

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
TÍTULOS PÚBLICOS			946.074,30	3,17%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.034.326,97	3,47%	697	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	365.321,31	1,23%	862	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	346.807,16	1,16%	792	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	476.516,97	1,60%	272	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	917.379,01	3,08%	638	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	360.509,18	1,21%	98	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	709.956,28	2,38%	1.141	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	805.688,02	2,70%	635	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.722.770,24	5,78%	382	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	722.233,67	2,42%	116	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	846.643,46	2,84%	219	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2028	413.356,25	1,39%	105	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2030	537.366,84	1,80%	122	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	1.894.886,44	6,36%	370	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.981.370,33	6,65%	1.542	1,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	402.415,94	1,35%	105	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.270.366,43	4,26%	44.456	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	88.213,16	0,30%	1.007	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	384.955,71	1,29%	238	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

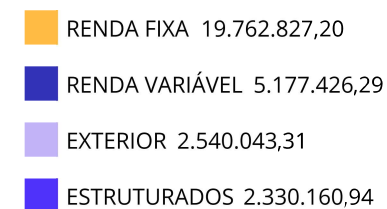
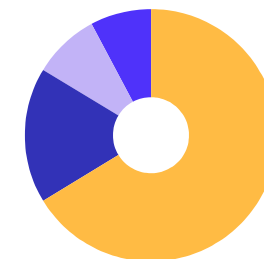
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	248.514,21	0,83%	1.148	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	176.208,17	0,59%	208	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	525.056,66	1,76%	95	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	443.137,01	1,49%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	1.284.945,86	4,31%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	857.807,62	2,88%	55.410	0,04%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	287.762,84	0,97%	20.809	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	737.184,26	2,47%	1.174	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	589.927,46	1,98%	6.047	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	769.414,97	2,58%	16.298	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	216.318,20	0,73%	8.478	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	627.009,36	2,10%	375	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	318.101,35	1,07%	338	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	767.413,40	2,57%	179	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	123.037,36	0,41%	7.487	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	387.422,76	1,30%	3.735	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	353.834,33	1,19%	62	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.411.696,97	4,74%	155	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	565.349,11	1,90%	21.756	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	562.997,23	1,89%	1.603	0,49%	Artigo 9º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	163.411,51	0,55%	78	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	587.513,31	1,97%	165	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.193.325,66	4,00%	34.588	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	385.910,46	1,29%	599	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			29.810.457,74				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			14.518,63				Artigo 6º
PL Total			29.824.976,37				

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%	946.074,30	3,17%	0,00%	22,95%	81,95%	23.483.595,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	13.537.548,07	45,41%	20,48%	27,30%	81,95%	10.892.122,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	2.693.314,34	9,03%	5,00%	12,30%	60,00%	15.192.960,30
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	1.728.082,87	5,80%	0,00%	0,00%	20,00%	4.234.008,68
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	857.807,62	2,88%	0,00%	5,00%	5,00%	632.715,27
Total Renda Fixa	100,00%	19.762.827,20	66,29%	25,48%	67,55%	248,90%	

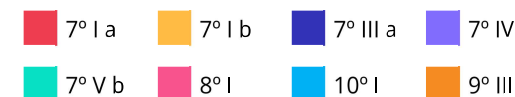
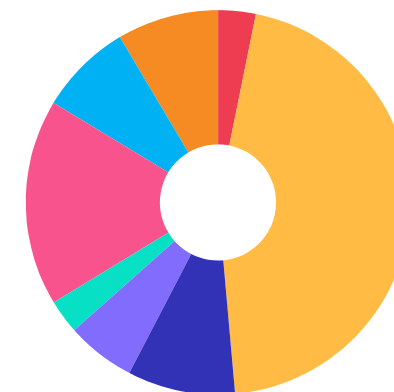


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.177.426,29	17,37%	12,75%	18,25%	20,00%	784.665,26
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.330.160,94	7,82%	0,00%	8,20%	10,00%	650.884,83
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	7.507.587,23	25,18%	12,75%	26,45%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.540.043,31	8,52%	0,00%	5,00%	10,00%	441.002,46
Total Exterior	10,00%	2.540.043,31	8,52%	0,00%	5,00%	10,00%	

