

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 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	11.028.796,01	10,69%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.899.964,53	1,84%	6.543.333.888,45	0,03%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	550.504,49	0,53%	4.649.802.742,18	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	802.955,61	0,78%	1.235.978.037,25	0,06%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.369.949,69	2,30%	218.215.436,00	1,09%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.455.104,28	1,41%	4.858.229.912,84	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	771.091,52	0,75%	4.585.046.250,25	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.744.793,86	1,69%	7.303.046.549,52	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.342.967,39	12,93%	4.133.113.700,82	0,32%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.234.154,56	7,01%	7.877.165.450,51	0,09%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.478,86	0,04%	11.312.134.510,29	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.114.959,71	3,02%	2.052.875.038,41	0,15%	7º I b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	803.189,71	0,78%	285.872.986,61	0,28%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.456.993,07	15,95%	683.118.622,81	2,41%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	17.944.782,81	17,40%	11.531.124.110,68	0,16%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.692.415,90	1,64%	126.491.485,84	1,34%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.305.465,20	1,27%	1.103.980.003,66	0,12%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.026,95	0,00%	2.969.679.625,74	0,00%	7º III a
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	766.109,47	0,74%	0,00		7º IV
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	766.017,89	0,74%	0,00		7º IV
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.665.726,46	1,61%	649.126.137,40	0,26%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.822.031,22	2,74%	234.298.636,37	1,20%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.752.762,76	1,70%	305.744.233,44	0,57%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	880.922,34	0,85%	1.551.287.563,93	0,06%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.208.507,54	3,11%	547.635.436,93	0,59%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.208.918,86	2,14%	244.733.368,12	0,90%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.207.374,03	1,17%	1.394.601.606,31	0,09%	8º I

Investimentos

\$ 103.155.683,46

Disponibilidades Financeiras

\$ 287.598,94

Total Carteira

\$ 103.443.282,40

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.739.799,06	1,69%	1.361.249.331,92	0,13%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	741.070,42	0,72%	115.388.111,59	0,64%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	324.576,78	0,31%	140.124.940,46	0,23%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	209.152,24	0,20%	65.268.360,89	0,32%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.305.120,24	2,23%	2.736.870.167,13	0,08%	9º III

Investimentos

 103.155.683,46

Disponibilidades Financeiras

 287.598,94

Total Carteira

 103.443.282,40

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.610,504923	133.704,64
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.804,560815	96.091,22
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.988,985651	244.460,30
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	5.158,9682	753.209,36
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.967,201939	1.743.487,88
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	5.027,94804	362.012,26
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.448,144728	664.673,66
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.402,777386	383.597,19
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	5.306,372323	774.730,36
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	5.241,111396	644.656,70
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	5.277,221411	643.821,01
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	5.205,370815	645.465,98
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	5.269,970197	774.685,62
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.494,074811	16.482,22
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.643,321809	107.223,11
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	5.169,991076	356.729,38
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.486,336473	130.103,76
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	5.188,256575	1.862.584,11
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	5.157,29286	691.077,24

Investimentos

\$ 103.155.683,46

Disponibilidades Financeiras

\$ 287.598,94

Total Carteira

\$ 103.443.282,40

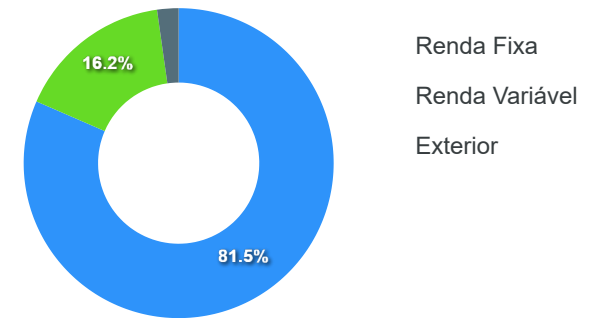
Governança (Pró Gestão)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	10,66%	11.028.796,01 89,34%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	32,99%	34.128.114,21 67,01%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	36,16%	37.400.683,93 23,84%
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	1,48%	1.532.127,36 18,52%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	16,20%	16.760.841,71 13,80%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,23%	2.305.120,24 7,77%

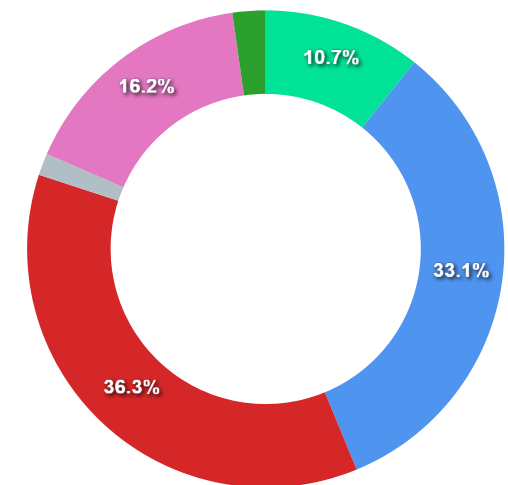
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

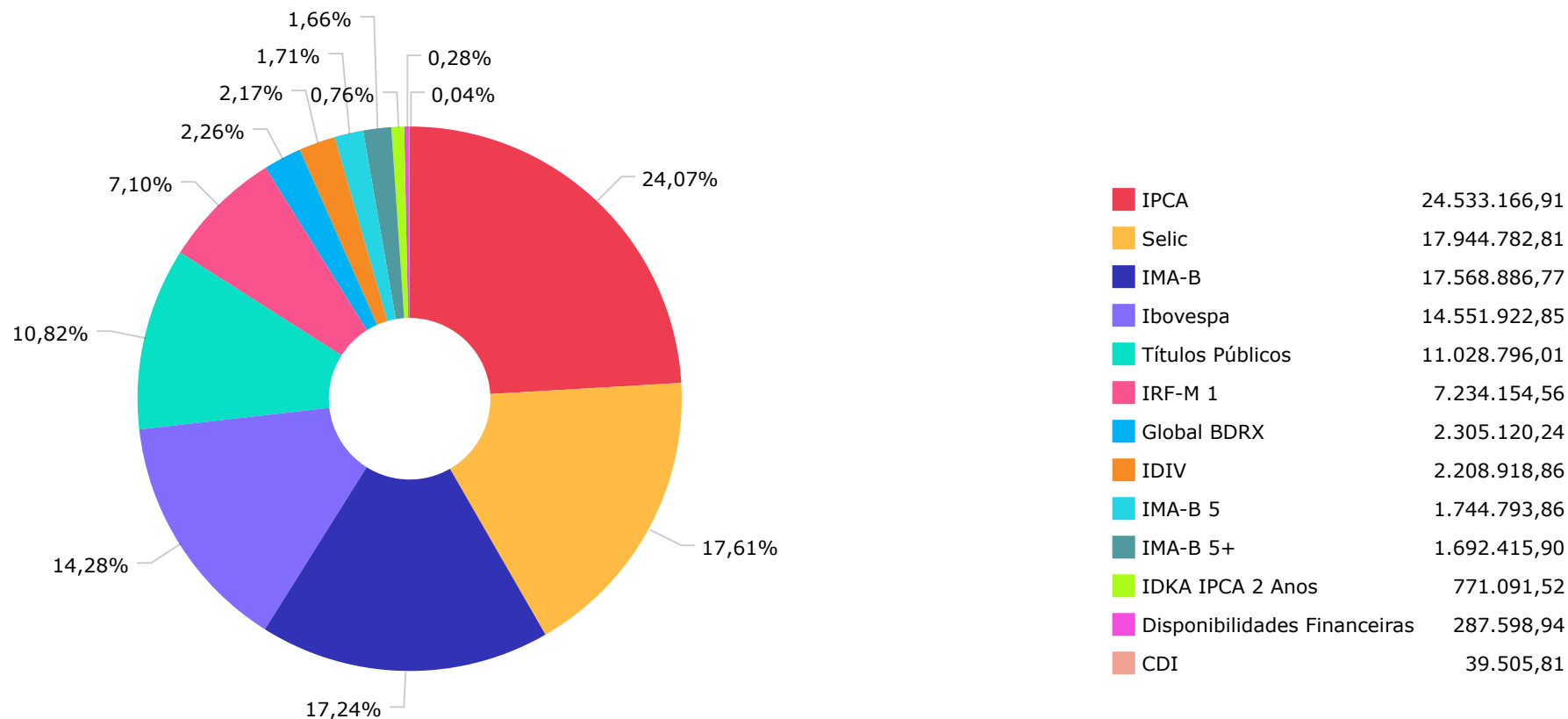


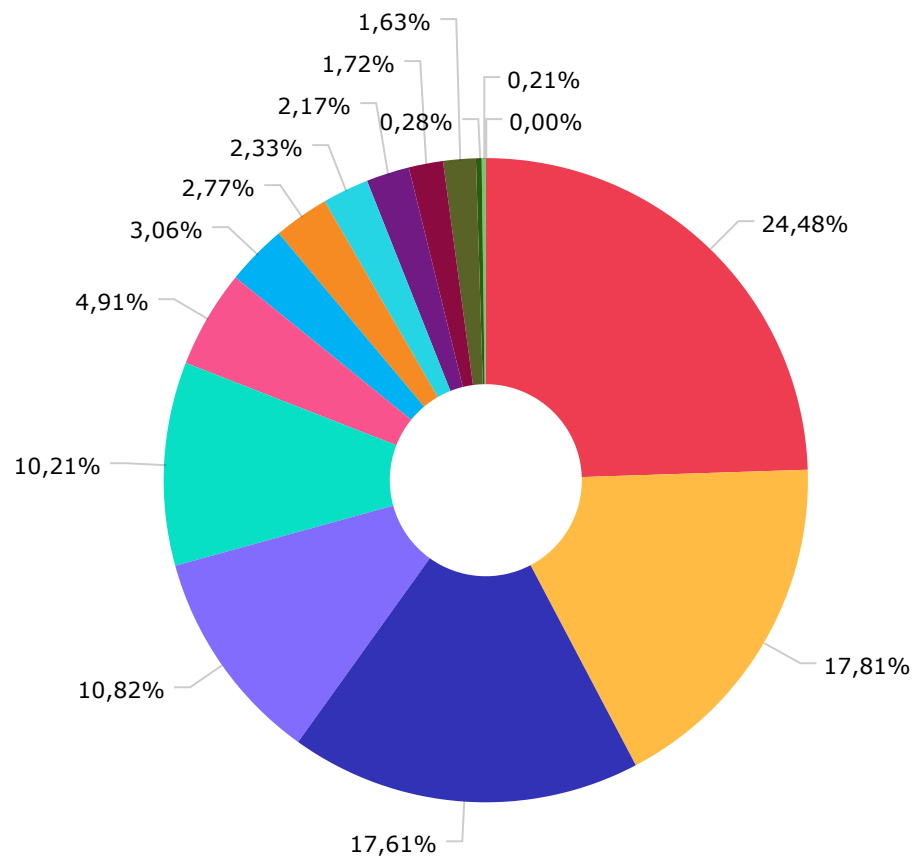
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	10,66%	0,00%	12,00%	100,00%	92.414.486,39
7º I b - FI 100% Títulos TN	32,99%	0,00%	24,00%	100,00%	69.315.168,19
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	103.443.282,40
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.172.164,12
7º III a - FI Referenciados RF	36,16%	0,00%	33,00%	60,00%	24.665.285,51
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	62.065.969,44
7º IV - Ativos Financeiros de ...	1,48%	0,00%	1,00%	20,00%	19.156.529,12
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.172.164,12
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.172.164,12
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.172.164,12

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	16,20%	0,00%	20,00%	30,00%	14.272.143,01
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	31.032.984,72
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	10.344.328,24
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	10.344.328,24
9º III - Ações - BDR Nível I	2,23%	0,00%	2,00%	10,00%	8.039.208,00
10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	10.344.328,24
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.172.164,12
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.172.164,12
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.172.164,12
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.172.164,12

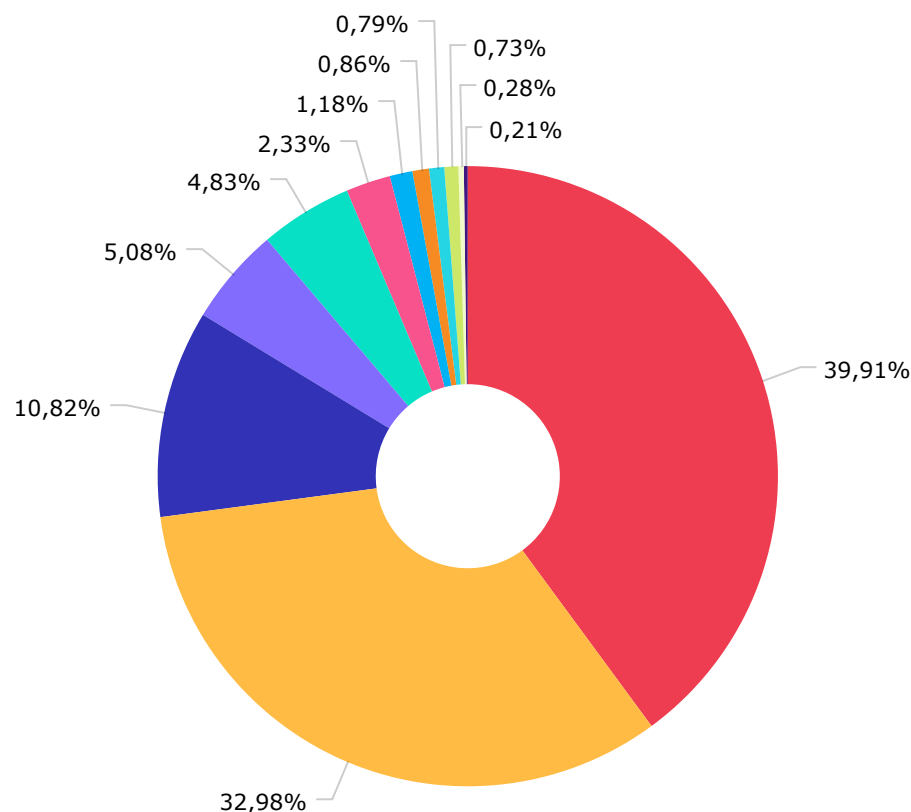
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82		
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,82	5,48	2,62	5,48	12,39	27,67	0,03	0,07
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78	5,00	2,39	5,00	11,34	26,39	0,05	0,10
GLOBAL 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		
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,80	-0,81	-2,22	-0,81	12,30	27,30	5,15	10,84
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1,55	-6,94	-2,88	-6,94	5,04	22,95	5,95	12,53
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1,53	-7,74	-3,29	-7,74	4,89	25,82	5,86	12,35
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	1,37	-8,14	-4,98	-8,14	2,05	20,33	5,93	12,49
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1,00	-9,38	-6,70	-9,38	-1,76	13,42	6,71	14,12
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,15	-9,73	-9,00	-9,73	-1,98	14,83	6,95	14,64
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	0,82	-10,10	-7,39	-10,10	-3,02	12,38	6,84	14,41
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,26	-9,75	-8,25	-9,75	-3,49	12,92	6,60	13,90
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-0,13	-13,33	-10,63	-13,33	-7,64	10,00	7,28	15,33
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,02	-14,97	-10,08	-14,97	-12,10	-7,28	7,10	14,95
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	11,05
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	2,07
IMA-B - BENCHMARK	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01		
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,86	-0,98	-1,08	-0,98	3,37	17,08	1,75	3,69

