



SERCONPREV
Serviços em consultoria e Previdência

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

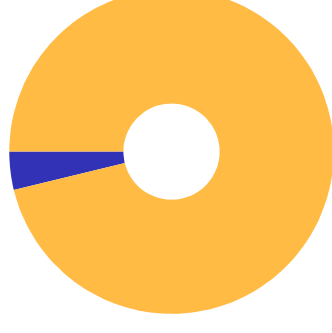
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	531.309,18	2,67%	382	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	76.800,06	0,39%	118	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	53.178,28	0,27%	810	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.576.165,42	7,93%	248	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.026.660,49	5,17%	308	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	Não há	968.752,59	4,87%	44	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	Não há	635.904,06	3,20%	24	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D + 0	16/05/2033	635.562,32	3,20%	41	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	Não há	633.779,99	3,19%	12	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	519.719,57	2,62%	777	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	911.911,70	4,59%	820	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.151.962,27	5,80%	903	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.604.279,31	8,07%	1.155	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.345.239,10	6,77%	430	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.671.706,90	13,44%	738	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	687.545,66	3,46%	1.148	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.997.492,85	10,05%	1.011	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.421.061,13	7,15%	453	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	668.509,25	3,36%	219	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	31.430,65	0,16%	5.672	0,03%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	61.294,15	0,31%	2.254	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	24.854,81	0,13%	1.554	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	D+4	Não há	296.862,98	1,49%	16.155	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	28.762,60	0,14%	4.917	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	D+4	Não há	312.782,62	1,57%	46	0,44%	Artigo 8º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			19.873.527,94				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3,98				Artigo 6º
PL Total			19.873.531,92				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea b	100,00%	14.342.931,24	72,17%	0,00%	45,00%	0,00%	-14.342.931,24
Artigo 7º, Inciso III, Alinea a	60,00%	4.774.608,89	24,02%	0,00%	20,00%	0,00%	-4.774.608,89
Total Renda Fixa	100,00%	19.117.540,13	96,20%	0,00%	80,00%	0,00%	

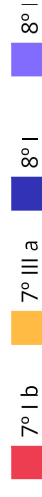


RENDA FIXA 19.117.540,13

RENDA VARIÁVEL 755.987,81

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	443.205,19	2,23%	0,00%	5,00%	0,00%	-443.205,19
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	312.782,62	1,57%	0,00%	7,00%	0,00%	-312.782,62
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	0,00%	0,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	755.987,81	3,80%	0,00%	15,00%	0,00%	



Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	18.524.694,76	93,21	0,09
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.218.854,84	6,13	-
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	129.978,34	0,65	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,60%	4,97%	2,29%	5,01%	9,44%	18,54%	-	-
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,20%	-	-	-	-	-	0,97%	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	2,96%	0,86%	2,96%	8,08%	18,05%	0,98%	1,71%
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%	4,49%	1,97%	4,49%	10,79%	25,84%	0,25%	0,35%
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%	1,73%
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%	3,78%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-1,08%	-1,30%	-1,50%	-1,30%	2,86%	16,46%	2,01%	3,98%
IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,32%	1,37%	-0,24%	1,37%	7,62%	25,50%	1,71%	2,51%
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	5,24%	2,53%	5,24%	11,71%	26,83%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,77%	5,10%	2,47%	5,10%	11,44%	26,23%	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	5,00%	2,39%	5,00%	11,34%	26,39%	0,05%	0,11%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,79%	5,19%	2,52%	5,19%	11,58%	26,65%	0,01%	0,08%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,80%	5,23%	2,47%	5,23%	12,03%	27,30%	0,04%	0,12%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	2,79%	2,86%	2,79%	5,46%	7,72%	0,48%	3,87%

IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,38%	-5,22%	-4,85%	-5,22%	-4,62%	-	2,35%	5,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,78%	2,89%	5,78%	11,46%	-	0,48%	0,87%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,17%	2,36%	0,55%	2,36%	7,39%	23,06%	0,88%	1,46%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-1,63%	-	-	-	-	-	2,61%	-

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,25%	-4,73%	-1,81%	-4,73%	-4,36%	-	2,20%	5,99%

