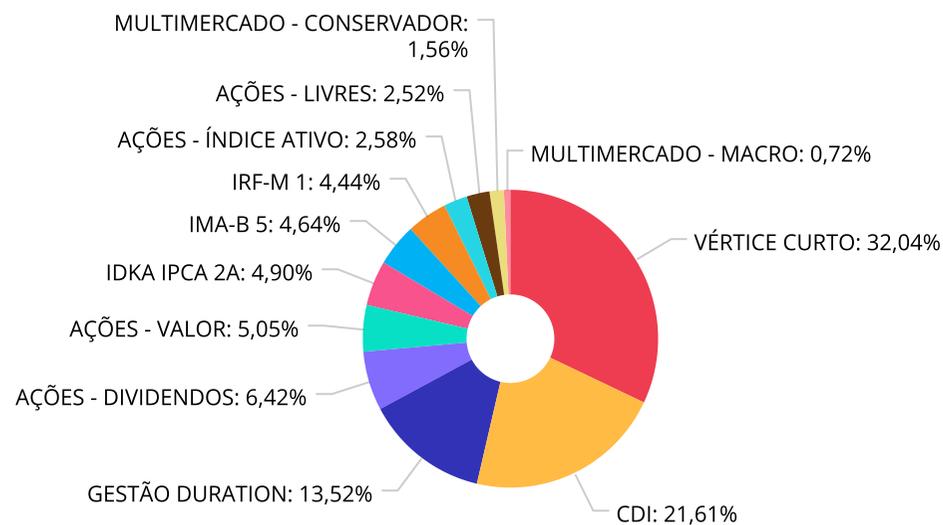
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	0,31%	-2,06%	-1,42%	-2,06%	8,28%	5,19%	2,89%	7,80%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	0,18%	-11,35%	-13,46%	-11,35%	-4,47%	13,02%	8,09%	19,29%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1,72%	-8,69%	-3,84%	-8,69%	2,24%	19,50%	5,72%	13,61%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,13%	-7,60%	-3,48%	-7,60%	3,60%	13,77%	5,36%	13,79%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,65%	-9,36%	-4,13%	-9,36%	2,49%	19,19%	5,79%	13,29%

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

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



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

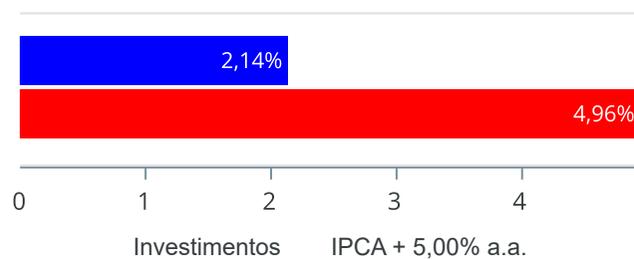


■ VÉRTICE CURTO	12.075.208,24	■ CDI	8.142.887,39	■ GESTÃO DURATION	5.095.595,83
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.420.282,14	■ AÇÕES - VALOR	1.902.617,13	■ IDKA IPCA 2A	1.844.838,33
■ IMA-B 5	1.748.709,07	■ IRF-M 1	1.673.363,67	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	972.373,56
■ AÇÕES - LIVRES	949.313,64	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	589.182,60	■ MULTIMERCADO - MACRO	269.964,03