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
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
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-1,08	-1,30	-1,50	-1,30	2,86	16,46	2,01	4,23
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
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
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-2,31	-5,26	-3,72	-5,26	-1,83	13,90	3,06	6,44
IPCA - BENCHMARK	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38	3,84	1,40	3,84	9,79	25,12	0,47	1,00
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,17	2,36	0,55	2,36	7,39	23,06	0,88	1,85
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,16	2,02	0,65	2,02	7,36	21,17	0,81	1,71
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20	1,81	0,27	1,81	7,18	22,58	1,24	2,60
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20	1,91	0,31	1,91	7,05	20,92	1,64	3,45
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02	1,97	0,22	1,97	6,11	17,70	1,37	2,88
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61	4,48	1,97	4,48	10,79	25,84	0,25	0,52
SELIC - BENCHMARK	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82		
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,78	5,10	2,47	5,10	11,39	26,18	0,01	0,02

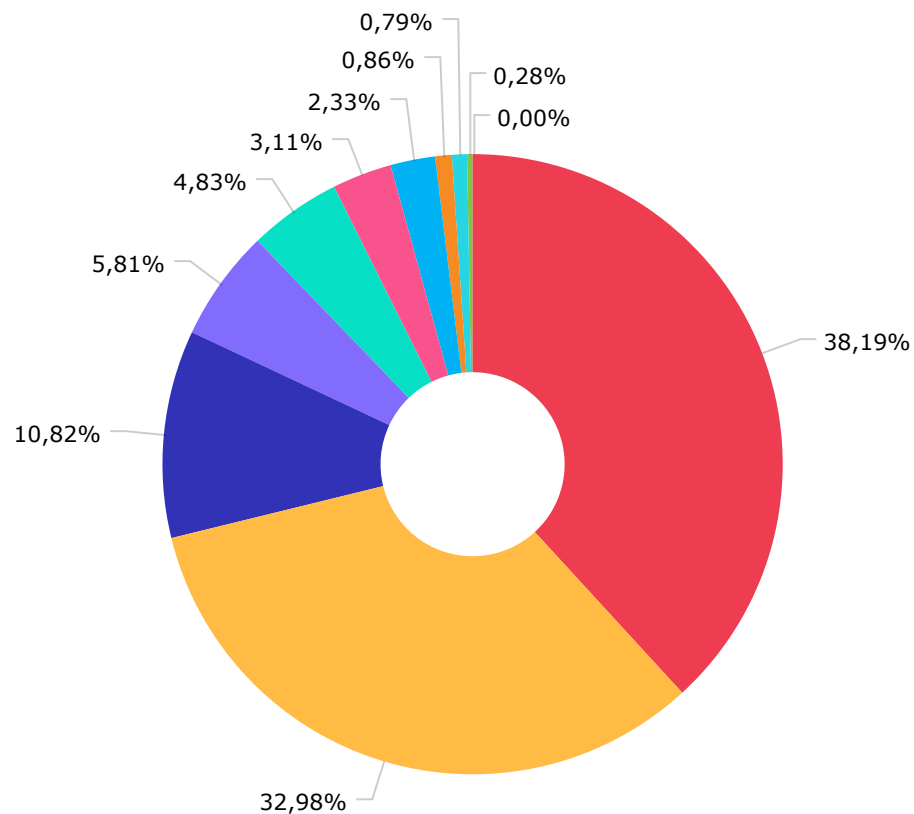




Renda Fixa Indexados	24.948.977,02
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	18.149.408,97
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	17.944.782,81
Títulos Públicos	11.028.796,01
Ações Livre	10.407.370,41
Renda Fixa Duração Livre Soberano	4.999.692,99
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	3.114.959,71
Ações Indexados	2.822.031,22
Renda Fixa Duração Alta Soberano	2.369.949,69
Ações Dividendos	2.208.918,86
Ações Índice Ativo	1.752.762,76
Ações Sustentabilidade/Governança	1.665.726,46
Disponibilidades Financeiras	287.598,94
Ações Valor/Crescimento	209.152,24
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	1.026,95



BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	40.668.985,76
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.614.602,31
TESOURO NACIONAL	11.028.796,01
ITAU UNIBANCO S.A.	5.179.335,55
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	4.919.151,09
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S....	2.369.949,69
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.207.374,03
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	880.922,34
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	804.216,66
ITAÚ DTVM S.A.	741.070,42
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	287.598,94
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	209.152,24



BANCO BRADESCO S.A.	38.916.223,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.614.602,31
TESOURO NACIONAL	11.028.796,01
ITAU UNIBANCO S.A.	5.920.405,97
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	4.919.151,09
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	3.169.289,03
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA...	2.369.949,69
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	880.922,34
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	803.189,71
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	287.598,94
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TIT...	1.026,95

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	95.999.136,54	1.530.719,12	81.000,00	97.025.811,90	-423.043,76	-423.043,76	-0,43% ▼	-0,43%	0,85%	0,85%	-50,59%	2,35%
Fevereiro	97.025.811,90	855.842,25	68.000,00	98.905.748,95	1.092.094,80	669.051,04	1,12% ▲	0,68%	1,20%	2,06%	33,01%	2,30%
Março	98.905.748,95	18.537.508,23	17.324.999,23	100.722.697,45	604.439,50	1.273.490,54	0,60% ▲	1,29%	0,55%	2,62%	49,24%	1,60%
Abril	100.722.697,45	4.446.055,88	5.087.843,25	99.279.189,39	-801.720,69	471.769,85	-0,80% ▼	0,48%	0,81%	3,45%	13,91%	1,87%
Maio	99.279.189,39	2.475.565,57	360.294,08	101.780.955,77	386.494,89	858.264,74	0,38% ▲	0,86%	0,87%	4,35%	19,77%	1,45%
Junho	101.780.955,77	1.485.329,78	627.900,00	103.155.683,46	517.297,91	1.375.562,65	0,50% ▲	1,37%	0,60%	4,98%	27,51%	1,89%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.273.490,54	1,29%	2,62%
2º Trim	102.072,11	0,08%	2,30%
1º Sem	1.375.562,65	1,37%	4,98%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

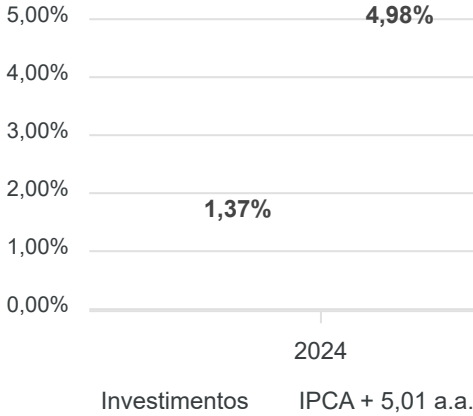
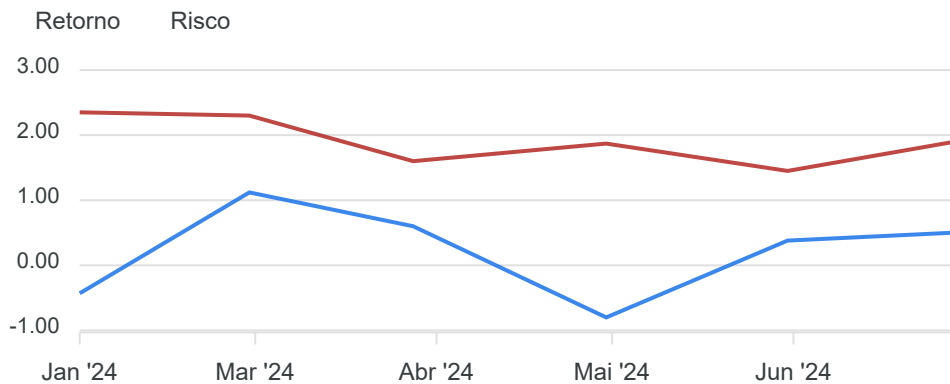
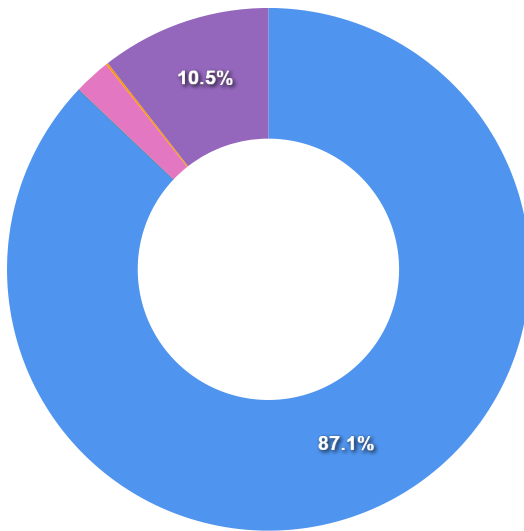


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 28/06/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	90.079.403,42	87,32
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	2.335.082,97	2,26
Até D+3600	133.704,64	0,13
Acima D+3600	10.895.091,37	10,56
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.946.421,17	0,00	0,00	11.028.796,01	82.374,84	0,75% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.892.716,53	0,00	0,00	1.899.964,53	7.248,00	0,38% ▲	0,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	555.982,35	0,00	0,00	550.504,49	-5.477,86	-0,99% ▼	1,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	803.121,01	0,00	0,00	802.955,61	-165,40	-0,02% ▼	1,37%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.390.461,63	0,00	0,00	2.369.949,69	-20.511,94	-0,86% ▼	1,75%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.490.640,69	0,00	0,00	16.456.993,07	-33.647,62	-0,20% ▼	1,24%
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	16.949.777,21	907.000,00	47.400,00	17.944.782,81	135.405,60	0,76% ▲	0,01%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.732.371,69	0,00	0,00	1.692.415,90	-39.955,79	-2,31% ▼	3,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.452.628,22	0,00	0,00	1.455.104,28	2.476,06	0,17% ▲	0,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	769.589,59	0,00	0,00	771.091,52	1.501,93	0,20% ▲	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.738.321,02	0,00	0,00	1.744.793,86	6.472,84	0,37% ▲	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.477.077,27	0,00	0,00	13.342.967,39	-134.109,88	-1,00% ▼	1,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.190.406,77	0,00	0,00	7.234.154,56	43.747,79	0,61% ▲	0,25%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.182,85	0,00	0,00	38.478,86	296,01	0,78% ▲	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.319.761,97	0,00	0,00	1.305.465,20	-14.296,77	-1,08% ▼	2,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.121.229,65	0,00	0,00	3.114.959,71	-6.269,94	-0,20% ▼	1,64%
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	753.000,00	0,00	0,00	766.109,47	13.109,47	1,74% ▲	-
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	753.000,00	0,00	0,00	766.017,89	13.017,89	1,73% ▲	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	801.913,67	0,00	0,00	803.189,71	1.276,04	0,16% ▲	0,81%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.056,10	578.329,78	580.500,00	1.026,95	1.141,07	0,20% ▲	0,03%
	83.178.659,39	1.485.329,78	627.900,00	84.089.721,51	53.632,34	0,06%	0,86%

