

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

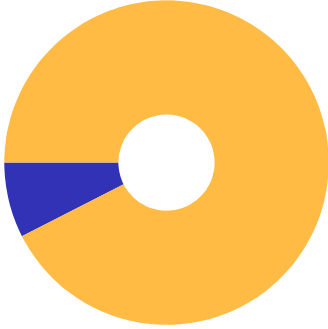
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	2.006.679,19	6,97%	248	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	Não há	1.464.385,27	5,09%	44	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	Não há	482.086,61	1,67%	24	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D + 0	16/05/2033	481.651,53	1,67%	41	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	D+0	Não há	480.552,07	1,67%	12	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.684.429,05	12,80%	777	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.528.764,45	8,79%	820	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.686.957,52	12,81%	903	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.326.684,42	18,51%	1.155	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	316.445,54	1,10%	430	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.007.162,64	10,45%	1.290	0,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	297.832,15	1,03%	1.011	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.299.738,86	7,99%	453	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	567.381,54	1,97%	219	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	91.179,74	0,32%	5.672	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	417.970,91	1,45%	2.254	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	44.087,56	0,15%	10.015	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	239.130,11	0,83%	16.155	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	217.711,24	0,76%	4.917	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.143.574,90	3,97%	46	1,62%	Artigo 8º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			28.784.405,30				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			76.603,69				Artigo 6º
PL Total			28.861.008,99				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	20.458.635,65	71,08%	0,00%	45,00%	0,00%	-20.458.635,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	6.172.115,19	21,44%	0,00%	20,00%	0,00%	-6.172.115,19
Total Renda Fixa	100,00%	26.630.750,84	92,52%	0,00%	80,00%	0,00%	

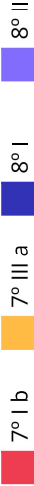


RENDA FIXA 26.630.750,84

RENDA VARIÁVEL 2.153.654,46

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%	1.010.079,56	3,51%	0,00%	5,00%	0,00%	-1.010.079,56
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	1.143.574,90	3,97%	0,00%	7,00%	0,00%	-1.143.574,90
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%	2.153.654,46	7,48%	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

Página 5 de 20

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	25.777.242,66	89,55	0,13
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	3.007.162,64	10,45	0,02

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%	-	-
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%	-	-
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%

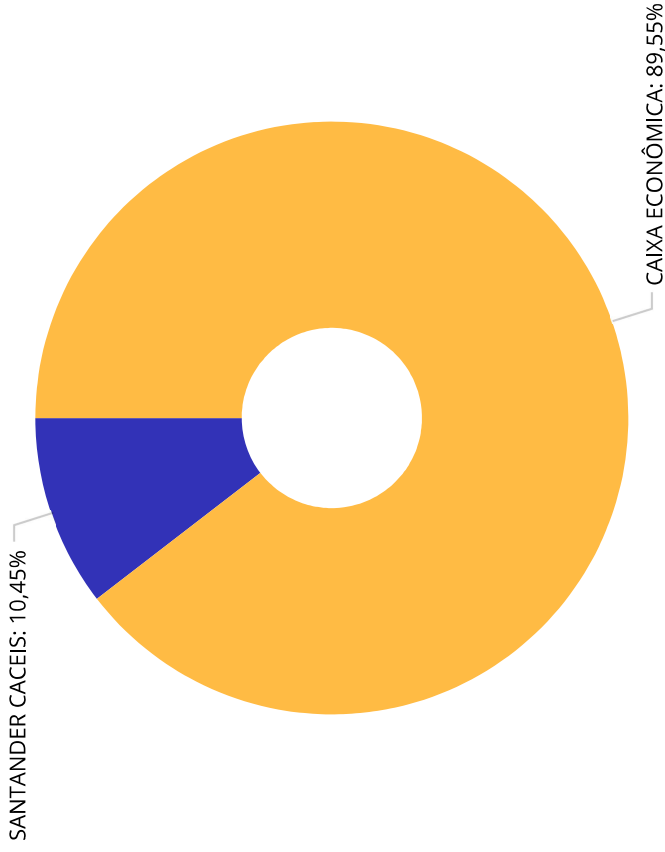
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,79%	5,21%	2,52%	5,21%	11,61%	26,61%	0,03%	0,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,80%	5,23%	2,47%	5,23%	12,03%	27,30%	0,04%	0,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
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%
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