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%	1,00%	5,00%	1.490.522,89



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	946.074,30	3,17	0,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	13.537.548,07	45,41	20,48	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	2.693.314,34	9,03	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	1.728.082,87	5,80	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	857.807,62	2,88	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	5.177.426,29	17,37	12,75	20,00
Artigo 9º, Inciso III	2.540.043,31	8,52	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.330.160,94	7,82	0,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.667.715,60	65,98	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	3.466.187,31	11,63	0,02
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.943.039,22	9,87	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.284.945,86	4,31	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	946.074,30	3,17	-
BANCO DAYCOVAL	443.137,01	1,49	0,00
GENIAL INVESTIMENTOS	387.422,76	1,30	-
MOS CAPITAL	353.834,33	1,19	0,26
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	318.101,35	1,07	-

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%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,20%	-	-	-	-	-	0,97%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02%	1,97%	0,22%	1,97%	6,11%	17,70%	1,37%	2,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,30%	0,57%	-0,45%	0,57%	4,43%	-	1,57%	3,14%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	3,11%	1,05%	3,11%	8,11%	18,30%	0,92%	1,71%
IMA Geral (Benchmark)	0,05%	2,42%	0,77%	2,42%	8,23%	23,40%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	2,32%	0,72%	2,32%	7,95%	23,35%	0,90%	1,71%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,25%	-5,04%	-3,58%	-5,04%	-1,43%	14,67%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,28%	-5,21%	-3,66%	-5,21%	-1,73%	13,89%	3,04%	6,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	4,51%	2,00%	4,51%	10,95%	26,28%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	4,40%	1,93%	4,40%	10,67%	25,58%	0,24%	0,35%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%	-	-
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,31%	2,33%	0,65%	2,33%	6,84%	17,58%	0,84%	1,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,38%	3,23%	1,19%	3,23%	8,03%	18,87%	0,81%	1,73%

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	3,20%	1,18%	3,20%	7,97%	18,82%	0,81%	1,74%
IMA-B (Benchmark)	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,98%	-1,28%	-1,34%	-1,28%	2,67%	16,26%	1,89%	3,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	-1,23%	-1,33%	-1,23%	2,76%	16,42%	1,89%	3,87%
IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,32%	1,37%	-0,24%	1,37%	7,50%	25,11%	1,71%	2,50%
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,17%	5,93%	3,30%	5,93%	11,82%	26,87%	0,43%	0,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	5,11%	2,98%	5,11%	10,59%	25,04%	0,18%	0,79%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,22%	7,48%	3,83%	7,48%	11,92%	24,18%	1,88%	2,95%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	3,84%	1,40%	3,84%	9,79%	25,12%	0,47%	0,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	5,24%	2,53%	5,24%	11,71%	26,83%	0,02%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,06%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,86%	6,10%	2,73%	6,10%	13,75%	27,89%	0,04%	0,21%
IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,72%	-0,83%	-1,08%	-0,83%	2,51%	15,92%	1,95%	3,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,78%	2,89%	5,78%	11,46%	-	0,48%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,73%	2,86%	5,73%	11,35%	20,70%	0,48%	0,87%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,86%	6,10%	2,73%	6,10%	13,75%	27,89%	0,04%	0,21%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,02%	0,57%	-0,74%	0,57%	5,60%	16,33%	1,91%	2,87%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,21%	2,19%	0,26%	2,19%	7,75%	21,19%	1,27%	1,77%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,36%	2,78%	0,48%	2,78%	9,19%	23,96%	1,07%	1,49%

Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1,72%	-8,69%	-3,84%	-8,69%	2,24%	19,50%	5,72%	13,61%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,13%	-7,60%	-3,48%	-7,60%	3,60%	13,77%	5,36%	13,79%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,03%	-12,00%	-6,72%	-12,00%	-1,82%	15,53%	6,12%	15,02%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,00%	-8,72%	-4,73%	-8,72%	2,83%	25,86%	6,10%	12,82%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,37%	-6,68%	-5,52%	-6,68%	4,80%	29,31%	6,88%	14,31%
QLZ MOS FI AÇÕES	-1,17%	-10,53%	-9,87%	-10,53%	-3,49%	-	10,64%	18,72%

IDIV (Benchmark)	1,99%	-3,41%	0,42%	-3,41%	12,09%	31,97%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,99%	-5,09%	-2,39%	-5,09%	8,46%	29,61%	5,37%	12,88%