**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024**

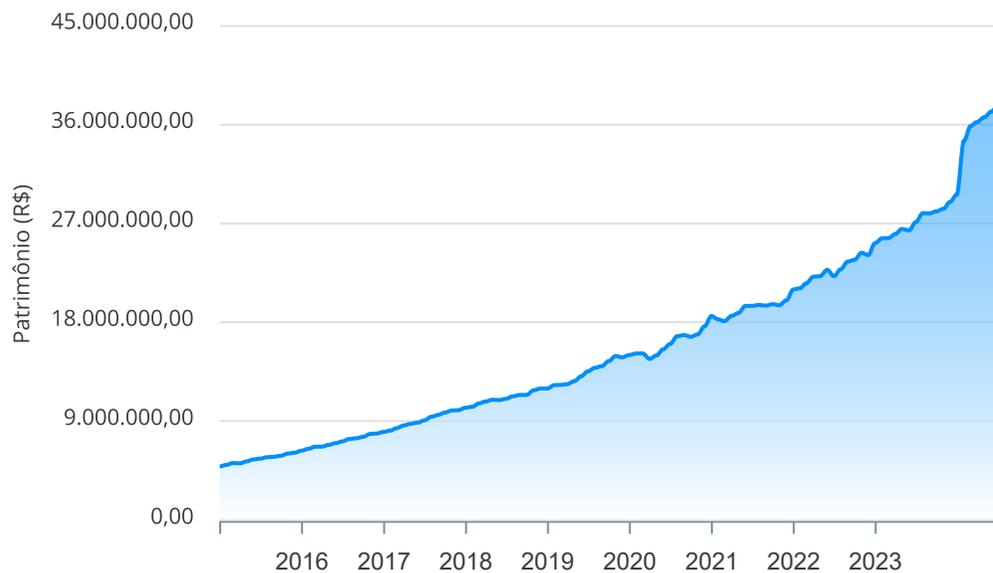
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	29.613.160,96	5.237.437,13	242.588,83	34.538.199,77	-69.809,49	-69.809,49	-0,20%	-0,20%	0,85%	0,85%	-23,77%	1,28%
Fevereiro	34.538.199,77	3.826.120,00	2.727.418,66	35.878.937,38	242.036,27	172.226,78	0,68%	0,48%	1,20%	2,06%	23,11%	1,99%
Março	35.878.937,38	149.609,13	0,00	36.234.909,80	206.363,29	378.590,07	0,57%	1,05%	0,55%	2,62%	40,13%	1,16%
Abril	36.234.909,80	754.238,94	291.770,24	36.677.770,49	-19.608,01	358.982,06	-0,05%	1,00%	0,81%	3,45%	28,92%	1,42%
Mai	36.677.770,49	3.057.558,92	2.659.887,38	37.182.659,51	107.217,48	466.199,54	0,29%	1,29%	0,87%	4,35%	29,65%	1,27%
Junho	37.182.659,51	479.098,65	289.856,06	37.684.335,63	312.433,53	778.633,07	0,84%	2,14%	0,59%	4,96%	43,04%	1,39%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



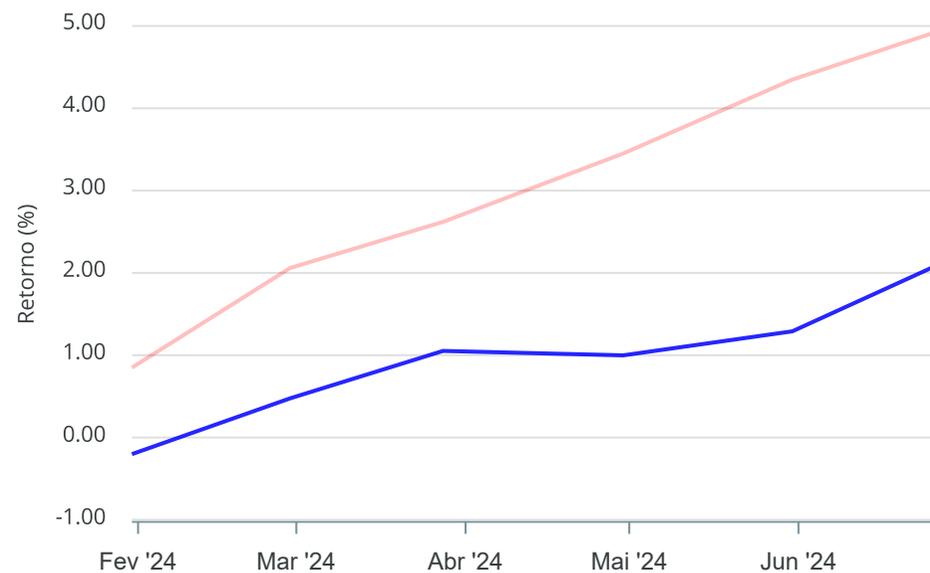
**Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores**