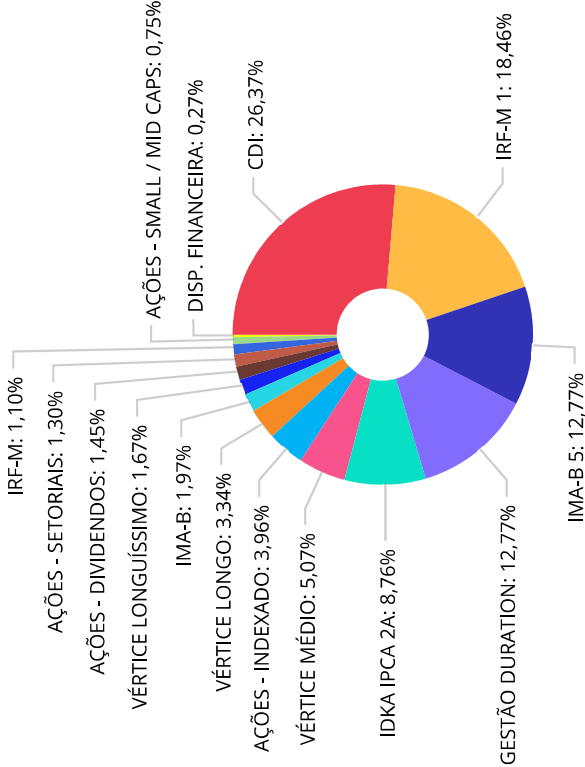
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	3,00%	-14,78%	-13,20%	-14,78%	-9,27%	-21,75%	9,53%	26,35%
Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	0,60%	-14,56%	-7,69%	-14,56%	-16,02%	-11,04%	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 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	25.777.242,66
SANTANDER CACEIS	3.007.162,64

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

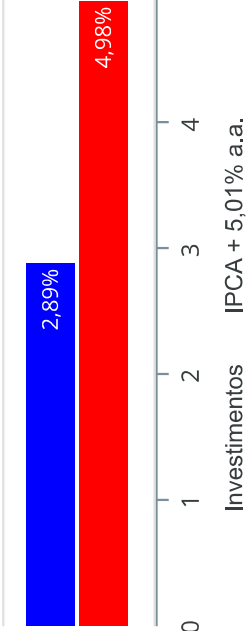


CDI	7.611.412,84	IRF-M 1	5.326.684,42	IMA-B 5	3.686.957,52	GESTÃO DURATION	3.684.429,05
IDKA IPCA 2A	2.528.764,45	VÉRTICE MÉDIO	1.464.385,27	AÇÕES - INDEXADO	1.143.574,90	VÉRTICE LONGO	963.738,14
IMA-B	567.381,54	VÉRTICE LONGUÍSSIMO	480.552,07	AÇÕES - DIVIDENDOS	417.970,91	AÇÕES - SETORIAIS	374.397,41
IRF-M	316.445,54	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	217.711,24	DISP. FINANCEIRA	76.603,69		