RENDIA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.640.229,31	0,00	0,00	1.665.726,46	25.497,15	1,55% ▲	5,95%
BRANESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.779.461,85	0,00	0,00	2.822.031,22	42.569,37	1,53% ▲	5,86%
BRANESCO SELECTION FIAÇÕES	1.755.013,63	0,00	0,00	1.752.762,76	-2.250,87	-0,13% ▼	7,28%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	862.353,09	0,00	0,00	880.922,34	18.569,25	2,15% ▲	6,95%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.176.775,80	0,00	0,00	3.208.507,54	31.731,74	1,00% ▲	6,71%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.167.706,02	0,00	0,00	2.208.918,86	41.212,84	1,90% ▲	5,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.204.241,77	0,00	0,00	1.207.374,03	3.132,26	0,26% ▲	6,60%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.709.042,06	0,00	0,00	1.739.799,06	30.757,00	1,80% ▲	5,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	735.067,17	0,00	0,00	741.070,42	6.003,25	0,82% ▲	6,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	321.305,02	0,00	0,00	324.576,78	3.271,76	1,02% ▲	7,10%
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	206.329,77	0,00	0,00	209.152,24	2.822,47	1,37% ▲	5,93%
-	16.557.525,49	0,00	0,00	16.760.841,71	203.316,22	1,23%	6,20%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.044.770,89	0,00	0,00	2.305.120,24	260.349,35	12,73% ▲	8,26%
	2.044.770,89	0,00	0,00	2.305.120,24	260.349,35	12,73%	0,00%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.873.820,47	0,00	0,00	1.899.964,53	26.144,06	1,40% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	557.925,72	0,00	0,00	550.504,49	-7.421,23	-1,33% ▼
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	824.879,50	0,00	23.692,76	802.955,61	1.768,87	0,21% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIXA	2.395.810,42	0,00	0,00	2.369.949,69	-25.860,73	-1,08% ▼
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	16.412.045,33	0,00	0,00	16.456.993,07	44.947,74	0,27% ▲
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	11.632.184,25	5.978.992,38	47.400,00	17.944.782,81	381.006,18	2,16% ▲
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIXA	1.757.810,67	0,00	0,00	1.692.415,90	-65.394,77	-3,72% ▼
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	1.447.129,79	0,00	0,00	1.455.104,28	7.974,49	0,55% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	764.537,51	0,00	0,00	771.091,52	6.554,01	0,86% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	1.724.441,72	0,00	0,00	1.744.793,86	20.352,14	1,18% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	13.525.370,37	0,00	0,00	13.342.967,39	-182.402,98	-1,35% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	7.094.599,07	91,50	0,00	7.234.154,56	139.463,99	1,97% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	37.582,21	0,00	0,00	38.478,86	896,65	2,39% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.325.284,86	0,00	0,00	1.305.465,20	-19.819,66	-1,50% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	3.105.315,28	0,00	0,00	3.114.959,71	9.644,43	0,31% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	0,00	753.000,00	0,00	766.109,47	13.109,47	1,74% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	0,00	753.000,00	0,00	766.017,89	13.017,89	1,73% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIXA	798.019,15	0,00	0,00	803.189,71	5.170,56	0,65% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENTA FIXA REFERENCIADO DI	2.234,29	921.867,35	925.200,00	1.026,95	2.125,31	0,23% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.926.741,54	0,00	136.601,32	11.028.796,01	238.655,79	2,18% ▲
	76.205.732,15	8.406.951,23	1.132.894,08	84.089.721,51	609.932,21	0,73%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.715.170,37	0,00	0,00	1.665.726,46	-49.443,91	-2,88% ▼
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.918.083,08	0,00	0,00	2.822.031,22	-96.051,86	-3,29% ▼
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	1.960.826,99	0,00	0,00	1.752.762,76	-208.064,23	-10,61% ▼
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	968.044,42	0,00	0,00	880.922,34	-87.122,08	-9,00% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.438.803,59	0,00	0,00	3.208.507,54	-230.296,05	-6,70% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.206.086,06	0,00	0,00	2.208.918,86	2.832,80	0,13% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.315.998,32	0,00	0,00	1.207.374,03	-108.624,29	-8,25% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.779.290,24	0,00	0,00	1.739.799,06	-39.491,18	-2,22% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	800.241,08	0,00	0,00	741.070,42	-59.170,66	-7,39% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	360.979,00	0,00	0,00	324.576,78	-36.402,22	-10,08% ▼
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	220.111,38	0,00	0,00	209.152,24	-10.959,14	-4,98% ▼
	17.683.634,53	0,00	0,00	16.760.841,71	-922.792,82	-5,22%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.133.479,94	0,00	1.118.648,05	0,00	-14.831,89	-1,31% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.899.740,32	0,00	0,00	2.305.120,24	405.379,92	21,34% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.504.280,42	0,00	1.506.858,13	0,00	2.577,71	0,17% ▲
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	978.801,46	0,00	985.270,74	0,00	6.469,28	0,66% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.317.028,63	0,00	1.332.366,33	0,00	15.337,70	1,16% ▲
	6.833.330,77	0,00	4.943.143,25	2.305.120,24	414.932,72	6,07%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	531.291,18	1.300.000,00	0,00	1.899.964,53	68.673,35	3,75% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	557.334,31	0,00	0,00	550.504,49	-6.829,82	-1,23% ▼
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	810.695,87	0,00	23.692,76	802.955,61	15.952,50	1,97% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIXA	2.393.513,10	0,00	0,00	2.369.949,69	-23.563,41	-0,98% ▼
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	10.741.249,27	5.500.000,00	0,00	16.456.993,07	215.743,80	1,33% ▲
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	4.656.979,03	12.865.111,38	97.210,00	17.944.782,81	519.902,40	2,97% ▲
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIXA	12.944.445,43	0,00	11.000.000,00	1.692.415,90	-252.029,53	-1,95% ▼
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	615.610,19	814.908,50	0,00	1.455.104,28	24.585,59	1,72% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	748.957,24	0,00	0,00	771.091,52	22.134,28	2,96% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	1.690.521,76	0,00	0,00	1.744.793,86	54.272,10	3,21% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	13.508.181,04	0,00	0,00	13.342.967,39	-165.213,65	-1,22% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	1.235.021,19	5.818.280,73	0,00	7.234.154,56	180.852,64	2,56% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	36.646,84	0,00	0,00	38.478,86	1.832,02	5,00% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.322.669,02	0,00	0,00	1.305.465,20	-17.203,82	-1,30% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	3.056.593,94	0,00	0,00	3.114.959,71	58.365,77	1,91% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPKA + 6,31%	0,00	753.000,00	0,00	766.109,47	13.109,47	1,74% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPKA + 6,22%	0,00	753.000,00	0,00	766.017,89	13.017,89	1,73% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIXA	787.259,85	0,00	0,00	803.189,71	15.929,86	2,02% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENTA FIXA REFERENCIADO DI	1.152,02	1.526.720,22	1.531.200,00	1.026,95	4.354,71	0,29% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.756.106,26	0,00	136.601,32	11.028.796,01	409.291,07	3,81% ▲
	66.394.227,54	29.331.020,83	12.788.704,08	84.089.721,51	1.153.177,22	1,39%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.790.038,64	0,00	0,00	1.665.726,46	-124.312,18	-6,94% ▼
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	3.058.765,51	0,00	0,00	2.822.031,22	-236.734,29	-7,74% ▼
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	2.022.342,55	0,00	0,00	1.752.762,76	-269.579,79	-13,33% ▼
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	975.885,55	0,00	0,00	880.922,34	-94.963,21	-9,73% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.540.661,39	0,00	0,00	3.208.507,54	-332.153,85	-9,38% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.297.559,45	0,00	0,00	2.208.918,86	-88.640,59	-3,86% ▼
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.337.794,68	0,00	0,00	1.207.374,03	-130.420,65	-9,75% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.754.048,25	0,00	0,00	1.739.799,06	-14.249,19	-0,81% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	824.291,46	0,00	0,00	741.070,42	-83.221,04	-10,10% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	381.702,12	0,00	0,00	324.576,78	-57.125,34	-14,97% ▼
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	227.676,43	0,00	0,00	209.152,24	-18.524,19	-8,14% ▼
	18.210.766,03	0,00	0,00	16.760.841,71	-1.449.924,32	-7,96%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	540.745,39	0,00	549.440,97	0,00	8.695,58	1,61% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.777.579,44	0,00	5.268.748,26	0,00	491.168,82	10,28% ▲
	5.318.324,83	0,00	5.818.189,23	0,00	499.864,40	9,40%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.040.285,64	0,00	1.118.648,05	0,00	78.362,41	7,53% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.652.221,17	0,00	0,00	2.305.120,24	652.899,07	39,52% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.328.935,25	0,00	1.506.858,13	0,00	177.922,88	13,39% ▲
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	849.355,91	0,00	985.270,74	0,00	135.914,83	16,00% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.205.020,17	0,00	1.332.366,33	0,00	127.346,16	10,57% ▲
	6.075.818,14	0,00	4.943.143,25	2.305.120,24	1.172.445,35	19,30%

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 decolaria 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
0,30%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+3
Quantidade de Cotistas
697
Patrimônio Líquido Fundo
6.543.333.888,45

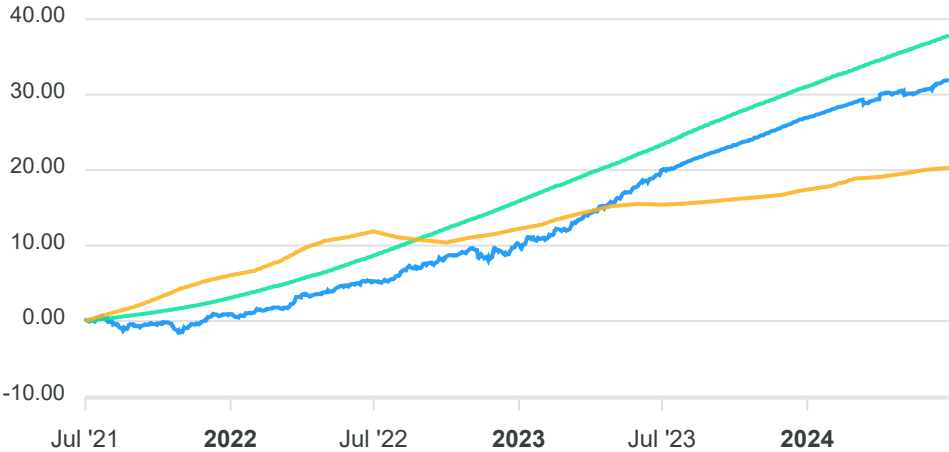
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IPCA
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe de Renda Fixa.

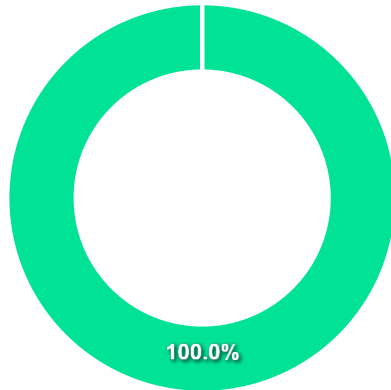
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,38%	3,84%	1,40%	3,84%	9,79%	25,12%	0,47%	1,00%
Benchmark	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%		
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 BB TOP JUROS BRASIL FI RENDA FIXA LP	6.518.071,39	100,00	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	256,47	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	30,73	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	26,46	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-59,57	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-74,82	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.518.071,39	100.00%
Valores a pagar/receber	183,18	0.00%

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

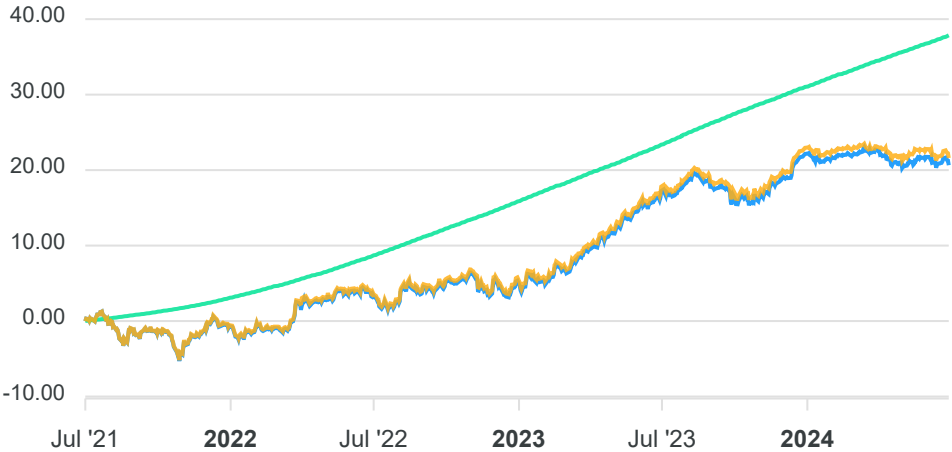
PERFIL DO FUNDO

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.

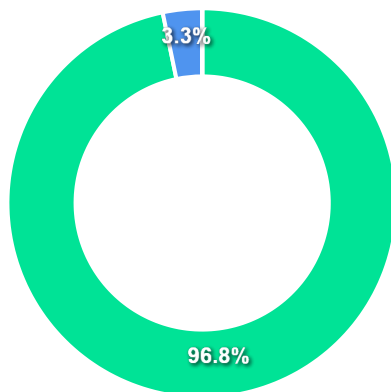
COMPARATIVO

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	4.498.872,68	96.75%
Operação compromissada	151.177,44	3.25%
Valores a pagar/receber	171,11	0.00%
Derivativos	-382,66	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	559.373,66	12,03	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	543.904,37	11,70	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	472.394,01	10,16	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	463.050,91	9,96	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	382.213,63	8,22	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	350.853,57	7,55	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	310.495,19	6,68	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	292.353,49	6,29	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	286.193,19	6,15	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	252.776,73	5,44	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	179.387,93	3,86	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	151.177,44	3,25	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	129.803,71	2,79	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	119.709,03	2,57	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	113.908,81	2,45	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029 (BRSTNCNTB716)	42.454,44	0,91	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	225,94	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	32,63	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	14,61	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	11,63	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Auditoria	3,30	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,85	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK29	-3,51	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	-18,71	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	-22,56	0,00	Derivativos

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+0
Quantidade de Cotistas
219
Patrimônio Líquido Fundo
1.235.978.037,25

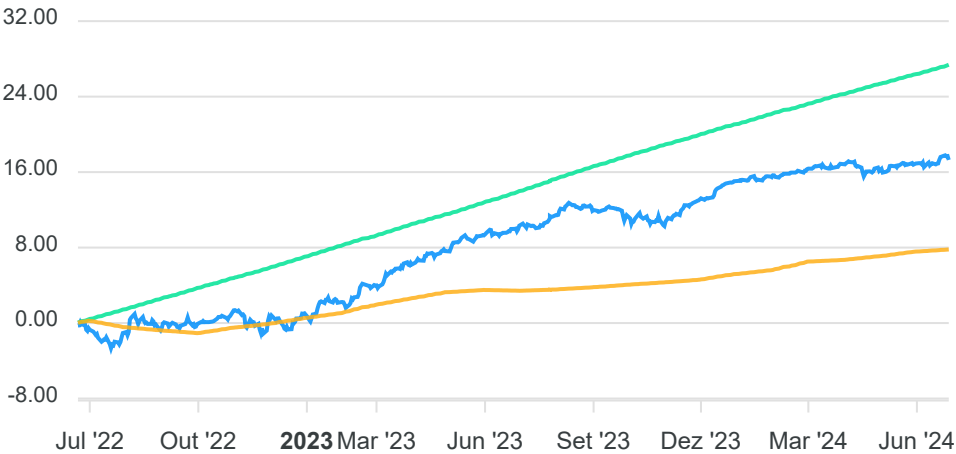
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IPCA
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos e derivativos de renda fixa, sendo que poderá incorrer nos seguintes fatores de risco: taxa de juros pré-fixadas, taxa de juros pós-fixadas, índices de preço e derivativos.

