

2024

Relatório Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Junho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.5, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 15 de janeiro de 2024.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.522.833,14	3,87%	5.571.325.652,69	0,05%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.912.711,59	4,47%	4.649.802.742,18	0,06%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.152.365,27	1,77%	3.792.665.736,98	0,03%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.673.647,33	7,17%	493.224.578,38	0,95%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.136.080,86	1,74%	4.038.072.337,63	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.884.730,09	15,16%	7.303.046.549,52	0,14%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.838.055,22	13,56%	4.133.113.700,82	0,21%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.469.351,70	5,32%	963.696.117,89	0,36%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.061.817,06	1,63%	340.562.033,85	0,31%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.291.682,52	1,98%	5.048.562.747,13	0,03%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.905.515,08	16,73%	16.508.104.382,05	0,07%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.483.054,13	3,81%	5.723.870.469,63	0,04%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	11.129.414,15	17,07%	649.126.137,40	1,71%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.433.093,83	3,73%	547.635.436,93	0,44%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	888.703,18	1,36%	2.736.870.167,13	0,03%	9º III
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	2.075,00	0,00%	1.651.667.837,50	0,00%	11º
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	410.000,00	0,63%	129.212.320,00	0,32%	11º

Investimentos

\$ 65.195.130,15

Disponibilidades Financeiras

\$ 193.569,36

Total Carteira

\$ 65.388.699,51

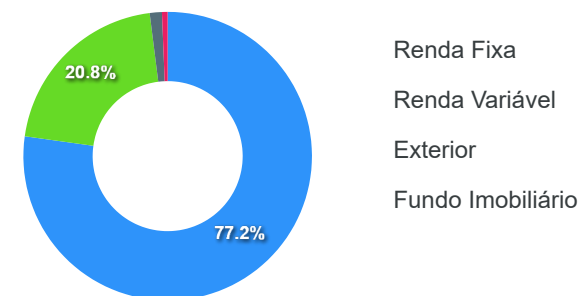
Governança (Pró Gestão)
[!\[\]\(6a9b39b98eb945faa14c645ec99e4eaa_img.jpg\)](#)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	54,68%	35.651.592,26 45,32%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	22,52%	14.680.251,73 37,48%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	20,80%	13.562.507,98 9,20%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,36%	888.703,18 8,64%
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,63%	412.075,00 4,37%

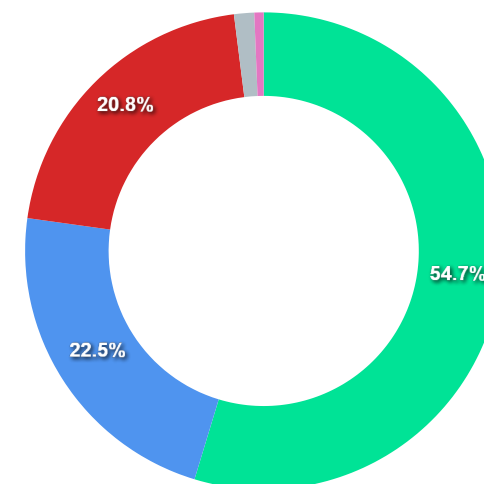
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