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	26.999.709,24	1.245.853,03	229.559,68	28.128.445,30	112.442,71	112.442,71	0,40%	0,40%	0,85%	0,85%	47,25%	0,76%
Fevereiro	28.128.445,30	286.157,96	165.237,26	28.434.641,04	185.275,04	297.717,75	0,66%	1,06%	1,20%	2,06%	51,40%	0,81%
Março	28.434.641,04	0,00	176.030,74	28.435.624,60	177.014,30	474.732,05	0,62%	1,69%	0,55%	2,62%	64,40%	0,77%
Abril	28.435.624,60	221.514,39	388.755,92	28.313.525,19	45.142,12	519.874,17	0,16%	1,85%	0,81%	3,45%	53,58%	1,06%
Mai	28.313.525,19	3.100.034,52	3.294.858,32	28.286.773,75	168.072,36	687.946,53	0,59%	2,45%	0,87%	4,35%	56,39%	0,95%
Junho	28.286.773,75	0,00	454.216,20	27.951.312,51	118.754,96	806.701,49	0,42%	2,89%	0,60%	4,98%	57,95%	1,09%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Investimentos

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 1+

Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV

Investimentos

☐ IMA-B 5

Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV

ANO

36M

☐ IMA-B

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
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	295.413,95	0,00	0,00	297.832,15	2.418,20	0,82%	0,82%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.281.603,14	0,00	0,00	2.299.738,86	18.135,72	0,79%	0,79%	0,04%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.983.543,81	0,00	0,00	3.007.162,64	23.618,83	0,79%	0,79%	0,03%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	2.442.615,40	0,00	454.216,20	2.006.679,19	18.279,99	0,75%	0,77%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.213.930,17	92.058,24	11.128,59	5.326.684,42	31.824,60	0,60%	0,61%	0,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.673.279,65	0,00	0,00	3.686.957,52	13.677,87	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	1.461.430,97	0,00	0,00	1.464.385,27	2.954,30	0,20%	0,20%	0,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.523.838,93	0,00	0,00	2.528.764,45	4.925,52	0,20%	0,20%	0,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.678.159,48	0,00	0,00	3.684.429,05	6.269,57	0,17%	0,17%	0,88%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	317.456,53	0,00	0,00	316.445,54	-1.010,99	-0,32%	-0,32%	1,71%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	573.595,20	0,00	0,00	567.381,54	-6.213,66	-1,08%	-1,08%	2,01%
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	488.186,65	0,00	0,00	482.086,61	-6.100,04	-1,25%	-1,25%	2,20%
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	488.375,60	0,00	0,00	481.651,53	-6.724,07	-1,38%	-1,38%	2,35%
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	488.494,99	0,00	0,00	480.552,07	-7.942,92	-1,63%	-1,63%	2,61%
Total Renda Fixa	26.909.924,47	92.058,24	465.344,79	26.630.750,84	94.112,92	0,35%		0,63%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	42.801,89	0,00	0,00	44.087,56	1.285,67	3,00%	3,00%	9,53%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	410.172,62	0,00	0,00	417.970,91	7.798,29	1,90%	1,90%	5,25%
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	234.773,79	0,00	0,00	239.130,11	4.356,32	1,86%	1,86%	11,44%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	1.127.298,45	0,00	0,00	1.143.574,90	16.276,45	1,44%	1,44%	5,71%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	90.633,95	0,00	0,00	91.179,74	545,79	0,60%	0,60%	9,56%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	218.681,63	0,00	0,00	217.711,24	-970,39	-0,44%	-0,44%	9,06%
Total Renda Variável	2.124.362,33	0,00	0,00	2.153.654,46	29.292,13	1,38%		6,84%