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	3.367.922,18	0,00	0,00	3.407.237,50	39.315,32	1,17%	1,17%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	989.828,69	0,00	0,00	1.001.372,67	11.543,98	1,17%	1,17%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.335.184,32	0,00	0,00	4.385.473,47	50.289,15	1,16%	1,16%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.243.519,75	0,00	0,00	3.281.124,60	37.604,85	1,16%	1,16%	0,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.354.274,28	0,00	0,00	2.373.545,95	19.271,67	0,82%	0,82%	0,02%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1.697.627,31	0,00	0,00	1.711.091,87	13.464,56	0,79%	0,79%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	941.019,58	55.611,79	0,00	1.004.098,82	7.467,45	0,75%	0,79%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.879.820,08	423.486,86	289.856,06	3.035.075,79	21.624,91	0,65%	0,71%	0,01%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.663.646,70	0,00	0,00	1.673.363,67	9.716,97	0,58%	0,58%	0,36%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	18.997,34	0,00	0,00	19.074,96	77,62	0,41%	0,41%	0,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.284.215,13	0,00	0,00	2.292.962,34	8.747,21	0,38%	0,38%	0,47%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	790.910,30	0,00	0,00	793.867,17	2.956,87	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	951.299,62	0,00	0,00	954.841,90	3.542,28	0,37%	0,37%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	913.648,77	0,00	0,00	915.986,47	2.337,70	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	927.042,67	0,00	0,00	928.851,86	1.809,19	0,20%	0,20%	0,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.777.685,35	0,00	0,00	2.782.420,03	4.734,68	0,17%	0,17%	0,88%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	20.350,32	0,00	0,00	20.213,46	-136,86	-0,67%	-0,67%	0,17%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>30.156.992,39</b>	<b>479.098,65</b>	<b>289.856,06</b>	<b>30.580.602,53</b>	<b>234.367,55</b>	<b>0,77%</b>		<b>0,43%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.262.203,85	0,00	0,00	1.286.201,12	23.997,27	1,90%	1,90%	5,25%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	955.967,88	0,00	0,00	972.373,56	16.405,68	1,72%	1,72%	5,72%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.470.814,36	0,00	0,00	1.487.468,96	16.654,60	1,13%	1,13%	5,36%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.121.812,18	0,00	0,00	1.134.081,02	12.268,84	1,09%	1,09%	6,91%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	943.167,71	0,00	0,00	949.313,64	6.145,93	0,65%	0,65%	5,79%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	587.339,71	0,00	0,00	589.182,60	1.842,89	0,31%	0,31%	2,89%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	414.405,94	0,00	0,00	415.148,17	742,23	0,18%	0,18%	8,09%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	269.955,49	0,00	0,00	269.964,03	8,54	0,00%	0,00%	1,85%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.025.667,12</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>7.103.733,10</b>	<b>78.065,98</b>	<b>1,11%</b>		<b>5,51%</b>

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...	4.263.441,65	0,00	0,00	4.385.473,47	122.031,82	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.189.855,61	0,00	0,00	3.281.124,60	91.268,99	2,86%	2,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.319.102,23	1.000.000,00	0,00	3.407.237,50	88.135,27	2,66%	2,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.136.079,20	1.366.502,22	1.539.566,55	3.035.075,79	72.060,92	1,60%	2,27%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.314.008,59	0,00	0,00	2.373.545,95	59.537,36	2,57%	2,57%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1.668.888,55	0,00	0,00	1.711.091,87	42.203,32	2,53%	2,53%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.640.954,46	0,00	0,00	1.673.363,67	32.409,21	1,98%	1,98%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	973.307,41	0,00	0,00	1.001.372,67	28.065,26	2,88%	2,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.715.344,60	550.096,85	0,00	2.292.962,34	27.520,89	1,21%	1,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	759.214,09	222.447,16	0,00	1.004.098,82	22.437,57	2,29%	2,53%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.767.171,38	0,00	0,00	2.782.420,03	15.248,65	0,55%	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	943.704,14	0,00	0,00	954.841,90	11.137,76	1,18%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	906.509,07	0,00	0,00	915.986,47	9.477,40	1,05%	1,05%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	784.630,51	0,00	0,00	793.867,17	9.236,66	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	920.956,94	0,00	0,00	928.851,86	7.894,92	0,86%	0,86%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	18.897,64	0,00	0,00	19.074,96	177,32	0,94%	0,94%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	20.607,05	0,00	0,00	20.213,46	-393,59	-1,91%	-1,91%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>28.342.673,12</b>	<b>3.139.046,23</b>	<b>1.539.566,55</b>	<b>30.580.602,53</b>	<b>638.449,73</b>	<b>2,13%</b>	