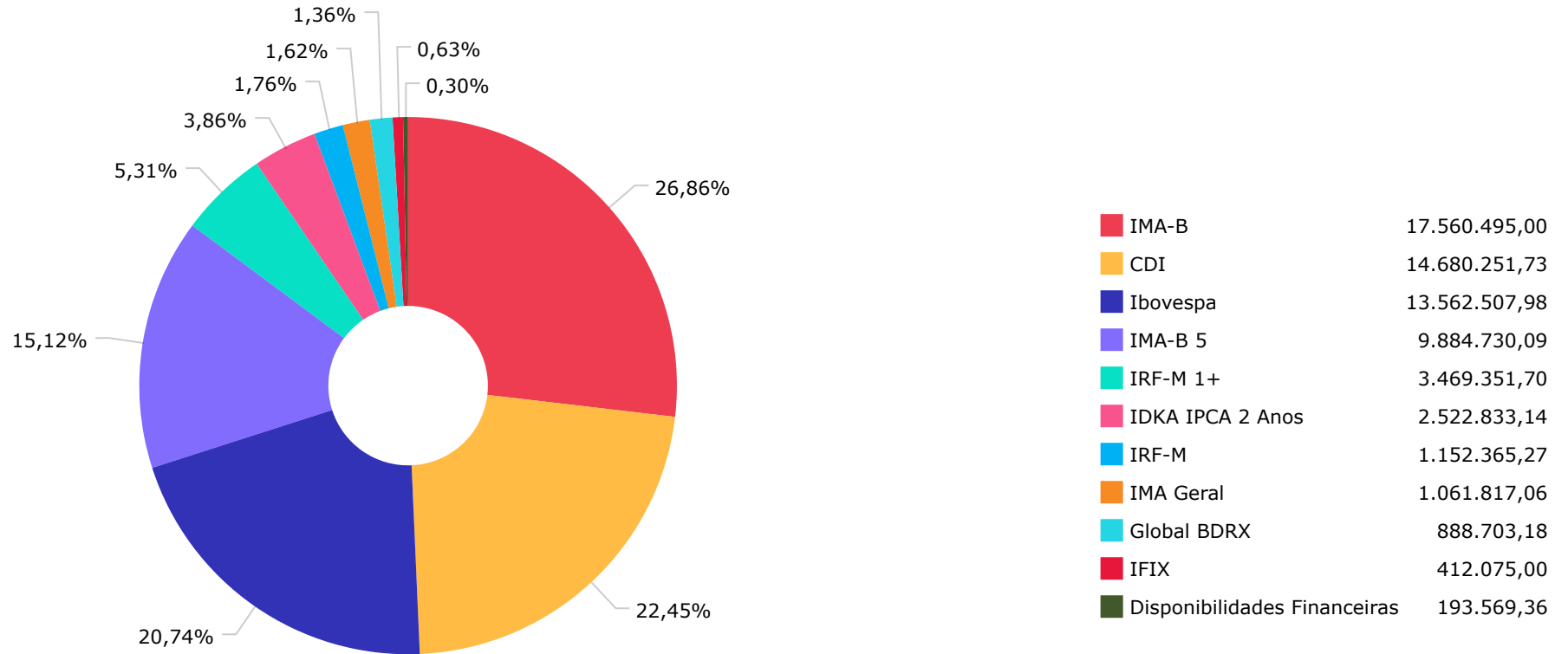
Artigos

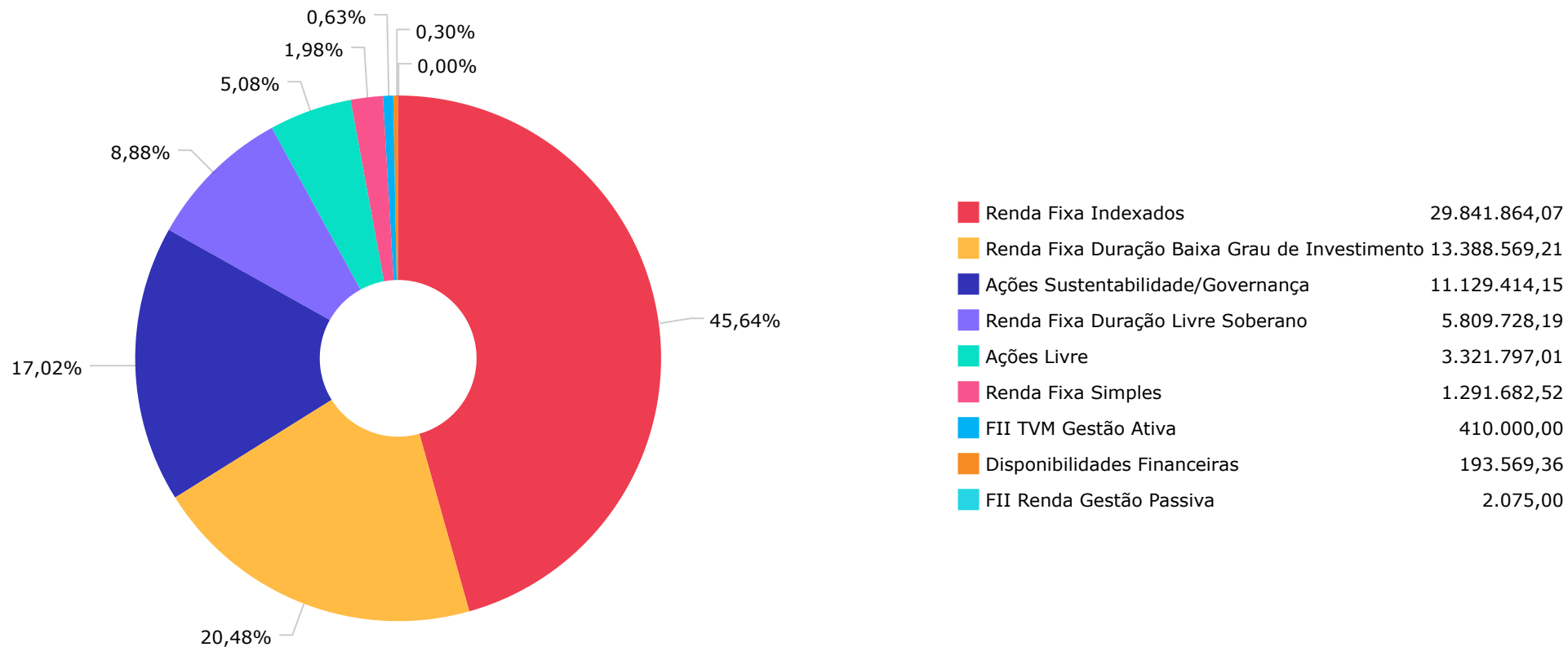


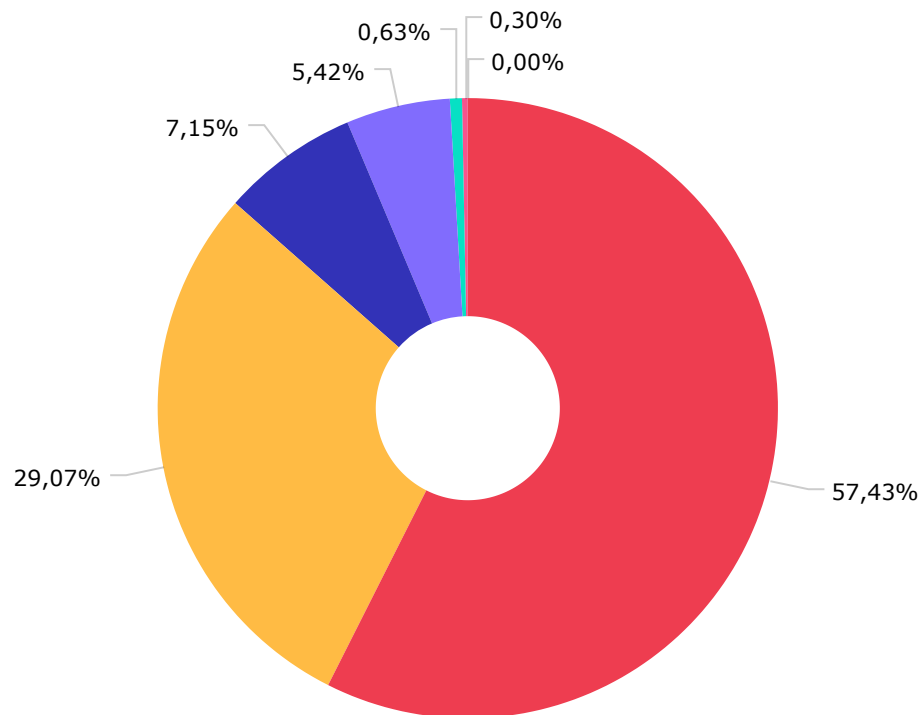
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	65.195.130,15	8° I - Fundos de Ações	20,80%	0,00%	23,00%	30,00%	5.996.031,07
7° I b - FI 100% Títulos TN	54,68%	0,00%	45,00%	100,00%	29.543.537,89	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	19.558.539,05
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	65.195.130,15	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.519.513,02
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.259.756,51	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.519.513,02
7° III a - FI Referenciados RF	22,52%	0,00%	21,00%	60,00%	24.436.826,36	9° III - Ações - BDR Nível I	1,36%	0,00%	2,00%	10,00%	5.630.809,84
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	39.117.078,09	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	6.519.513,02
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	13.039.026,03	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.259.756,51
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.259.756,51	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.259.756,51
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.259.756,51	11° - Fundos Imobiliários	0,63%	0,00%	1,00%	5,00%	2.847.681,51
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.259.756,51	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.259.756,51

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82		
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83	5,49	2,62	5,49	12,54	27,99	0,02	0,04
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	5,36	2,57	5,36	12,19	27,40	0,02	0,04
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71	4,71	2,27	4,71	10,59	24,34	0,01	0,01
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	12,79	41,07	21,74	41,07	54,78	77,13		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,73	39,52	21,34	39,52	52,18	72,57	8,26	17,39
IBOVESPA - BENCHMARK	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74		
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1,55	-6,94	-2,88	-6,94	5,04	22,95	5,95	12,53
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1,00	-9,38	-6,70	-9,38	-1,76	13,42	6,71	14,12
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26	3,11	1,05	3,11	8,11	18,30	0,92	1,95
IMA GERAL - BENCHMARK	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40		
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,98	-1,20	-1,32	-1,20	2,85	16,48	1,89	3,98
IMA-B - BENCHMARK	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01		
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16	2,79	2,86	2,79	5,45	7,72	0,48	1,02
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,00	-1,22	-1,35	-1,22	2,87	16,57	1,90	4,00
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99	-1,23	-1,33	-1,23	2,76	16,42	1,89	3,99
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,00	-1,26	-1,36	-1,26	2,73	16,27	1,89	3,99
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,37	3,21	1,18	3,21	8,00	18,98	0,81	1,71

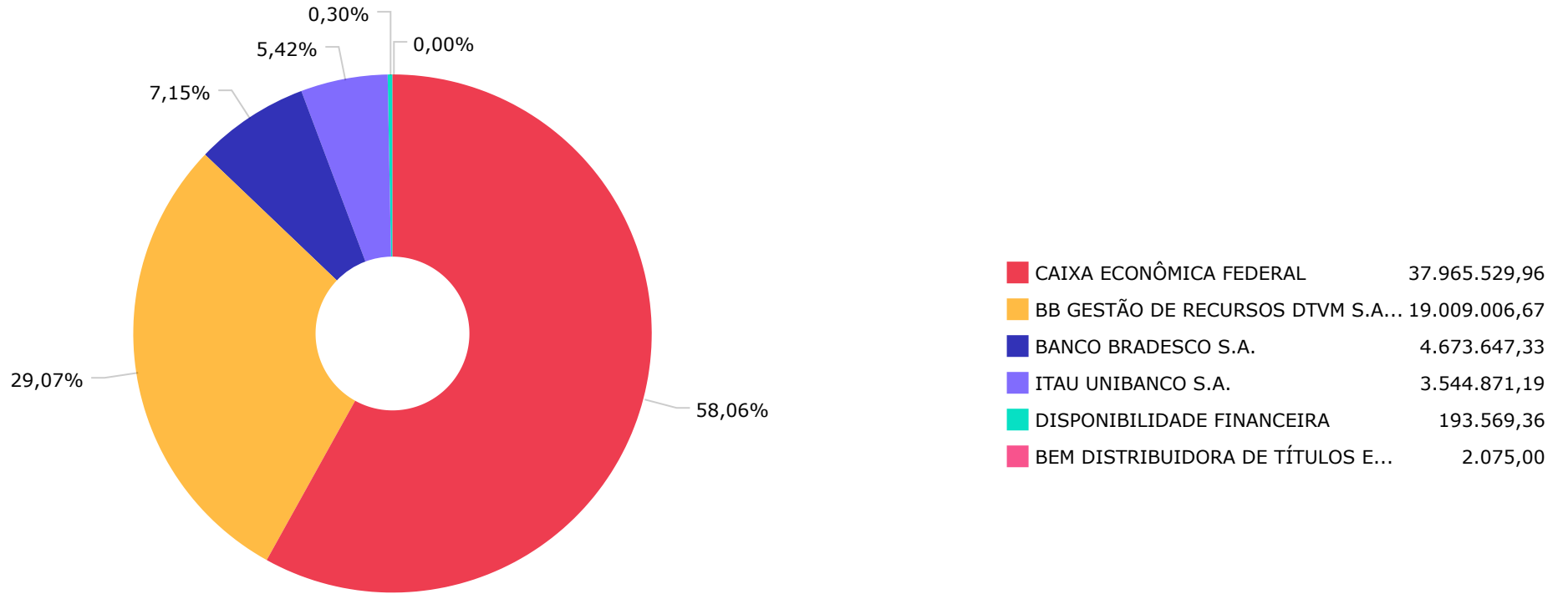
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M - BENCHMARK	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,32	1,37	-0,24	1,37	7,50	25,10	1,71	3,59
IRF-M 1+ - BENCHMARK	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,75	0,08	-1,20	0,08	6,33	25,74	2,38	5,02
IFIX - BENCHMARK	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73		
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	-0,24	6,04	-2,94	6,04	4,84	29,28	5,93	12,50
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,61	2,37	2,19	2,37	4,22	29,58	9,73	20,49







CAIXA DTVM	37.555.529,96
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	19.009.006,67
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	4.673.647,33
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	3.544.871,19
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	410.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	193.569,36
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	2.075,00



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	64.623.409,13	256.981,42	409.744,44	64.121.341,50	-349.304,61	-349.304,61	-0,54% ▼	-0,54%	0,85%	0,85%	-63,53%	2,22%
Fevereiro	64.121.341,50	592.748,55	422.510,58	64.957.982,59	666.403,12	317.098,51	1,04% ▲	0,49%	1,20%	2,06%	23,79%	2,76%
Março	64.957.982,59	4.987.466,99	6.421.762,94	63.643.498,62	119.811,98	436.910,49	0,18% ▲	0,68%	0,55%	2,62%	25,95%	1,65%
Abril	63.643.498,62	2.591.763,89	1.066.552,19	64.628.381,28	-540.329,04	-103.418,55	-0,83% ▼	-0,16%	0,81%	3,45%	-4,64%	2,22%
Maio	64.628.381,28	479.556,60	433.062,99	64.836.327,35	161.452,46	58.033,91	0,25% ▲	0,09%	0,87%	4,35%	2,07%	1,67%
Junho	64.836.327,35	500.228,28	424.177,26	65.195.130,15	282.751,78	340.785,69	0,44% ▲	0,53%	0,60%	4,98%	10,64%	2,28%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	436.910,49	0,68%	2,62%
2º Trim	-96.124,80	-0,15%	2,30%
1º Sem	340.785,69	0,53%	4,98%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

