

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	240.190.948,48	41,51%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.342.453,24	5,94%	6.543.333.888,45	0,52%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.635.884,77	2,88%	4.858.229.912,84	0,34%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	65.846.512,86	11,38%	7.877.165.450,51	0,84%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.193.061,26	2,63%	2.052.875.038,41	0,74%	7º I b
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.012.163,58	0,17%	11.692.368.410,92	0,01%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.485.476,93	8,73%	16.508.104.382,05	0,31%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	26.619.961,98	4,60%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.806.462,86	4,81%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	37.852.949,16	6,54%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.791.923,79	3,77%	0,00		7º IV
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.748.867,48	2,20%	1.108.199.259,35	1,15%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	16.423.447,24	2,84%	459.571.224,62	3,57%	8º I
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.640.704,10	2,01%	771.250.758,76	1,51%	9º III

Investimentos

 578.590.817,73

Disponibilidades Financeiras

 0,00

Total Carteira

 578.590.817,73

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2040 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	5.000	4.463,31129	22.316.556,45
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.296,198298	12.888.594,89
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.296,198298	8.592.396,60
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.383,015263	4.383.015,26
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.463,719386	11.927.058,20
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.540,772127	35.545.164,21
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.078,743494	4.788.444,86
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.394,24004	8.788.480,08
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.340,723674	36.140.865,31
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	18/06/2024	A mercado	5.000	4.078,743494	20.393.717,47
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.505,121757	207.235,60
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.557,272076	20.507.724,34
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.497,148858	22.485.744,29
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.321,723603	9.939.964,29
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7555%	154	4.566,739894	703.277,94
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2024	A mercado	5.000	4.116,541737	20.582.708,69

Investimentos

\$ 578.590.817,73

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 578.590.817,73

Governança (Pró Gestão)

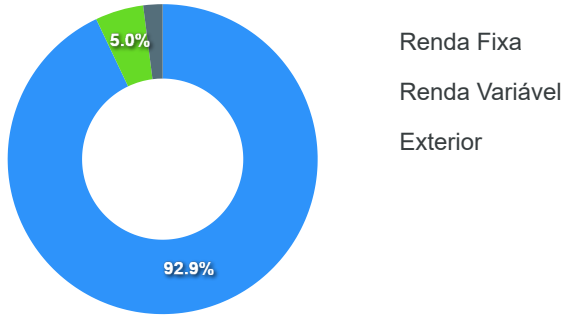


Artigos	Limite (%)		Utilizado		Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	41,51%	240.190.948,48	58,49%	338.399.869,25
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,82%	132.017.912,13	77,18%	446.572.905,60
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	8,90%	51.497.640,51	51,10%	295.656.850,13
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	19,72%	114.071.297,79	0,28%	1.646.865,76
8º I - Fundos de Ações	30,00%	5,04%	29.172.314,72	24,96%	144.404.930,60
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,01%	11.640.704,10	7,99%	46.218.377,67

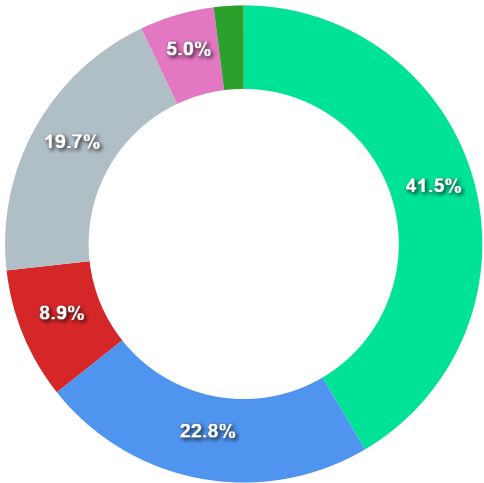
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