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,47%	14,48%	3,92%	14,48%	22,70%	44,25%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3,96%	16,75%	5,07%	16,75%	29,39%	66,04%	2,95%	11,07%

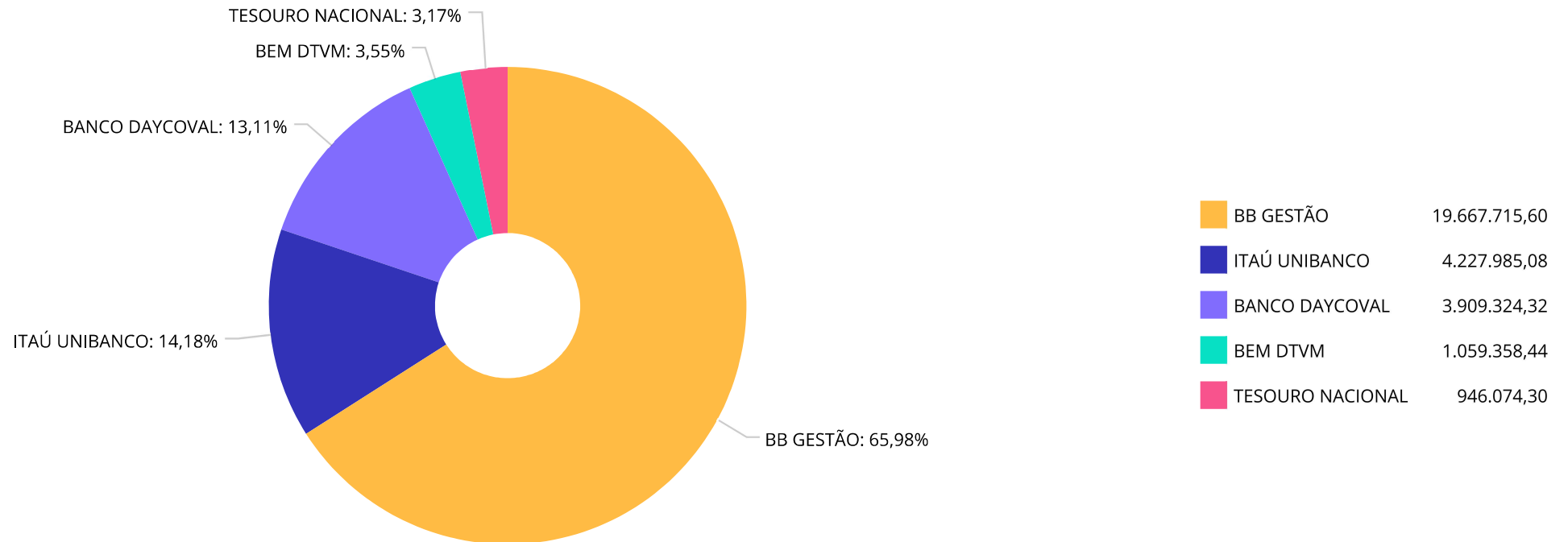
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,95%	16,24%	5,15%	16,24%	27,39%	56,34%	3,30%	11,16%
SMLL (Benchmark)	-0,39%	-14,85%	-11,23%	-14,85%	-11,96%	5,47%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	0,09%	-12,64%	-9,61%	-12,64%	-9,60%	6,31%	8,13%	18,15%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-3,41%	-19,71%	-16,08%	-19,71%	-17,97%	-1,96%	12,11%	21,45%