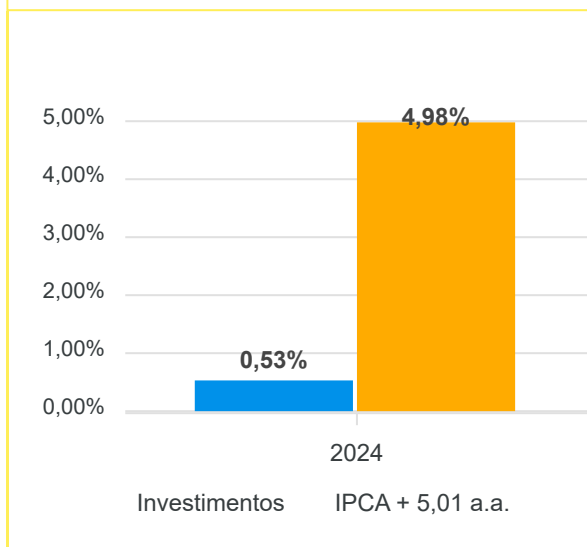
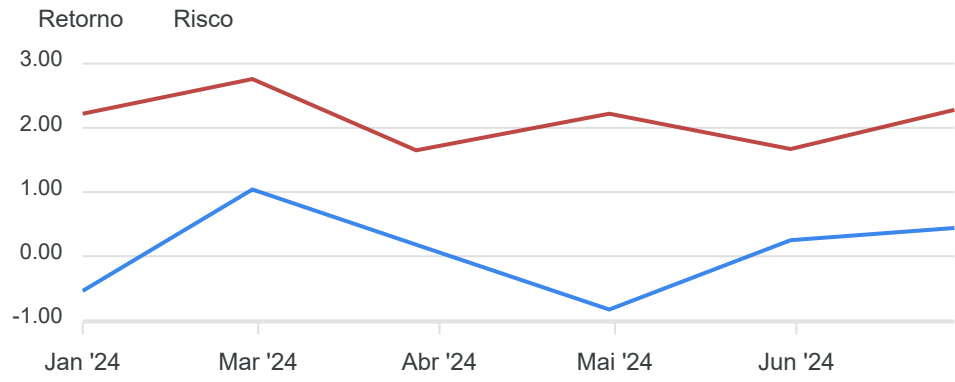
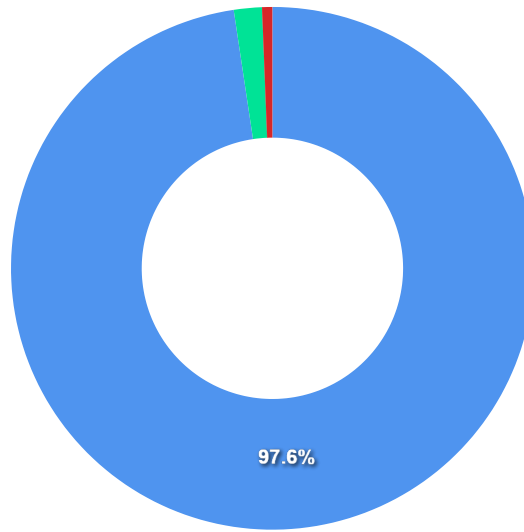


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 28/06/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	63.840.543,65	97,63
Até D+180	1.136.080,86	1,74
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	412.075,00	0,63



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.675.742,40	25.209,50	420.972,30	1.291.682,52	11.702,92	0,69% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.516.394,60	0,00	0,00	2.522.833,14	6.438,54	0,26% ▲	0,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.941.694,82	0,00	0,00	2.912.711,59	-28.983,23	-0,99% ▼	1,89%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.156.015,85	0,00	0,00	1.152.365,27	-3.650,58	-0,32% ▼	1,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.720.786,03	0,00	0,00	4.673.647,33	-47.138,70	-1,00% ▼	1,89%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.123.060,28	0,00	0,00	1.136.080,86	13.020,58	1,16% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.633.554,38	186.671,57	3.204,96	10.905.515,08	88.494,09	0,82% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.848.059,69	0,00	0,00	9.884.730,09	36.670,40	0,37% ▲	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.926.886,34	0,00	0,00	8.838.055,22	-88.831,12	-1,00% ▼	1,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.495.440,13	0,00	0,00	3.469.351,70	-26.088,43	-0,75% ▼	2,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.175.919,57	288.347,21	0,00	2.483.054,13	18.787,35	0,76% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.072.345,23	0,00	0,00	1.061.817,06	-10.528,17	-0,98% ▼	1,89%
	50.285.899,32	500.228,28	424.177,26	50.331.843,99	-30.106,35	-0,06%	1,08%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	10.959.057,06	0,00	0,00	11.129.414,15	170.357,09	1,55% ▲	5,95%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.409.030,82	0,00	0,00	2.433.093,83	24.063,01	1,00% ▲	6,71%
-	13.368.087,88	0,00	0,00	13.562.507,98	194.420,10	1,45%	6,09%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	2.060,60	0,00	0,00	2.075,00	14,40	0,70% ▲	5,93%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	391.950,00	0,00	0,00	410.000,00	18.050,00	4,61% ▲	9,73%
-	394.010,60	0,00	0,00	412.075,00	18.064,40	4,58%	9,71%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	788.329,55	0,00	0,00	888.703,18	100.373,63	12,73% ▲	8,26%
	788.329,55	0,00	0,00	888.703,18	100.373,63	12,73%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.442.198,76	726.609,82	916.021,17	1.291.682,52	38.895,11	1,79% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.499.946,30	0,00	1.000.000,00	2.522.833,14	22.886,84	0,65% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.951.977,21	0,00	0,00	2.912.711,59	-39.265,62	-1,33% ▼
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.155.112,74	0,00	0,00	1.152.365,27	-2.747,47	-0,24% ▼
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.738.007,34	0,00	0,00	4.673.647,33	-64.360,01	-1,36% ▼
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.104.479,20	0,00	0,00	1.136.080,86	31.601,66	2,86% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.602.458,42	2.043.417,33	7.771,27	10.905.515,08	267.410,60	2,51% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.769.429,71	0,00	0,00	9.884.730,09	115.300,38	1,18% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.958.874,49	0,00	0,00	8.838.055,22	-120.819,27	-1,35% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.511.490,93	0,00	0,00	3.469.351,70	-42.139,23	-1,20% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.630.287,94	801.521,62	0,00	2.483.054,13	51.244,57	2,11% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.075.979,73	0,00	0,00	1.061.817,06	-14.162,67	-1,32% ▼
	48.440.242,77	3.571.548,77	1.923.792,44	50.331.843,99	243.844,89	0,49%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	11.459.769,53	0,00	0,00	11.129.414,15	-330.355,38	-2,88% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.607.733,25	0,00	0,00	2.433.093,83	-174.639,42	-6,70% ▼
	14.067.502,78	0,00	0,00	13.562.507,98	-504.994,80	-3,59%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	2.137,80	0,00	0,00	2.075,00	-62,80	-2,94% ▼
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	401.200,00	0,00	0,00	410.000,00	8.800,00	2,19% ▲
	403.337,80	0,00	0,00	412.075,00	8.737,20	2,17%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	732.415,27	0,00	0,00	888.703,18	156.287,91	21,34% ▲
	732.415,27	0,00	0,00	888.703,18	156.287,91	21,34%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.549.390,63	793.354,94	2.141.009,06	1.291.682,52	89.946,01	2,69% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.429.755,01	0,00	1.000.000,00	2.522.833,14	93.078,13	2,71% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.948.848,05	0,00	0,00	2.912.711,59	-36.136,46	-1,23% ▼
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.136.833,09	0,00	0,00	1.152.365,27	15.532,18	1,37% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.905.702,75	0,00	2.872.516,75	0,00	-33.186,00	-1,14% ▼
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.095.591,08	3.634.092,00	0,00	4.673.647,33	-56.035,75	-1,18% ▼
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.105.279,78	0,00	31.198,15	1.136.080,86	61.999,23	5,61% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.868.026,86	2.557.412,00	7.771,27	10.905.515,08	487.847,49	4,68% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.577.263,91	0,00	0,00	9.884.730,09	307.466,18	3,21% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.947.488,70	0,00	0,00	8.838.055,22	-109.433,48	-1,22% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.466.424,53	0,00	0,00	3.469.351,70	2.927,17	0,08% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	2.423.886,79	0,00	2.483.054,13	59.167,34	2,44% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.074.675,73	0,00	0,00	1.061.817,06	-12.858,67	-1,20% ▼
	46.105.280,12	9.408.745,73	6.052.495,23	50.331.843,99	870.313,37	1,76%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	11.959.995,70	0,00	0,00	11.129.414,15	-830.581,55	-6,94% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.684.974,64	0,00	0,00	2.433.093,83	-251.880,81	-9,38% ▼
	14.644.970,34	0,00	0,00	13.562.507,98	-1.082.462,36	-7,39%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB PROGRESSIVO II FII - BBPO11	1.956,80	0,00	0,00	2.075,00	118,20	6,04% ▲
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	400.500,00	0,00	2.950,00	410.000,00	12.450,00	3,11% ▲
	402.456,80	0,00	2.950,00	412.075,00	12.568,20	3,12%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.983.487,64	0,00	1.500.000,00	888.703,18	405.215,54	20,43% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.487.214,23	0,00	1.622.365,17	0,00	135.150,94	9,09% ▲
	3.470.701,87	0,00	3.122.365,17	888.703,18	540.366,48	15,57%

Cenário Econômico

No fim do ano passado, as expectativas para 2024 eram otimistas. Os analistas esperavam que os juros começassem a cair nos Estados Unidos e seguissem em trajetória de queda no Brasil. Com isso, a bolsa decolava e a renda variável finalmente voltaria a ter mais apelo. Seis meses depois, não foi o que aconteceu. O ciclo de cortes da Selic parou, em 10,5% (pelo menos por enquanto) mais cedo do que o esperado e a bolsa acumula uma queda, no ano, de quase 8%. Até agora, a renda fixa continua sendo a classe mais rentável do país, com o CDI trazendo boa rentabilidade. E, em nossas expectativas, o segundo semestre tende a ir pelo mesmo caminho, a menos que existam mudanças significativas no âmbito fiscal ou na economia norte-americana.

