

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

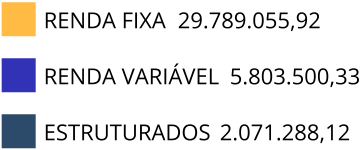
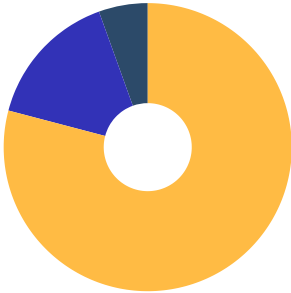
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	944.811,23	2,51%	697	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.182.674,95	11,11%	862	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.168.712,23	11,07%	792	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.220.976,99	3,24%	382	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.113.454,97	2,96%	370	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.608.374,71	6,93%	820	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.817.855,15	7,48%	903	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	470.318,44	1,25%	1.542	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.741.284,57	12,59%	15.679	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.273.215,27	6,04%	1.007	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	186.156,73	0,49%	1.148	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.331.088,55	3,53%	147	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.449.437,02	6,50%	1.011	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.280.695,11	3,40%	589	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	512.014,31	1,36%	186	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	242.854,62	0,64%	507	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	251.369,81	0,67%	1.174	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BRANCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.579.541,18	4,19%	371	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	572.435,64	1,52%	2.254	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	317.259,15	0,84%	4.917	0,05%	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
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	314.034,08	0,83%	375	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	272.538,08	0,72%	33	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.741.453,46	4,62%	4.029	0,87%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	442.708,55	1,18%	102	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	363.425,10	0,96%	4.679	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	1.265.154,47	3,36%	12.767	0,32%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			37.663.844,37				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			280.482,97	Artigo 6º			
PL Total			37.944.327,34				

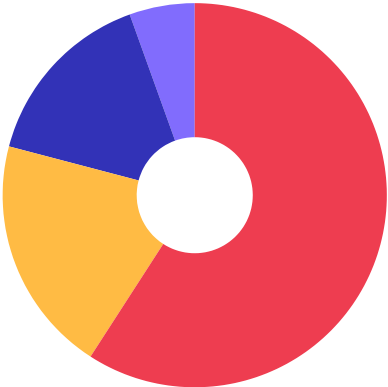
Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Junho / 2024)

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%	5,00%	20,00%	7.532.768,87
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	22.268.463,24	59,12%	30,00%	50,00%	95,00%	13.512.188,91
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	60,00%	7.520.592,68	19,97%	10,00%	15,00%	55,00%	13.194.521,72
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	7.532.768,87
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.883.192,22
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.883.192,22
Total Renda Fixa	100,00%	29.789.055,92	79,09%	40,00%	75,00%	200,00%	



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%	5.803.500,33	15,41%	10,00%	15,00%	30,00%	5.495.652,98
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	11.299.153,31
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.071.288,12	5,50%	3,00%	7,00%	10,00%	1.695.096,32
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.883.192,22
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.883.192,22
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	7.874.788,45	20,91%	13,00%	22,00%	80,00%	



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%	3,00%	10,00%	3.766.384,44
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	

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	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	22.268.463,24	59,12	30,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.520.592,68	19,97	10,00	55,00
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	5.803.500,33	15,41	10,00	30,00
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	2.071.288,12	5,50	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.584.226,80	38,72	-
CAIXA DTVM	9.571.495,32	25,41	-
SICREDI	7.287.134,15	19,35	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.910.629,73	7,73	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	2.013.991,54	5,35	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	784.352,52	2,08	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	512.014,31	1,36	-

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%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	2,96%	0,86%	2,96%	8,08%	18,05%	0,98%	1,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	3,11%	1,05%	3,11%	8,11%	18,30%	0,92%	1,71%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%	-	-
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%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,31%	2,33%	0,65%	2,33%	6,84%	17,58%	0,84%	1,82%
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%

IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	-0,34%	1,34%	-0,33%	1,34%	7,69%	25,60%	1,77%	2,64%

CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,79%	5,20%	2,52%	5,20%	11,60%	26,60%	0,01%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
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 FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,06%
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%

IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
-------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	---	---