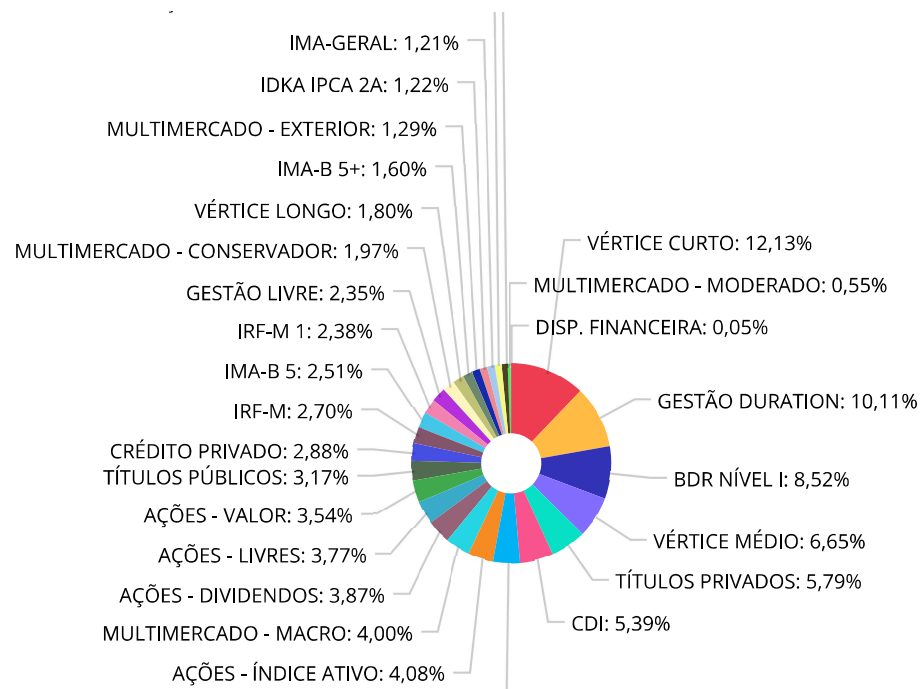
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	9,06%	30,08%	14,91%	30,08%	42,46%	44,18%	5,71%	11,883%
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	6,21%	26,41%	8,96%	26,41%	43,70%	89,86%	5,16%	14,922%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	9,77%	30,18%	14,26%	30,18%	42,38%	57,22%	6,32%	13,607%

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



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



■ VÉRTICE CURTO	3.617.656,68	■ GESTÃO DURATION	3.015.697,30	■ BDR NÍVEL I	2.540.043,31	■ VÉRTICE MÉDIO	1.982.233,38
■ TÍTULOS PRIVADOS	1.728.082,87	■ CDI	1.607.093,80	■ IMA-B	1.302.334,72	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.216.936,82
■ MULTIMERCADO - MACRO	1.193.325,66	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.154.836,16	■ AÇÕES - LIVRES	1.123.249,30	■ AÇÕES - VALOR	1.055.285,61
■ TÍTULOS PÚBLICOS	946.074,30	■ CRÉDITO PRIVADO	857.807,62	■ IRF-M	805.688,02	■ IMA-B 5	749.223,10
■ IRF-M 1	709.956,28	■ GESTÃO LIVRE	701.264,83	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	587.513,31	■ VÉRTICE LONGO	537.366,84
■ IMA-B 5+	476.516,97	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	385.910,46	■ IDKA IPCA 2A	365.321,31	■ IMA-GERAL	360.509,18
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	339.355,56	■ AÇÕES - EXTERIOR	287.762,84	■ MULTIMERCADO - MODERADO	163.411,51	■ DISP. FINANCEIRA	14.518,63

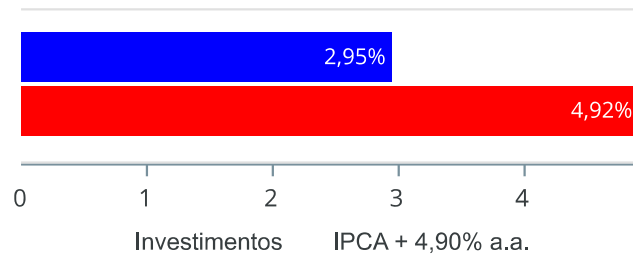
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2033	14/07/2023	115	4.342,32518690	4.190,905343	499.367,40	481.954,11	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	14/07/2023	110	4.389,37139706	4.219,274429	482.830,85	464.120,19	Mercado