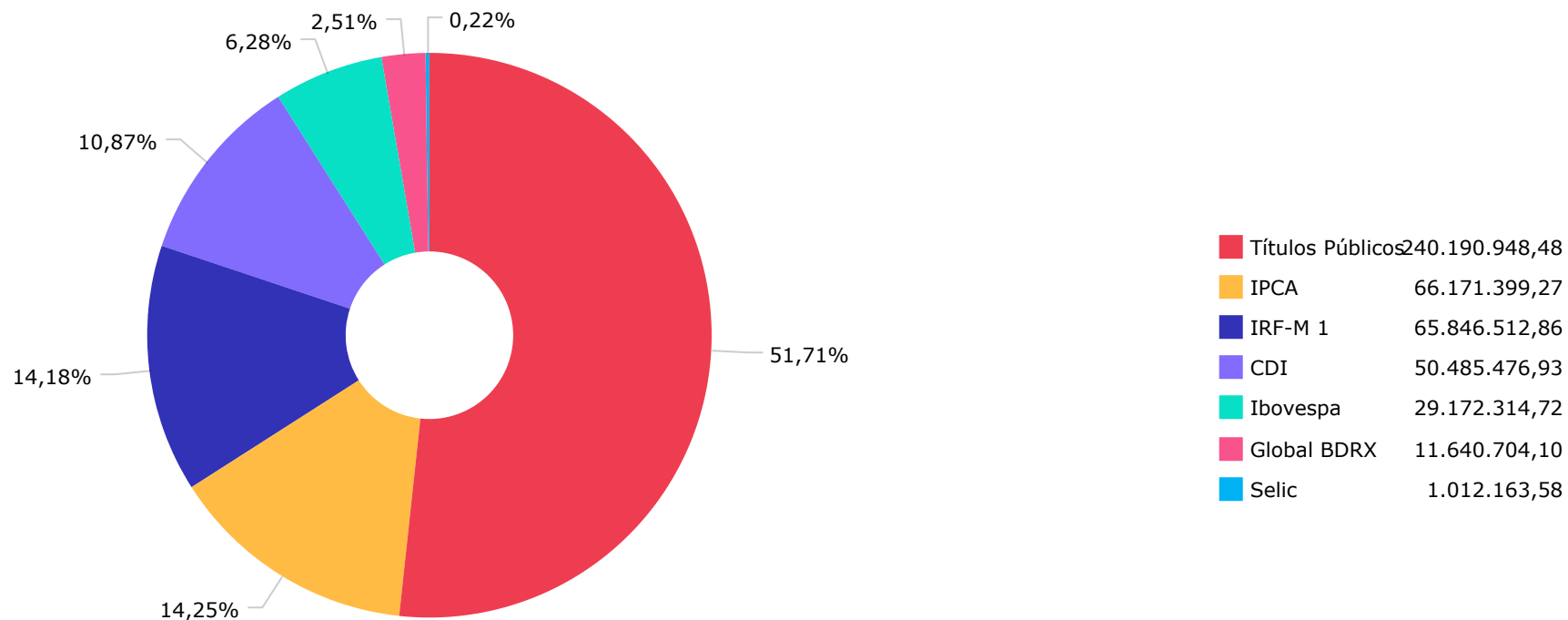
Artigos

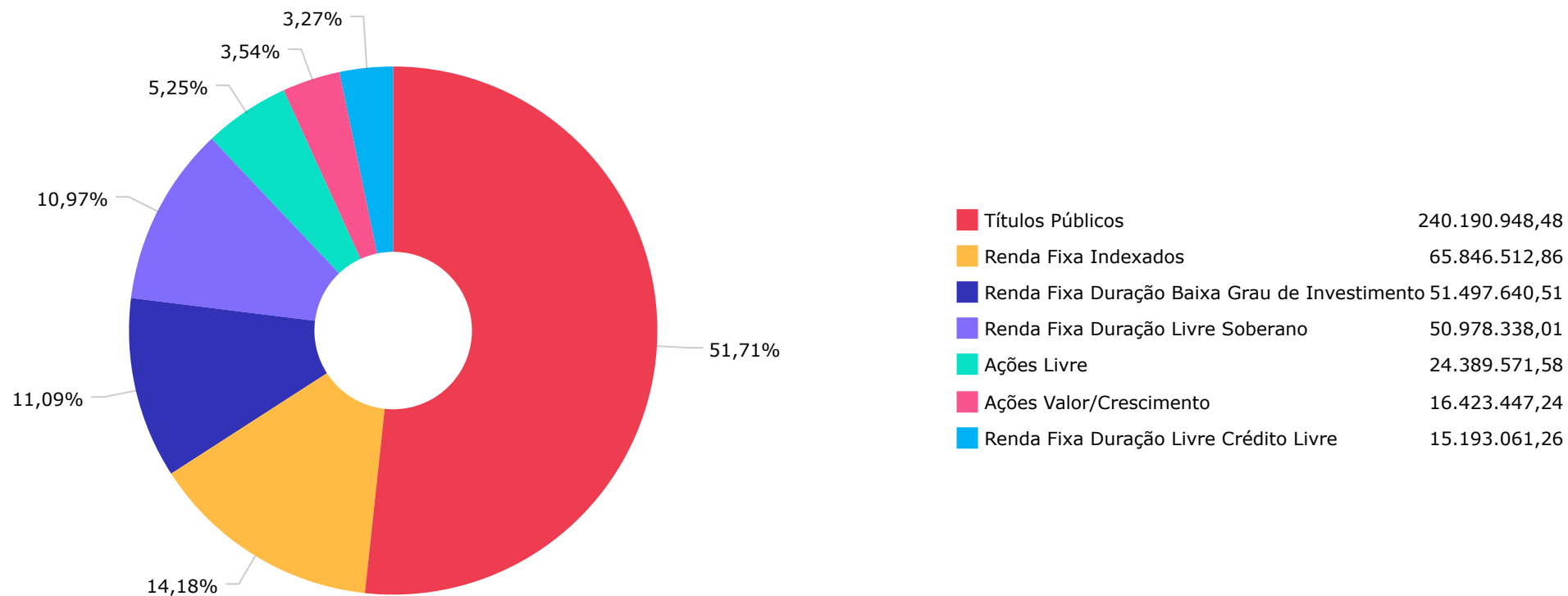


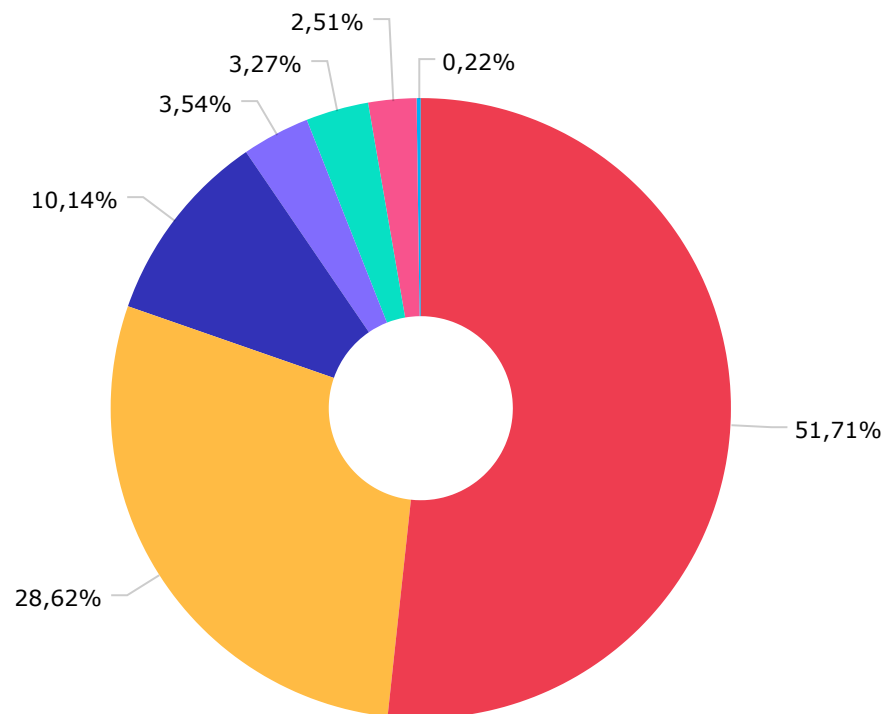
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	41,51%	0,00%	36,00%	100,00%	338.399.869,25
7º I b - FI 100% Títulos TN	22,82%	0,00%	14,00%	100,00%	446.572.905,60
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	578.590.817,73
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.929.540,89
7º III a - FI Referenciados RF	8,90%	0,00%	15,00%	60,00%	295.656.850,13
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	347.154.490,64
7º IV - Ativos Financeiros de ...	19,72%	0,00%	14,00%	20,00%	1.646.865,76
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.929.540,89
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.929.540,89
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.929.540,89