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
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20%	1,81%	0,27%	1,81%	7,18%	22,58%	1,24%	1,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,78%	2,89%	5,78%	11,46%	-	0,48%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS 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

	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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	-0,89%	-1,94%	-0,89%	6,09%	21,55%	3,30%	4,15%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,27%	-1,91%	-1,97%	-1,91%	5,94%	21,72%	3,43%	4,88%

Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,65%	-9,36%	-4,13%	-9,36%	2,49%	19,19%	5,79%	13,29%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1,72%	-8,69%	-3,84%	-8,69%	2,24%	19,50%	5,72%	13,61%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	0,86%	-10,89%	-6,59%	-10,89%	-0,77%	18,76%	5,50%	13,74%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	1,10%	-12,09%	-7,76%	-12,09%	-2,08%	17,11%	5,43%	14,17%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	-0,15%	-9,45%	-8,52%	-9,45%	2,31%	27,68%	6,40%	13,98%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,13%	-7,60%	-3,48%	-7,60%	3,60%	13,77%	5,36%	13,79%

IDIV (Benchmark)	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%

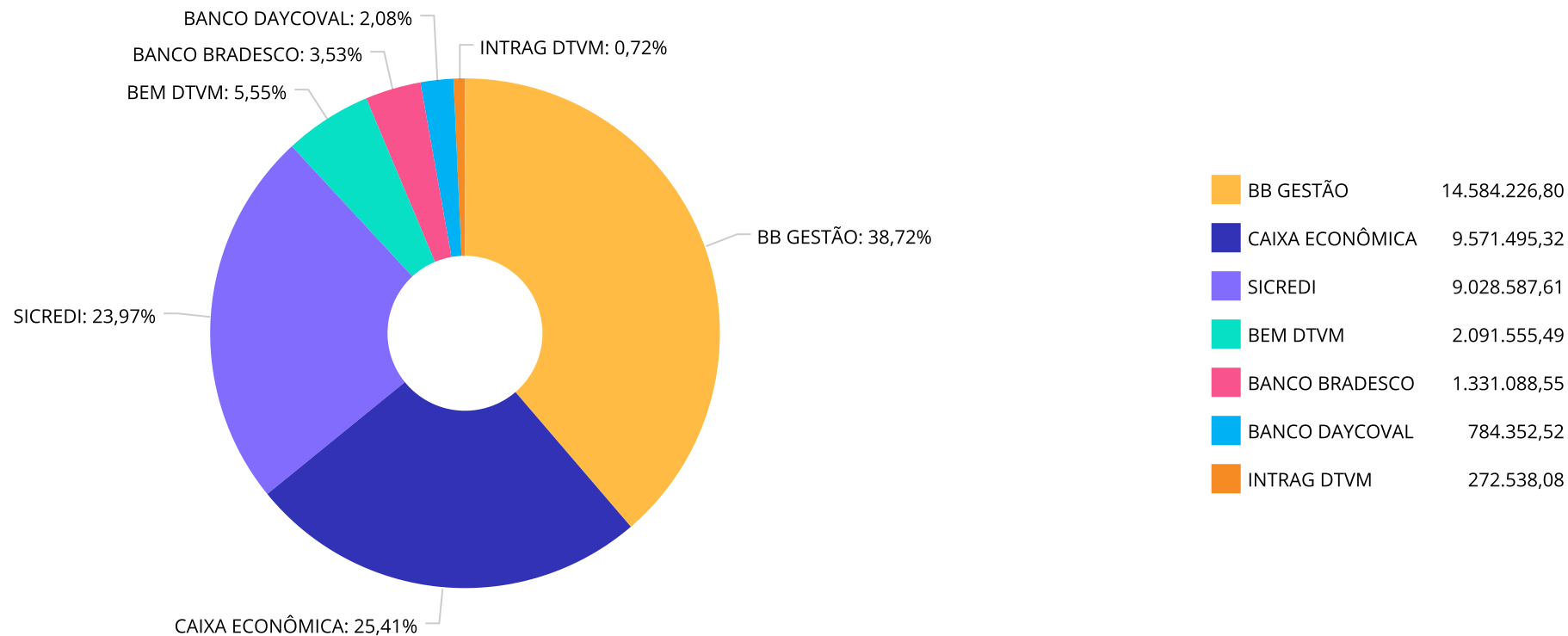
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,47%	14,48%	3,92%	14,48%	22,70%	44,25%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	4,02%	17,05%	5,21%	17,05%	30,05%	67,57%	3,01%	11,08%

