

Relatório Analítico dos Investimentos

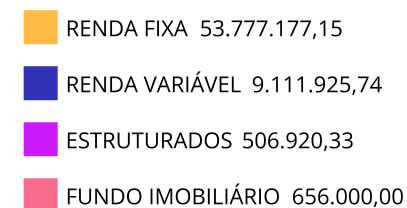
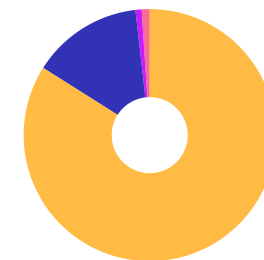
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	1.418.376,49	2,21%	186	0,66%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	244.822,87	0,38%	3.994	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	233.337,21	0,36%	2.491	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	246.052,73	0,38%	16.298	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	221.919,01	0,35%	8.478	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	3.666.013,25	5,72%	81	0,97%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	541.954,29	0,85%	97	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	508.159,43	0,79%	928	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	494.354,13	0,77%	3.735	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	451.409,49	0,70%	62	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	488.856,80	0,76%	33	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	596.670,04	0,93%	55	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	506.920,33	0,79%	565	0,11%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	656.000,00	1,02%		0,46%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			64.052.023,22				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.401,78				Artigo 6º
PL Total			64.054.425,00				

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%	100,00%	64.052.023,22
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	38.840.857,53	60,64%	25,00%	34,00%	100,00%	25.211.165,69
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.405.202,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	14.936.319,62	23,32%	25,00%	30,00%	60,00%	23.494.894,31
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	12.810.404,64
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.202.601,16
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.202.601,16
Total Renda Fixa	100,00%	53.777.177,15	83,96%	50,00%	74,00%	300,00%	

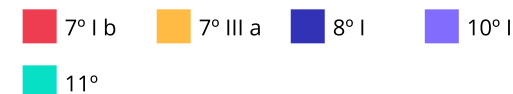
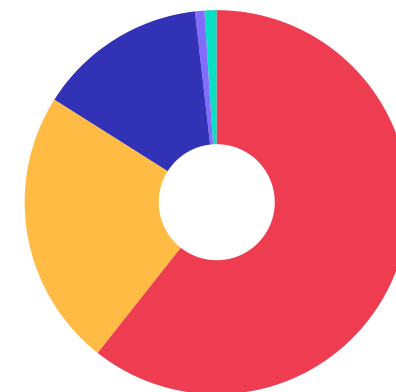


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	9.111.925,74	14,23%	5,00%	15,00%	30,00%	10.103.681,23
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	506.920,33	0,79%	0,00%	5,00%	10,00%	5.898.281,99
Artigo 11º	5,00%	656.000,00	1,02%	1,00%	1,00%	5,00%	2.546.601,16
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.274.846,07	16,04%	6,00%	21,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.405.202,32
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.405.202,32
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.405.202,32
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	

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%	0,00%	5,00%	3.202.601,16



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.387.935,39	50,57	-
BANESTES DTVM	16.780.167,40	26,20	-
CAIXA DTVM	9.877.219,43	15,42	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	1.418.376,49	2,21	-
TARPON INVESTIMENTOS	596.670,04	0,93	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	541.954,29	0,85	-
OCCAM BRASIL	508.159,43	0,79	-
ICATU VANGUARDA	506.920,33	0,79	-
GENIAL INVESTIMENTOS	494.354,13	0,77	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	488.856,80	0,76	-
MOS CAPITAL	451.409,49	0,70	-

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%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,20%	-	-	-	-	-	0,97%	-
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,72%	0,22%	-1,14%	0,22%	6,61%	26,65%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,75%	-0,07%	-1,30%	-0,07%	6,12%	25,45%	2,39%	3,53%
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,25%	-5,04%	-3,58%	-5,04%	-1,43%	14,67%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,28%	-5,21%	-3,66%	-5,21%	-1,73%	13,89%	3,04%	6,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,25%	-5,08%	-3,61%	-5,08%	-1,41%	14,09%	3,00%	5,98%
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%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	4,51%	2,00%	4,51%	10,87%	26,10%	0,24%	0,35%
IMA-B (Benchmark)	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,98%	-1,28%	-1,34%	-1,28%	2,67%	16,26%	1,89%	3,89%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,99%	-1,36%	-1,31%	-1,36%	2,78%	16,73%	1,90%	4,02%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	-1,15%	-1,56%	-1,43%	-1,56%	2,47%	16,26%	2,06%	4,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,00%	-1,22%	-1,35%	-1,22%	2,87%	16,57%	1,90%	3,86%