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	26.866.290,46	120.383,91	202.251,39	26.789.839,64	5.416,66	5.416,66	0,02%	0,02%	0,84%	0,84%	2,40%	2,11%
Fevereiro	26.789.839,64	676.141,60	297.543,34	27.476.083,97	307.646,07	313.062,73	1,13%	1,15%	1,19%	2,04%	56,38%	2,41%
Março	27.476.083,97	560.539,86	208.818,52	28.020.986,35	193.181,04	506.243,77	0,69%	1,85%	0,54%	2,60%	71,44%	1,99%
Abril	28.020.986,35	990.410,98	669.245,56	28.118.663,44	-223.488,33	282.755,44	-0,79%	1,05%	0,80%	3,42%	30,78%	2,64%
Mai	28.118.663,44	3.650.486,52	3.328.323,65	28.647.488,93	206.662,62	489.418,06	0,73%	1,79%	0,86%	4,31%	41,46%	2,15%
Junho	28.647.488,93	1.186.744,87	359.480,69	29.810.457,74	335.704,63	825.122,69	1,14%	2,95%	0,59%	4,92%	59,81%	2,51%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



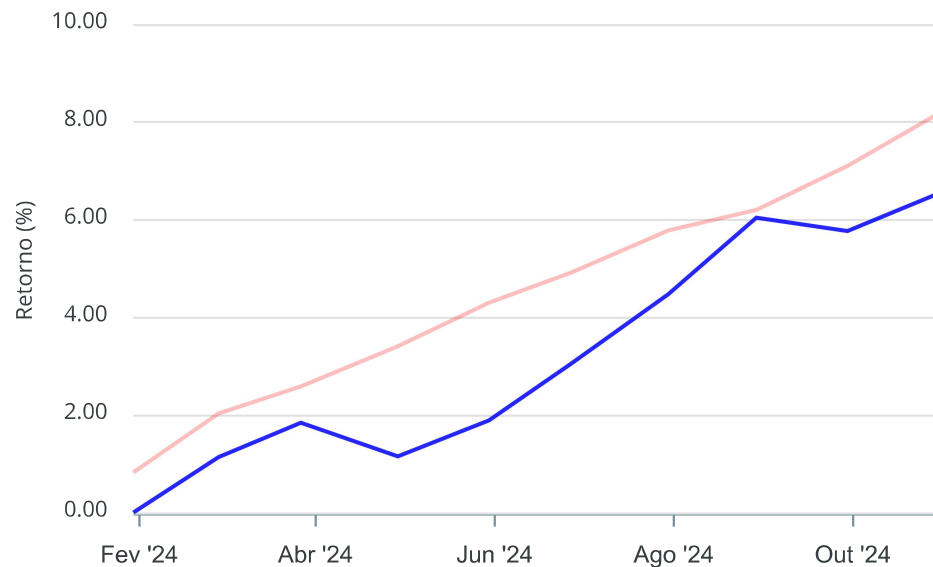
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	519.005,89	0,00	0,00	525.056,66	6.050,77	1,17%	1,17%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.873.157,38	0,00	0,00	1.894.886,44	21.729,06	1,16%	1,16%	0,48%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.152.805,50	103.500,00	0,00	1.270.366,43	14.060,93	1,12%	1,22%	1,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.547.334,66	156.515,66	0,00	1.722.770,24	18.919,92	1,11%	1,17%	0,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	174.644,03	0,00	0,00	176.208,17	1.564,14	0,90%	0,90%	0,18%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	439.217,71	0,00	0,00	443.137,01	3.919,30	0,89%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	850.479,01	0,00	0,00	857.807,62	7.328,61	0,86%	0,86%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	40.683,60	414.243,12	209.480,69	248.514,21	3.068,18	0,67%	0,79%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	705.683,74	0,00	0,00	709.956,28	4.272,54	0,61%	0,61%	0,24%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	1.278.079,29	0,00	0,00	1.284.945,86	6.866,57	0,54%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	46.060,67	41.796,03	0,00	88.213,16	356,46	0,41%	0,71%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.030.381,21	0,00	0,00	1.034.326,97	3.945,76	0,38%	0,38%	0,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	400.896,66	0,00	0,00	402.415,94	1.519,28	0,38%	0,38%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	345.515,43	0,00	0,00	346.807,16	1.291,73	0,37%	0,37%	0,81%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.975.315,23	0,00	0,00	1.981.370,33	6.055,10	0,31%	0,31%	0,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	364.388,97	0,00	0,00	365.321,31	932,34	0,26%	0,26%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	720.773,21	0,00	0,00	722.233,67	1.460,46	0,20%	0,20%	0,97%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	360.411,50	0,00	0,00	360.509,18	97,68	0,03%	0,03%	0,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	846.817,87	0,00	0,00	846.643,46	-174,41	-0,02%	-0,02%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	414.606,67	0,00	0,00	413.356,25	-1.250,42	-0,30%	-0,30%	1,57%

