

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

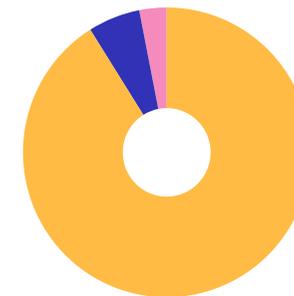
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			70.015.762,11	16,35%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	D+0	Não há	54.428.349,96	12,71%	190	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	21.334.411,28	4,98%	370	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.246.450,10	1,23%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA...	D+0	Não há	15.469.070,68	3,61%	23	2,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	38.784.166,73	9,06%	308	0,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	23.469.858,35	5,48%	488	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	68.829.022,61	16,08%	1.011	0,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	70.135.001,78	16,38%	407	1,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	10.933.176,33	2,55%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	D+0	Não se aplica	6.507.594,39	1,52%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	D+0	Não se aplica	4.341.424,74	1,01%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	449.118,31	0,10%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.990.056,74	0,93%	2.374	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.155.196,29	0,50%	1.088	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.031.323,60	0,47%	22.759	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.061.120,15	0,71%	1.737	3,23%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.785.441,51	0,42%	371	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.878.699,29	0,44%	118	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.961.371,80	0,46%	1.852	0,13%	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
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	4.009.701,38	0,94%	33	1,03%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	2.108.191,14	0,49%	2.462	3,23%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	2.089.389,02	0,49%	82	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	6.940.476,52	1,62%	110	0,44%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	2.523.285,17	0,59%	3.746	0,36%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.684.442,15	0,86%	326	0,48%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			428.162.102,13				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	70.015.762,11	16,35%	3,00%	12,00%	30,00%	58.432.868,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	135.262.448,75	31,59%	20,00%	35,85%	62,50%	132.338.865,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	70,00%	162.433.882,74	37,94%	13,00%	38,00%	60,00%	94.463.378,54
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	21.782.195,46	5,09%	1,00%	6,00%	12,00%	29.597.256,80
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	10,00%	449.118,31	0,10%	0,00%	0,15%	0,50%	1.691.692,20
Total Renda Fixa	100,00%	389.943.407,37	91,07%	37,00%	92,00%	165,00%	



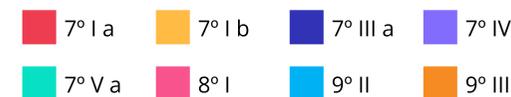
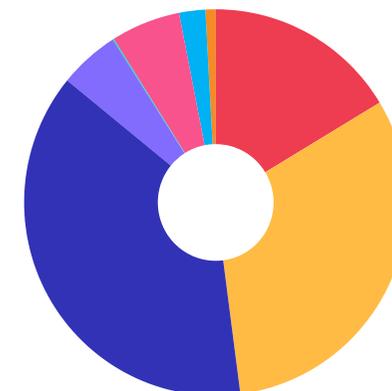
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	25.070.490,92	5,86%	3,00%	4,00%	15,00%	39.153.824,40
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	8,00%	34.252.968,17
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	25.070.490,92	5,86%	3,00%	6,50%	23,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	9.463.761,69	2,21%	0,00%	1,00%	8,00%	24.789.206,48
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.684.442,15	0,86%	0,00%	0,50%	15,00%	60.539.873,17
Total Exterior	10,00%	13.148.203,84	3,07%	0,00%	1,50%	23,00%	



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	70.015.762,11	16,35	3,00	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	135.262.448,75	31,59	20,00	62,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	162.433.882,74	37,94	13,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	21.782.195,46	5,09	1,00	12,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	449.118,31	0,10	0,00	0,50
Artigo 8º, Inciso I	25.070.490,92	5,86	3,00	15,00
Artigo 9º, Inciso II	9.463.761,69	2,21	0,00	8,00
Artigo 9º, Inciso III	3.684.442,15	0,86	0,00	15,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	8,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	107.613.189,34	25,13	0,54
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	86.889.757,65	20,29	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	70.135.001,78	16,38	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	70.015.762,11	16,35	-
BANCO BRADESCO	25.348.557,64	5,92	0,00
BANCO BTG PACTUAL	21.782.195,46	5,09	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	17.430.442,48	4,07	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	5.246.450,10	1,23	0,00
ITAÚ DTVM	4.009.701,38	0,94	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.990.056,74	0,93	0,01
SAFRA ASSET MANAGEMENT	3.684.442,15	0,86	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.061.120,15	0,71	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.523.285,17	0,59	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.108.191,14	0,49	0,00
VINCI PARTNERS	2.089.389,02	0,49	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.785.441,51	0,42	0,03
GRAPHEN INVESTIMENTOS	449.118,31	0,10	0,52