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	5,04%	0,00%	6,00%	30,00%	144.404.930,60
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	173.577.245,32
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	57.859.081,77
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	57.859.081,77
9º III - Ações - BDR Nível I	2,01%	0,00%	2,00%	10,00%	46.218.377,67
10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	57.859.081,77
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.929.540,89

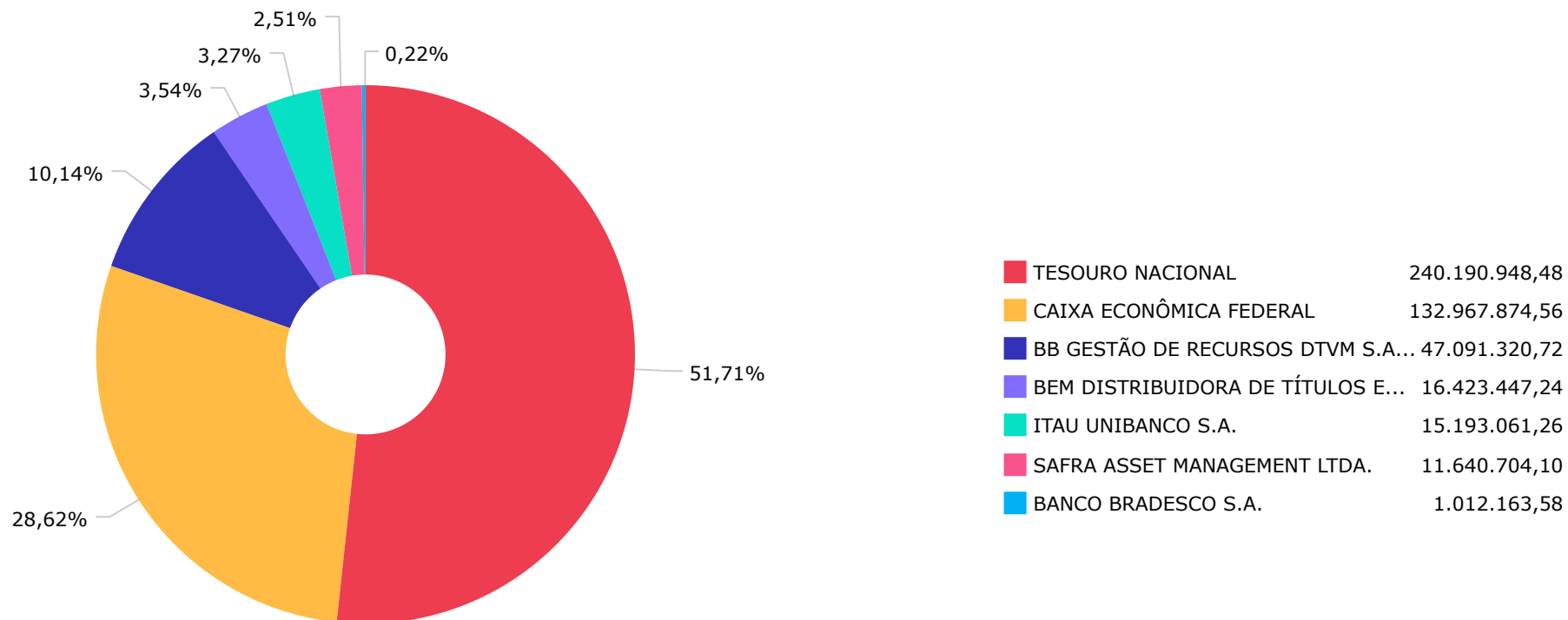
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	5,36	2,57	5,36	12,19	27,40	0,02	0,04
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	12,79	41,07	21,74	41,07	54,78	77,13		
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,45	28,06	16,10	28,06	39,91	49,16	6,55	13,79
IBOVESPA - BENCHMARK	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74		
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,36	-6,68	-5,52	-6,68	4,80	29,31	6,88	14,48
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90	-11,11	-3,95	-11,11	0,53	13,12	5,03	10,59
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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20	1,91	0,31	1,91	7,05	20,92	1,64	3,45
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 PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83	5,69	2,69	5,69	12,72	28,36	0,02	0,05







TESOIRO NACIONAL	240.190.948,48
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	132.967.874,56
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	47.091.320,72
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	16.423.447,24
ITAU UNIBANCO S.A.	15.193.061,26
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	11.640.704,10
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	1.012.163,58



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	555.471.939,62	3.459.435,67	6.976.737,86	555.888.364,94	3.933.727,51	3.933.727,51	0,71% ▲	0,71%	0,84%	0,84%	84,52%	0,61%
Fevereiro	555.888.364,94	13.121.177,93	9.022.822,62	565.782.661,55	5.795.941,30	9.729.668,81	1,04% ▲	1,75%	1,20%	2,05%	85,37%	0,71%
Março	565.782.661,55	29.232.887,35	30.527.818,89	570.083.126,57	5.595.396,56	15.325.065,37	0,99% ▲	2,76%	0,54%	2,60%	106,15%	0,54%
Abril	570.083.126,57	4.342.199,84	3.640.748,99	572.319.389,76	1.534.812,34	16.859.877,71	0,27% ▲	3,03%	0,80%	3,42%	88,60%	0,76%
Maio	572.319.389,76	52.454.006,19	63.085.696,36	565.735.296,16	4.047.596,57	20.907.474,28	0,71% ▲	3,76%	0,86%	4,31%	87,24%	0,58%
Junho	565.735.296,16	45.767.999,47	36.867.852,06	578.590.817,73	3.955.374,16	24.862.848,44	0,69% ▲	4,48%	0,59%	4,93%	90,87%	0,56%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	15.325.065,37	2,76%	2,60%
2º Trim	9.537.783,07	1,67%	2,27%
1º Sem	24.862.848,44	4,48%	4,93%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