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
IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
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 AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,58%	3,89%	1,87%	3,89%	8,86%	20,43%	0,00%	0,06%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	0,57%	3,77%	1,82%	3,77%	8,52%	19,57%	0,00%	0,06%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,84%	5,51%	2,64%	5,51%	12,32%	24,99%	0,03%	0,09%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,79%	5,83%	3,11%	5,83%	12,30%	25,00%	0,03%	0,63%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,71%	4,70%	2,27%	4,70%	10,59%	23,51%	0,00%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,06%
IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	5,10%	2,47%	5,10%	11,43%	23,98%	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,17%	2,36%	0,55%	2,36%	7,39%	23,06%	0,88%	1,46%

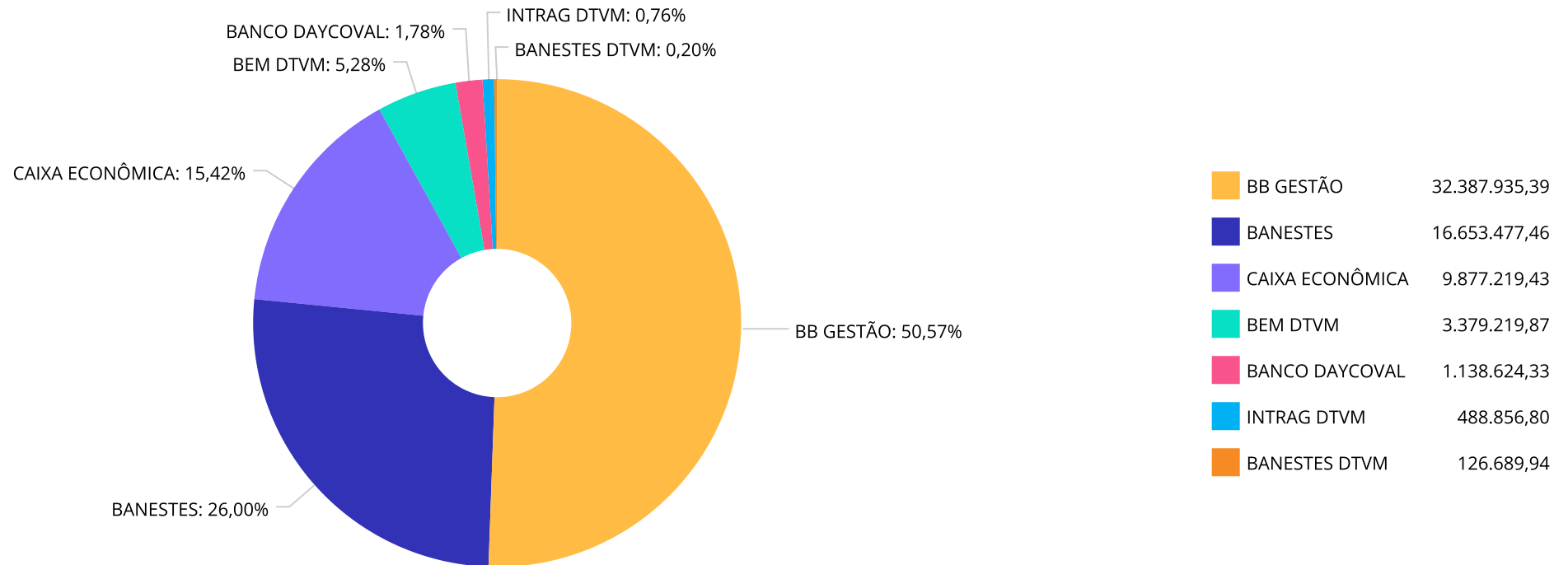
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1,25%	1,20%	-0,03%	1,20%	9,30%	41,36%	3,60%	5,46%
Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	-0,15%	-9,45%	-8,52%	-9,45%	2,31%	27,68%	6,40%	13,98%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,13%	-5,60%	-8,25%	-5,60%	9,73%	53,18%	6,51%	15,62%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	0,21%	-3,03%	-5,29%	-3,03%	20,69%	79,31%	8,82%	16,09%
OCCAM FIC AÇÕES	2,08%	-7,75%	-3,76%	-7,75%	2,12%	16,27%	4,33%	13,21%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,00%	-8,72%	-4,73%	-8,72%	2,83%	25,86%	6,10%	12,82%
QLZ MOS FI AÇÕES	-1,17%	-10,53%	-9,87%	-10,53%	-3,49%	-	10,64%	18,72%
BB AGRO FIC AÇÕES	3,30%	-5,65%	-3,66%	-5,65%	3,91%	11,32%	7,96%	16,00%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	1,10%	-12,09%	-7,76%	-12,09%	-2,08%	17,11%	5,43%	14,17%
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%
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%