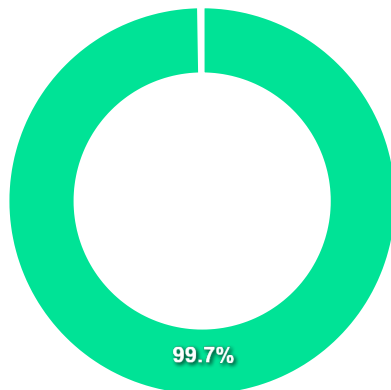
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,02%	1,97%	0,22%	1,97%	6,11%	17,70%	1,37%	2,88%
Benchmark	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	1.232.814,31	99,74	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	3.048,41	0,25	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	110,24	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	29,20	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	3,15	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	2,48	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,85	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-9,51	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-9,84	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.232.814,31	99.74%
Operação compromissada	3.048,41	0.25%
Valores a pagar/receber	126,58	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.
Gestão
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+1
Quantidade de Cotistas
118
Patrimônio Líquido Fundo
218.215.436,00

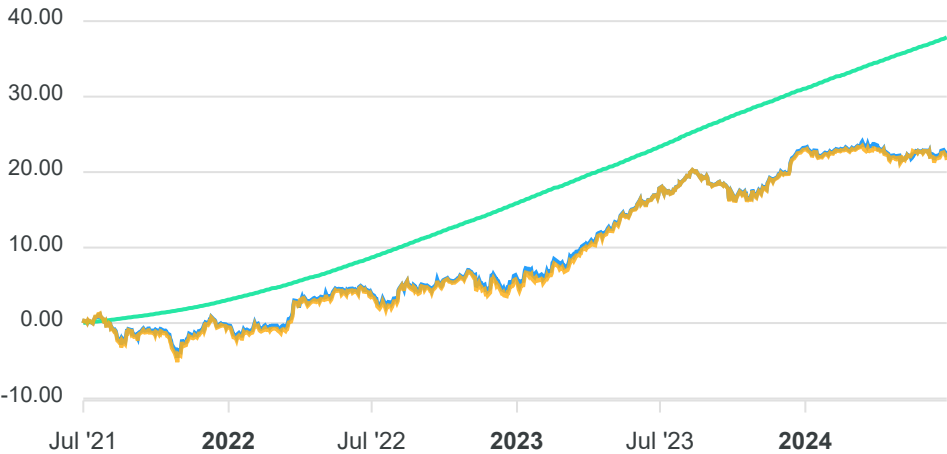
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IMA-B
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Alta Soberano
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em títulos de emissão do Tesouro Nacional atrelados ao IPCA.

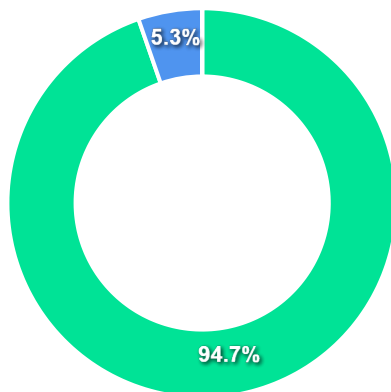
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,86%	-0,98%	-1,08%	-0,98%	3,37%	17,08%	1,75%	3,69%
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	206.725,48	94.73%
Operação compromissada	11.587,13	5.31%
Valores a pagar/receber	-97,17	-0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	28.019,65	12,84	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	24.979,82	11,45	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	21.107,32	9,67	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	20.513,83	9,40	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	19.955,52	9,14	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	19.386,63	8,88	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	13.260,02	6,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	12.864,56	5,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	12.362,67	5,67	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	11.587,13	5,31	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	11.002,32	5,04	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	9.437,20	4,32	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	7.324,66	3,36	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	4.647,58	2,13	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	1.533,62	0,70	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	330,09	0,15	Títulos Federais
Outros Valores a receber	23,17	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	9,40	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-129,74	-0,06	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
777
Patrimônio Líquido Fundo
4.858.229.912,84

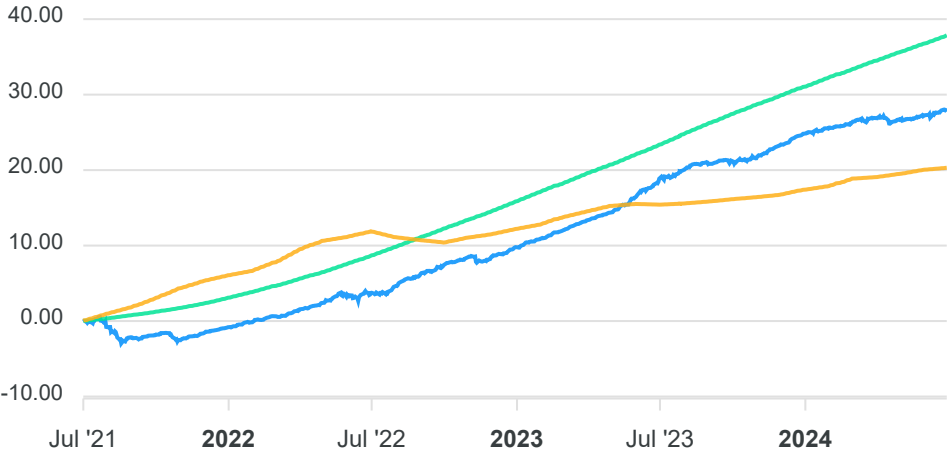
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IPCA
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA
MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:
10.948.555/0001-13.

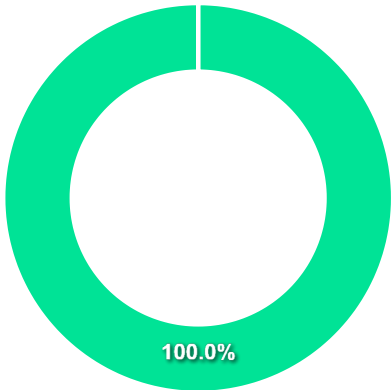
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,17%	2,36%	0,55%	2,36%	7,39%	23,06%	0,88%	1,85%
Benchmark	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%		
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 CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA LP	4.858.631,86	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	29,58	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-431,52	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	4.858.631,86	100.01%
Valores a pagar/receber	-401,94	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
820
Patrimônio Líquido Fundo
4.585.046.250,25

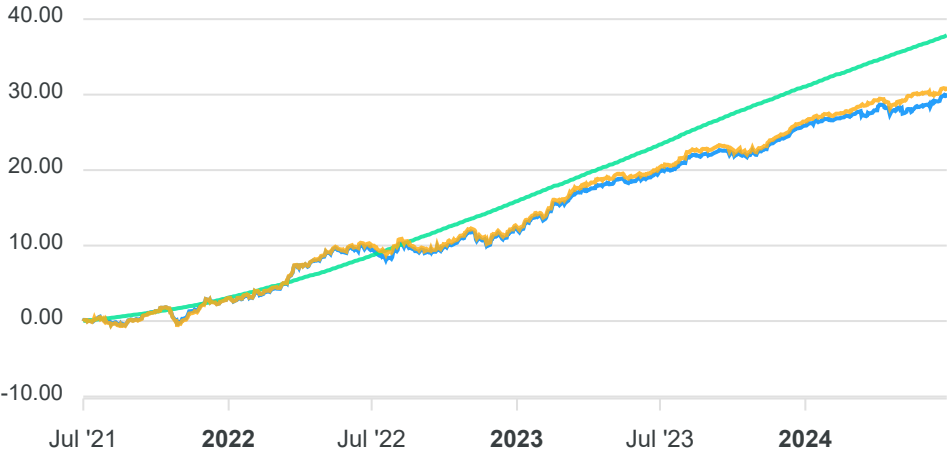
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IDKA IPCA 2 Anos
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados
Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.

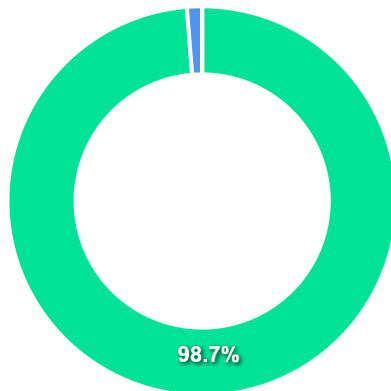
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,20%	2,96%	0,86%	2,96%	8,08%	18,05%	0,98%	2,07%
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



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	3.315.482,17	74,55	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	1.050.616,64	23,62	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2025	55.347,99	1,24	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2029	25.583,33	0,58	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	685,57	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	23,85	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-167,64	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.391.682,15	98.74%
Operação compromissada	55.347,99	1.24%
Valores a pagar/receber	541,78	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
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

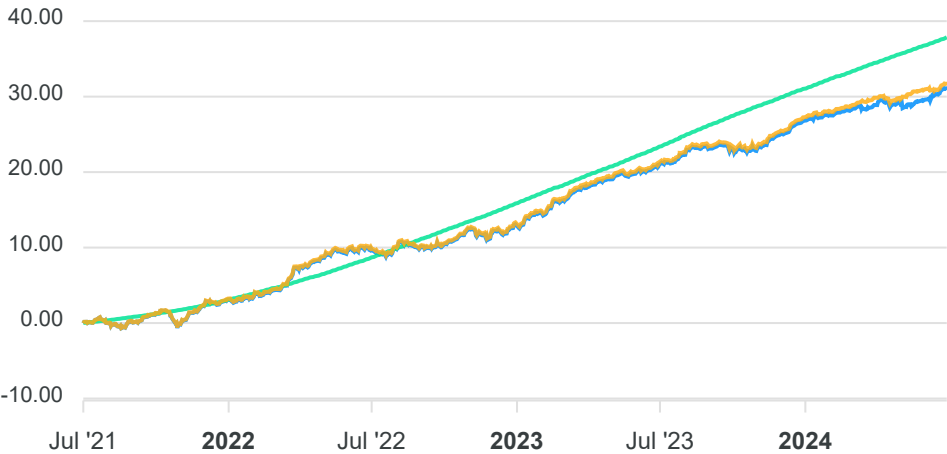
PERFIL DO FUNDO

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.

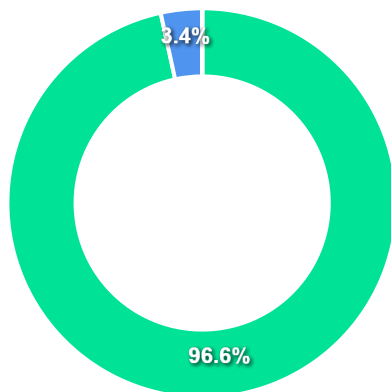
COMPARATIVO

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



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.053.572,49	96.59%
Operação compromissada	249.938,79	3.42%
Derivativos	-198,54	-0.00%
Valores a pagar/receber	-464,73	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	1.813.756,97	24,84	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	1.812.496,08	24,82	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	1.493.895,71	20,46	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	978.851,24	13,40	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	795.816,44	10,90	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	249.938,79	3,42	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2029 (BRSTNCNTB716)	138.702,90	1,90	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	11.133,04	0,15	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	7.433,60	0,10	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1.486,51	0,02	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	78,22	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	29,58	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	-198,54	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-572,52	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
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

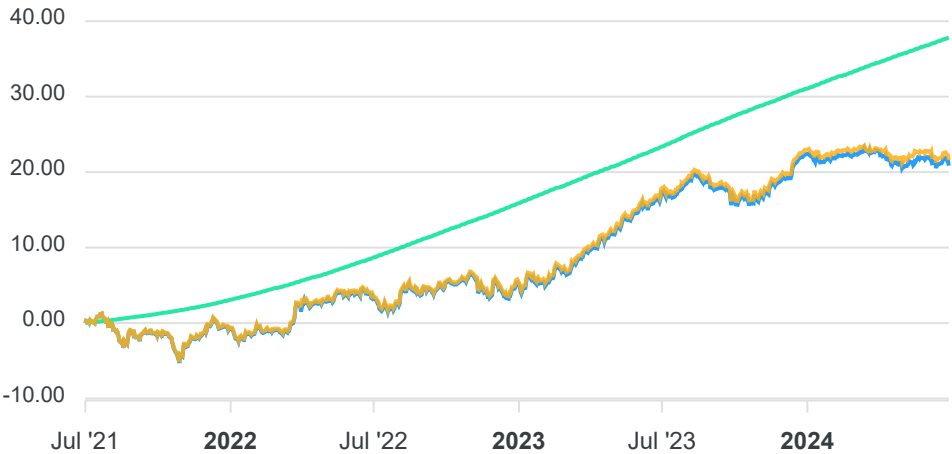
PERFIL DO FUNDO

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.