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

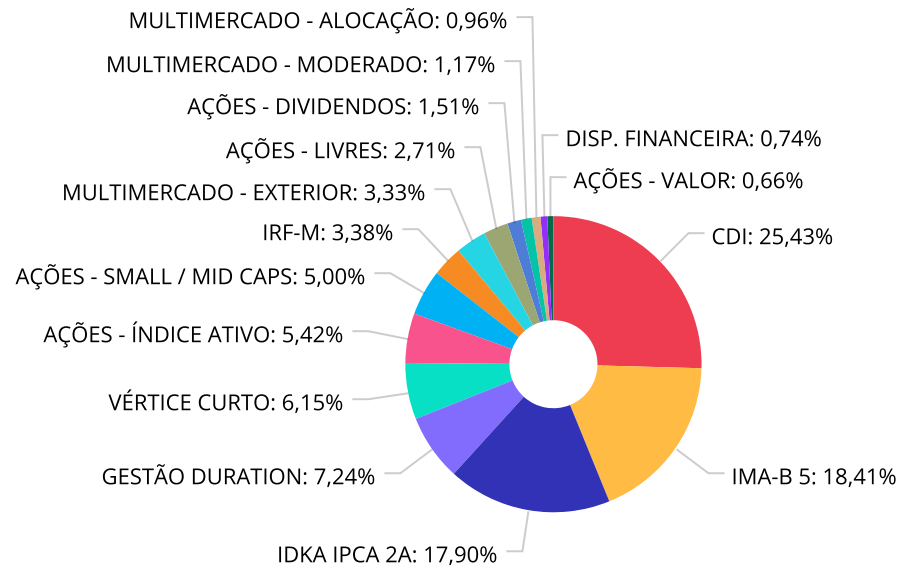
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-0,04%	-12,82%	-8,16%	-12,82%	-13,42%	-5,01%	8,45%	19,39%

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



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

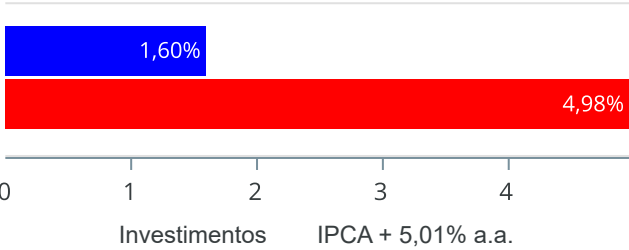


CDI	9.650.093,59	IMA-B 5	6.986.567,38	IDKA IPCA 2A	6.791.049,66	GESTÃO DURATION	2.746.218,22
VÉRTICE CURTO	2.334.431,96	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.055.487,54	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.896.800,33	IRF-M	1.280.695,11
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.265.154,47	AÇÕES - LIVRES	1.027.407,01	AÇÕES - DIVIDENDOS	572.435,64	MULTIMERCADO - MODERADO	442.708,55
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	363.425,10	DISP. FINANCEIRA	280.482,97	AÇÕES - VALOR	251.369,81		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