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
IMA-B 5 (Benchmark)	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	2,77%	2,82%	2,77%	5,05%	-45,56%	0,47%	4,02%
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,84%	5,69%	2,69%	5,69%	12,72%	28,36%	0,02%	0,11%
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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA SIMPLES	0,79%	5,22%	2,52%	5,22%	11,66%	26,76%	0,00%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83%	5,49%	2,62%	5,49%	12,54%	27,99%	0,02%	0,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	5,20%	2,51%	5,20%	11,62%	26,72%	0,00%	0,06%
IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,73%	2,86%	5,73%	11,35%	20,70%	0,48%	0,87%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,51%	-0,68%	0,75%	-0,68%	-7,59%	-6,82%	0,08%	4,95%

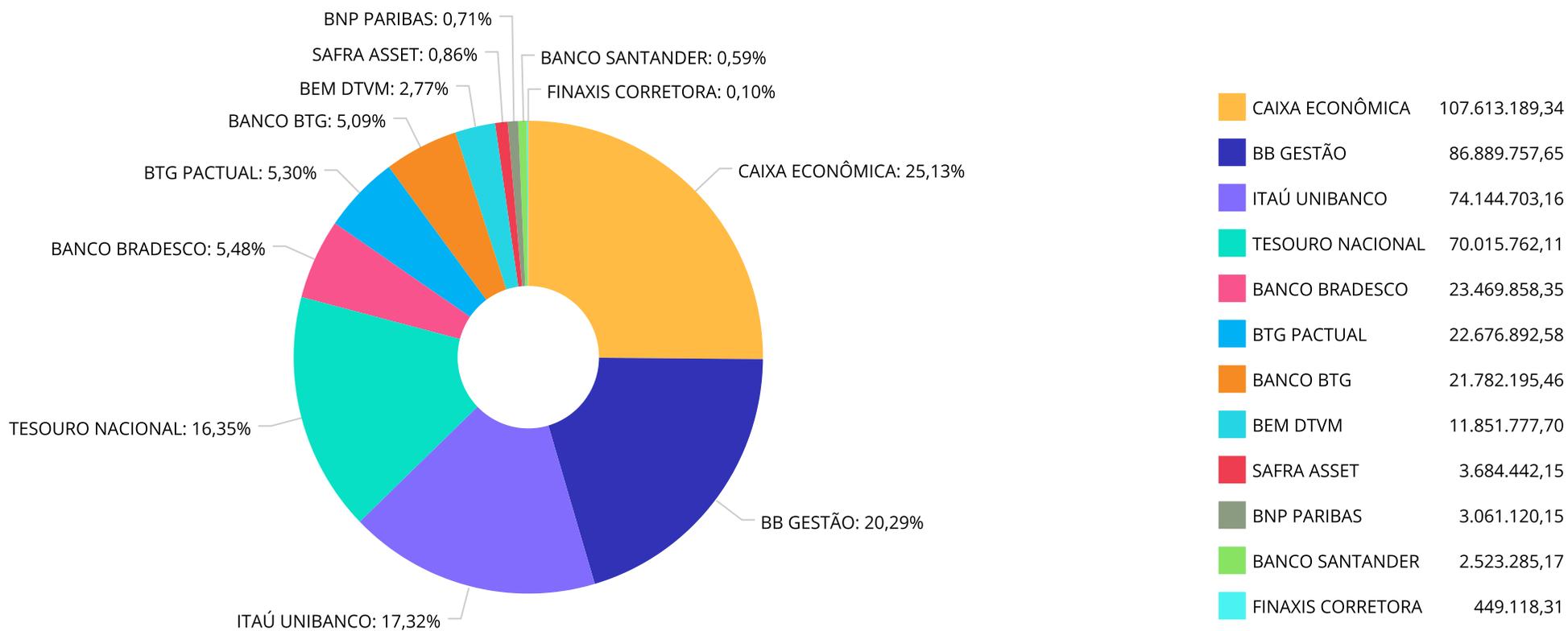
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	1,11%	-10,19%	-6,16%	-10,19%	-0,28%	18,71%	6,26%	13,72%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,54%	-12,65%	-6,03%	-12,65%	-0,46%	5,66%	6,32%	14,36%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,51%	-7,52%	-5,82%	-7,52%	2,87%	19,95%	6,34%	15,03%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2,26%	-10,97%	-6,10%	-10,97%	-4,49%	8,52%	5,91%	13,76%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	-0,13%	-13,33%	-10,63%	-13,33%	-7,64%	10,00%	7,28%	14,88%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,15%	-9,73%	-9,00%	-9,73%	-1,98%	14,83%	6,95%	15,40%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	1,37%	-8,14%	-4,98%	-8,14%	2,05%	20,33%	5,93%	13,70%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1,55%	-6,95%	-2,88%	-6,95%	5,04%	22,95%	5,95%	13,85%
SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-0,04%	-12,82%	-8,16%	-12,82%	-13,42%	-5,01%	8,45%	19,39%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,61%	-5,58%	-6,85%	-5,58%	-0,67%	12,91%	5,89%	16,47%