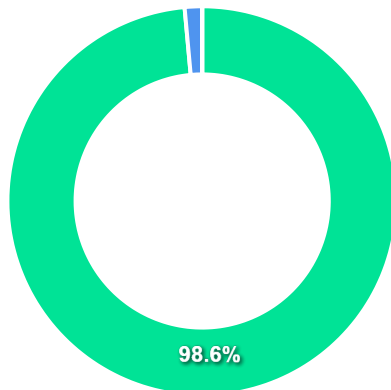
COMPARATIVO

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	4.073.443,26	98.56%
Operação compromissada	59.547,32	1.44%
Valores a pagar/receber	123,12	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	506.282,70	12,25	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	445.220,24	10,77	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	421.701,81	10,20	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	417.286,73	10,10	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	341.155,01	8,25	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	335.524,76	8,12	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	277.234,45	6,71	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	261.027,70	6,32	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	255.419,07	6,18	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	225.625,70	5,46	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	222.295,17	5,38	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	116.099,13	2,81	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	106.700,76	2,58	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	101.654,60	2,46	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	59.547,32	1,44	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2029 (BRSTNCNTB716)	38.743,92	0,94	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1.471,49	0,04	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	317,67	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	29,58	0,00	Valores a pagar/receber
LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	0,00	0,00	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	0,00	0,00	Títulos Federais
Outros Valores a pagar	-224,13	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
1.155
Patrimônio Líquido Fundo
7.877.165.450,51

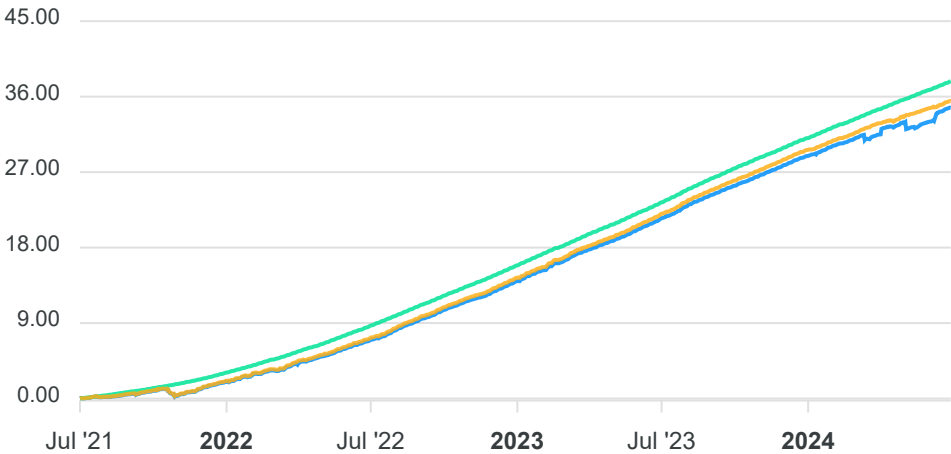
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IRF-M 1
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados
Política de Investimento
Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.

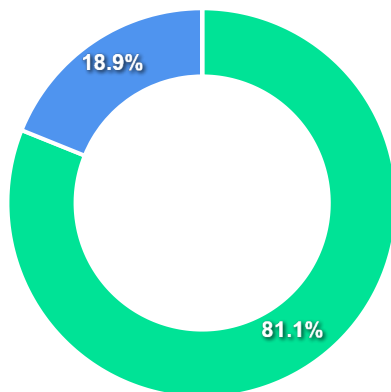
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,61%	4,48%	1,97%	4,48%	10,79%	25,84%	0,25%	0,52%
Benchmark	0,63%	4,51%	2,00%	4,51%	10,95%	26,28%		
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
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2029	6.388.574,45	81,10	Operação compromissada
NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	966.448,55	12,27	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	225.216,09	2,86	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCLTN7N2)	148.225,06	1,88	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2025 (BRSTNCLTN830)	131.255,40	1,67	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2024 (BRSTNCLTN822)	16.559,26	0,21	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	4.932,19	0,06	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	29,58	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	0,45	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV24	-107,52	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	-1.025,71	-0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ25	-2.526,18	-0,03	Derivativos
Outros Valores a pagar	-4.075,13	-0,05	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	6.388.574,45	81.14%
Títulos Federais	1.487.704,35	18.90%
Valores a pagar/receber	886,64	0.01%
Derivativos	-3.658,97	-0.05%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
738
Patrimônio Líquido Fundo
11.312.134.510,29

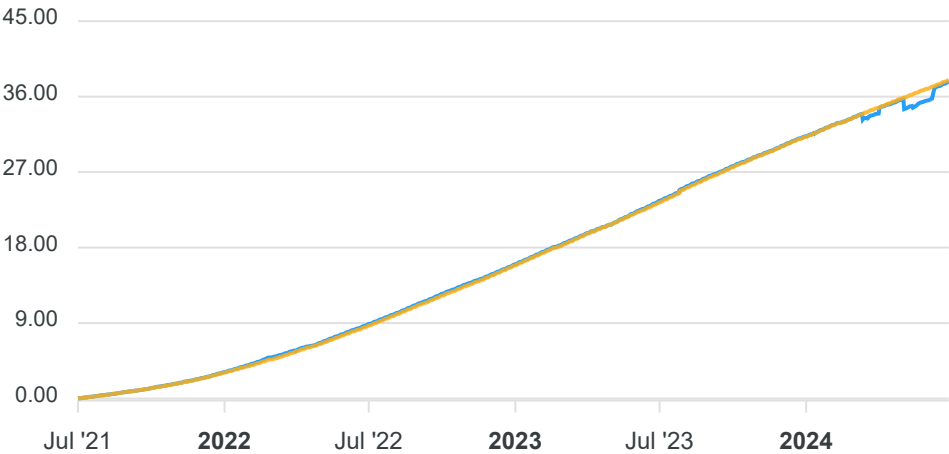
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
CDI
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais, com prazo médio de carteira superior 365 dias.

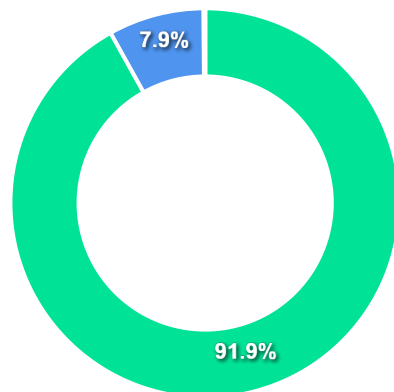
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,78%	5,00%	2,39%	5,00%	11,34%	26,39%	0,05%	0,10%
Benchmark	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	10.406.336,80	91.93%
Operação compromissada	896.640,76	7.92%
Valores a pagar/receber	9.156,94	0.08%
Derivativos	7.967,41	0.07%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	1.435.235,52	12,69	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	1.356.626,51	11,99	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/06/2030 (BRSTNCLF1RQ4)	996.108,04	8,81	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2026 (BRSTNCLTN7U7)	954.048,16	8,43	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	945.862,54	8,36	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	922.181,44	8,15	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2026	896.640,76	7,93	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	633.121,12	5,60	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026 (BRSTNCLTN848)	620.033,54	5,48	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	589.719,93	5,21	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2029 (BRSTNCLF1RM3)	580.268,89	5,13	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	552.004,37	4,88	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2030 (BRSTNCLTN8A7)	378.767,83	3,35	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	241.490,52	2,13	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	109.445,90	0,97	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	78.244,29	0,69	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	13.178,19	0,12	Títulos Federais
Outros Valores a receber	7.982,27	0,07	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF30	3.111,14	0,03	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF26	2.941,95	0,03	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN26	2.565,00	0,02	Derivativos
Outras Disponibilidades	1.740,36	0,02	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF27	582,76	0,01	Derivativos
LTN - Venc.: 01/10/2025 (BRSTNCLTN863)	0,00	0,00	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV25	0,00	0,00	Derivativos
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	0,00	0,00	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	-396,39	0,00	Derivativos

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	ITAU UNIBANCO S.A.
Gestão	ITAU UNIBANCO S.A.
Taxa de Administração	0,40%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	206
Patrimônio Líquido Fundo	2.052.875.038,41

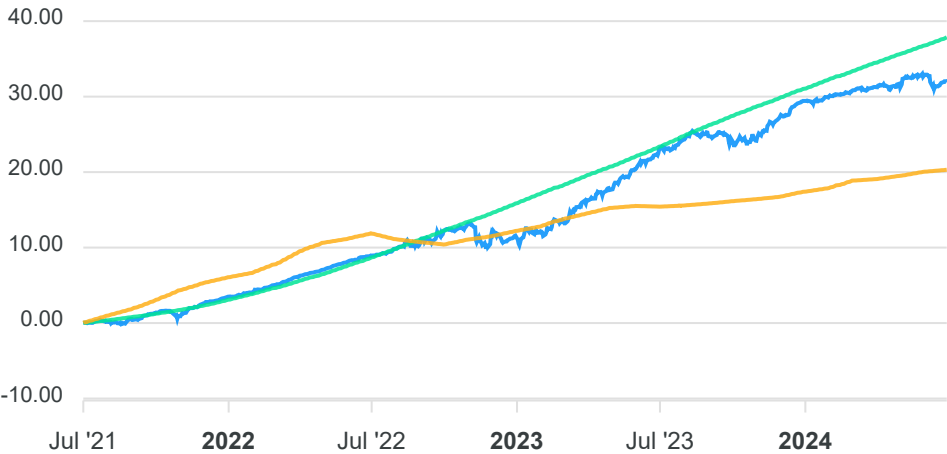
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IPCA
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre
Política de Investimento	Alocar preponderante em cotas de fundos de investimento de renda fixa atrelados ao IMA e seus sub-índices, podendo alocar também em fundos de investimento de renda fixa que seguem o CDI.

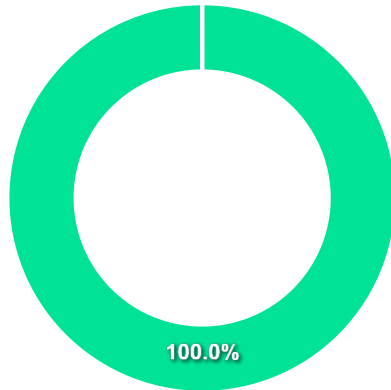
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,20%	1,91%	0,31%	1,91%	7,05%	20,92%	1,64%	3,45%
Benchmark	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%		
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 ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.912.115,03	99,80	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	13.946,80	0,73	Valores a pagar/receber
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.710,94	0,19	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-13.839,06	-0,72	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.915.825,97	99.99%
Valores a pagar/receber	177,74	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,40%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+1
Quantidade de Cotistas
63
Patrimônio Líquido Fundo
285.872.986,61

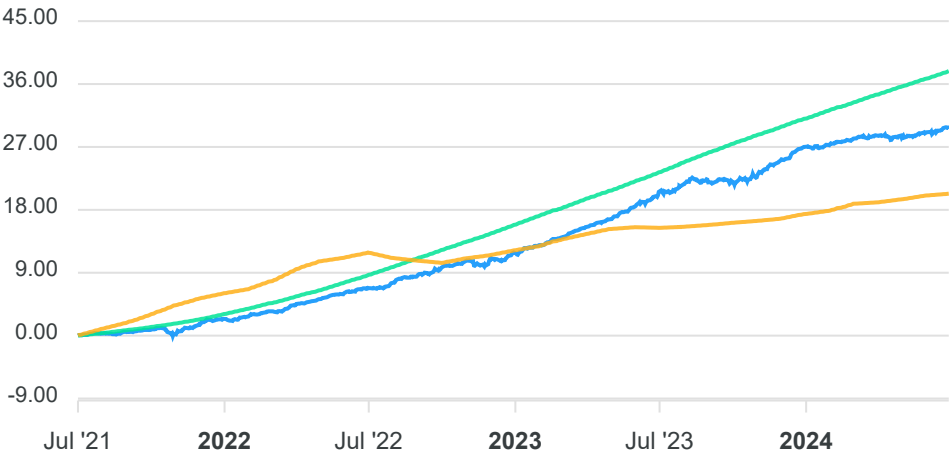
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IPCA
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos que invistam em ativos de renda fixa relacionados à variação das taxas de juros pós ou pré-fixados, de índices de preços, ou ambos, sendo vedada a exposição à moeda estrangeira e renda variável.