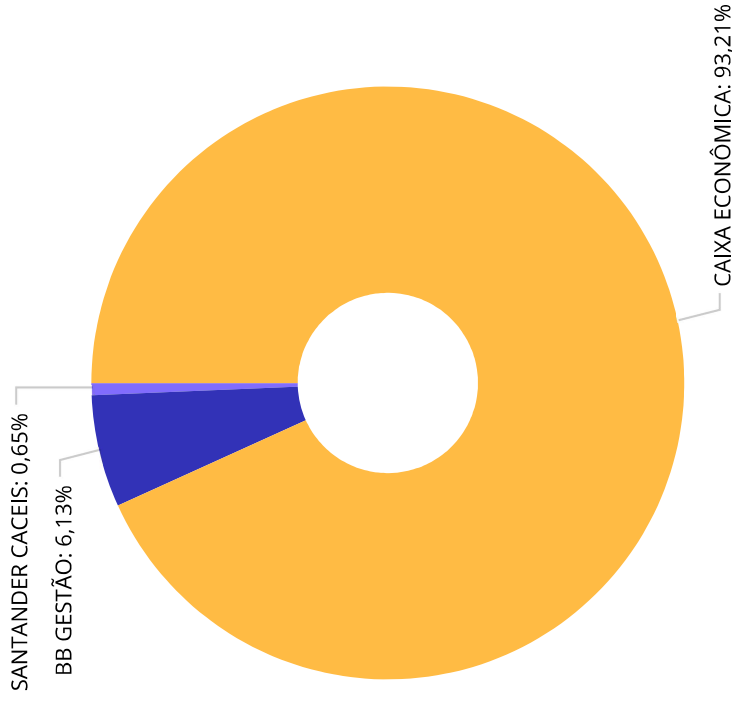
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	0,60%	-14,56%	-7,69%	-14,56%	-16,02%	-11,04%	9,56%	20,67%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	1,44%	-7,49%	-3,20%	-7,49%	4,86%	25,30%	5,71%	13,36%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	1,36%	-9,29%	-4,65%	-9,29%	0,39%	16,27%	5,64%	13,73%
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	1,86%	13,36%	15,88%	13,36%	40,12%	129,43%	11,44%	29,04%

IDIV (Benchmark)	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	1,90%	-3,86%	0,13%	-3,86%	10,80%	28,70%	5,25%	11,91%

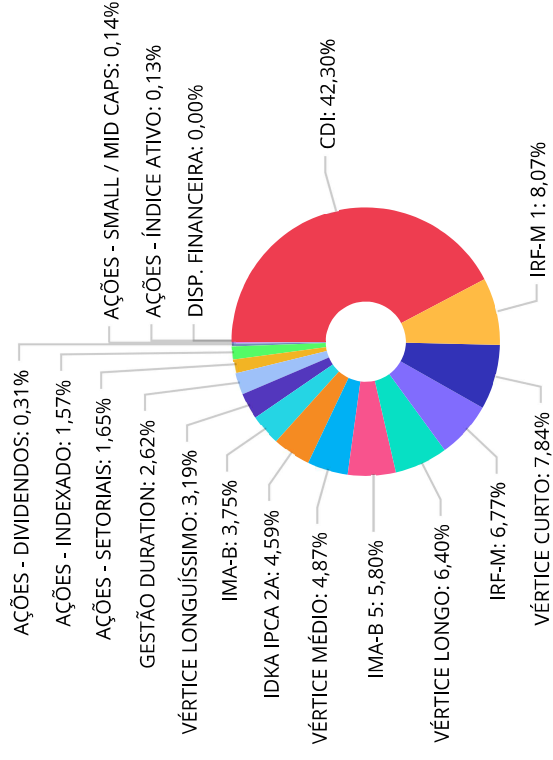
SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	-0,44%	-15,12%	-11,33%	-15,12%	-12,55%	3,94%	9,06%	19,37%

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



CAIXA ECONÔMICA	18.524.694,76
BB GESTÃO	1.218.854,84
SANTANDER CACEIS	129.978,34

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

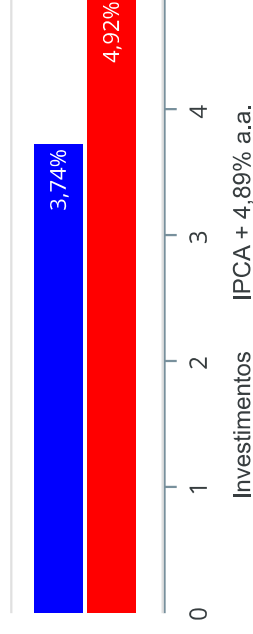


Sub-Segment	Value	Sub-Segment	Value	Sub-Segment	Value
CDI	8.407.150,24	IRF-M 1	1.604.279,31	VÉRTICE CURTO	1.557.969,67
VÉRTICE LONGO	1.271.466,38	IMA-B 5	1.151.962,27	VÉRTICE MÉDIO	968.752,59
IMA-B	745.309,31	VÉRTICE LONGUÍSSIMO	633.779,99	GESTÃO DURATION	519.719,57
AÇÕES - INDEXADO	312.782,62	AÇÕES - DIVIDENDOS	61.294,15	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	28.762,60
DISP. FINANCEIRA	3,98			AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	24.854,81
				IRF-M	1.345.239,10
				IDKA IPCA 2A	911.911,70
				AÇÕES - SETORIAIS	328.293,63