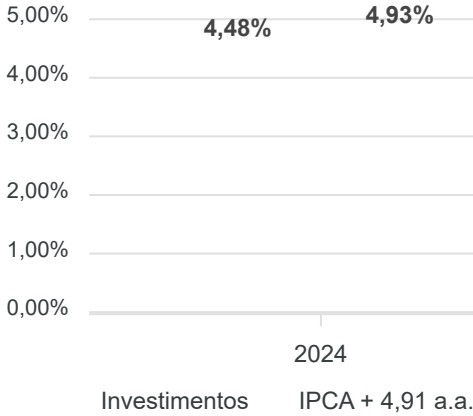
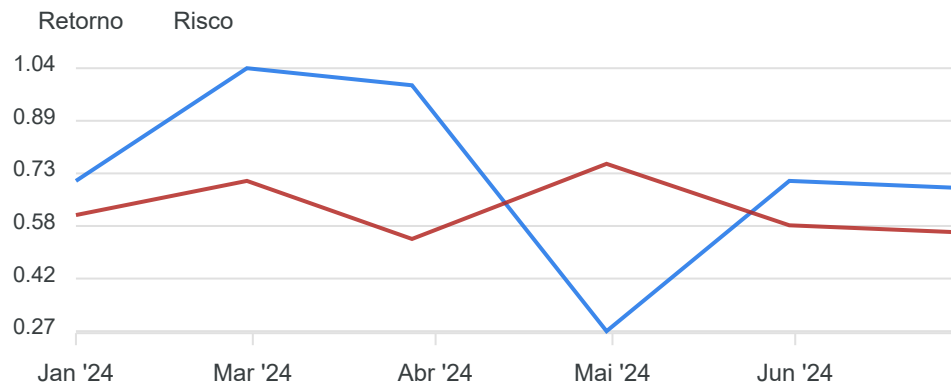
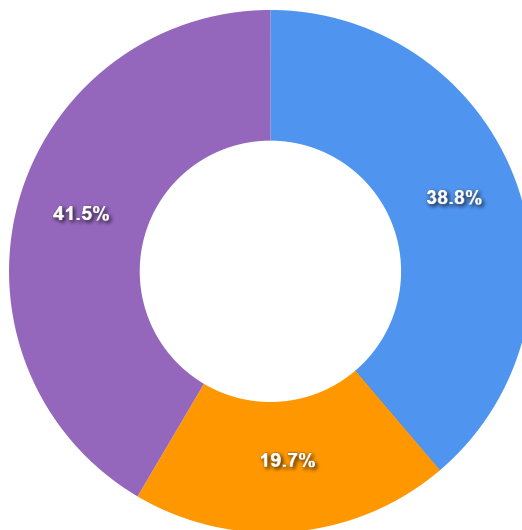


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 28/06/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	224.328.571,46	38,77
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	114.071.297,79	19,72
Acima D+3600	240.190.948,48	41,51
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	219.070.073,06	20.895.133,13	0,00	240.190.948,48	225.742,29	0,09% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	34.211.443,37	0,00	0,00	34.342.453,24	131.009,87	0,38% ▲	0,47%
BRDESCO PREMIUM FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	1.003.783,55	0,00	0,00	1.012.163,58	8.380,03	0,83% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI LP	49.433.806,56	24.872.866,34	24.236.018,46	50.485.476,93	414.822,49	0,56% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIJA	16.607.576,61	0,00	0,00	16.635.884,77	28.308,16	0,17% ▲	0,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA	65.448.312,84	0,00	0,00	65.846.512,86	398.200,02	0,61% ▲	0,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	15.223.642,50	0,00	0,00	15.193.061,26	-30.581,24	-0,20% ▼	1,64%
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	26.373.057,11	0,00	0,00	26.619.961,98	246.904,87	0,94% ▲	-
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.541.390,09	0,00	0,00	27.806.462,86	265.072,77	0,96% ▲	-
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	37.485.499,73	0,00	0,00	37.852.949,16	367.449,43	0,98% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.603.497,53	0,00	0,00	21.791.923,79	188.426,26	0,87% ▲	-
	514.002.082,95	45.767.999,47	24.236.018,46	537.777.798,91	2.243.734,95	0,42%	0,17%

RENDÁ VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	12.479.494,43	0,00	12.631.833,60	0,00	152.339,17	1,22% ▲	7,96%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.511.668,57	0,00	0,00	12.748.867,48	237.198,91	1,90% ▲	5,03%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	16.202.358,29	0,00	0,00	16.423.447,24	221.088,95	1,36% ▲	6,88%
-	41.193.521,29	0,00	12.631.833,60	29.172.314,72	610.627,03	1,48%	6,07%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.539.691,92	0,00	0,00	11.640.704,10	1.101.012,18	10,45% ▲	6,55%
	10.539.691,92	0,00	0,00	11.640.704,10	1.101.012,18	10,45%	0,00%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.869.891,27	0,00	0,00	34.342.453,24	472.561,97	1,40% ▲
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.000.000,00	0,00	1.012.163,58	12.163,58	1,22% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	74.855.560,64	43.926.269,96	69.853.078,94	50.485.476,93	1.556.725,27	1,31% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.544.714,21	0,00	0,00	16.635.884,77	91.170,56	0,55% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	64.363.921,30	214.626,21	0,00	65.846.512,86	1.267.965,35	1,96% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.146.021,04	0,00	0,00	15.193.061,26	47.040,22	0,31% ▲
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	25.972.997,34	0,00	0,00	26.619.961,98	646.964,64	2,49% ▲
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.106.912,00	0,00	0,00	27.806.462,86	699.550,86	2,58% ▲
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	36.910.023,07	0,00	0,00	37.852.949,16	942.926,09	2,55% ▲
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.269.321,05	0,00	0,00	21.791.923,79	522.602,74	2,46% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	196.950.307,22	42.423.309,33	2.209.356,21	240.190.948,48	3.026.688,14	1,26% ▲
	512.989.669,14	87.564.205,50	72.062.435,15	537.777.798,91	9.286.359,42	1,76%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AGRO FIC AÇÕES	13.380.805,38	0,00	12.631.833,60	0,00	-748.971,78	-5,60% ▼
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	13.272.949,69	0,00	0,00	12.748.867,48	-524.082,21	-3,95% ▼
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.058.757,03	15.000.000,00	0,00	16.423.447,24	-635.309,79	-3,72% ▼
	28.712.512,10	15.000.000,00	12.631.833,60	29.172.314,72	-1.908.363,78	-6,14%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	7.070.052,50	0,00	7.154.019,89	0,00	83.967,39	1,19% ▲
	7.070.052,50	0,00	7.154.019,89	0,00	83.967,39	1,19%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.284.658,17	0,00	11.746.008,77	0,00	461.350,60	4,09% ▲
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.026.234,66	0,00	0,00	11.640.704,10	1.614.469,44	16,10% ▲
	21.310.892,83	0,00	11.746.008,77	11.640.704,10	2.075.820,04	9,74%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.073.378,14	0,00	0,00	34.342.453,24	1.269.075,10	3,84% ▲
BRANESCO PREMIUM FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.000.000,00	0,00	1.012.163,58	12.163,58	1,22% ▲
CAIXA BRASIL FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI LP	101.928.376,21	57.280.335,24	112.955.701,28	50.485.476,93	4.232.466,76	2,66% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	16.252.447,20	0,00	0,00	16.635.884,77	383.437,57	2,36% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	59.383.993,44	3.674.061,88	0,00	65.846.512,86	2.788.457,54	4,42% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	14.908.385,03	0,00	0,00	15.193.061,26	284.676,23	1,91% ▲
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	25.101.337,97	0,00	0,00	26.619.961,98	1.518.624,01	6,05% ▲
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	0,00	27.000.000,00	0,00	27.806.462,86	806.462,86	2,99% ▲
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	35.609.181,55	0,00	0,00	37.852.949,16	2.243.767,61	6,30% ▲
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	20.625.659,61	0,00	0,00	21.791.923,79	1.166.264,18	5,65% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	194.682.639,88	42.423.309,33	5.634.113,24	240.190.948,48	8.719.112,51	3,68% ▲
	501.565.399,03	131.377.706,45	118.589.814,52	537.777.798,91	23.424.507,95	4,55%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AGRO FIC AÇÕES	13.663.372,11	0,00	12.631.833,60	0,00	-1.031.538,51	-7,55% ▼
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	14.341.677,98	0,00	0,00	12.748.867,48	-1.592.810,50	-11,11% ▼
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	17.000.000,00	0,00	16.423.447,24	-576.552,76	-3,39% ▼
	28.005.050,09	17.000.000,00	12.631.833,60	29.172.314,72	-3.200.901,77	-9,89%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	6.906.959,99	0,00	7.154.019,89	0,00	247.059,90	3,58% ▲
	6.906.959,99	0,00	7.154.019,89	0,00	247.059,90	3,58%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.904.729,78	0,00	11.746.008,77	0,00	1.841.278,99	18,59% ▲
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.089.800,73	0,00	0,00	11.640.704,10	2.550.903,37	28,06% ▲
	18.994.530,51	0,00	11.746.008,77	11.640.704,10	4.392.182,36	23,12%