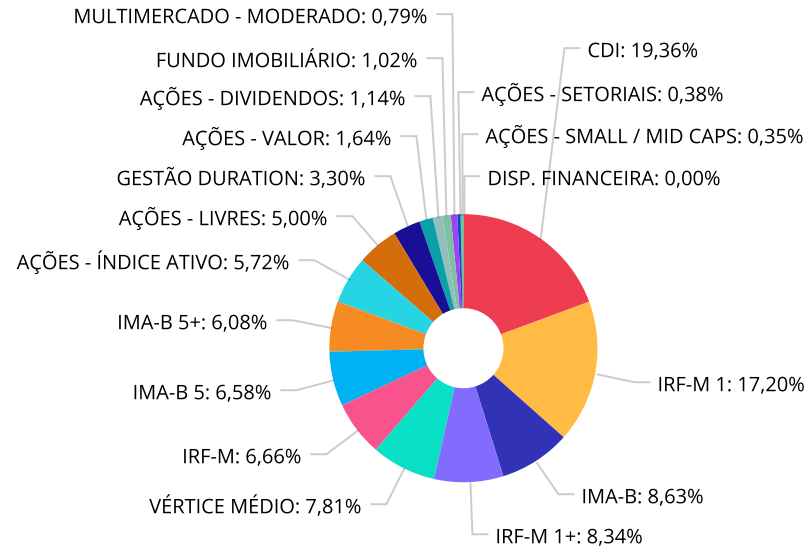
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	-1,04%	1,08%	-1,78%	1,08%	6,09%	19,73%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,61%	2,37%	2,19%	2,37%	4,22%	29,58%	9,73%	38,90%
SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
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)

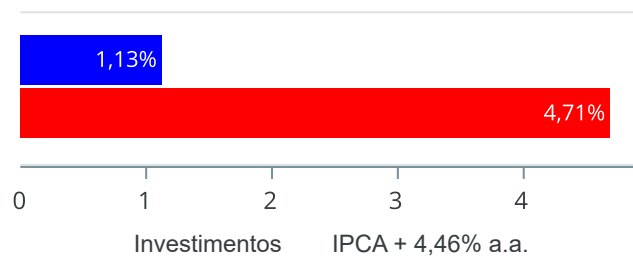


■ CDI	12.399.043,04	■ IRF-M 1	11.018.488,27	■ IMA-B	5.527.298,79	■ IRF-M 1+	5.342.053,08
■ VÉRTICE MÉDIO	5.004.063,92	■ IRF-M	4.263.350,13	■ IMA-B 5	4.217.788,48	■ IMA-B 5+	3.893.356,44
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.666.013,25	■ AÇÕES - LIVRES	3.201.365,55	■ GESTÃO DURATION	2.111.735,00	■ AÇÕES - VALOR	1.050.113,72
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	727.691,34	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	656.000,00	■ MULTIMERCADO - MODERADO	506.920,33	■ AÇÕES - SETORIAIS	244.822,87
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	221.919,01	■ DISP. FINANCEIRA	2.401,78				

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	61.952.201,88	1.528.358,98	1.343.178,15	62.138.960,43	1.577,72	1.577,72	0,00%	0,00%	0,80%	0,80%	0,32%	1,30%
Fevereiro	62.138.960,43	1.489.010,46	1.163.377,66	63.039.670,01	575.076,78	576.654,50	0,92%	0,92%	1,16%	1,97%	46,75%	1,67%
Março	63.039.670,01	1.998.928,66	1.841.985,78	63.340.803,24	144.190,35	720.844,85	0,23%	1,15%	0,51%	2,49%	46,28%	1,41%
Abril	63.340.803,24	4.761.318,95	4.551.783,04	63.220.933,33	-329.405,82	391.439,03	-0,52%	0,63%	0,76%	3,27%	19,21%	1,77%
Mai	63.220.933,33	1.929.215,89	1.571.654,21	63.742.288,47	163.793,46	555.232,49	0,26%	0,89%	0,83%	4,13%	21,52%	1,40%
Junho	63.742.288,47	6.716.218,90	6.557.590,37	64.052.023,22	151.106,22	706.338,71	0,24%	1,13%	0,56%	4,71%	23,94%	1,86%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