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

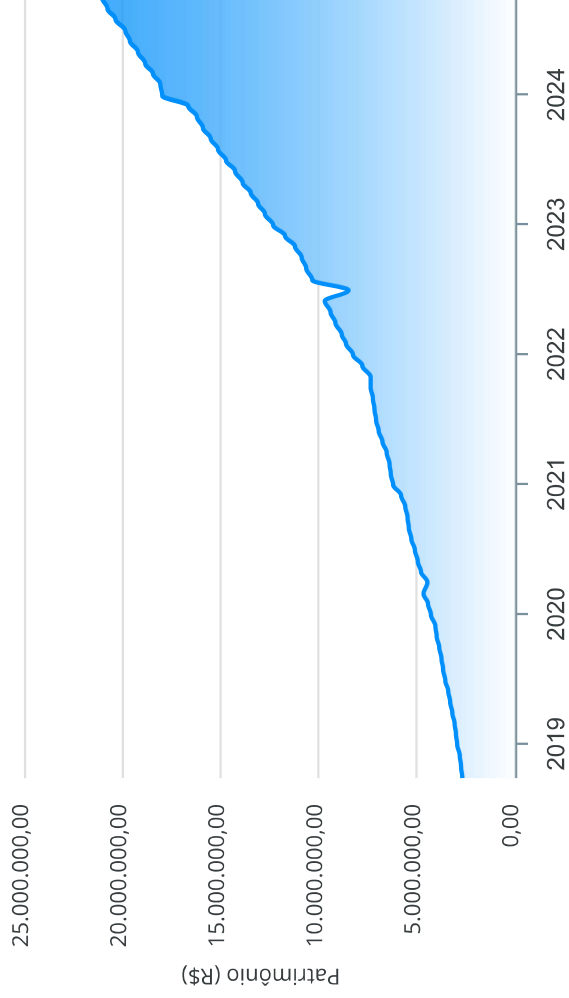
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	16.584.732,45	494.173,56	217.620,00	16.996.925,46	135.639,45	135.639,45	0,80%	0,80%	0,84%	0,84%	95,83%	0,55%
Fevereiro	16.996.925,46	465.423,07	271.006,30	17.304.850,43	113.508,20	249.147,65	0,66%	1,47%	1,19%	2,04%	71,95%	0,82%
Março	17.304.850,43	527.561,33	233.366,27	17.708.912,85	109.867,36	359.015,01	0,62%	2,10%	0,54%	2,59%	81,08%	0,64%
Abril	17.708.912,85	508.643,45	309.473,48	18.008.405,82	100.323,00	459.338,01	0,56%	2,68%	0,80%	3,41%	78,36%	0,77%
Mai	18.008.405,82	3.409.777,64	3.130.067,36	18.412.561,39	124.445,29	583.783,30	0,68%	3,37%	0,86%	4,30%	78,39%	1,01%
Junho	18.412.561,39	314.843,82	222.368,58	18.571.049,44	66.012,81	649.796,11	0,36%	3,74%	0,59%	4,92%	76,08%	0,96%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