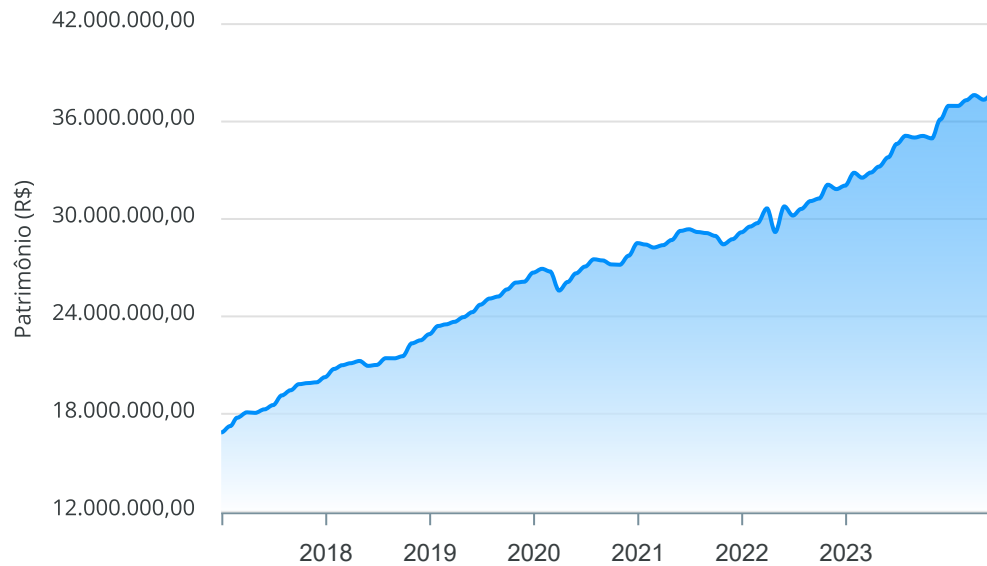
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	36.578.253,86	0,00	0,00	36.506.133,34	-72.120,52	-72.120,52	-0,20%	-0,20%	0,85%	0,85%	-23,21%	1,54%
Fevereiro	36.506.133,34	0,00	64.660,89	36.736.840,75	295.368,30	223.247,78	0,81%	0,61%	1,20%	2,06%	29,60%	1,53%
Março	36.736.840,75	558.737,77	0,00	37.562.402,21	266.823,69	490.071,47	0,72%	1,33%	0,55%	2,62%	50,72%	1,43%
Abril	37.562.402,21	0,00	0,00	37.260.772,74	-301.629,47	188.442,00	-0,80%	0,52%	0,81%	3,45%	14,96%	1,87%
Maiο	37.260.772,74	0,00	0,00	37.442.694,86	181.922,12	370.364,12	0,49%	1,01%	0,87%	4,35%	23,14%	1,47%
Junho	37.442.694,86	0,00	0,00	37.663.844,37	221.149,51	591.513,63	0,59%	1,60%	0,60%	4,98%	32,21%	1,67%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