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	808.240,35	0,00	0,00	805.688,02	-2.552,33	-0,32%	-0,32%	1,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	541.240,47	0,00	0,00	537.366,84	-3.873,63	-0,72%	-0,72%	1,95%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	539.632,76	0,00	150.000,00	384.955,71	-4.677,05	-0,87%	-0,98%	1,89%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.495,79	470.690,06	0,00	476.516,97	-4.668,88	-0,97%	-2,28%	3,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	926.507,48	0,00	0,00	917.379,01	-9.128,47	-0,99%	-0,99%	1,89%
TÍTULOS PÚBLICOS	962.303,02	0,00	0,00	946.074,30	-16.228,72	-1,69%	-	-
Total Renda Fixa	18.874.678,10	1.186.744,87	359.480,69	19.762.827,20	60.884,92	0,31%		0,99%

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	371.198,31	0,00	0,00	385.910,46	14.712,15	3,96%	3,96%	2,95%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	276.841,40	0,00	0,00	287.762,84	10.921,44	3,95%	3,95%	3,30%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	379.835,32	0,00	0,00	387.422,76	7.587,44	2,00%	2,00%	6,10%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	755.099,63	0,00	0,00	769.414,97	14.315,34	1,90%	1,90%	5,03%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	616.430,59	0,00	0,00	627.009,36	10.578,77	1,72%	1,72%	5,72%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	313.819,14	0,00	0,00	318.101,35	4.282,21	1,36%	1,36%	6,88%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	728.930,30	0,00	0,00	737.184,26	8.253,96	1,13%	1,13%	5,36%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	759.883,90	0,00	0,00	767.413,40	7.529,50	0,99%	0,99%	5,37%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	585.392,04	0,00	0,00	587.513,31	2.121,27	0,36%	0,36%	1,07%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	163.072,40	0,00	0,00	163.411,51	339,11	0,21%	0,21%	1,27%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	122.924,15	0,00	0,00	123.037,36	113,21	0,09%	0,09%	8,13%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	589.763,30	0,00	0,00	589.927,46	164,16	0,03%	0,03%	6,12%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.193.066,20	0,00	0,00	1.193.325,66	259,46	0,02%	0,02%	1,91%
QLZ MOS FI AÇÕES	358.004,87	0,00	0,00	353.834,33	-4.170,54	-1,16%	-1,16%	10,64%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	223.963,49	0,00	0,00	216.318,20	-7.645,29	-3,41%	-3,41%	12,11%
Total Renda Variável	7.438.225,04	0,00	0,00	7.507.587,23	69.362,19	0,93%		4,83%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.286.037,83	0,00	0,00	1.411.696,97	125.659,14	9,77%	9,77%	6,32%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	516.237,38	0,00	0,00	562.997,23	46.759,85	9,06%	9,06%	5,71%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	532.310,58	0,00	0,00	565.349,11	33.038,53	6,21%	6,21%	5,16%
Total Exterior	2.334.585,79	0,00	0,00	2.540.043,31	205.457,52	8,80%		5,93%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.842.158,62	0,00	0,00	1.894.886,44	52.727,82	2,86%	2,86%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.409.493,92	113.383,24	300.000,00	1.270.366,43	47.489,27	3,12%	3,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.152.882,58	528.247,41	0,00	1.722.770,24	41.640,25	2,48%	2,88%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	1.251.526,20	0,00	0,00	1.284.945,86	33.419,66	2,67%	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	835.010,12	0,00	0,00	857.807,62	22.797,50	2,73%	2,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	958.557,80	0,00	800.000,00	176.208,17	17.650,37	1,84%	2,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	508.298,85	0,00	0,00	525.056,66	16.757,81	3,30%	3,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	696.544,67	0,00	0,00	709.956,28	13.411,61	1,93%	1,93%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.968.679,84	0,00	0,00	1.981.370,33	12.690,49	0,64%	0,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	403.287,94	837.494,01	1.004.780,03	248.514,21	12.512,29	1,01%	2,53%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	