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

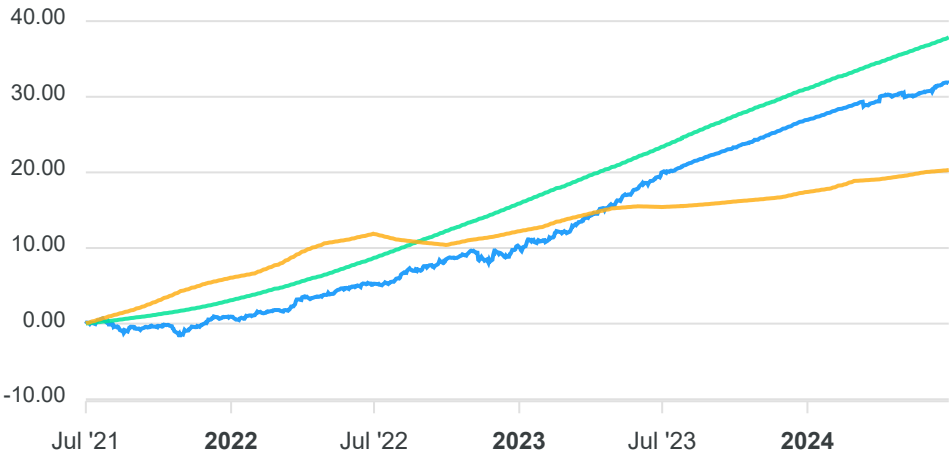
PERFIL DO FUNDO

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.

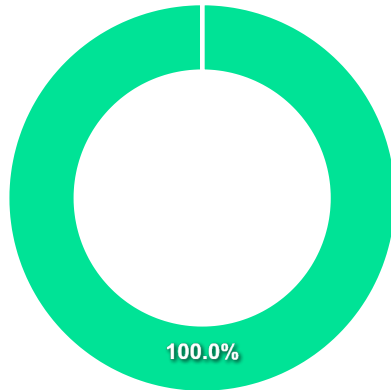
COMPARATIVO

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	6.633.900,44	100,00	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	255,10	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a receber / DIFERIR CVM 31/12/24	37,20	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Cetip	30,73	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	3,59	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-55,64	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-76,62	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.633.900,44	100.00%
Valores a pagar/receber	157,17	0.00%
Outros	37,20	0.00%

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

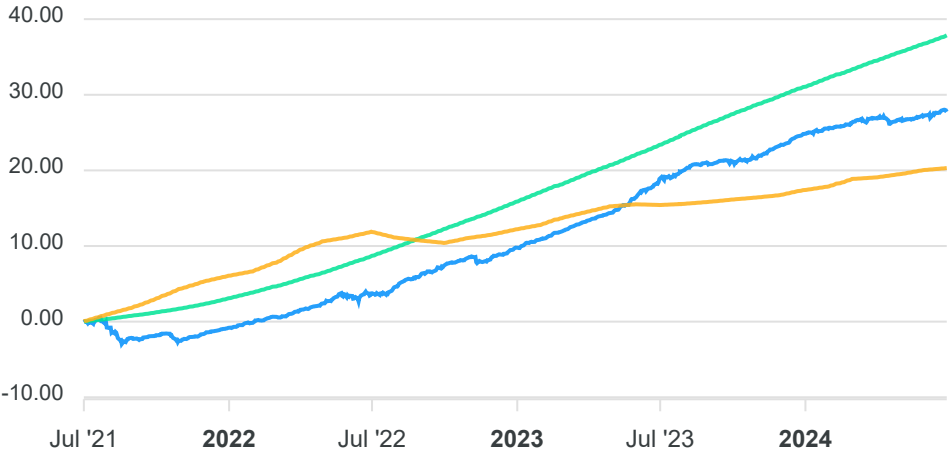
PERFIL DO FUNDO

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.