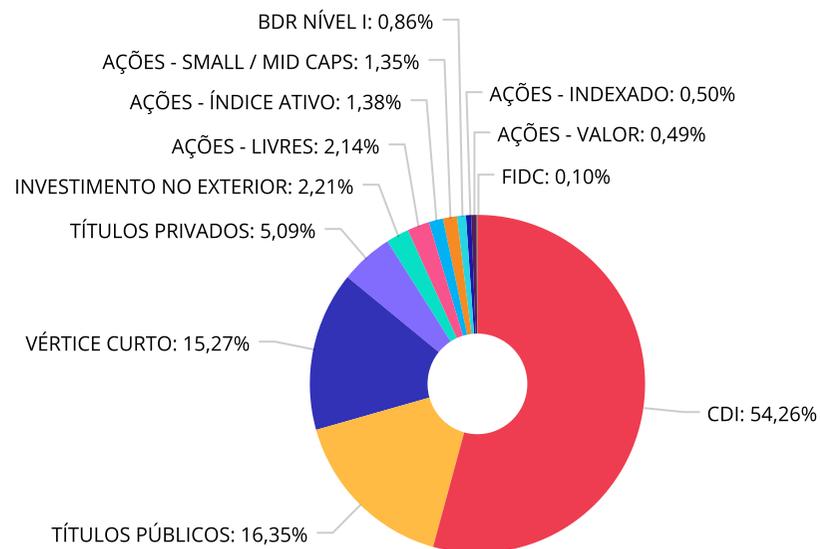
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,45%	28,06%	16,10%	28,06%	39,91%	49,16%	6,55%	12,450%
MSCI WORLD (Benchmark)	8,10%	27,24%	13,69%	27,24%	36,54%	46,37%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	10,57%	31,47%	15,78%	31,47%	46,24%	65,37%	6,15%	12,977%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	8,44%	26,69%	13,22%	26,69%	37,16%	47,09%	5,69%	10,586%

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



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



■ CDI	232.331.303,38	■ TÍTULOS PÚBLICOS	70.015.762,11	■ VÉRTICE CURTO	65.365.028,11	■ TÍTULOS PRIVADOS	21.782.195,46
■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.463.761,69	■ AÇÕES - LIVRES	9.143.204,57	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.888.400,67	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	5.775.498,25
■ BDR NÍVEL I	3.684.442,15	■ AÇÕES - INDEXADO	2.155.196,29	■ AÇÕES - VALOR	2.108.191,14	■ FIDC	449.118,31