No primeiro semestre, o Ibovespa acumulou uma queda de 7,66%. Dos seis meses até aqui, apenas junho e fevereiro foram de alta na bolsa brasileira. Já o CDI (taxa que acompanha de perto a Selic e é usada como indexador de muitos investimentos de renda fixa) vem entregando uma rentabilidade de 5,22% no ano, mesmo com os cortes de juros feitos em janeiro, março e maio. Até mesmo a boa e velha poupança rendeu mais que a bolsa brasileira, já que ela entregou uma rentabilidade de 3,40% no ano até agora.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2024. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2024 ainda não foram atingidos diante das oportunidades que o mercado ofereceu como boas alternativas.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstraram de forma consolidada e no período resultados ainda insatisfatórios.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade com os objetivos da política de investimentos, e de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva da DRPPS, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Os resultados no período continuam insatisfatórios. Até agora, a renda fixa e os investimentos no exterior continuam sendo a referência de rentabilidade, com o CDI na renda fixa se destacando na relação risco x retorno. O segmento de renda variável segue comprometido com a bolsa acumulando queda no ano, diante das incertezas no cenário interno combinado com a instabilidade fiscal.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2024, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 12 de julho de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	862
Patrimônio Líquido Fundo	5.571.325.652,69

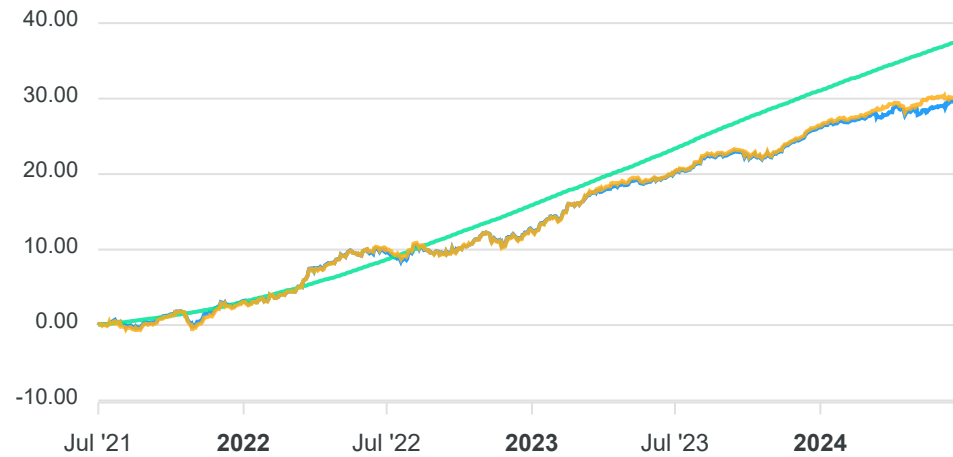
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IDKA IPCA 2 Anos
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

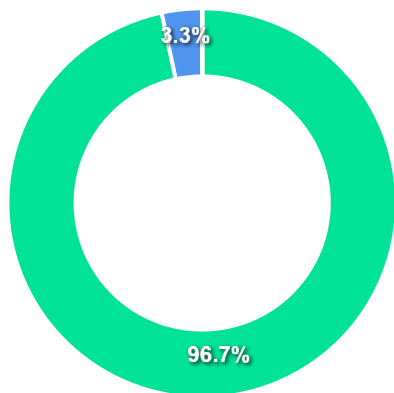
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,26%	3,11%	1,05%	3,11%	8,11%	18,30%	0,92%	1,95%
Benchmark	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.056.465,68	96.66%
Operação compromissada	140.081,89	3.34%
Valores a pagar/receber	150,80	0.00%
Outros	-30,87	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	1.645.990,91	39,22	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	1.539.374,46	36,68	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	871.100,31	20,76	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2031	140.081,89	3,34	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	210,46	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	20,40	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	13,13	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Selic	13,13	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	5,42	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,14	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	-8,38	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Cetip	-32,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-33,30	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-35,45	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	-35,63	0,00	Outros

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 638
Patrimônio Líquido Fundo 4.649.802.742,18

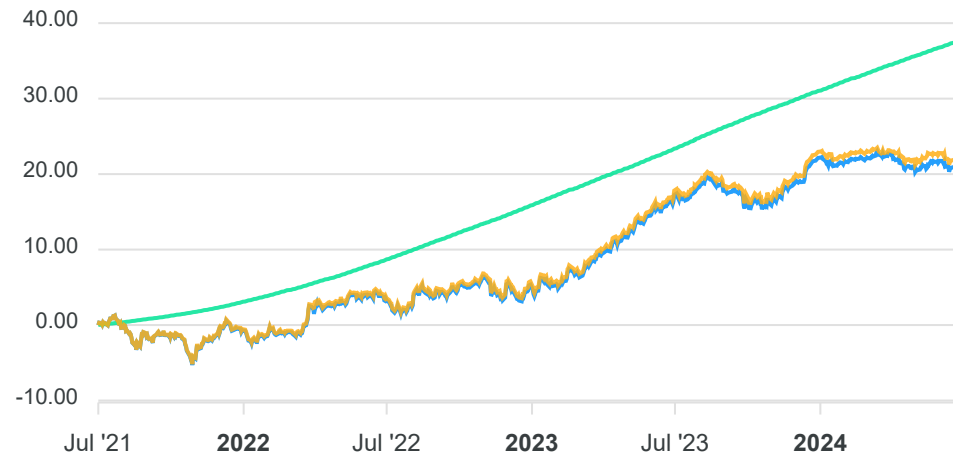
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

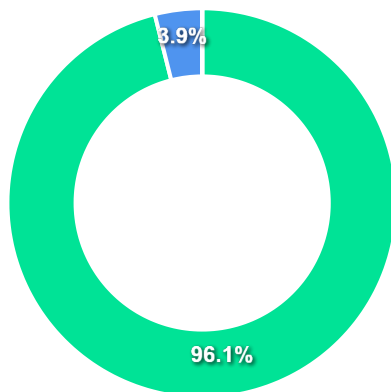
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,99%	-1,23%	-1,33%	-1,23%	2,76%	16,42%	1,89%	3,99%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.276.115,92	96.08%
Operação compromissada	92.699,24	3.91%
Valores a pagar/receber	175,30	0.01%
Outros	-16,90	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	299.405,68	12,64	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	284.858,91	12,02	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	276.735,31	11,68	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	247.369,35	10,44	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	235.342,75	9,93	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	191.398,14	8,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	148.059,38	6,25	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	137.660,96	5,81	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	118.328,04	4,99	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	112.412,28	4,75	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	101.984,40	4,31	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2031	92.699,24	3,91	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	63.834,74	2,69	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029	58.725,99	2,48	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	209,90	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	20,40	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	7,82	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	5,42	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,14	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	-0,52	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	-16,38	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Administração	-18,83	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-20,21	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-31,34	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	635
Patrimônio Líquido Fundo	3.792.665.736,98

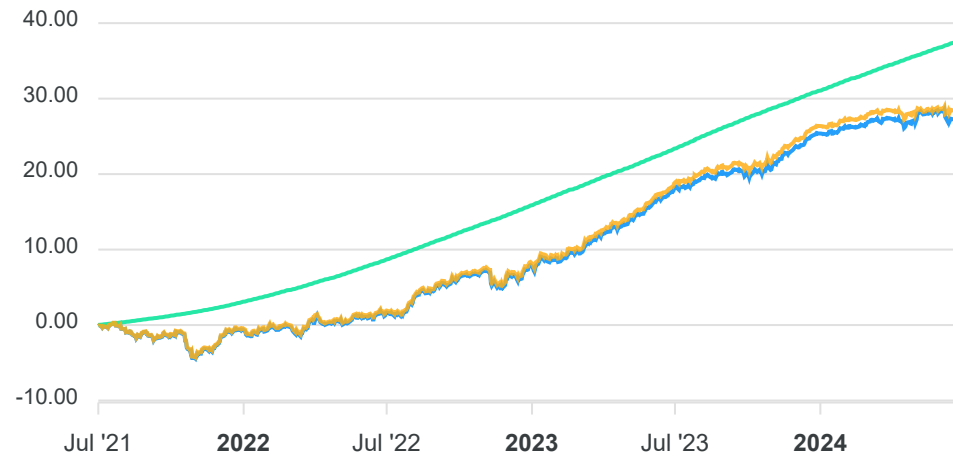
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IRF-M
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

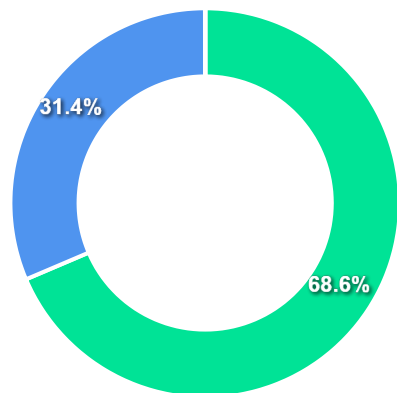
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,32%	1,37%	-0,24%	1,37%	7,50%	25,10%	1,71%	3,59%
Benchmark	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.749.567,10	68.63%
Operação compromissada	800.755,04	31.41%
Valores a pagar/receber	434,93	0.02%
Outros	-555,46	-0.02%
Derivativos	-822,88	-0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/12/2030	800.755,04	31,41	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2027	204.033,77	8,00	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026	193.001,70	7,57	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	168.861,64	6,62	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2026	131.573,89	5,16	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	120.641,61	4,73	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2025	114.042,75	4,47	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2027	91.217,93	3,58	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	86.253,77	3,38	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026	86.250,06	3,38	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2029	85.976,41	3,37	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2030	81.283,61	3,19	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2031	70.077,26	2,75	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2026	69.199,00	2,71	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2028	56.086,90	2,20	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2029	40.978,90	1,61	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2033	40.625,64	1,59	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2035	31.369,33	1,23	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2026	30.664,20	1,20	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2032	19.935,26	0,78	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2028	12.685,66	0,50	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2027	8.163,80	0,32	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2029	4.337,00	0,17	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2027	2.307,00	0,09	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	470,86	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	20,40	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	7,31	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO BRADESCO S.A.
Gestão BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 95
Patrimônio Líquido Fundo 493.224.578,38