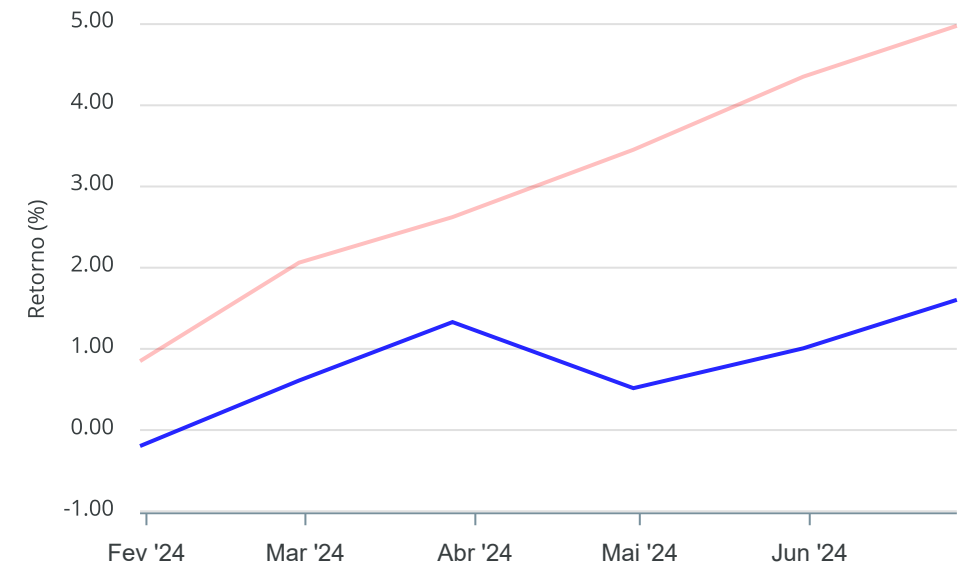
Evolução do Patrimônio



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...	1.206.888,42	0,00	0,00	1.220.976,99	14.088,57	1,17%	1,17%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.100.686,75	0,00	0,00	1.113.454,97	12.768,22	1,16%	1,16%	0,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.429.549,14	0,00	0,00	2.449.437,02	19.887,88	0,82%	0,82%	0,02%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	4.704.129,72	0,00	0,00	4.741.284,57	37.154,85	0,79%	0,79%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	184.699,23	0,00	0,00	186.156,73	1.457,50	0,79%	0,79%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.257.165,87	0,00	0,00	2.273.215,27	16.049,40	0,71%	0,71%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	941.206,95	0,00	0,00	944.811,23	3.604,28	0,38%	0,38%	0,47%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.153.185,31	0,00	0,00	4.168.712,23	15.526,92	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.807.401,47	0,00	0,00	2.817.855,15	10.453,68	0,37%	0,37%	0,81%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	468.881,14	0,00	0,00	470.318,44	1.437,30	0,31%	0,31%	0,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.172.000,31	0,00	0,00	4.182.674,95	10.674,64	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.603.294,14	0,00	0,00	2.608.374,71	5.080,57	0,20%	0,20%	0,98%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.333.810,06	0,00	0,00	1.331.088,55	-2.721,51	-0,20%	-0,20%	1,24%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1.285.055,59	0,00	0,00	1.280.695,11	-4.360,48	-0,34%	-0,34%	1,77%
Total Renda Fixa	29.647.954,10	0,00	0,00	29.789.055,92	141.101,82	0,48%		0,61%

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
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	1.216.258,48	0,00	0,00	1.265.154,47	48.895,99	4,02%	4,02%	3,01%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	561.755,45	0,00	0,00	572.435,64	10.680,19	1,90%	1,90%	5,25%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	308.735,77	0,00	0,00	314.034,08	5.298,31	1,72%	1,72%	5,72%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	248.555,32	0,00	0,00	251.369,81	2.814,49	1,13%	1,13%	5,36%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	269.581,97	0,00	0,00	272.538,08	2.956,11	1,10%	1,10%	5,43%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.726.612,41	0,00	0,00	1.741.453,46	14.841,05	0,86%	0,86%	5,50%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	241.282,36	0,00	0,00	242.854,62	1.572,26	0,65%	0,65%	5,79%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.580.100,86	0,00	0,00	1.579.541,18	-559,68	-0,04%	-0,04%	8,45%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	512.772,47	0,00	0,00	512.014,31	-758,16	-0,15%	-0,15%	6,40%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	364.403,97	0,00	0,00	363.425,10	-978,87	-0,27%	-0,27%	3,43%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	318.673,27	0,00	0,00	317.259,15	-1.414,12	-0,44%	-0,44%	9,06%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	446.008,43	0,00	0,00	442.708,55	-3.299,88	-0,74%	-0,74%	3,30%
Total Renda Variável	7.794.740,76	0,00	0,00	7.874.788,45	80.047,69	1,03%		5,67%

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
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	4.624.847,05	0,00	0,00	4.741.284,57	116.437,52	2,52%	2,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.387.996,02	0,00	0,00	2.449.437,02	61.441,00	2,57%	2,57%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.222.702,18	0,00	0,00	2.273.215,27	50.513,09	2,27%	2,27%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.120.209,19	0,00	0,00	4.168.712,23	48.503,04	1,18%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.139.398,24	0,00	0,00	4.182.674,95	43.276,71	1,05%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.186.741,22	0,00	0,00	1.220.976,99	34.235,77	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.784.986,29	0,00	0,00	2.817.855,15	32.868,86	1,18%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.082.471,56	0,00	0,00	1.113.454,97	30.983,41	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.586.204,41	0,00	0,00	2.608.374,71	22.170,30	0,86%	0,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	931.810,35	0,00	0,00	944.811,23	13.000,88	1,40%	1,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	181.566,90	0,00	0,00	186.156,73	4.589,83	2,53%	2,53%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.327.453,05	0,00	0,00	1.331.088,55	3.635,50	0,27%	0,27%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	467.306,10	0,00	0,00	470.318,44	3.012,34	0,64%	0,64%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1.284.897,27	0,00	0,00	1.280.695,11	-4.202,16	-0,33%	-0,33%
Total Renda Fixa	29.328.589,83	0,00	0,00	29.789.055,92	460.466,09	1,57%	