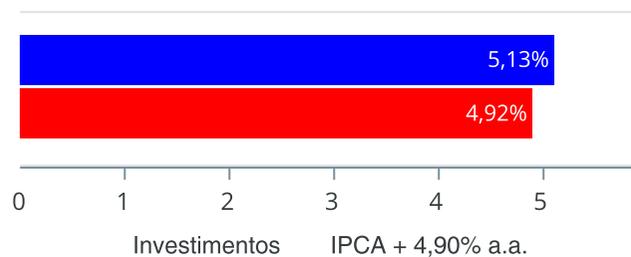
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	29/12/2023	7.088	4.234,873594	4.341,196206	30.016.784,03	30.770.398,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2033	15/03/2024	4.209	4.400,547220	4.381,503162	18.521.903,25	18.441.746,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	26/09/2023	2.798	4.289,210000	4.510,972559	12.001.209,58	12.621.701,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	26/09/2023	1.846	4.332,972337	4.432,240182	7.998.666,93	8.181.915,37	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	423.689.101,33	83.034.131,85	73.230.269,18	436.706.840,81	3.213.876,81	3.213.876,81	0,74%	0,74%	0,84%	0,84%	88,23%	0,77%
Fevereiro	436.706.840,81	20.472.671,56	26.501.690,07	434.977.949,13	4.300.126,83	7.514.003,64	0,98%	1,73%	1,19%	2,04%	84,78%	1,33%
Março	434.977.949,13	41.737.480,50	46.120.648,28	434.653.894,18	4.059.112,83	11.573.116,47	0,93%	2,68%	0,54%	2,60%	103,31%	0,65%
Abril	434.653.894,18	30.459.083,32	33.945.792,02	433.377.512,41	2.210.326,93	13.783.443,40	0,51%	3,20%	0,80%	3,42%	93,78%	0,78%
Mai	433.377.512,41	31.479.359,50	35.932.925,26	432.004.867,52	3.080.920,87	16.864.364,27	0,71%	3,94%	0,86%	4,31%	91,42%	0,73%
Junho	432.004.867,52	33.590.322,72	42.370.263,67	428.162.102,13	4.937.175,56	21.801.539,83	1,14%	5,13%	0,59%	4,92%	104,09%	0,82%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



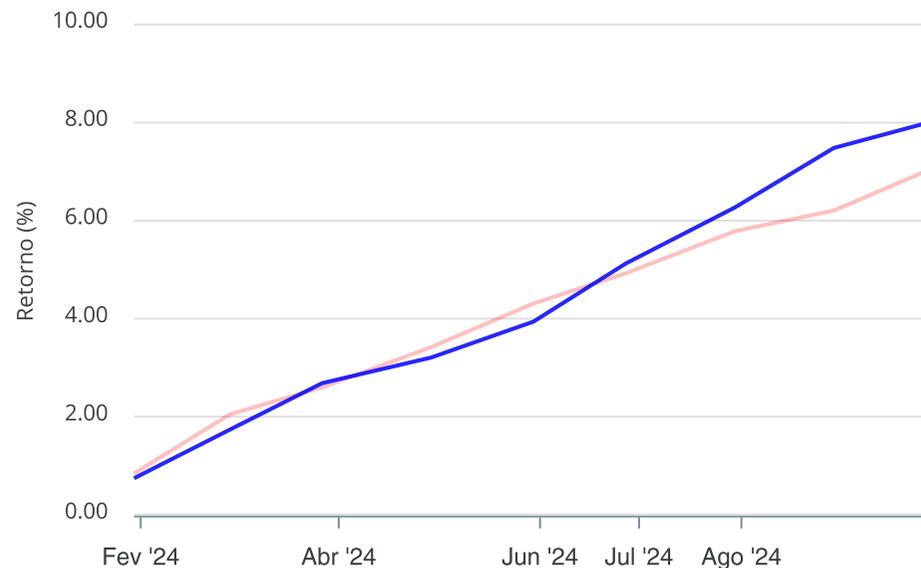
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.185.728,00	0,00	0,00	5.246.450,10	60.722,10	1,17%	1,17%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	21.089.765,11	0,00	0,00	21.334.411,28	244.646,17	1,16%	1,16%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	38.339.662,91	0,00	0,00	38.784.166,73	444.503,82	1,16%	1,16%	0,48%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	4.302.185,71	0,00	0,00	4.341.424,74	39.239,03	0,91%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	6.449.258,22	0,00	0,00	6.507.594,39	58.336,17	0,90%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	10.837.730,08	0,00	0,00	10.933.176,33	95.446,25	0,88%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	69.439.666,10	0,00	0,00	70.015.762,11	576.096,01	0,83%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	69.560.946,58	0,00	0,00	70.135.001,78	574.055,20	0,83%	0,83%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	53.543.108,10	461.211,11	0,00	54.428.349,96	424.030,75	0,79%	0,79%	0,00%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	15.348.588,07	0,00	0,00	15.469.070,68	120.482,61	0,78%	0,78%	0,00%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	36.028.967,20	12.000.000,00	24.869.475,40	23.469.858,35	310.366,55	0,65%	0,83%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	64.694.342,42	21.129.111,61	17.500.788,27	68.829.022,61	506.356,85	0,59%	0,82%	0,02%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	451.414,77	0,00	0,00	449.118,31	-2.296,46	-0,51%	-0,51%	0,08%
Total Renda Fixa	395.271.363,27	33.590.322,72	42.370.263,67	389.943.407,37	3.451.985,05	0,87%		0,12%