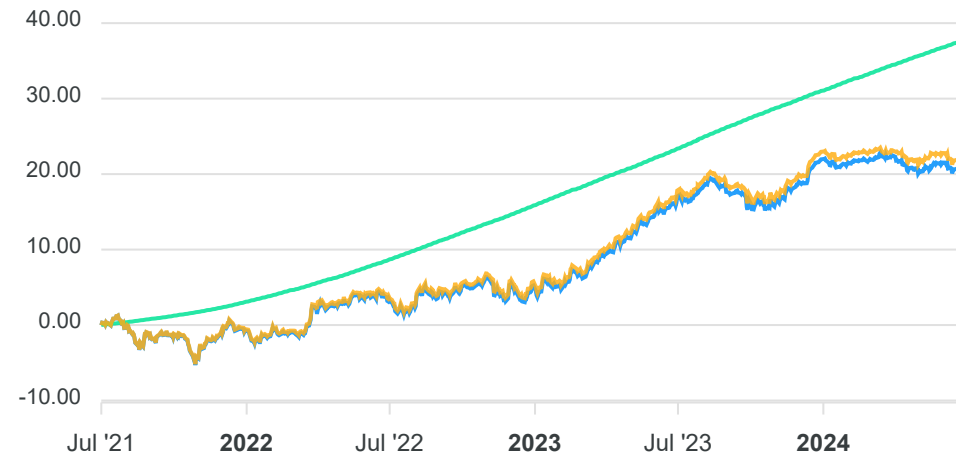
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento Aplica seus recursos, através de outros fundos, em oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

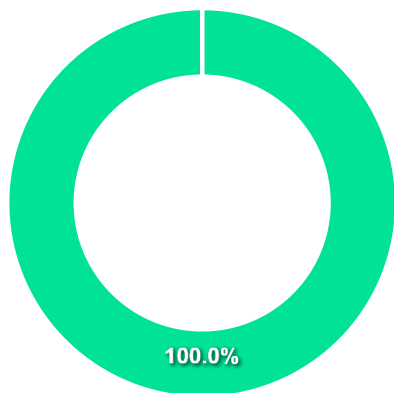
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,00%	-1,26%	-1,36%	-1,26%	2,73%	16,27%	1,89%	3,99%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de Fundos / BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI FINANCEIR...	271.012,56	100,01	Outros
Outros Valores a receber	13,98	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-57,40	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	271.012,56	100.01%
Valores a pagar/receber	-33,43	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
308

Patrimônio Líquido Fundo
4.038.072.337,63

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

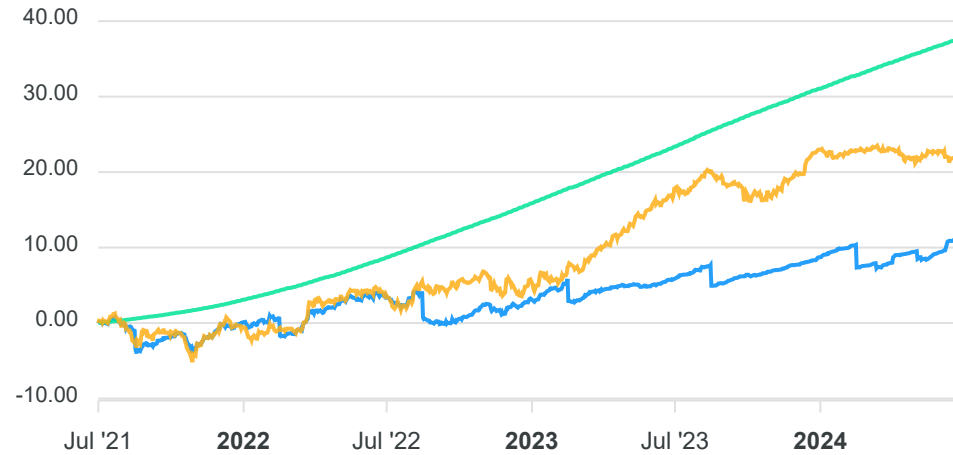
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em um único ativo, uma NTN-B com vencimento em 2024.

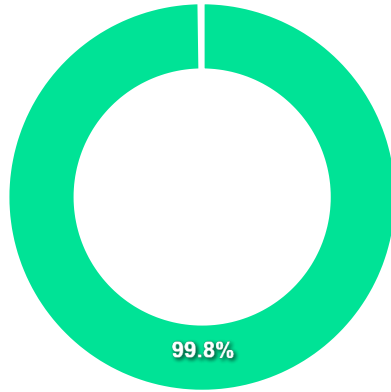
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	2,79%	2,86%	2,79%	5,45%	7,72%	0,48%	1,02%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	4.068.361,17	99,78	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2028	9.205,59	0,23	Operação compromissada
Outros Valores a receber	23,85	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,79	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-153,58	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.068.361,17	99.78%
Operação compromissada	9.205,59	0.23%
Valores a pagar/receber	-118,94	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
903

Patrimônio Líquido Fundo
7.303.046.549,52

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5

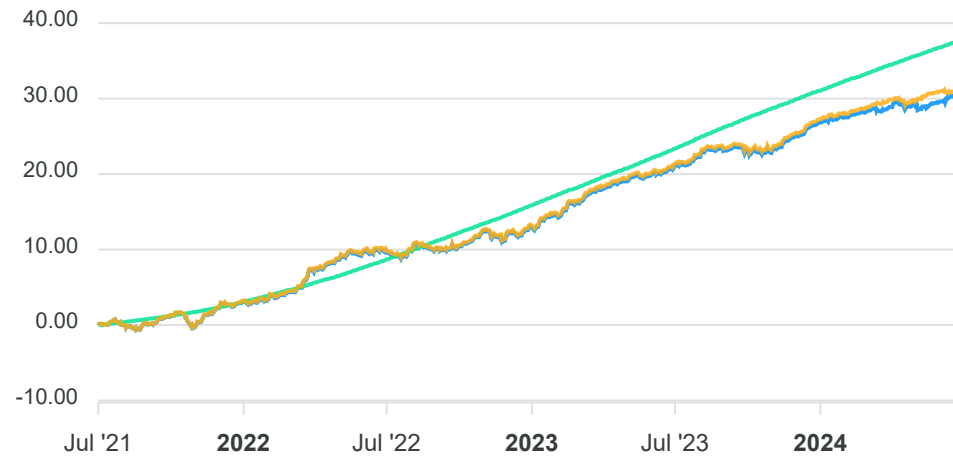
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

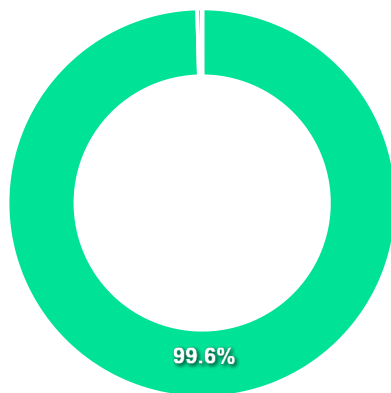
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,37%	3,21%	1,18%	3,21%	8,00%	18,98%	0,81%	1,71%
Benchmark	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.566.546,65	27,75	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	1.494.202,09	26,46	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	1.336.082,77	23,66	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	870.425,70	15,42	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029	333.510,32	5,91	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	22.554,72	0,40	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2026	12.800,06	0,23	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030	8.580,72	0,15	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.707,60	0,03	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	54,28	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	19,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-301,28	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.623.855,91	99.60%
Operação compromissada	22.554,72	0.40%
Valores a pagar/receber	-227,04	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
753

Patrimônio Líquido Fundo
4.133.113.700,82

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

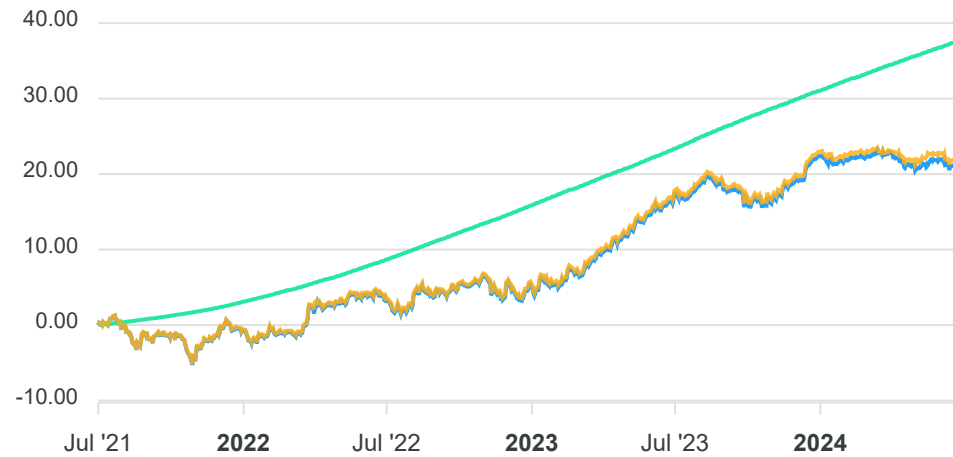
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B.