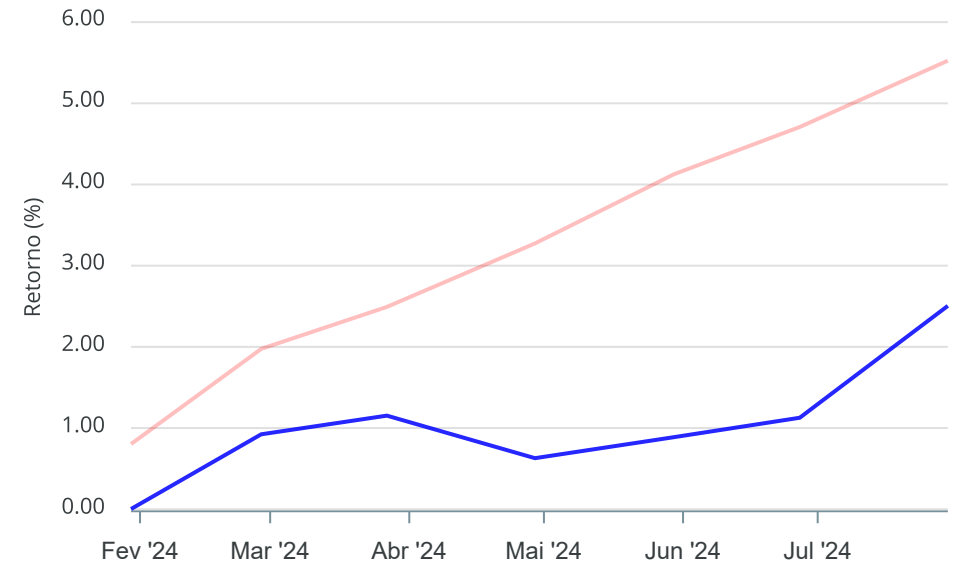
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.095.618,12	0,00	0,00	6.146.913,82	51.295,70	0,84%	0,84%	0,03%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.827.609,29	0,00	0,00	4.865.826,67	38.217,38	0,79%	0,79%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.185.734,76	0,00	0,00	4.217.788,48	32.053,72	0,77%	0,77%	0,00%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.980.022,23	0,00	0,00	2.998.397,25	18.375,02	0,62%	0,62%	0,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.101.021,02	0,00	130.000,00	8.020.091,02	49.070,00	0,61%	0,61%	0,24%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.402.599,10	10.064,44	1.300.000,00	119.927,63	7.264,09	0,51%	0,71%	0,01%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.476.546,21	1.234.566,58	4.600.835,27	1.133.466,01	23.188,49	0,41%	0,58%	0,00%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	180.241,16	86.867,88	141.231,05	126.689,94	811,95	0,30%	0,57%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.108.141,60	0,00	0,00	2.111.735,00	3.593,40	0,17%	0,17%	0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.004.063,92	4.063,92	0,08%	0,20%	0,97%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	6.798,79	384.720,00	385.524,05	6.218,97	224,23	0,06%	0,71%	0,00%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.276.856,01	0,00	0,00	4.263.350,13	-13.505,88	-0,32%	-0,32%	1,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.518.868,31	0,00	0,00	2.500.068,59	-18.799,72	-0,75%	-0,75%	2,38%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.863.485,81	0,00	0,00	2.841.984,49	-21.501,32	-0,75%	-0,75%	2,39%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.629.987,87	0,00	0,00	2.604.190,30	-25.797,57	-0,98%	-0,98%	1,89%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.591.600,29	0,00	0,00	1.575.787,43	-15.812,86	-0,99%	-0,99%	1,90%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	283.590,77	0,00	0,00	280.768,77	-2.822,00	-1,00%	-1,00%	1,90%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.078.935,06	0,00	0,00	1.066.552,29	-12.382,77	-1,15%	-1,15%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	671.505,86	0,00	0,00	656.414,85	-15.091,01	-2,25%	-2,25%	3,00%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.312.531,06	0,00	0,00	3.236.941,59	-75.589,47	-2,28%	-2,28%	3,04%

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
Total Renda Fixa	53.591.693,32	6.716.218,90	6.557.590,37	53.777.177,15	26.855,30	0,05%		0,97%