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
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.993.362,67	0,00	0,00	3.061.120,15	67.757,48	2,26%	2,26%	5,91%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.920.027,39	0,00	0,00	1.961.371,80	41.344,41	2,15%	2,15%	6,95%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.122.206,87	0,00	0,00	2.155.196,29	32.989,42	1,55%	1,55%	5,95%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.000.617,78	0,00	0,00	2.031.323,60	30.705,82	1,53%	1,53%	6,32%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.079.741,51	0,00	0,00	2.108.191,14	28.449,63	1,37%	1,37%	5,93%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3.965.777,86	0,00	0,00	4.009.701,38	43.923,52	1,11%	1,11%	6,26%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.965.767,48	0,00	0,00	3.990.056,74	24.289,26	0,61%	0,61%	5,89%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.078.762,11	0,00	0,00	2.089.389,02	10.626,91	0,51%	0,51%	6,34%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.786.074,14	0,00	0,00	1.785.441,51	-632,63	-0,04%	-0,04%	8,45%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.881.111,90	0,00	0,00	1.878.699,29	-2.412,61	-0,13%	-0,13%	7,28%
Total Renda Variável	24.793.449,71	0,00	0,00	25.070.490,92	277.041,21	1,12%		6,40%

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
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	6.277.215,40	0,00	0,00	6.940.476,52	663.261,12	10,57%	10,57%	6,15%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.335.956,73	0,00	0,00	3.684.442,15	348.485,42	10,45%	10,45%	6,55%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.326.882,41	0,00	0,00	2.523.285,17	196.402,76	8,44%	8,44%	5,69%
Total Exterior	11.940.054,54	0,00	0,00	13.148.203,84	1.208.149,30	10,12%		6,17%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	68.347.178,92	0,00	0,00	70.135.001,78	1.787.822,86	2,62%	2,62%
TÍTULOS PÚBLICOS	69.985.128,09	0,00	1.659.289,69	70.015.762,11	1.689.923,71	2,41%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	54.770.098,86	60.498.779,05	47.931.885,14	68.829.022,61	1.492.029,84	1,29%	2,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	51.757.622,39	1.349.583,47	0,00	54.428.349,96	1.321.144,10	2,49%	2,51%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	52.890.514,62	32.021.113,33	62.657.806,12	23.469.858,35	1.216.036,52	1,43%	2,69%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	37.705.331,69	0,00	0,00	38.784.166,73	1.078.835,04	2,86%	2,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	20.740.751,99	0,00	0,00	21.334.411,28	593.659,29	2,86%	2,86%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	13.451.236,57	1.659.289,69	0,00	15.469.070,68	358.544,42	2,37%	2,52%
LETRA FINANCEIRA BTG	10.648.523,31	0,00	0,00	10.933.176,33	284.653,02	2,67%	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	6.345.284,98	0,00	0,00	6.507.594,39	162.309,41	2,56%	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.102.564,40	0,00	0,00	5.246.450,10	143.885,70	2,82%	2,82%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	4.232.147,86	0,00	0,00	4.341.424,74	109.276,88	2,58%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	445.786,05	0,00	0,00	449.118,31	3.332,26	0,75%	0,75%
Total Renda Fixa	396.422.169,73	95.528.765,54	112.248.980,95	389.943.407,37	10.241.453,05	2,08%	

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 GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.219.169,17	0,00	0,00	2.155.196,29	-63.972,88	-2,88%	-2,88%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.218.655,94	0,00	0,00	2.108.191,14	-110.464,80	-4,98%	-4,98%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.218.496,74	0,00	0,00	2.089.389,02	-129.107,72	-5,82%	-5,82%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.161.551,89	0,00	0,00	2.031.323,60	-130.228,29	-6,02%	-6,02%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.944.044,80	0,00	0,00	1.785.441,51	-158.603,29	-8,16%	-8,16%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.155.348,91	0,00	0,00	1.961.371,80	-193.977,11	-9,00%	-9,00%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.259.883,78	0,00	0,00	3.061.120,15	-198.763,63	-6,10%	-6,10%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.101.713,00	0,00	0,00	1.878.699,29	-223.013,71	-10,61%	-10,63%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	4.272.818,33	0,00	0,00	4.009.701,38	-263.116,95	-6,16%	-6,16%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.283.432,14	0,00	0,00	3.990.056,74	-293.375,40	-6,85%	-6,85%
Total Renda Variável	26.835.114,70	0,00	0,00	25.070.490,92	-1.764.623,78	-6,58%	