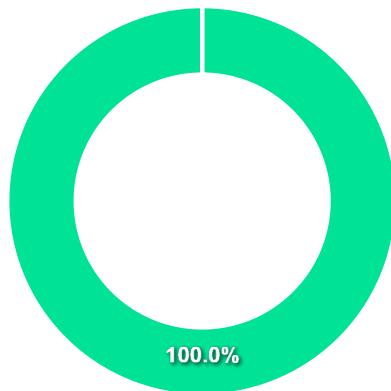
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,16%	2,02%	0,65%	2,02%	7,36%	21,17%	0,81%	1,71%
Benchmark	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%		
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 SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	132.486,89	46,34	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	62.960,23	22,02	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	46.059,34	16,11	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.401,06	15,53	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	23,77	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-63,31	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	285.907,52	100.01%
Valores a pagar/receber	-34,53	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BRADESCO S.A.
Gestão
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM
Taxa de Administração
0,40%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4
Quantidade de Cotistas
147
Patrimônio Líquido Fundo
683.118.622,81

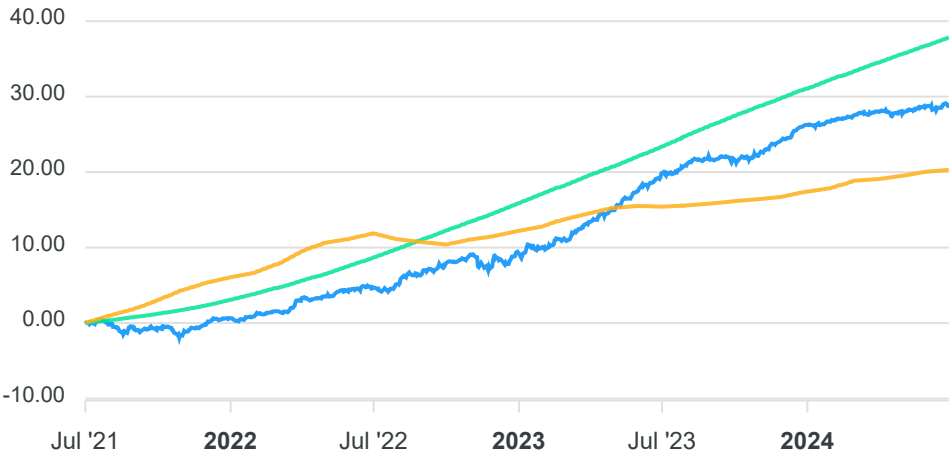
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
IPCA
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de renda fixa, os quais atuam nos mercados de juros pré e pós-fixados e índices de preços, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

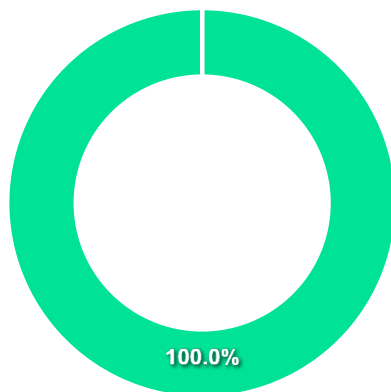
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,20%	1,81%	0,27%	1,81%	7,18%	22,58%	1,24%	2,60%
Benchmark	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%		
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 BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	189.206,06	28,35	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	166.586,20	24,96	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	153.992,06	23,07	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	75.574,89	11,32	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	38.848,35	5,82	Fundos de Investimento
Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	38.037,04	5,70	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	3.196,19	0,48	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.735,96	0,26	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	508,99	0,08	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	21,03	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-270,40	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	667.685,73	100.04%
Valores a pagar/receber	-239,37	-0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BRADESCO S.A.
Gestão
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM
Taxa de Administração
0,15%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
656
Patrimônio Líquido Fundo
11.531.124.110,68

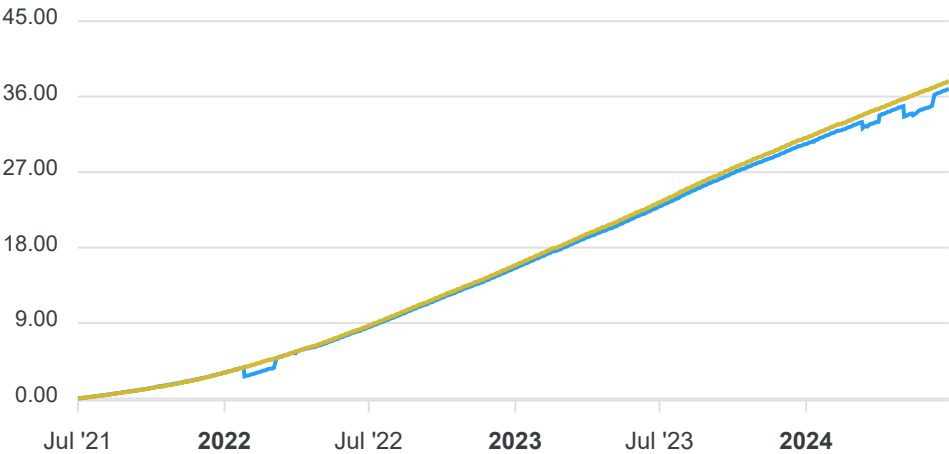
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
Selic
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Soberano
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em carteira composta de ativos ou modalidades operacionais vinculados a variação do CDI, sendo vedada a exposição em moeda estrangeira e renda variável.

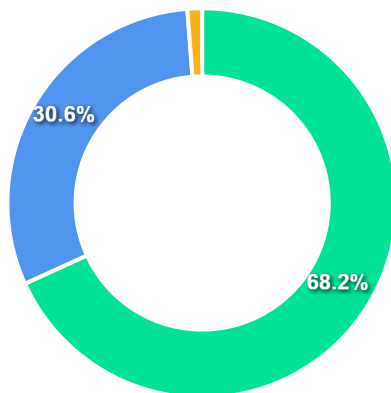
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,78%	5,10%	2,47%	5,10%	11,39%	26,18%	0,01%	0,02%
Benchmark	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	8.449.904,15	68.20%
Operação compromissada	3.788.462,59	30.58%
Valores a pagar/receber	151.174,30	1.22%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2025	2.238.825,81	18,07	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2026	2.025.180,90	16,35	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027	1.584.461,36	12,79	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2024	1.549.636,78	12,51	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2025	1.349.393,54	10,89	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	954.350,73	7,70	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	891.126,50	7,19	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024	693.377,74	5,60	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028	304.772,13	2,46	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2028	287.391,89	2,32	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	220.344,97	1,78	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	153.544,30	1,24	Valores a pagar/receber
LFT - Venc.: 01/03/2029	139.504,41	1,13	Títulos Federais
Outros Valores a receber	23,66	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-2.393,66	-0,02	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
34
Patrimônio Líquido Fundo
126.491.485,84

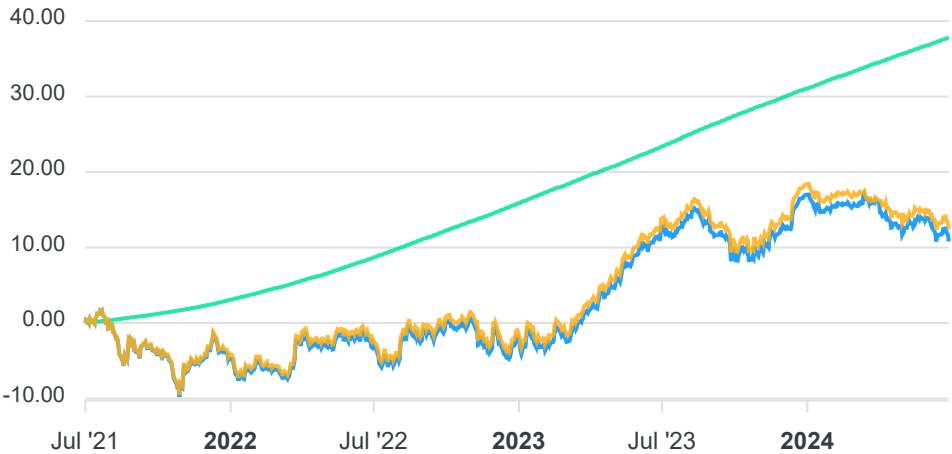
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
IMA-B 5+
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento
Política de Investimento
Investe seus recursos em cotas de fundo de investimento, nos 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.

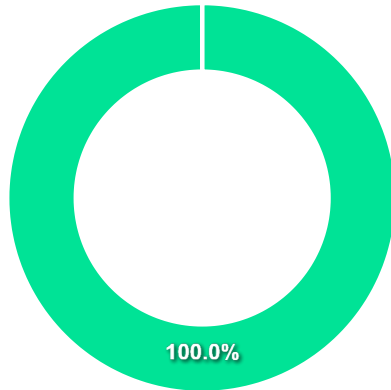
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,31%	-5,26%	-3,72%	-5,26%	-1,83%	13,90%	3,06%	6,44%
Benchmark	-2,25%	-5,04%	-3,58%	-5,04%	-1,43%	14,67%		
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 BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	120.798,77	100,02	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	10,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	8,41	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-40,07	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	120.798,77	100.02%
Valores a pagar/receber	-21,65	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	219
Patrimônio Líquido Fundo	1.103.980.003,66

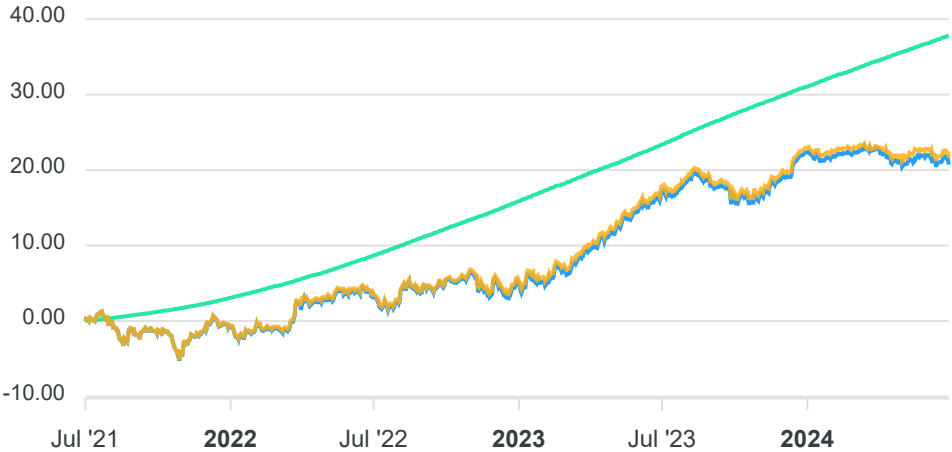
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark	IMA-B
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 dias.

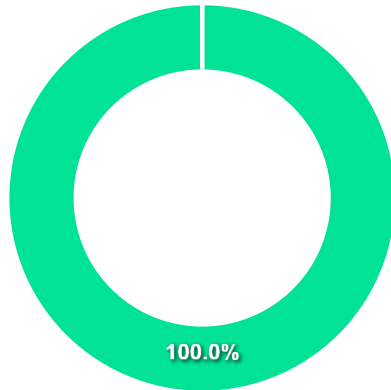
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,08%	-1,30%	-1,50%	-1,30%	2,86%	16,46%	2,01%	4,23%
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 CAIXA MASTER BRASIL IMA-B FI RENDA FIXA LP	1.104.020,70	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	24,60	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-65,30	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.104.020,70	100.00%
Valores a pagar/receber	-40,70	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
468
Patrimônio Líquido Fundo
2.969.679.625,74

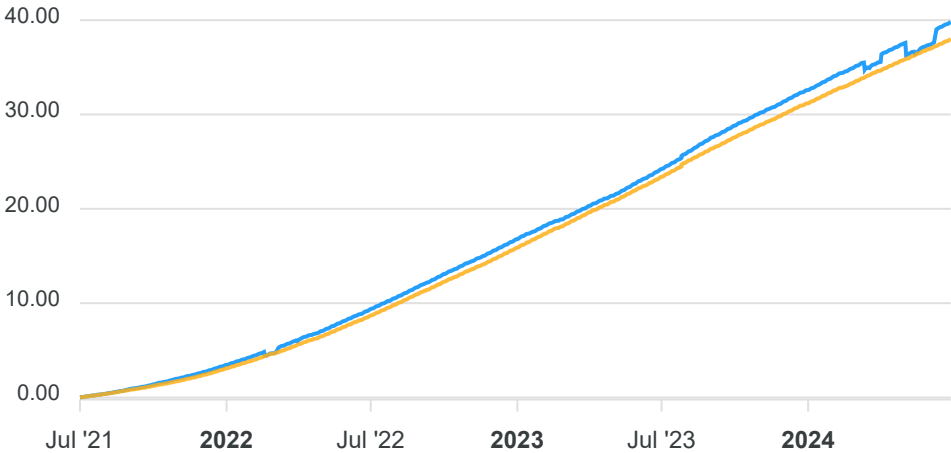
PERFIL DO FUNDO

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 em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa e cotas de fundos de índice de renda fixa.

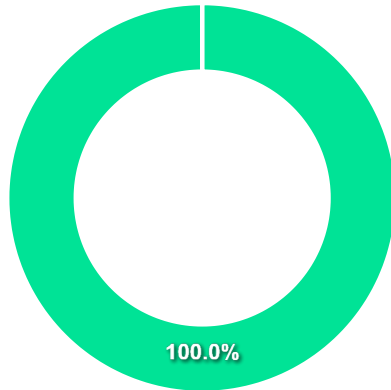
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,82%	5,48%	2,62%	5,48%	12,39%	27,67%	0,03%	0,07%
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
Cotas de SANTANDER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	2.970.116,23	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	44,30	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-485,90	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.970.116,23	100.01%
Valores a pagar/receber	-436,60	-0.01%

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.