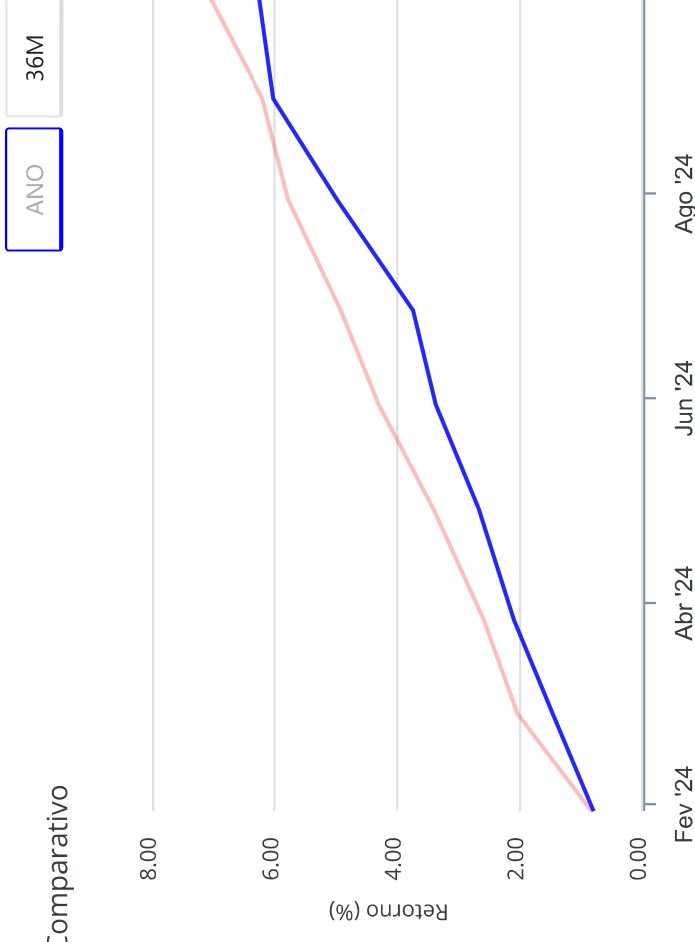


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	525.178,53	0,00	0,00	531.309,18	6.130,65	1,17%	1,17%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.014.893,97	0,00	0,00	1.026.660,49	11.766,52	1,16%	1,16%	0,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.981.274,48	0,00	0,00	1.997.492,85	16.218,37	0,82%	0,82%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1.409.854,65	0,00	0,00	1.421.061,13	11.206,48	0,79%	0,79%	0,04%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	52.760,44	0,00	0,00	53.178,28	417,84	0,79%	0,79%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	682.162,58	0,00	0,00	687.545,66	5.383,08	0,79%	0,79%	0,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.550.210,78	14.000,00	0,00	1.576.165,42	11.954,64	0,76%	0,77%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.551.767,64	100.000,00	0,00	2.671.706,90	19.939,26	0,75%	0,78%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.741.532,20	87.582,30	235.415,95	1.604.279,31	10.580,76	0,58%	0,61%	0,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.147.688,72	0,00	0,00	1.151.962,27	4.273,55	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	966.798,20	0,00	0,00	968.752,59	1.954,39	0,20%	0,20%	0,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	810.538,46	100.000,00	0,00	911.911,70	1.373,24	0,15%	0,20%	0,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	419.206,78	100.000,00	0,00	519.719,57	512,79	0,10%	0,17%	0,88%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.349.536,95	0,00	0,00	1.345.239,10	-4.297,85	-0,32%	-0,32%	1,71%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	77.464,77	0,00	0,00	76.800,06	-664,71	-0,86%	-0,86%	1,75%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	675.830,41	0,00	0,00	668.509,25	-7.321,16	-1,08%	-1,08%	2,01%
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	643.950,42	0,00	0,00	635.904,06	-8.046,36	-1,25%	-1,25%	2,20%
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	644.435,05	0,00	0,00	635.562,32	-8.872,73	-1,38%	-1,38%	2,35%
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	644.255,58	0,00	0,00	633.779,99	-10.475,59	-1,63%	-1,63%	2,61%
Total Renda Fixa	18.889.340,61	401.582,30	235.415,95	19.117.540,13	62.033,17	0,33%		0,68%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insttit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	60.150,55	0,00	0,00	61.294,15	1.143,60	1,90%	1,90%	5,25%
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	291.454,94	0,00	0,00	296.862,98	5.408,04	1,86%	1,86%	11,44%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	308.330,79	0,00	0,00	312.782,62	4.451,83	1,44%	1,44%	5,71%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	24.522,57	0,00	0,00	24.854,81	332,24	1,35%	1,35%	5,64%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	31.242,52	0,00	0,00	31.430,65	188,13	0,60%	0,60%	9,56%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	28.890,80	0,00	0,00	28.762,60	-128,20	-0,44%	-0,44%	9,06%
Total Renda Variável	744.592,17	0,00	0,00	755.987,81	11.395,64	1,53%		8,21%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.197.775,64	417.199,93	0,00	2.671.706,90	56.731,33	2,17%	2,39%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.764.513,90	0,00	1.399.584,36	1.421.061,13	56.131,59	2,03%	2,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.947.388,30	0,00	0,00	1.997.492,85	50.104,55	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	2.107.781,88	174.181,78	715.707,37	1.604.279,31	38.023,02	1,67%	1,97%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.371.807,49	168.000,00	0,00	1.576.165,42	36.357,93	2,36%	2,47%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	998.102,51	0,00	0,00	1.026.660,49	28.557,98	2,86%	2,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	670.593,73	0,00	0,00	687.545,66	16.951,93	2,53%	2,53%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA ZA TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.003.220,80	392.193,28	1.500.000,00	911.911,70	16.497,62	0,69%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	516.411,45	0,00	0,00	531.309,18	14.897,73	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.225.910,87	0,00	87.049,48	1.151.962,27	13.100,88	1,07%	1,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	161.629,46	355.443,52	0,00	519.719,57	2.646,59	0,51%	0,55%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	966.528,12	0,00	968.752,59	2.224,47	0,23%	-
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	51.873,80	0,00	0,00	53.178,28	1.304,48	2,51%	2,51%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	77.638,10	0,00	0,00	76.800,06	-838,04	-1,08%	-1,08%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.348.522,49	0,00	0,00	1.345.239,10	-3.283,39	-0,24%	-0,24%
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	644.352,08	0,00	635.904,06	-8.448,02	-1,31%	-1,81%
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	644.352,08	0,00	635.562,32	-8.789,76	-1,36%	-4,85%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	678.658,58	0,00	0,00	668.509,25	-10.149,33	-1,50%	-1,50%
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	644.352,08	0,00	633.779,99	-10.572,09	-1,64%	-