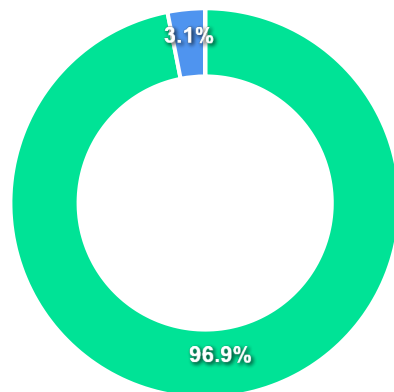
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,00%	-1,22%	-1,35%	-1,22%	2,87%	16,57%	1,90%	4,00%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.207.960,11	96.90%
Operação compromissada	70.760,70	3.11%
Valores a pagar/receber	-111,38	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	277.337,83	12,17	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	269.460,88	11,83	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	240.946,10	10,57	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	229.576,19	10,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	218.812,02	9,60	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	187.323,34	8,22	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	156.971,26	6,89	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	145.603,68	6,39	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	136.089,21	5,97	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	117.492,34	5,16	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	101.577,16	4,46	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2025	70.760,70	3,11	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	64.933,67	2,85	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029	60.146,08	2,64	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.690,35	0,07	Títulos Federais
Outros Valores a receber	19,96	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,49	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-141,82	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
235

Patrimônio Líquido Fundo
963.696.117,89

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IRF-M 1+

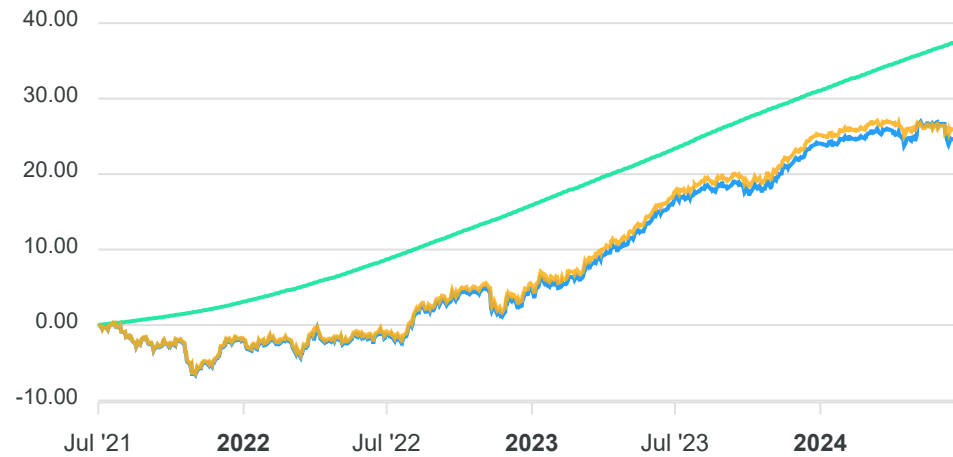
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré e/ou pós-fixadas.

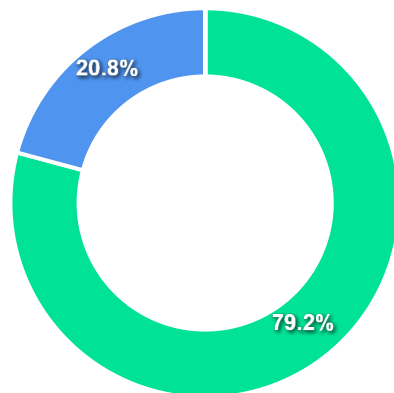
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,75%	0,08%	-1,20%	0,08%	6,33%	25,74%	2,38%	5,02%
Benchmark	-0,72%	0,22%	-1,14%	0,22%	6,61%	26,65%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	447.208,06	79.24%
Operação compromissada	117.657,52	20.85%
Outros	-59,31	-0.01%
Derivativos	-168,77	-0.03%
Valores a pagar/receber	-241,66	-0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	117.657,52	20,84	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2028	86.070,85	15,24	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	64.407,08	11,41	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2031	60.910,45	10,79	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2027	44.419,16	7,87	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2035	41.027,78	7,27	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2030	36.577,63	6,48	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2028	28.417,36	5,03	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2033	27.979,45	4,96	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2032	23.479,31	4,16	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2029	19.828,50	3,51	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2029	8.590,00	1,52	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030	3.432,29	0,61	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	2.068,20	0,37	Títulos Federais
Outros Valores a receber	14,28	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,62	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF30	3,68	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas / Bolsa Mercadoria Futu...	1,88	0,00	Outros
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	0,00	0,00	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-0,61	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-0,95	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF28	-2,63	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-3,15	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-3,62	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-3,72	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	-5,61	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31	-6,01	0,00	Derivativos

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
Taxa de Administração 0,18%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 53
Patrimônio Líquido Fundo 340.562.033,85

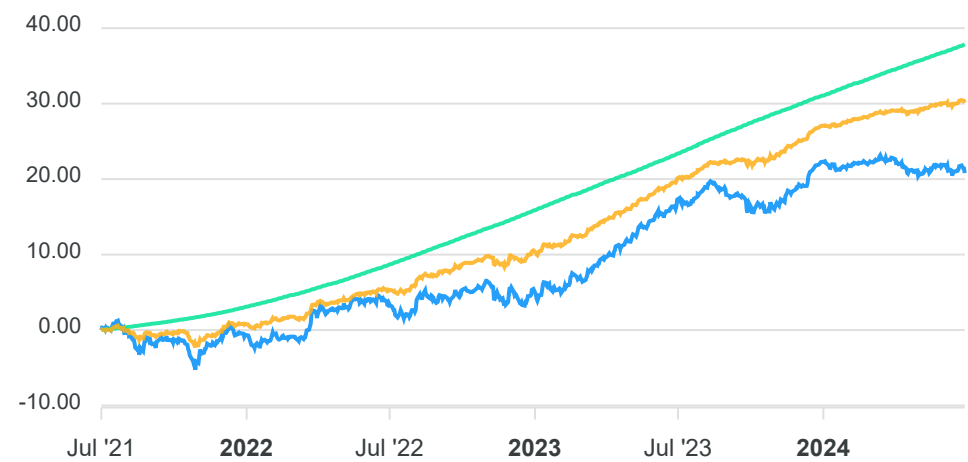
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA Geral
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa, os quais apliquem, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos.

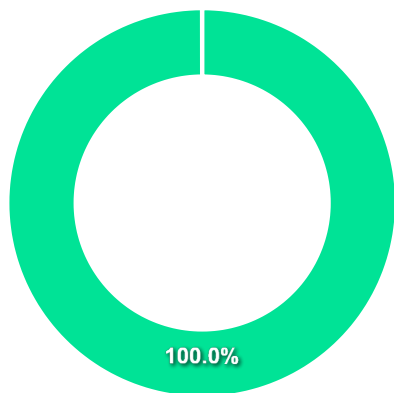
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,98%	-1,20%	-1,32%	-1,20%	2,85%	16,48%	1,89%	3,98%
Benchmark	0,05%	2,42%	0,77%	2,42%	8,23%	23,40%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de Fundos / ITAÚ RENDA FIXA IMAB FIF RESP LIMITADA	265.194,21	99,76	Outros
Cotas de Fundos / ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	589,08	0,22	Outros
Outras Disponibilidades	100,00	0,04	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	10,74	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-50,26	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	265.783,29	99.98%
Valores a pagar/receber	60,48	0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 1,00%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 1.007
Patrimônio Líquido Fundo 5.048.562.747,13

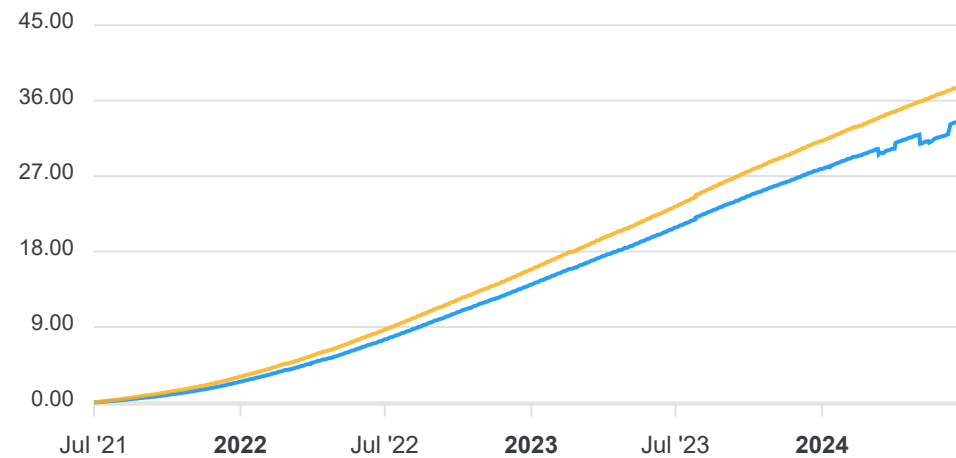
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark CDI
Classificação ANBIMA Renda Fixa Simples
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em fundos de investimento os quais investem, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

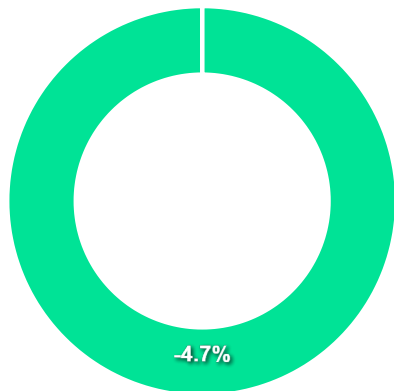
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,01%
Benchmark	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Outros Valores a receber	20,66	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	18,90	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IOF_a_recolher	18,03	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,65	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR_a_recolher	0,85	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Cetip	-32,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	-69,32	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-178,19	0,00	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Valores a pagar/receber	10,20	-4.67%
Outros	-228,62	104.67%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.011

Patrimônio Líquido Fundo
16.508.104.382,05

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

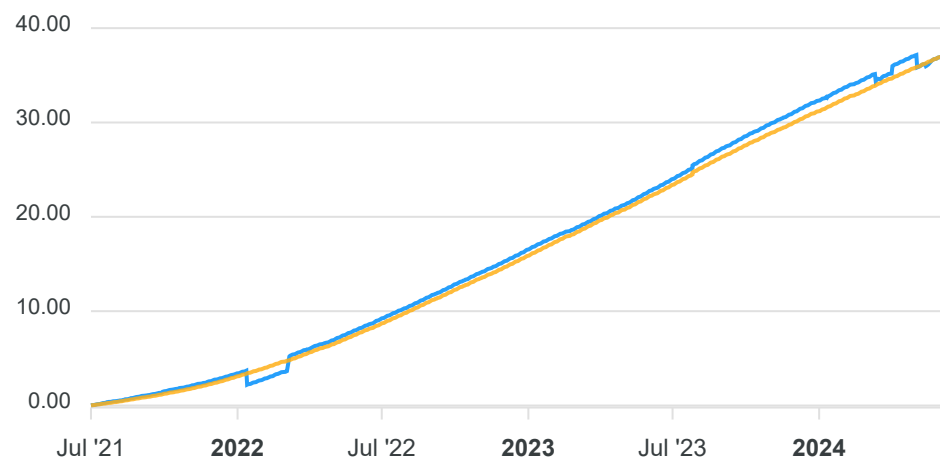
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em ativos financeiros que sejam considerados de baixo risco de crédito e classificados por agência de risco registrada na CVM.