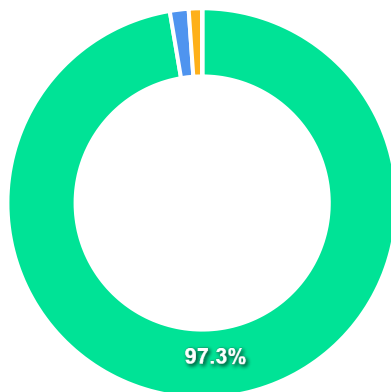
COMPARATIVO

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	631.859,95	97.34%
Operação compromissada	10.098,49	1.56%
Valores a pagar/receber	7.207,23	1.11%
Outros	5,54	0.00%
Derivativos	-44,07	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	79.191,13	12,20	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	50.591,28	7,79	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	44.769,85	6,90	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	25.187,91	3,88	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	21.676,93	3,34	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	20.359,22	3,14	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	18.536,66	2,86	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	18.139,83	2,79	Ações
WEG ON NM - WEGE3	18.056,48	2,78	Ações
B3 ON NM - B3SA3	16.781,18	2,59	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	15.883,83	2,45	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	11.439,00	1,76	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	10.806,14	1,66	Ações
JBS ON NM - JBSS3	10.700,73	1,65	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	10.483,20	1,61	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	10.471,77	1,61	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2045	10.098,49	1,56	Operação compromissada
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	9.794,65	1,51	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	9.296,50	1,43	Ações
EMBRAER ON NM - EMBR3	8.806,14	1,36	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	7.543,88	1,16	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	7.176,14	1,11	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	6.967,99	1,07	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	6.922,80	1,07	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	6.907,45	1,06	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	6.622,46	1,02	Ações
ENEVA ON NM - ENEV3	6.182,36	0,95	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BRADESCO S.A.
Gestão
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM
Taxa de Administração
0,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+3
Quantidade de Cotistas
47
Patrimônio Líquido Fundo
234.298.636,37

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I
Benchmark
Ibovespa
Classificação ANBIMA
Ações Indexados
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações, bônus ou recibos de subscrição, Certificados de Depósito de Ações e BDR Nível II e III.

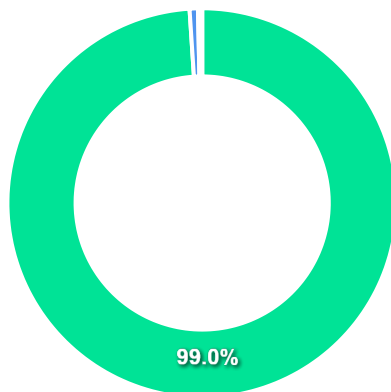
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,53%	-7,74%	-3,29%	-7,74%	4,89%	25,82%	5,86%	12,35%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	232.309,32	98.96%
Valores a pagar/receber	1.616,89	0.69%
Operação compromissada	788,83	0.34%
Outros	26,19	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	17.882,81	7,62	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	14.655,52	6,24	Ações
VALE ON N1 - VALE3	12.099,20	5,15	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	11.477,83	4,89	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	6.169,55	2,63	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	6.148,67	2,62	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ELET3	5.586,93	2,38	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - WEGE3	5.350,76	2,28	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBAS3	4.987,71	2,12	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	4.669,31	1,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	4.564,13	1,94	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3	4.382,26	1,87	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	4.349,41	1,85	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	4.116,60	1,75	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	3.445,60	1,47	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ABEV3	3.415,13	1,45	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	3.304,57	1,41	Ações
WEG ON NM - WEGE3	2.899,98	1,24	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	2.870,57	1,22	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PRIO3	2.801,32	1,19	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RENT3	2.744,72	1,17	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EQTL3	2.694,86	1,15	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SUZB3	2.578,12	1,10	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	2.544,61	1,08	Ações
Outros Valores a receber	2.526,78	1,08	Valores a pagar/receber
BRADESCO PN N1 - BBDC4	2.450,81	1,04	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - JBSS3	2.430,10	1,04	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA
Gestão
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM
Taxa de Administração
1,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4
Quantidade de Cotistas
118
Patrimônio Líquido Fundo
305.744.233,44

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I
Benchmark
Ibovespa
Classificação ANBIMA
Ações Índice Ativo
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 67% dos seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações, cotas de Fundos de ações e cotas dos Fundos de índice de ações. O fundo não pode conter mais de 20 empresas emissoras de ações.

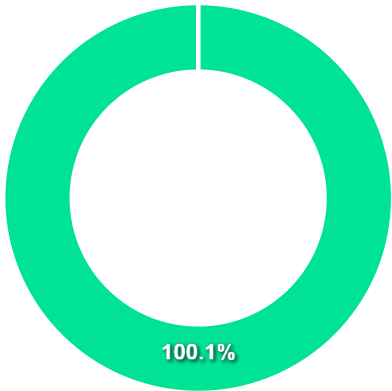
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,13%	-13,33%	-10,63%	-13,33%	-7,64%	10,00%	7,28%	15,33%
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
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL FI AÇÕES	310.390,11	100,11	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	93,87	0,03	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	9,36	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-442,29	-0,14	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	310.390,11	100.11%
Valores a pagar/receber	-339,06	-0.11%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM

Gestão
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
3,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4 ou D+33

Quantidade de Cotistas
1.852

Patrimônio Líquido Fundo
1.149.355.348,82

Patrimônio Líquido Master
1.551.287.563,93

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, preponderantemente, em cotas do BTG
PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES,
CNPJ: 17.009.959/0001-90.

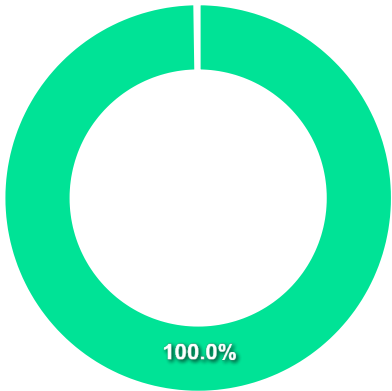
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,15%	-9,73%	-9,00%	-9,73%	-1,98%	14,83%	6,95%	14,64%
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
Cotas de BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FIAÇÃOE...	1.385.717,13	100,00	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2029	3.288,32	0,24	Operação compromissada
Outros Valores a receber	330,03	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-3.632,84	-0,26	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.385.717,13	100.00%
Operação compromissada	3.288,32	0.24%
Valores a pagar/receber	-3.302,81	-0.24%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
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.

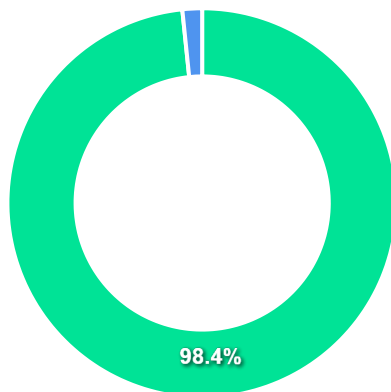
COMPARATIVO

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



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	548.542,17	98.37%
Valores a pagar/receber	9.093,52	1.63%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de NAVI INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	54.720,22	9,99	Fundos de Investimento
Cotas de GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	48.653,34	8,88	Fundos de Investimento
Cotas de TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	47.954,86	8,76	Fundos de Investimento
Cotas de SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI AÇÕES	47.933,06	8,75	Fundos de Investimento
Cotas de REAL INVESTOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	47.759,76	8,72	Fundos de Investimento
Cotas de CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	47.208,64	8,62	Fundos de Investimento
Cotas de OCEANA SELECTION 30 E FIC AÇÕES	47.118,20	8,60	Fundos de Investimento
Cotas de CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	46.603,61	8,51	Fundos de Investimento
Cotas de OCCAM FIC AÇÕES	33.407,07	6,10	Fundos de Investimento
Cotas de BRASIL CAPITAL 30 FIC AÇÕES	28.868,79	5,27	Fundos de Investimento
Cotas de TRUXT C VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	26.784,35	4,89	Fundos de Investimento
Cotas de ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	26.387,59	4,82	Fundos de Investimento
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	22.728,38	4,15	Fundos de Investimento
Cotas de MOAT CAIXA AÇÕES FIC AÇÕES	12.158,44	2,22	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	10.259,25	1,87	Valores a pagar/receber
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	10.255,87	1,87	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.165,74	-0,21	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração
1,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4
Quantidade de Cotistas
2.254
Patrimônio Líquido Fundo
244.733.368,12

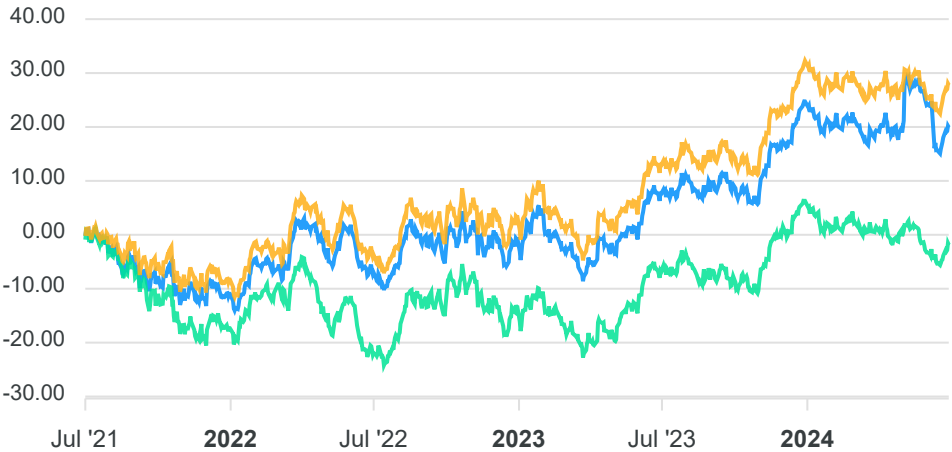
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I
Benchmark
IDIV
Classificação ANBIMA
Ações Dividendos
Política de Investimento
Aplica seus recursos em ações de empresas que possuam a política e/ou potencial de distribuição de dividendos e/ou juros sobre o capital.

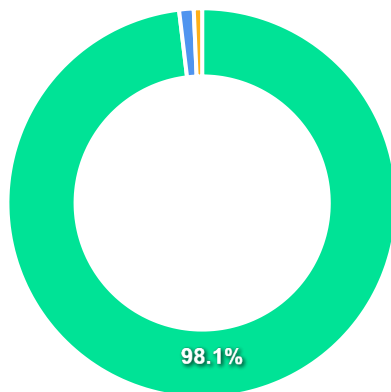
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,90%	-3,86%	0,13%	-3,86%	10,80%	28,70%	5,25%	11,05%
Benchmark	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%		
IBOVESPA	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	240.241,20	98.10%
Valores a pagar/receber	2.956,58	1.21%
Fundos de Investimento	1.697,77	0.69%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
GERDAU PN N1 - GGBR4	12.979,04	5,30	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	12.914,09	5,28	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	11.167,68	4,56	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	10.854,03	4,44	Ações
VALE ON N1 - VALE3	10.782,73	4,41	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	10.761,27	4,40	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	9.996,53	4,08	Ações
JBS ON NM - JBSS3	9.077,55	3,71	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	8.811,63	3,60	Ações
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	7.880,25	3,22	Ações
COPEL ON N1 - CPLE3	7.495,82	3,06	Ações
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	7.253,01	2,96	Ações
SANTOS BRP ON NM - STBP3	6.407,31	2,62	Ações
KLABIN S.A. UNT N2 - KLBN11	6.202,38	2,53	Ações
TIM ON NM - TIMS3	6.077,28	2,48	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	5.750,54	2,35	Ações
TELEF BRASIL ON - VIVT3	5.744,58	2,35	Ações
SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	5.626,55	2,30	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	5.425,33	2,22	Ações
SID NACIONAL ON - CSNA3	5.415,75	2,21	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	5.395,20	2,20	Ações
TAESA UNT N2 - TAEE11	5.216,65	2,13	Ações
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	5.134,43	2,10	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	4.901,13	2,00	Ações
CIELO ON NM - CIEL3	4.309,77	1,76	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	4.277,81	1,75	Ações
CSNMINERACAOON N2 - CMIN3	4.035,74	1,65	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA
Gestão
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.
Taxa de Administração
2,00%
Taxa de Performance
20,00%
Disponibilidade de Resgate
D+15
Quantidade de Cotistas
2.110
Patrimônio Líquido Fundo
1.394.601.606,31

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I
Benchmark
Ibovespa
Classificação ANBIMA
Ações Livre
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de renda variável, podendo aproveitar oportunidades disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento.

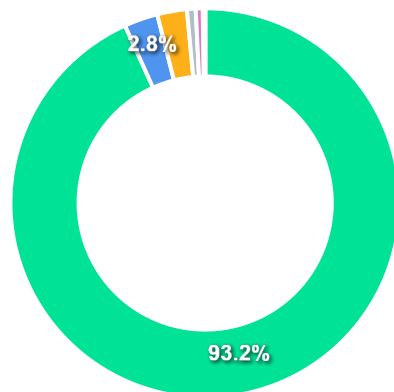
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,26%	-9,75%	-8,25%	-9,75%	-3,49%	12,92%	6,60%	13,90%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	1.368.590,33	93.25%
Operação compromissada	40.998,53	2.79%
Brazilian Depositary Receipts	36.116,19	2.46%
Fundos de Investimento	10.618,92	0.72%
Valores a pagar/receber	8.418,69	0.57%
Derivativos	1.516,47	0.10%
Títulos Federais	1.440,69	0.10%
Outros	17,80	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	64.272,33	4,38	Ações
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	40.998,53	2,79	Operação compromissada
BTGP BANCO UNT - BPAC11	37.404,68	2,55	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	36.030,62	2,45	Ações
SANEPAR UNT N2 - SAPR11	35.347,05	2,41	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - UGPA3	30.202,55	2,06	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	29.048,16	1,98	Ações
NEOENERGIA ON ATZ NM - NEOE3	28.270,01	1,93	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MULT3	27.391,78	1,87	Ações
IGUATEMI S.AUNT N1 - IGTI11	25.671,72	1,75	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	25.566,41	1,74	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	24.820,61	1,69	Ações
TELEF BRASIL ON - VIVT3	24.437,55	1,67	Ações
ABC BRASIL PN N2 - ABCB4	23.204,83	1,58	Ações
VALE ON N1 - VALE3	22.502,49	1,53	Ações
MARCOPOLO PN N2 - POMO4	21.848,89	1,49	Ações
VALID ON NM - VLID3	19.847,07	1,35	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	19.657,00	1,34	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CURY3	19.577,57	1,33	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	19.269,47	1,31	Ações
GPS ON NM - GGPS3	18.476,65	1,26	Ações
COPASA ON NM - CSMG3	18.392,28	1,25	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	18.185,24	1,24	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	16.426,18	1,12	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	16.339,91	1,11	Ações
RANDON PART PN N1 - RAPT4	14.978,83	1,02	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SBSP3	14.518,13	0,99	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Taxa de Administração	1,90%
Taxa de Performance	20,00%
Disponibilidade de Resgate	D+24
Quantidade de Cotistas	11.978
Patrimônio Líquido Fundo	1.114.262.445,89
Patrimônio Líquido Master	1.361.249.331,92