431.557,56	0,00	0,00	443.137,01	11.579,45	2,68%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	1.027.649,19	0,00	1.034.326,97	6.677,78	0,65%	1,40%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	641.460,46	0,00	285.000,00	360.509,18	4.048,72	0,63%	0,72%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	342.772,05	0,00	0,00	346.807,16	4.035,11	1,18%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	361.541,45	0,00	0,00	365.321,31	3.779,86	1,05%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	718.880,90	0,00	722.233,67	3.352,77	0,47%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,00	400.000,00	0,00	402.415,94	2.415,94	0,60%	1,19%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	131.515,91	88.028,54	133.318,30	88.213,16	1.987,01	0,91%	2,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	869.760,21	0,00	24.981,85	846.643,46	1.865,10	0,21%	0,22%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.796.416,38	10.420,50	1.000.000,00	805.688,02	-1.148,86	-0,06%	-0,24%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	188.285,27	0,00	187.057,31	0,00	-1.227,96	-0,65%	-1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	415.000,00	0,00	413.356,25	-1.643,75	-0,40%	-0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	438.385,13	103.500,00	0,00	537.366,84	-4.518,29	-0,83%	-1,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	481.110,56	0,00	476.516,97	-4.593,59	-0,95%	-3,66%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	541.620,48	0,00	150.000,00	384.955,71	-6.664,77	-1,23%	-1,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	929.746,00	0,00	0,00	917.379,01	-12.366,99	-1,33%	-1,33%
TÍTULOS PÚBLICOS	985.758,07	0,00	14.518,63	946.074,30	-25.165,14	-2,55%	-
Total Renda Fixa	18.685.259,51	4.723.714,35	3.899.656,12	19.762.827,20	253.509,46	1,30%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	367.292,50	0,00	0,00	385.910,46	18.617,96	5,07%	5,07%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	214.920,80	59.476,93	0,00	287.762,84	13.365,11	4,87%	5,15%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	584.710,34	0,00	0,00	587.513,31	2.802,97	0,48%	0,48%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	456.031,93	0,00	457.393,78	0,00	1.361,85	0,30%	-10,27%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	162.984,16	0,00	0,00	163.411,51	427,35	0,26%	0,26%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13.929,48	307.000,00	0,00	318.101,35	-2.828,13	-0,88%	-5,52%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.202.251,74	0,00	0,00	1.193.325,66	-8.926,08	-0,74%	-0,74%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	136.117,45	0,00	0,00	123.037,36	-13.080,09	-9,61%	-9,61%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	46.889,71	737.451,09	0,00	767.413,40	-16.927,40	-2,16%	-2,39%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	406.634,60	0,00	0,00	387.422,76	-19.211,84	-4,72%	-4,72%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	652.035,95	0,00	0,00	627.009,36	-25.026,59	-3,84%	-3,84%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	763.770,43	0,00	0,00	737.184,26	-26.586,17	-3,48%	-3,48%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	801.044,18	0,00	0,00	769.414,97	-31.629,21	-3,95%	-3,95%
QLZ MOS FI AÇÕES	392.590,39	0,00	0,00	353.834,33	-38.756,06	-9,87%	-9,87%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	257.776,73	0,00	0,00	216.318,20	-41.458,53	-16,08%	-16,08%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	632.439,02	0,00	0,00	589.927,46	-42.511,56	-6,72%	-6,72%
Total Renda Variável	7.091.419,41	1.103.928,02	457.393,78	7.507.587,23	-230.366,42	-2,98%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.235.525,83	0,00	0,00	1.411.696,97	176.171,14	14,26%	14,26%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	489.928,32	0,00	0,00	562.997,23	73.068,91	14,91%	14,91%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	518.853,28	0,00	0,00	565.349,11	46.495,83	8,96%	8,96%
Total Exterior	2.244.307,43	0,00	0,00	2.540.043,31	295.735,88	13,18%	