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	627.120,00	0,00	0,00	656.000,00	28.880,00	4,61%	5,40%	9,73%
BB AGRO FIC AÇÕES	237.006,67	0,00	0,00	244.822,87	7.816,20	3,30%	3,30%	7,96%
OCCAM FIC AÇÕES	497.809,65	0,00	0,00	508.159,43	10.349,78	2,08%	2,08%	4,33%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	484.672,51	0,00	0,00	494.354,13	9.681,62	2,00%	2,00%	6,10%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	241.474,80	0,00	0,00	246.052,73	4.577,93	1,90%	1,90%	5,03%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.609.162,59	0,00	0,00	3.666.013,25	56.850,66	1,58%	1,58%	5,61%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	500.655,36	0,00	0,00	506.920,33	6.264,97	1,25%	1,25%	3,60%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	535.905,86	0,00	0,00	541.954,29	6.048,43	1,13%	1,13%	6,51%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	483.554,37	0,00	0,00	488.856,80	5.302,43	1,10%	1,10%	5,43%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	230.812,89	0,00	0,00	233.337,21	2.524,32	1,09%	1,09%	6,91%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	595.451,37	0,00	0,00	596.670,04	1.218,67	0,20%	0,20%	8,82%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	1.420.476,72	0,00	0,00	1.418.376,49	-2.100,23	-0,15%	-0,15%	6,40%
QLZ MOS FI AÇÕES	456.730,12	0,00	0,00	451.409,49	-5.320,63	-1,16%	-1,16%	10,64%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	229.762,24	0,00	0,00	221.919,01	-7.843,23	-3,41%	-3,41%	12,11%
Total Renda Variável	10.150.595,15	0,00	0,00	10.274.846,07	124.250,92	1,22%		6,50%

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
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.988.631,24	0,00	0,00	6.146.913,82	158.282,58	2,64%	2,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.996.107,48	0,00	130.000,00	8.020.091,02	153.983,54	1,93%	1,93%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.719.093,67	0,00	0,00	4.865.826,67	146.733,00	3,11%	3,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.116.249,00	0,00	0,00	4.217.788,48	101.539,48	2,47%	2,47%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.265.968,11	3.907.457,80	7.120.251,09	1.133.466,01	80.291,19	0,98%	1,87%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.939.559,88	0,00	0,00	2.998.397,25	58.837,37	2,00%	2,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.236.249,21	156.292,62	1.300.000,00	119.927,63	27.385,80	1,97%	2,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.100.161,94	0,00	0,00	2.111.735,00	11.573,06	0,55%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.004.063,92	4.063,92	0,08%	-
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	174.416,27	341.923,32	392.239,74	126.689,94	2.590,09	0,50%	1,82%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	132.806,27	1.001.080,00	1.128.536,79	6.218,97	869,49	0,08%	2,27%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	284.606,98	0,00	0,00	280.768,77	-3.838,21	-1,35%	-1,35%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.279.843,90	0,00	2.000.000,00	4.263.350,13	-16.493,77	-0,26%	-0,24%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.696.990,39	0,00	610.000,00	1.066.552,29	-20.438,10	-1,20%	-1,43%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.596.622,99	0,00	0,00	1.575.787,43	-20.835,56	-1,30%	-1,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	681.023,29	0,00	0,00	656.414,85	-24.608,44	-3,61%	-3,61%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.530.434,77	0,00	0,00	2.500.068,59	-30.366,18	-1,20%	-1,20%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.639.675,35	0,00	0,00	2.604.190,30	-35.485,05	-1,34%	-1,34%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.879.445,94	0,00	0,00	2.841.984,49	-37.461,45	-1,30%	-1,30%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.359.745,84	0,00	0,00	3.236.941,59	-122.804,25	-3,66%	-3,66%

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
Total Renda Fixa	55.617.632,52	10.406.753,74	12.681.027,62	53.777.177,15	433.818,51	0,66%	