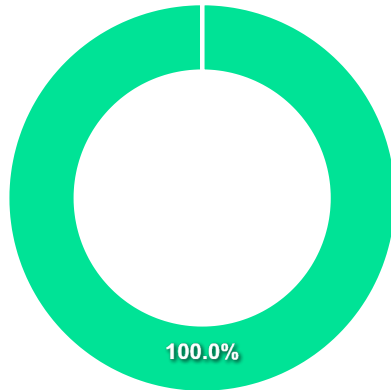
COMPARATIVO

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	5.033.295,14	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	33,52	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-364,72	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.033.295,14	100.01%
Valores a pagar/receber	-331,20	-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
1.155
Patrimônio Líquido Fundo
7.877.165.450,51

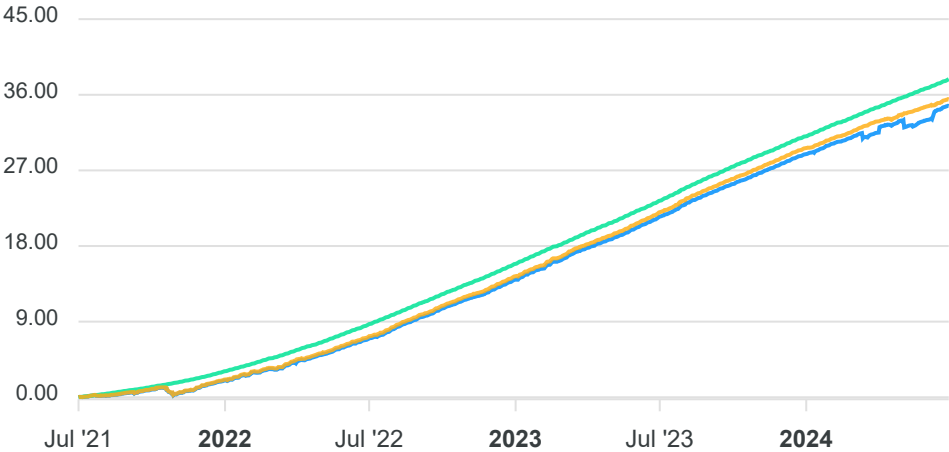
PERFIL DO FUNDO

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.

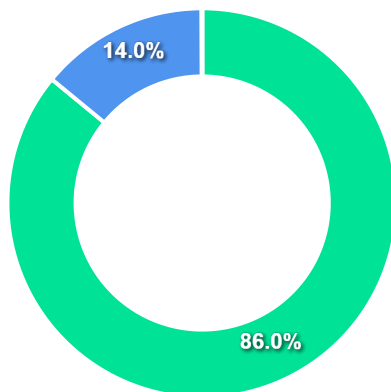
COMPARATIVO

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



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	7.217.654,52	85.96%
Títulos Federais	1.173.266,67	13.97%
Valores a pagar/receber	4.392,59	0.05%
Outros	875,98	0.01%
Derivativos	495,60	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2026	7.217.654,52	85,97	Operação compromissada
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	815.739,93	9,72	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024	223.446,02	2,66	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2025	104.090,98	1,24	Títulos Federais
Obrigações por venda a termo a entregar / VENDA DE RENDA F...	75.458,98	0,90	Outros
LTN - Venc.: 01/04/2025	29.989,74	0,36	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	3.345,70	0,04	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	1.413,47	0,02	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	803,22	0,01	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	492,25	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	82,36	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	3,35	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-366,57	0,00	Valores a pagar/receber
Vendas a termo a receber / Venda de renda fixa à termo - L...	-75.468,58	-0,90	Outros

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

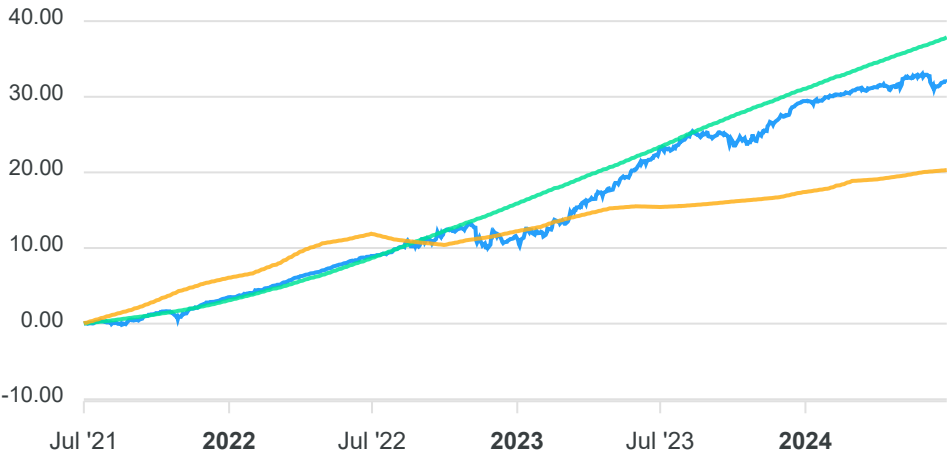
PERFIL DO FUNDO

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.

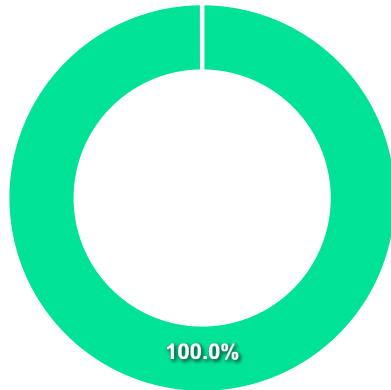
COMPARATIVO

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	2.235.301,01	99,80	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	9.306,67	0,42	Valores a pagar/receber
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.929,81	0,18	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-8.806,21	-0,39	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.239.230,82	99.97%
Valores a pagar/receber	570,46	0.03%

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+0
Quantidade de Cotistas
488
Patrimônio Líquido Fundo
11.692.368.410,92

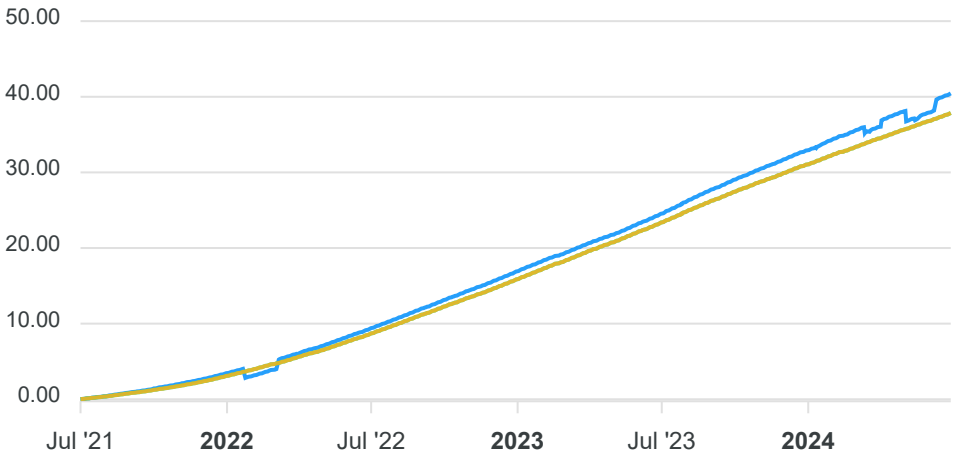
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
Selic
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação do CDI.