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.843.475,80	0,00	52.008,64	1.894.886,44	103.419,28	7,34%	5,73%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.169.758,75	311.189,29	300.000,00	1.270.366,43	89.418,39	12,06%	7,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.154.001,76	528.247,41	33.127,17	1.722.770,24	73.648,24	7,31%	5,78%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	1.214.441,50	0,00	0,00	1.284.945,86	70.504,36	9,09%	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	808.467,60	0,00	0,00	857.807,62	49.340,02	10,22%	6,10%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.936.296,98	0,00	0,00	1.981.370,33	45.073,35	4,88%	2,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	939.193,04	0,00	800.000,00	176.208,17	37.015,13	8,60%	5,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	857.332,64	955.474,13	1.596.050,36	248.514,21	31.757,80	7,79%	5,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	680.032,18	0,00	0,00	709.956,28	29.924,10	7,37%	4,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	495.682,54	0,00	0,00	525.056,66	29.374,12	10,14%	5,93%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	417.574,96	0,00	0,00	443.137,01	25.562,05	9,87%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.370.119,08	410.676,88	1.000.000,00	805.688,02	24.892,06	3,91%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	854.804,86	0,00	24.981,85	846.643,46	16.820,45	4,56%	1,97%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	631.425,38	0,00	285.000,00	360.509,18	14.083,80	5,08%	2,32%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	354.290,75	0,00	0,00	365.321,31	11.030,56	5,92%	3,11%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	336.049,43	0,00	0,00	346.807,16	10.757,73	5,82%	3,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	1.027.649,19	0,00	1.034.326,97	6.677,78	0,00%	3,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	47.704,24	179.439,37	142.656,14	88.213,16	3.725,69	5,78%	4,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	718.880,90	0,00	722.233,67	3.352,77	0,00%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,00	400.000,00	0,00	402.415,94	2.415,94	0,00%	3,23%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	188.057,08	0,00	187.057,31	0,00	-999,77	-0,54%	-1,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	415.000,00	0,00	413.356,25	-1.643,75	0,00%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	343.048,62	207.000,00	9.170,24	537.366,84	-3.511,54	0,73%	-0,83%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	481.110,56	0,00	476.516,97	-4.593,59	0,00%	-5,21%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	497.869,51	43.265,15	150.000,00	384.955,71	-6.178,95	-0,12%	-1,28%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	928.760,45	0,00	0,00	917.379,01	-11.381,44	-0,05%	-1,23%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.010.171,01	0,00	28.217,66	946.074,30	-35.879,05	-0,04%	-
Total Renda Fixa	18.078.558,16	5.677.932,88	4.608.269,37	19.762.827,20	614.605,53	3,21%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	330.543,92	0,00	0,00	385.910,46	55.366,54	23,73%	16,75%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	188.448,91	65.839,55	0,00	287.762,84	33.474,38	20,93%	16,24%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	571.646,44	0,00	0,00	587.513,31	15.866,87	4,79%	2,78%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.186.548,91	0,00	0,00	1.193.325,66	6.776,75	2,59%	0,57%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	159.910,56	0,00	0,00	163.411,51	3.500,95	4,28%	2,19%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	320.699,03	0,00	318.101,35	-2.597,68	7,68%	-6,68%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	140.845,37	0,00	0,00	123.037,36	-17.808,01	-12,71%	-12,64%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	48.220,97	737.451,09	0,00	767.413,40	-18.258,66	-1,51%	-5,09%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	482.892,26	0,00	457.393,78	0,00	-25.498,48	-5,27%	-15,26%
QLZ MOS FI AÇÕES	0,00	382.785,19	0,00	353.834,33	-28.950,86	-1,40%	-10,53%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	424.426,92	0,00	0,00	387.422,76	-37.004,16	-7,72%	-8,72%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	269.409,18	0,00	0,00	216.318,20	-53.090,98	-17,69%	-19,71%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	686.643,50	0,00	0,00	627.009,36	-59.634,14	-4,68%	-8,68%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	797.809,74	0,00	0,00	737.184,26	-60.625,48	-5,35%	-7,60%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	670.338,28	0,00	0,00	589.927,46	-80.410,82	-7,43%	-12,00%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	865.543,68	0,00	0,00	769.414,97	-96.128,71	-8,58%	-11,11%
Total Renda Variável	6.823.228,64	1.506.774,86	457.393,78	7.507.587,23	-365.022,49	-4,64%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.084.441,31	0,00	0,00	1.411.696,97	327.255,66	38,95%	30,18%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	432.820,24	0,00	0,00	562.997,23	130.176,99	40,92%	30,08%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	447.242,11	0,00	0,00	565.349,11	118.107,00	29,12%	26,41%
Total Exterior	1.964.503,66	0,00	0,00	2.540.043,31	575.539,65	29,30%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. 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.