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	5.084.879,21	183.475,48	42.865,77	5.326.684,42	101.195,50	1,92%	1,97%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.933.281,02	0,00	0,00	3.007.162,64	73.881,62	2,52%	2,52%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	3.309.174,15	0,00	1.376.261,63	2.006.679,19	73.766,67	2,23%	2,47%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.782.604,03	194.329,66	739.756,86	2.299.738,86	62.562,03	2,10%	2,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	3.587.179,68	78.514,39	21.811,95	3.686.957,52	43.075,40	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.368.392,08	126.659,44	2.000.000,00	2.528.764,45	33.712,93	0,75%	0,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.684.237,06	0,00	0,00	3.684.429,05	20.191,99	0,55%	0,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	290.361,41	0,00	0,00	297.832,15	7.470,74	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	1.461.022,71	0,00	1.464.385,27	3.362,56	0,23%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	317.217,91	0,00	0,00	316.445,54	-772,37	-0,24%	-0,24%
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	487.007,57	0,00	482.086,61	-4.920,96	-1,01%	-1,81%
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	487.007,57	0,00	481.651,53	-5.356,04	-1,10%	-4,85%
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	487.007,57	0,00	480.552,07	-6.455,50	-1,33%	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	575.995,56	0,00	0,00	567.381,54	-8.614,02	-1,50%	-1,50%
Total Renda Fixa	26.913.322,11	3.505.024,39	4.180.696,21	26.630.750,84	393.100,55	1,29%	

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	206.361,88	0,00	0,00	239.130,11	32.768,23	15,88%	15,88%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	417.434,88	0,00	0,00	417.970,91	536,03	0,13%	0,13%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	50.791,90	0,00	0,00	44.087,56	-6.704,34	-13,20%	-13,20%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	98.780,26	0,00	0,00	91.179,74	-7.600,52	-7,69%	-7,69%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	245.530,07	0,00	0,00	217.711,24	-27.818,83	-11,33%	-11,33%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	1.181.321,16	0,00	0,00	1.143.574,90	-37.746,26	-3,20%	-3,20%
Total Renda Variável	2.200.220,15	0,00	0,00	2.153.654,46	-46.565,69	-2,12%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	5.240.220,33	183.475,48	325.674,80	5.326.684,42	228.663,41	7,03%	4,48%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	3.398.170,18	0,00	1.552.292,37	2.006.679,19	160.801,38	7,74%	5,10%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.858.127,74	0,00	0,00	3.007.162,64	149.034,90	7,98%	5,21%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.122.226,73	951.487,62	904.994,12	2.299.738,86	131.018,63	7,69%	5,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.279.370,05	126.659,44	2.000.000,00	2.528.764,45	122.734,96	4,64%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.191.462,83	635.514,39	251.371,63	3.686.957,52	111.351,93	4,99%	3,21%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.599.507,29	0,00	0,00	3.684.429,05	84.921,76	4,57%	2,36%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	282.671,33	0,00	0,00	297.832,15	15.160,82	8,24%	5,36%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	1.461.022,71	0,00	1.464.385,27	3.362,56	0,00%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	95.777,74	217.853,03	0,00	316.445,54	2.814,77	3,22%	1,37%
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	487.007,57	0,00	482.086,61	-4.920,96	0,00%	-4,72%
CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	487.007,57	0,00	481.651,53	-5.356,04	0,00%	-5,22%
CAIXA BRASIL 2035 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	487.007,57	0,00	480.552,07	-6.455,50	0,00%	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	574.858,67	0,00	0,00	567.381,54	-7.477,13	0,81%	-1,30%
Total Renda Fixa	25.642.392,89	5.037.035,38	5.034.332,92	26.630.750,84	985.655,49	3,84%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	210.954,60	0,00	0,00	239.130,11	28.175,51	12,69%	13,36%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	51.732,71	0,00	0,00	44.087,56	-7.645,15	-6,61%	-14,78%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	106.713,15	0,00	0,00	91.179,74	-15.533,41	-12,07%	-14,56%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	434.743,45	0,00	0,00	417.970,91	-16.772,54	3,30%	-3,86%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	256.478,90	0,00	0,00	217.711,24	-38.767,66	-14,25%	-15,12%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	1.236.199,98	0,00	0,00	1.143.574,90	-92.625,08	-1,66%	-7,49%
Total Renda Variável	2.296.822,79	0,00	0,00	2.153.654,46	-143.168,33	-6,23%	

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.