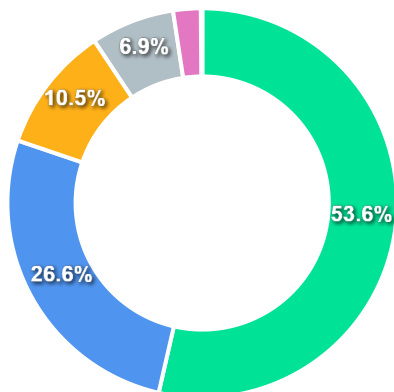
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,83%	5,69%	2,69%	5,69%	12,72%	28,36%	0,02%	0,05%
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. (%)
Operação compromissada	6.306.510,80	53.60%
Títulos Privados	3.131.586,38	26.62%
Debêntures	1.231.920,10	10.47%
Títulos Federais	816.057,25	6.94%
Fundos de Investimento	268.410,34	2.28%
Outros	13.646,02	0.12%
Valores a pagar/receber	-2.197,44	-0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2025	2.531.104,42	21,51	Operação compromissada
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2025	2.215.922,50	18,83	Operação compromissada
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	1.559.483,88	13,25	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2027	396.264,49	3,37	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	239.754,79	2,04	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2028	203.007,98	1,73	Títulos Federais
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/...	141.711,18	1,20	Títulos Privados
Cotas de ACR BEM BANCOS EMISSORES DE CARTÃO DE CRÉDITO RES...	116.243,54	0,99	Fundos de Investimento
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	111.988,20	0,95	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	102.316,08	0,87	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	98.161,45	0,83	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2027	96.409,58	0,82	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	84.385,09	0,72	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2030	84.071,39	0,71	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	56.823,64	0,48	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	56.633,71	0,48	Títulos Privados
Cotas de CLOUDWALK BIG PICTURE I SEGMENTO MEIOS DE PAGAMEN...	56.583,80	0,48	Fundos de Investimento
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	55.317,62	0,47	Títulos Privados
Debênture Simples - CELG12	50.934,10	0,43	Debêntures
Debênture Simples - NTSD36	50.116,15	0,43	Debêntures
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	50.103,96	0,43	Títulos Privados
Debênture Simples - ANHBA4	48.923,61	0,42	Debêntures
Debênture Simples - PALFA2	48.078,67	0,41	Debêntures
Debênture Simples - CIEL16	46.752,29	0,40	Debêntures
Cotas de SUMUP I MEIOS DE PAGAMENTO RESP LIMITADA FIDC	46.422,82	0,39	Fundos de Investimento
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	45.407,64	0,39	Títulos Privados
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/...	41.388,64	0,35	Títulos Privados

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
1.011
Patrimônio Líquido Fundo
16.508.104.382,05

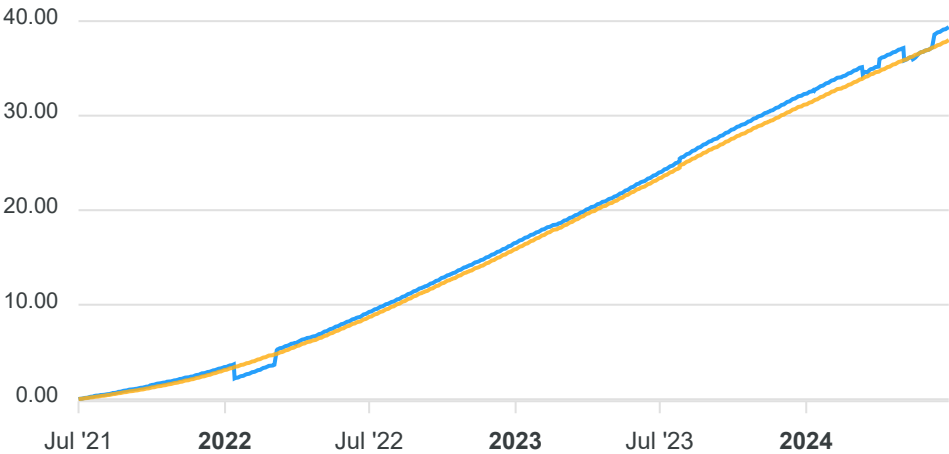
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
CDI
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em ativos financeiros que sejam considerados de baixo risco de crédito e classificados por agência de risco registrada na CVM.

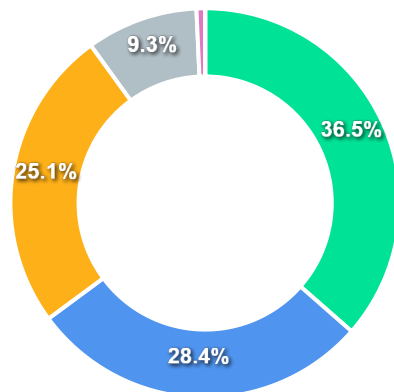
COMPARATIVO

28/06/2024

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



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação comprometida	5.820.529,70	36.45%
Títulos Privados	4.538.964,04	28.43%
Títulos Federais	4.013.461,68	25.14%
Debêntures	1.479.889,52	9.27%
Outros	114.372,56	0.72%
Valores a pagar/receber	33,76	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2029	5.820.529,70	36,45	Operação comprometida
LFT - Venc.: 01/03/2027	1.500.462,26	9,40	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	942.847,98	5,90	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	565.518,11	3,54	Títulos Federais
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	426.683,15	2,67	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2026	355.816,43	2,23	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	337.497,74	2,11	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	263.266,50	1,65	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2028	240.587,78	1,51	Títulos Federais
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	205.988,24	1,29	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Ve...	203.633,20	1,28	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	197.699,85	1,24	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	194.705,75	1,22	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	139.481,25	0,87	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	119.882,78	0,75	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	119.630,81	0,75	Títulos Privados
Debêntures - PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS (33.000.16...	114.630,25	0,72	Debêntures
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) -...	114.101,42	0,71	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	112.177,79	0,70	Títulos Privados
Debêntures - LOCALIZA RENT A CAR S.A. (16.670.085/0001-55)...	105.711,87	0,66	Debêntures
LFT - Venc.: 01/03/2029	102.053,30	0,64	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) -...	99.164,52	0,62	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	98.271,58	0,62	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2024	96.469,10	0,60	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	87.431,12	0,55	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	85.304,53	0,53	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2025	84.760,27	0,53	Títulos Federais