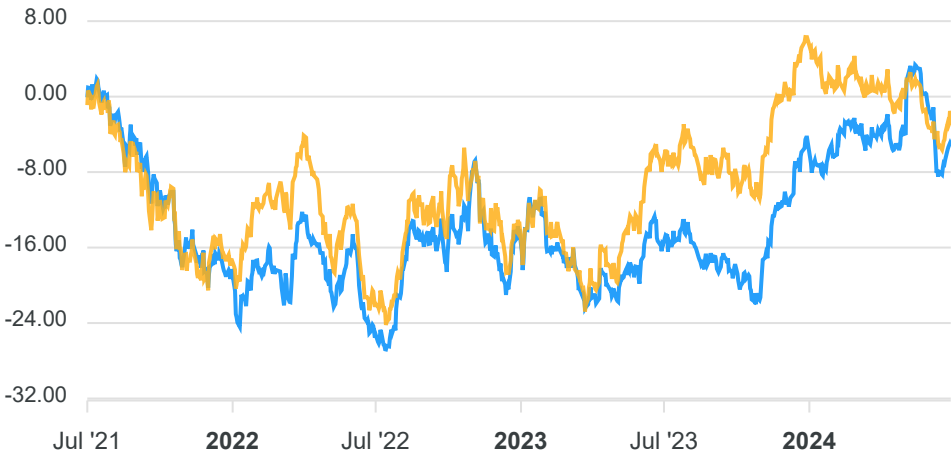
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Livre
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 18.138.837/0001-67.

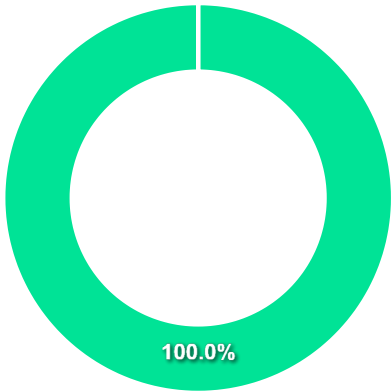
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,80%	-0,81%	-2,22%	-0,81%	12,30%	27,30%	5,15%	10,84%
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
Cotas de ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES	1.121.261,97	99,78	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	2.825,77	0,25	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	2.683,05	0,24	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	70,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-3.064,67	-0,27	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.124.087,74	100.03%
Valores a pagar/receber	-311,62	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão	ITAÚ DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,80%
Taxa de Performance	10,00%
Disponibilidade de Resgate	D+24
Quantidade de Cotistas	16
Patrimônio Líquido Fundo	115.388.111,59

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 classificados como Ações, os quais investem em ativos financeiros que tenham como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado.

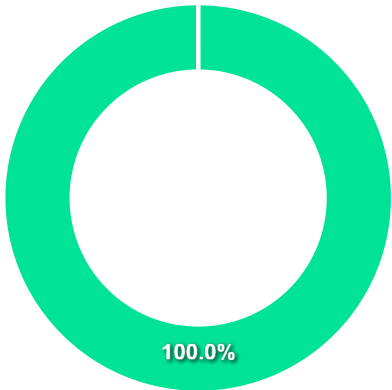
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,82%	-10,10%	-7,39%	-10,10%	-3,02%	12,38%	6,84%	14,41%
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
Cotas de ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS MULTIGESTOR X RE...	119.159,54	99,13	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	1.051,47	0,87	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	78,18	0,07	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	8,48	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-91,58	-0,08	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	120.211,02	100.00%
Valores a pagar/receber	-4,92	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Taxa de Administração	2,50%
Taxa de Performance	20,00%
Disponibilidade de Resgate	D+24
Quantidade de Cotistas	50
Patrimônio Líquido Fundo	88.011.484,45
Patrimônio Líquido Master	140.124.940,46

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Livre
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ PHOENIX FI AÇÕES, CNPJ: 09.094.073/0001-64.

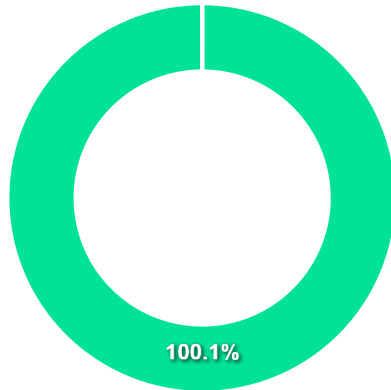
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	-14,97%	-10,08%	-14,97%	-12,10%	-7,28%	7,10%	14,95%
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
Cotas de ITAÚ PHOENIX FI AÇÕES	91.804,96	99,95	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	183,38	0,20	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	30,00	0,03	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	12,72	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-178,34	-0,19	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	91.988,34	100.15%
Valores a pagar/receber	-135,62	-0.15%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA
Gestão
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.
Taxa de Administração
1,50%
Taxa de Performance
20,00%
Disponibilidade de Resgate
D+4
Quantidade de Cotistas
2.462
Patrimônio Líquido Fundo
65.268.360,89

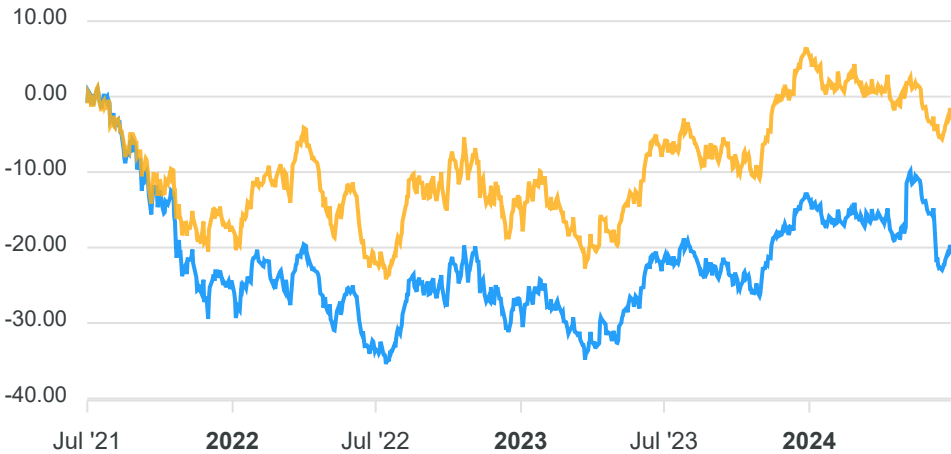
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I
Benchmark
Ibovespa
Classificação ANBIMA
Ações Valor/Crescimento
Política de Investimento
Aplica seus recursos no mercado de renda variável, utilizando-se de análise fundamentalista, observando entre outros aspectos, a potencialidade do valor intrínseco das ações selecionadas.

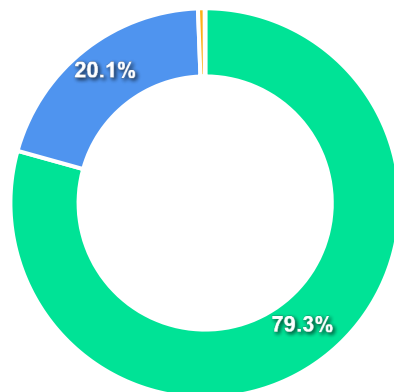
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,37%	-8,14%	-4,98%	-8,14%	2,05%	20,33%	5,93%	12,49%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	60.358,74	79.32%
Operação compromissada	15.286,62	20.09%
Valores a pagar/receber	418,22	0.55%
Derivativos	32,01	0.04%
Outros	0,84	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2025	15.286,62	20,09	Operação compromissada
VALE ON N1 - VALE3	6.281,35	8,25	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	4.979,28	6,54	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	4.258,16	5,60	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	3.466,57	4,56	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	2.737,83	3,60	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	2.668,97	3,51	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	2.518,94	3,31	Ações
B3 ON NM - B3SA3	2.069,53	2,72	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	1.905,00	2,50	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	1.620,90	2,13	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	1.558,66	2,05	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	1.548,29	2,03	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	1.339,87	1,76	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	1.167,13	1,53	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	1.096,10	1,44	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	932,43	1,23	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	885,50	1,16	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	844,07	1,11	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	829,54	1,09	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	819,38	1,08	Ações
WEG ON NM - WEGE3	802,03	1,05	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	708,40	0,93	Ações
GRUPO NATURAON NM - NTCO3	700,80	0,92	Ações
JBS ON NM - JBSS3	677,13	0,89	Ações
ASSAI ON NM - ASAI3	673,44	0,88	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	663,52	0,87	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
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

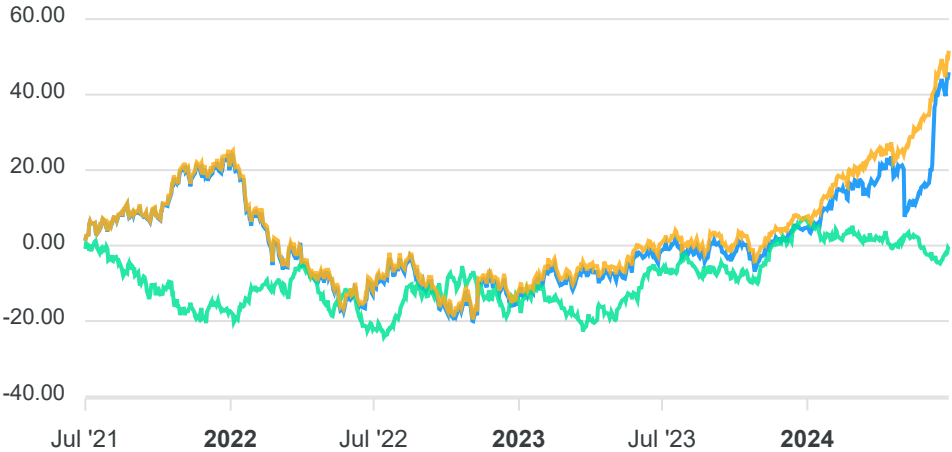
PERFIL DO FUNDO

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.

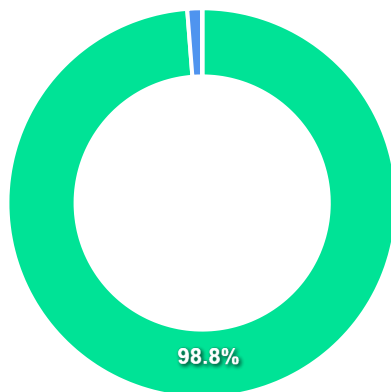
COMPARATIVO

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 Depositary Receipts	2.707.057,10	98.84%
Fundos de Investimento	33.727,57	1.23%
Outros	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-2.012,72	-0.07%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
MICROSOFT CORPORATION - MSFT34	271.181,79	9,91	Brazilian Depositary Rece...
APPLE INC - AAPL34	270.201,11	9,87	Brazilian Depositary Rece...
NVIDIA CORP - NVDC34	266.921,09	9,75	Brazilian Depositary Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	157.220,59	5,74	Brazilian Depositary Rece...
META PLATFORMS, INC - M1TA34	87.359,92	3,19	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	85.366,93	3,12	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL35	82.826,65	3,03	Brazilian Depositary Rece...
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD - TSMC34	74.524,81	2,72	Brazilian Depositary Rece...
ELI LILLY AND COMPANY - LILY34	70.245,12	2,57	Brazilian Depositary Rece...
BROADCOM INC - AVGO34	68.250,37	2,49	Brazilian Depositary Rece...
TESLA, INC - TSLA34	54.845,46	2,00	Brazilian Depositary Rece...
JPMORGAN CHASE & CO - JPMC34	45.625,23	1,67	Brazilian Depositary Rece...
WALMART INC - WALM34	43.185,85	1,58	Brazilian Depositary Rece...
NOVO NORDISK S.A. - N1VO34	39.110,16	1,43	Brazilian Depositary Rece...
UNITEDHEALTH GROUP INC - UNHH34	36.541,83	1,34	Brazilian Depositary Rece...
EXXON MOBIL CORPORATION - EXXO34	35.710,33	1,30	Brazilian Depositary Rece...
ORACLE CORPORATION - ORCL34	35.101,80	1,28	Brazilian Depositary Rece...
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIA...	33.727,57	1,23	Fundos de Investimento
ASML HOLDING NV - ASML34	31.928,00	1,17	Brazilian Depositary Rece...
MASTERCARD INCORPORATED - MSCD34	31.925,73	1,17	Brazilian Depositary Rece...
PROCTER & GAMBLE COMPANY - PGCO34	30.849,27	1,13	Brazilian Depositary Rece...
COSTCO WHOLESALE CORPORATION - COWC34	29.842,06	1,09	Brazilian Depositary Rece...
THE HOME DEPOT, INC - HOME34	28.220,84	1,03	Brazilian Depositary Rece...
TOYOTA MOTOR CORP - TMCO34	25.564,15	0,93	Brazilian Depositary Rece...
MERCK & CO, INC - MRCK34	25.424,27	0,93	Brazilian Depositary Rece...
BANK OF AMERICA CORPORATION - BOAC34	24.862,85	0,91	Brazilian Depositary Rece...
ABBVIE INC - ABBV34	24.017,28	0,88	Brazilian Depositary Rece...