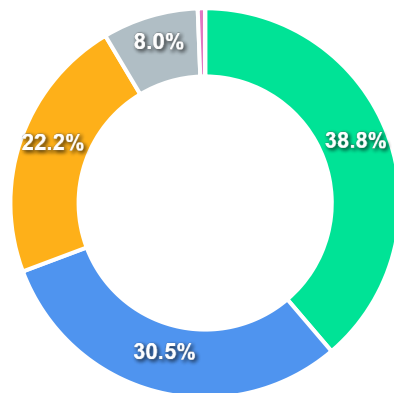
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,04%
Benchmark	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Privados	9.716.180,20	38.77%
Operação compromissada	7.649.300,74	30.52%
Títulos Federais	5.551.875,93	22.15%
Debêntures	1.992.597,80	7.95%
Outros	150.689,68	0.60%
Valores a pagar/receber	3.243,60	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2027	7.649.300,74	30,52	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2027	1.913.631,26	7,64	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	1.353.398,81	5,40	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028	818.801,91	3,27	Títulos Federais
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	718.989,19	2,87	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2026	655.528,66	2,62	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	505.945,61	2,02	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	495.391,92	1,98	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-9...	495.339,17	1,98	Títulos Privados
Letra Financeira - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305...	419.953,84	1,68	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2026	412.275,30	1,64	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	394.889,01	1,58	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) -...	360.628,01	1,44	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	334.082,66	1,33	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001...	331.699,88	1,32	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Ve...	317.890,92	1,27	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	306.097,22	1,22	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2028	279.592,55	1,12	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	268.404,24	1,07	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	259.567,91	1,04	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Ve...	238.437,00	0,95	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	226.382,36	0,90	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	226.095,54	0,90	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-9...	139.243,94	0,56	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) -...	133.121,32	0,53	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	131.857,27	0,53	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	128.748,10	0,51	Títulos Privados

Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
Taxa de Administração 0,18%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 407
Patrimônio Líquido Fundo 5.723.870.469,63

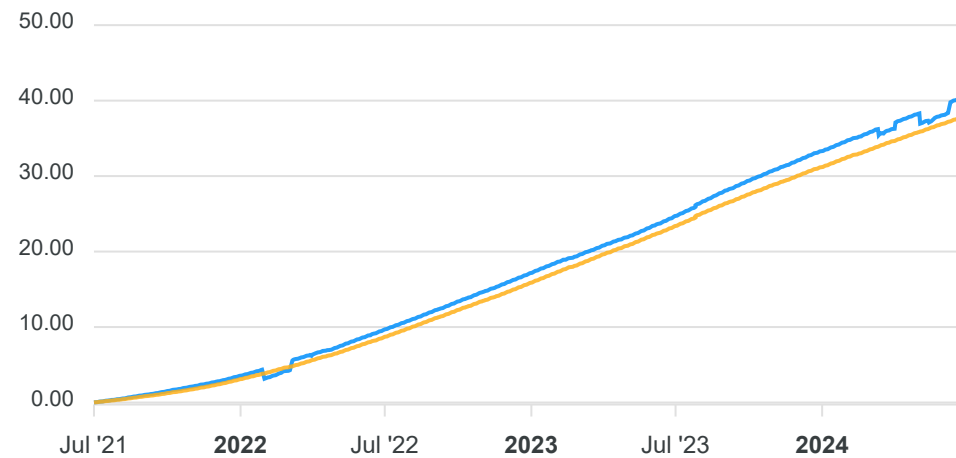
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark CDI
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em títulos da dívida pública federal, ativos financeiros de renda fixa considerados de baixo risco de crédito ou em cotas de fundos de índice que invistam nos ativos anteriormente mencionados.

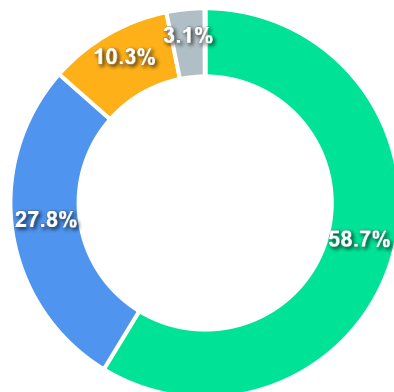
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,83%	5,49%	2,62%	5,49%	12,54%	27,99%	0,02%	0,04%
Benchmark	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	4.552.281,78	58.72%
Títulos Privados	2.154.554,10	27.79%
Debêntures	798.874,88	10.31%
Títulos Federais	243.417,22	3.14%
Outros	4.358,31	0.06%
Derivativos	64,80	0.00%
Valores a pagar/receber	-1.266,61	-0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2028	4.044.181,88	52,17	Operação compromissada
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2027	508.099,90	6,55	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2027	169.245,29	2,18	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	115.875,03	1,49	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	105.446,62	1,36	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-9...	100.538,91	1,30	Títulos Privados
Letra Financeira - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305...	77.837,92	1,00	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - ...	74.460,92	0,96	Títulos Privados
Letra Financeira - CONCÓRDIA BANCO S.A. (10.264.663/0001-7...	71.212,25	0,92	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	67.241,26	0,87	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	56.923,47	0,73	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO RCI BRASIL S.A. (62.307.848/0001-...	46.349,48	0,60	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2028	39.576,85	0,51	Títulos Federais
Debênture Simples - CHSF24	39.410,74	0,51	Debêntures
CDB/ RDB - GOLDMAN SACHS DO BRASIL S.A. (04.332.281/0001-3...	39.337,93	0,51	Títulos Privados
Debênture Simples - ENGI A8	37.376,72	0,48	Debêntures
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	35.316,35	0,46	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	35.260,26	0,45	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO CITIBANK S.A. (33.479.023/0001-80...	34.964,58	0,45	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2027	34.595,08	0,45	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	34.207,29	0,44	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	33.641,52	0,43	Títulos Privados
Debênture Simples - BSA318	32.531,64	0,42	Debêntures
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	31.893,27	0,41	Títulos Privados
Debênture Simples - CIEL16	31.789,27	0,41	Debêntures
Letra Financeira - BANCO VOLKSWAGEN S.A. (59.109.165/0001-...	30.609,80	0,39	Títulos Privados
Debênture Simples - ENEVA3	29.677,97	0,38	Debêntures

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	1.088
Patrimônio Líquido Fundo	649.126.137,40

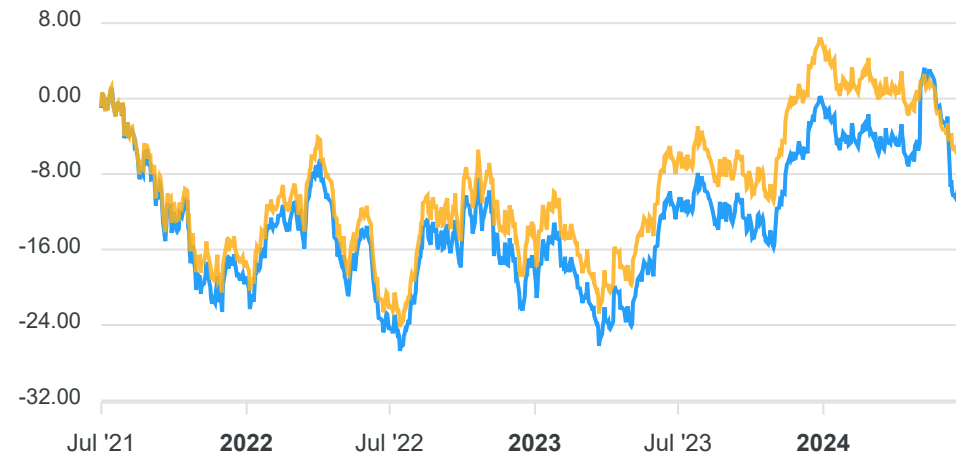
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Sustentabilidade/Governança
Política de Investimento	Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

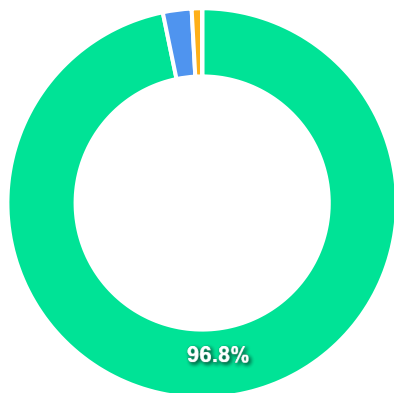
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,55%	-6,94%	-2,88%	-6,94%	5,04%	22,95%	5,95%	12,53%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	597.320,62	96.77%
Operação compromissada	14.699,34	2.38%
Valores a pagar/receber	5.336,76	0.86%
Outros	-98,10	-0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	51.087,83	8,28	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	35.902,71	5,82	Ações
VALE ON N1 - VALE3	32.894,22	5,33	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	25.616,58	4,15	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	25.137,89	4,07	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	23.020,31	3,73	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	22.616,44	3,66	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	17.843,20	2,89	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	16.280,79	2,64	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	15.827,64	2,56	Ações
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/12/2030	14.699,34	2,38	Operação compromissada
JBS ON NM - JBSS3	12.425,16	2,01	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3	12.257,88	1,99	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	12.132,83	1,97	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	11.688,49	1,89	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	11.099,38	1,80	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - WEGE3	10.267,29	1,66	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EMBR3	8.729,62	1,41	Ações
B3 ON NM - B3SA3	8.182,87	1,33	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	8.115,24	1,31	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RENT3	7.119,76	1,15	Ações
ENEVA ON NM - ENEV3	6.454,14	1,05	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	6.331,69	1,03	Ações
WEG ON NM - WEGE3	6.299,18	1,02	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	5.757,73	0,93	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	5.720,10	0,93	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	5.612,97	0,91	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+25

Quantidade de Cotistas
864

Patrimônio Líquido Fundo
547.635.436,93

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de ações geridos por gestores distintos.