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	641.920,00	0,00	0,00	656.000,00	14.080,00	2,19%	2,19%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	500.000,00	0,00	506.920,33	6.920,33	1,38%	-0,03%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	246.052,73	-3.947,27	-1,58%	-3,95%
BB AGRO FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	244.822,87	-5.177,13	-2,07%	-3,66%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	494.354,13	-5.645,87	-1,13%	-4,72%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	233.337,21	-16.662,79	-6,67%	-7,70%
OCCAM FIC AÇÕES	528.037,00	0,00	0,00	508.159,43	-19.877,57	-3,76%	-3,76%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	221.919,01	-28.080,99	-11,23%	-16,08%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	630.022,75	0,00	0,00	596.670,04	-33.352,71	-5,29%	-5,29%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	529.993,37	0,00	0,00	488.856,80	-41.136,57	-7,76%	-7,76%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	590.657,76	0,00	0,00	541.954,29	-48.703,47	-8,25%	-8,25%
QLZ MOS FI AÇÕES	500.853,11	0,00	0,00	451.409,49	-49.443,62	-9,87%	-9,87%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	507.027,10	1.000.000,00	0,00	1.418.376,49	-88.650,61	-5,88%	-8,52%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.794.659,63	0,00	0,00	3.666.013,25	-128.646,38	-3,39%	-3,39%
Total Renda Variável	7.723.170,72	3.000.000,00	0,00	10.274.846,07	-448.324,65	-4,18%	

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
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.160.068,05	0,00	1.360.000,00	6.146.913,82	346.845,77	6,47%	5,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.806.549,45	0,00	130.000,00	8.020.091,02	343.541,57	5,34%	4,40%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.597.966,31	0,00	0,00	4.865.826,67	267.860,36	6,76%	5,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.013.271,15	0,00	0,00	4.217.788,48	204.517,33	6,02%	5,10%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.200.750,97	7.252.599,59	8.468.004,54	1.133.466,01	148.119,99	3,57%	3,89%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.868.999,34	0,00	0,00	2.998.397,25	129.397,91	5,41%	4,51%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.180.465,42	0,00	2.000.000,00	4.263.350,13	82.884,71	2,78%	1,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.199.929,23	282.819,78	1.418.903,16	119.927,63	56.081,78	4,86%	4,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.063.061,99	0,00	0,00	2.111.735,00	48.673,01	3,34%	2,36%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	198.280,40	754.552,47	830.856,25	126.689,94	4.713,32	1,79%	3,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.004.063,92	4.063,92	0,00%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.497.959,23	0,00	0,00	2.500.068,59	2.109,36	1,62%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	83.183,37	2.133.080,00	2.211.805,26	6.218,97	1.760,86	0,45%	4,70%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.844.066,28	0,00	0,00	2.841.984,49	-2.081,79	1,44%	-0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	284.245,27	0,00	0,00	280.768,77	-3.476,50	0,81%	-1,22%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.597.435,60	0,00	0,00	1.575.787,43	-21.648,17	-0,02%	-1,36%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.699.292,56	0,00	610.000,00	1.066.552,29	-22.740,27	-0,34%	-1,56%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.637.925,22	0,00	0,00	2.604.190,30	-33.734,92	-0,03%	-1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	691.541,31	0,00	0,00	656.414,85	-35.126,46	-2,04%	-5,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.414.792,94	0,00	0,00	3.236.941,59	-177.851,35	-5,10%	-5,21%

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
Total Renda Fixa	54.039.784,09	15.423.051,84	17.029.569,21	53.777.177,15	1.343.910,43	1,93%	

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	640.800,00	0,00	0,00	656.000,00	15.200,00	-1,64%	2,37%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	500.000,00	0,00	506.920,33	6.920,33	3,64%	1,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	246.052,73	-3.947,27	0,85%	-11,11%
BB AGRO FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	244.822,87	-5.177,13	-2,06%	-5,65%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	494.354,13	-5.645,87	1,86%	-8,72%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	233.337,21	-16.662,79	-4,89%	-5,85%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	615.293,35	0,00	0,00	596.670,04	-18.623,31	-1,00%	-3,03%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	221.919,01	-28.080,99	-7,29%	-19,71%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	574.130,13	0,00	0,00	541.954,29	-32.175,84	-2,24%	-5,60%
OCCAM FIC AÇÕES	550.855,34	0,00	0,00	508.159,43	-42.695,91	-5,72%	-7,75%
QLZ MOS FI AÇÕES	504.547,55	0,00	0,00	451.409,49	-53.138,06	-7,39%	-10,53%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	556.108,11	0,00	0,00	488.856,80	-67.251,31	-7,19%	-12,09%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	512.248,11	1.000.000,00	0,00	1.418.376,49	-93.871,62	-4,41%	-9,45%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.958.435,20	0,00	0,00	3.666.013,25	-292.421,95	-3,88%	-7,39%
Total Renda Variável	7.912.417,79	3.000.000,00	0,00	10.274.846,07	-637.571,72	-5,84%	

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 MOSAICO CONSULTORIA. 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.