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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	5.994.424,42	0,00	0,00	6.940.476,52	946.052,10	15,78%	15,78%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.173.440,48	0,00	0,00	3.684.442,15	511.001,67	16,10%	16,10%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.228.744,85	0,00	0,00	2.523.285,17	294.540,32	13,22%	13,22%
Total Exterior	11.396.609,75	0,00	0,00	13.148.203,84	1.751.594,09	15,37%	

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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	66.484.641,77	0,00	0,00	70.135.001,78	3.650.360,01	8,37%	5,49%
TÍTULOS PÚBLICOS	50.281.738,67	18.501.354,72	2.007.743,14	70.015.762,11	3.240.411,86	0,05%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	71.444.759,37	127.443.308,00	133.082.059,36	68.829.022,61	3.023.014,60	5,69%	5,36%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	33.248.232,70	87.791.464,94	100.368.139,42	23.469.858,35	2.798.300,13	6,19%	5,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	46.929.448,28	4.884.515,42	0,00	54.428.349,96	2.614.386,26	7,57%	5,20%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	37.732.662,41	0,00	1.065.060,02	38.784.166,73	2.116.564,34	7,34%	2,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	20.755.582,04	0,00	585.562,14	21.334.411,28	1.164.391,38	7,42%	5,73%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	30.675.244,77	2.152.406,37	18.501.354,72	15.469.070,68	1.142.774,26	6,57%	5,22%
LETRA FINANCEIRA BTG	10.332.259,28	0,00	0,00	10.933.176,33	600.917,05	8,30%	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	6.141.967,26	0,00	0,00	6.507.594,39	365.627,13	8,27%	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.104.956,60	0,00	144.663,23	5.246.450,10	286.156,73	7,28%	2,77%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	4.095.607,58	0,00	0,00	4.341.424,74	245.817,16	8,36%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	452.208,40	0,00	0,00	449.118,31	-3.090,09	-1,98%	-0,68%
Total Renda Fixa	383.679.309,13	240.773.049,45	255.754.582,03	389.943.407,37	21.245.630,82	3,40%	

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2.149.019,48	0,00	2.347.006,45	0,00	197.986,97	9,22%	16,56%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.316.037,31	0,00	0,00	2.155.196,29	-160.841,02	-1,56%	-6,94%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.259.314,76	0,00	0,00	2.089.389,02	-169.925,74	-2,63%	-7,52%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.294.909,28	0,00	0,00	2.108.191,14	-186.718,14	-2,79%	-8,14%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.172.807,17	0,00	0,00	1.961.371,80	-211.435,37	-2,32%	-9,73%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.225.953,88	0,00	0,00	3.990.056,74	-235.897,14	1,37%	-5,58%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.048.064,64	0,00	0,00	1.785.441,51	-262.623,13	-14,76%	-12,82%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.167.648,47	0,00	0,00	1.878.699,29	-288.949,18	-4,04%	-13,33%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.325.394,53	0,00	0,00	2.031.323,60	-294.070,93	-6,42%	-12,65%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.438.205,55	0,00	0,00	3.061.120,15	-377.085,40	-2,39%	-10,97%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	4.464.567,99	0,00	0,00	4.009.701,38	-454.866,61	-5,56%	-10,19%
Total Renda Variável	29.861.923,06	0,00	2.347.006,45	25.070.490,92	-2.444.425,69	-8,19%	

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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	5.279.170,80	0,00	0,00	6.940.476,52	1.661.305,72	31,83%	31,47%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.877.046,32	0,00	0,00	3.684.442,15	807.395,83	28,72%	28,06%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	1.991.652,02	0,00	0,00	2.523.285,17	531.633,15	30,29%	26,69%
Total Exterior	10.147.869,14	0,00	0,00	13.148.203,84	3.000.334,70	29,57%	

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.