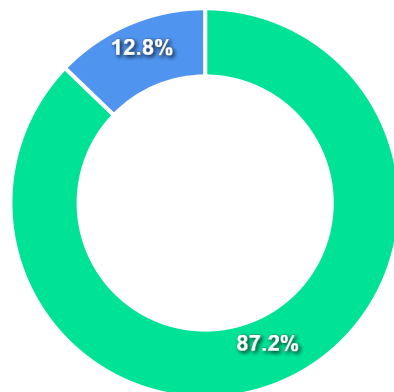
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,00%	-9,38%	-6,70%	-9,38%	-1,76%	13,42%	6,71%	14,12%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Outros Valores a receber	36.167,13	10,61	Valores a pagar/receber
Cotas de Fundos / NAVI INSTITUCIONAL II FI FINANCEIRO - CI...	34.334,21	10,07	Outros
Cotas de Fundos / REAL INVESTOR INSTITUCIONAL FIC DE FI FI...	31.322,99	9,19	Outros
Cotas de Fundos / GUEPARDO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIM...	31.101,37	9,12	Outros
Cotas de Fundos / CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIME...	29.956,22	8,79	Outros
Cotas de Fundos / SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FIF DE ...	27.130,08	7,96	Outros
Cotas de Fundos / OCCAM FI FINANCEIRO - CIC EM AÇÕES - RES...	24.383,31	7,15	Outros
Cotas de Fundos / AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTI...	22.233,01	6,52	Outros
Cotas de Fundos / ALASKA INSTITUCIONAL LONG ONLY FUNDO DE ...	19.200,86	5,63	Outros
Cotas de Fundos / TRÍGONO DELPHOS INCOME FUNDO DE INVESTIM...	16.287,71	4,78	Outros
Cotas de Fundos / MOAT CAIXA AÇÕES FIF CIC EM AÇÕES RESPON...	7.447,41	2,18	Outros
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-441,04	-0,13	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	243.397,18	87.20%
Valores a pagar/receber	35.726,09	12.80%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
0,70%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
448

Patrimônio Líquido Fundo
2.736.870.167,13

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
Global BDRX

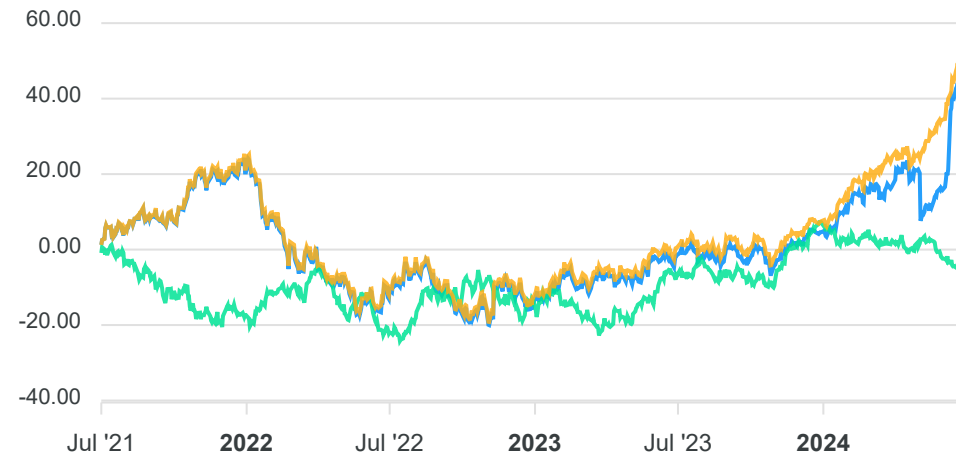
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.

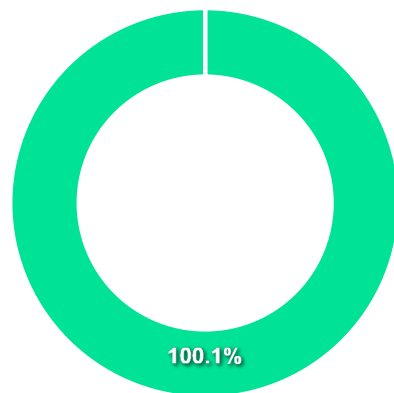
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	12,73%	39,52%	21,34%	39,52%	52,18%	72,57%	8,26%	17,39%
Benchmark	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%		
IBOVESPA	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depository Receipts	797.108,11	100.14%
Valores a pagar/receber	-1.095,45	-0.14%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Brazilian Depository Receipt - BDR - NVDC34	256.808,43	10,92	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - TSMC34	72.124,23	3,07	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - TSLA34	64.769,83	2,75	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - WALM34	46.563,01	1,98	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - ORCL34	39.435,69	1,68	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - NFLX34	30.711,40	1,31	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - PGC034	22.456,05	0,96	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - P2LT34	21.323,60	0,91	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - TMC034	18.363,56	0,78	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - UNHH34	16.716,54	0,71	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - WFC034	15.734,37	0,67	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - SSFO34	14.341,78	0,61	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - MCDC34	13.454,74	0,57	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - U1BE34	11.839,35	0,50	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - TMOS34	11.183,43	0,48	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - VERZ34	11.070,08	0,47	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - P1DD34	10.224,53	0,43	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - S2HO34	10.210,68	0,43	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - SNEC34	10.175,15	0,43	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - QCOM34	10.058,33	0,43	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - ULEV34	9.122,76	0,39	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - NEXT34	8.978,67	0,38	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - PFIZ34	8.625,08	0,37	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - S1PO34	8.612,63	0,37	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - P2AN34	7.383,40	0,31	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - P1LD34	6.231,03	0,27	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - S2EA34	5.979,44	0,25	Brazilian Depository Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁROS LTDA

Gestão
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS SA

Taxa de Administração
0,28%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
67.899

Patrimônio Líquido Fundo
1.651.667.837,50

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 11º

Benchmark
IFIX

Classificação ANBIMA
FII Renda Gestão Passiva

Política de Investimento
Investimento de longo prazo em empreendimentos imobiliários comerciais. Os recursos temporariamente não aplicados em imóveis serão investidos em LCI, CRI, LH, títulos de renda fixa e cotas de fundos de renda fixa.

COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,24%	6,04%	-2,94%	6,04%	4,84%	29,28%	5,93%	12,50%
Benchmark	-1,04%	1,08%	-1,78%	1,08%	6,09%	19,73%		
IBOVESPA	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Imóveis / Imóveis para Renda (acabado) AV. AFONSO PENA, 7...	0,00	0,00	Outros
Imóveis / Imóveis para Renda (acabado) AV.BERNARDINO DE C...	0,00	0,00	Outros
Imóveis / Imóveis para Renda (acabado) AV.PENHA DE FRANCA...	0,00	0,00	Outros
Imóveis / Imóveis para Renda (acabado) R.ESPIRITO SANTO,5...	0,00	0,00	Outros
Imóveis / Imóveis para Renda (acabado) R.PINHEIROS,1492	0,00	0,00	Outros
Imóveis / Imóveis para Renda (acabado) R.VOLUNTARIOS DE S...	0,00	0,00	Outros
Imóveis / Imóveis para Renda (acabado) RUA MORAIS BARROS,...	0,00	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Administração	-324,55	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-324,55	100.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
1,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
2.112

Patrimônio Líquido Fundo
129.212.320,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 11º

Benchmark
IFIX

Classificação ANBIMA
FII TVM Gestão Ativa

Política de Investimento
Investir predominantemente em cotas de FII, buscando deter pelo menos 5% dos fundos em que investir, de modo a poder convocar e ter maior representatividade nas assembleias gerais de cotistas. Pode aplicar ainda em outros ativos permitidos a FII.

COMPARATIVO

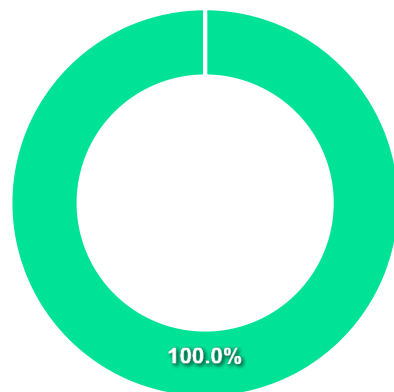
📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,61%	2,37%	2,19%	2,37%	4,22%	29,58%	9,73%	20,49%
Benchmark	-1,04%	1,08%	-1,78%	1,08%	6,09%	19,73%		
IBOVESPA	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BRESCO LOGÍSTICA RESP LIMITADA FII - BRCO11	3.687,18	2,88	Fundos de Investimento
Cotas de TELLUS PROPERTIES RESP LIMITADA FII - TEPP11	1.803,22	1,41	Fundos de Investimento
Cotas FI RENDA FIXA	0,00	0,00	Fundos de Investimento



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.490,40	100.00%