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	18.121.829,00	4.406.602,87	3.702.341,21	19.117.540,13	291.449,47	1,55%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	256.183,57	0,00	0,00	296.862,98	40.679,41	15,88%	15,88%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	61.215,53	0,00	0,00	61.294,15	78,62	0,13%	0,13%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	26.066,33	0,00	0,00	24.854,81	-1.211,52	-4,65%	-4,65%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	34.050,63	0,00	0,00	31.430,65	-2.619,98	-7,69%	-7,69%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	32.437,84	0,00	0,00	28.762,60	-3.675,24	-11,33%	-11,33%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	323.106,71	0,00	0,00	312.782,62	-10.324,09	-3,20%	-3,20%
Total Renda Variável	733.060,61	0,00	0,00	755.987,81	22.927,20	3,13%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.691.875,71	0,00	1.399.584,36	1.421.061,13	128.769,78	7,97%	5,23%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.143.076,21	417.199,93	0,00	2.671.706,90	111.430,76	7,65%	5,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.895.812,65	0,00	0,00	1.997.492,85	101.680,20	8,24%	5,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	2.433.270,08	279.274,73	1.201.377,93	1.604.279,31	93.112,43	6,90%	4,48%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.565.173,92	168.000,00	233.366,27	1.576.165,42	76.357,77	7,67%	5,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	998.825,99	0,00	28.193,34	1.026.660,49	56.027,84	7,34%	2,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.446.100,57	912.822,65	1.500.000,00	911.911,70	52.988,48	4,48%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.152.283,35	50.000,00	87.049,48	1.151.962,27	36.728,40	5,10%	3,21%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	638.674,34	14.838,67	0,00	687.545,66	34.032,65	8,09%	5,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	516.912,76	0,00	14.838,67	531.309,18	29.235,09	7,60%	5,78%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	780.350,33	551.646,45	0,00	1.345.239,10	13.242,32	3,60%	1,37%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	514.443,52	0,00	519.719,57	5.276,05	0,00%	2,36%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	50.553,56	0,00	0,00	53.178,28	2.624,72	7,97%	5,19%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	966.528,12	0,00	968.752,59	2.224,47	0,00%	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	77.563,65	0,00	0,00	76.800,06	-763,59	0,99%	-0,98%
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	644.352,08	0,00	635.904,06	-8.448,02	0,00%	-4,72%
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	644.352,08	0,00	635.562,32	-8.789,76	0,00%	-5,22%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	504.615,55	173.000,00	0,00	668.509,25	-9.106,30	0,55%	-1,30%
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	644.352,08	0,00	633.779,99	-10.572,09	0,00%	-
Total Renda Fixa	16.895.088,67	5.980.810,31	4.464.410,05	19.117.540,13	706.051,20	3,83%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	261.885,11	0,00	0,00	296.862,98	34.977,87	12,69%	13,36%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	63.753,78	0,00	0,00	61.294,15	-2.459,63	3,30%	-3,86%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	27.400,63	0,00	0,00	24.854,81	-2.545,82	-4,01%	-9,29%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	33.884,33	0,00	0,00	28.762,60	-5.121,73	-14,25%	-15,12%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	36.785,19	0,00	0,00	31.430,65	-5.354,54	-12,07%	-14,56%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	338.116,78	0,00	0,00	312.782,62	-25.334,16	-1,66%	-7,49%
Total Renda Variável	761.825,82	0,00	0,00	755.987,81	-5.838,01	-0,77%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da SERCONPREV - SERVIÇOS E CONSULTORIA EM PREVIDÊNCIA S/S LTDA.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