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 FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	547.966,94	0,00	550.096,85	0,00	2.129,91	0,39%	0,48%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.284.551,64	0,00	0,00	1.286.201,12	1.649,48	0,13%	0,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	269.620,14	0,00	0,00	269.964,03	343,89	0,13%	0,13%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	597.665,78	0,00	0,00	589.182,60	-8.483,18	-1,42%	-1,42%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	1.151.850,28	0,00	1.134.081,02	-17.769,26	-1,54%	-7,70%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.170.206,95	0,00	1.151.850,28	0,00	-18.356,67	-1,57%	-3,95%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.011.185,09	0,00	0,00	972.373,56	-38.811,53	-3,84%	-3,84%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	990.199,52	0,00	0,00	949.313,64	-40.885,88	-4,13%	-4,13%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.541.113,76	0,00	0,00	1.487.468,96	-53.644,80	-3,48%	-3,48%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	479.726,86	0,00	0,00	415.148,17	-64.578,69	-13,46%	-13,46%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.892.236,68</b>	<b>1.151.850,28</b>	<b>1.701.947,13</b>	<b>7.103.733,10</b>	<b>-238.406,73</b>	<b>-2,64%</b>	

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...	4.266.490,09	0,00	120.367,38	4.385.473,47	239.350,76	5,73%	5,73%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.192.167,76	0,00	90.103,65	3.281.124,60	179.060,49	5,73%	2,79%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	178.390,24	6.955.914,98	4.237.329,24	3.035.075,79	138.099,81	3,60%	4,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.153.564,89	2.153.482,01	33.114,63	3.407.237,50	133.305,23	5,53%	5,78%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.252.723,23	0,00	0,00	2.373.545,95	120.822,72	5,36%	5,36%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1.380.035,56	250.000,00	0,00	1.711.091,87	81.056,31	5,13%	5,23%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.354.031,47	250.000,00	0,00	1.673.363,67	69.332,20	4,47%	4,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.675.005,10	550.096,85	0,00	2.292.962,34	67.860,39	3,71%	3,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.600.718,37	118.762,79	0,00	2.782.420,03	62.938,87	2,35%	2,36%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	974.941,83	0,00	28.659,14	1.001.372,67	55.089,98	5,76%	2,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	973.955,86	0,00	1.004.098,82	30.142,96	3,48%	5,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	925.141,38	0,00	0,00	954.841,90	29.700,52	3,21%	3,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	888.329,06	0,00	0,00	915.986,47	27.657,41	3,11%	3,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	902.189,07	0,00	0,00	928.851,86	26.662,79	2,97%	2,96%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	769.241,93	0,00	0,00	793.867,17	24.625,24	3,21%	3,20%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	18.676,51	0,00	0,00	19.074,96	398,45	2,14%	2,13%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	20.780,75	0,00	0,00	20.213,46	-567,29	-2,72%	-2,73%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>30.156.992,39</b>	<b>479.098,65</b>	<b>289.856,06</b>	<b>30.580.602,53</b>	<b>234.367,55</b>	<b>0,77%</b>	

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 FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	535.723,97	0,00	550.096,85	0,00	14.372,88	2,69%	2,78%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	264.931,42	0,00	0,00	269.964,03	5.032,61	1,90%	1,90%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	0,00	600.000,00	0,00	589.182,60	-10.817,40	-1,81%	-2,06%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	1.151.850,28	0,00	1.134.081,02	-17.769,26	-1,55%	-5,85%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	200.248,48	250.000,00	0,00	415.148,17	-35.100,31	-7,78%	-11,34%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.337.814,42	0,00	0,00	1.286.201,12	-51.613,30	-3,86%	-3,86%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	800.454,67	250.000,00	0,00	972.373,56	-78.081,11	-7,43%	-8,68%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.047.332,31	0,00	0,00	949.313,64	-98.018,67	-9,36%	-9,36%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.264.431,16	0,00	1.151.850,28	0,00	-112.580,88	-8,90%	-11,11%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.609.797,29	0,00	0,00	1.487.468,96	-122.328,33	-7,61%	-7,60%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>8.708.862,93</b>	<b>0,00</b>	<b>1.701.947,13</b>	<b>7.103.733,10</b>	<b>96.817,30</b>	<b>1,11%</b>	

## 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.