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
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	1.202.522,90	0,00	0,00	1.265.154,47	62.631,57	5,21%	5,21%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	571.701,53	0,00	0,00	572.435,64	734,11	0,13%	0,13%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	370.713,28	0,00	0,00	363.425,10	-7.288,18	-1,97%	-1,97%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	451.487,08	0,00	0,00	442.708,55	-8.778,53	-1,94%	-1,94%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	260.435,33	0,00	0,00	251.369,81	-9.065,52	-3,48%	-3,48%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	253.314,10	0,00	0,00	242.854,62	-10.459,48	-4,13%	-4,13%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	326.568,51	0,00	0,00	314.034,08	-12.534,43	-3,84%	-3,84%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	295.471,75	0,00	0,00	272.538,08	-22.933,67	-7,76%	-7,76%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	357.798,10	0,00	0,00	317.259,15	-40.538,95	-11,33%	-11,33%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	559.675,41	0,00	0,00	512.014,31	-47.661,10	-8,52%	-8,52%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.864.270,34	0,00	0,00	1.741.453,46	-122.816,88	-6,59%	-6,59%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.719.854,05	0,00	0,00	1.579.541,18	-140.312,87	-8,16%	-8,16%
Total Renda Variável	8.233.812,38	0,00	0,00	7.874.788,45	-359.023,93	-4,36%	

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
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	4.507.019,18	0,00	0,00	4.741.284,57	234.265,39	5,20%	5,20%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.039.401,54	0,00	0,00	4.168.712,23	129.310,69	3,21%	3,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.056.382,77	0,00	0,00	4.182.674,95	126.292,18	3,11%	3,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.324.751,12	0,00	0,00	2.449.437,02	124.685,90	5,36%	5,36%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.171.017,78	0,00	0,00	2.273.215,27	102.197,49	4,71%	4,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.730.205,30	0,00	0,00	2.817.855,15	87.649,85	3,21%	3,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.533.501,00	0,00	0,00	2.608.374,71	74.873,71	2,97%	2,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.187.893,26	0,00	34.100,07	1.220.976,99	67.183,80	5,77%	5,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.083.245,55	0,00	30.560,82	1.113.454,97	60.770,24	5,73%	5,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	909.897,11	0,00	0,00	944.811,23	34.914,12	3,83%	3,84%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.307.455,20	0,00	0,00	1.331.088,55	23.633,35	1,81%	1,81%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1.263.798,42	0,00	0,00	1.280.695,11	16.896,69	1,33%	1,34%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	459.619,37	0,00	0,00	470.318,44	10.699,07	2,33%	2,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	176.887,20	0,00	0,00	186.156,73	9.269,53	5,23%	5,24%
Total Renda Fixa	28.751.074,80	0,00	64.660,89	29.789.055,92	1.102.642,01	3,84%	

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
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	1.080.870,62	0,00	0,00	1.265.154,47	184.283,85	17,05%	17,05%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	446.674,50	0,00	0,00	442.708,55	-3.965,95	-0,88%	-0,89%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	370.507,99	0,00	0,00	363.425,10	-7.082,89	-1,92%	-1,91%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	272.042,27	0,00	0,00	251.369,81	-20.672,46	-7,61%	-7,60%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	595.406,63	0,00	0,00	572.435,64	-22.970,99	-3,86%	-3,86%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	267.929,88	0,00	0,00	242.854,62	-25.075,26	-9,36%	-9,36%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	343.901,50	0,00	0,00	314.034,08	-29.867,42	-8,68%	-8,68%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	310.030,75	0,00	0,00	272.538,08	-37.492,67	-12,09%	-12,09%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,00	558.737,77	0,00	512.014,31	-46.723,46	-8,37%	-9,45%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	373.753,25	0,00	0,00	317.259,15	-56.494,10	-15,12%	-15,12%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.954.183,53	0,00	0,00	1.741.453,46	-212.730,07	-10,89%	-10,89%
BRANCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.811.878,14	0,00	0,00	1.579.541,18	-232.336,96	-12,83%	-12,82%
Total Renda Variável	7.827.179,06	558.737,77	0,00	7.874.788,45	-511.128,38	-6,10%	

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 & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