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
20,00%
Disponibilidade de Resgate
D+3
Quantidade de Cotistas
16.298
Patrimônio Líquido Fundo
1.108.199.259,35

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 de fundos de investimento que apresentem carteira composta por ações emitidas por empresas brasileiras e seus proventos, títulos públicos federais e contratos de índices futuros.

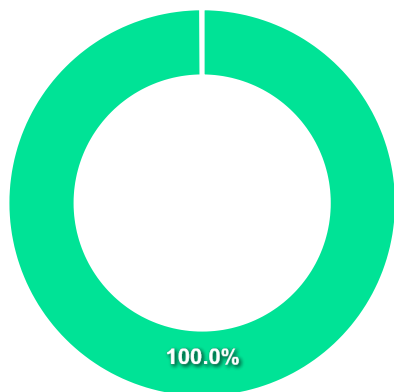
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	10,59%
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 BB QUANTITATIVO FI AÇÕES	1.102.592,68	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	933,49	0,08	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	36,96	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,68	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	3,48	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas_a_Emitir_Passi	3,48	0,00	Outros
Valores a pagar / IR_a_recolher	0,19	0,00	Outros
Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	0,12	0,00	Outros
Outras Disponibilidades	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-15,37	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-131,94	-0,01	Outros
Valores a pagar / Cotas_Resgatadas	-845,12	-0,08	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.102.592,68	100.00%
Valores a pagar/receber	962,25	0.09%
Outros	-973,27	-0.09%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA
Gestão
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA
Taxa de Administração
2,00%
Taxa de Performance
20,00%
Disponibilidade de Resgate
D+3
Quantidade de Cotistas
338
Patrimônio Líquido Fundo
459.571.224,62

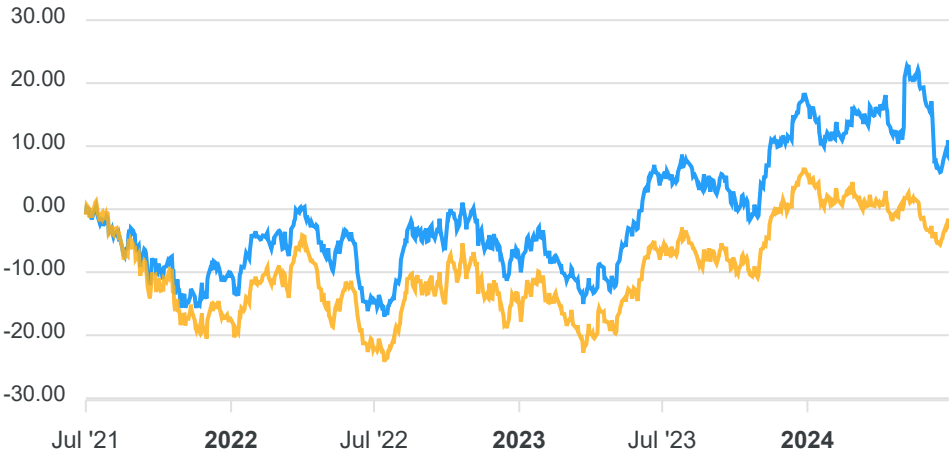
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I
Benchmark
Ibovespa
Classificação ANBIMA
Ações Valor/Crescimento
Política de Investimento
Aplica seus recursos no mercado de renda variável, podendo aplicar em outras classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo.

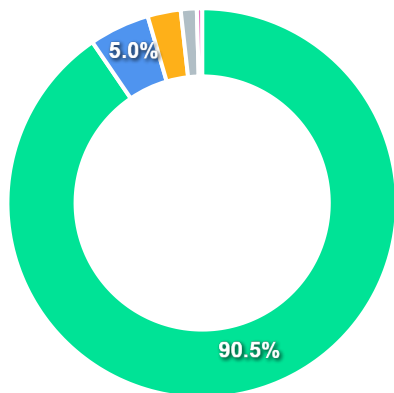
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,36%	-6,68%	-5,52%	-6,68%	4,80%	29,31%	6,88%	14,48%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	353.492,17	90.47%
Operação compromissada	19.582,26	5.01%
Brazilian Depositary Receipts	10.744,99	2.75%
Valores a pagar/receber	5.195,76	1.33%
Debêntures	1.716,17	0.44%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	39.983,35	10,23	Ações
ITAUUNIBANCO ON N1 - ITUB3	36.102,75	9,24	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	20.628,79	5,28	Ações
ALLOS ON NM - ALOS3	20.096,44	5,14	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	19.582,26	5,01	Operação compromissada
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	18.872,48	4,83	Ações
ELETRONBRAS PNB N1 - ELET6	18.856,89	4,83	Ações
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	16.795,90	4,30	Ações
MRV ON NM - MRVE3	16.347,34	4,18	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	16.275,67	4,17	Ações
PORTO SEGURO ON NM - PSSA3	12.430,80	3,18	Ações
AZUL PN N2 - AZUL4	11.543,54	2,95	Ações
TELEF BRASIL ON - VIVT3	11.279,30	2,89	Ações
MARCOPOLO PN N2 - POMO4	10.984,51	2,81	Ações
ENERGISA UNT N2 - ENGI11	10.764,96	2,76	Ações
INTER CO INC - INBR32	10.744,99	2,75	Brazilian Depositary Rece...
WILSON SONS ON NM - PORT3	9.798,14	2,51	Ações
VIBRA ON NM - VBRR3	9.545,83	2,44	Ações
LOG COM PROPON NM - LOGG3	8.927,04	2,28	Ações
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	8.670,27	2,22	Ações
DEXCO ON NM - DXCO3	8.614,80	2,20	Ações
RANDON PART PN N1 - RAPT4	7.941,60	2,03	Ações
SANTOS BRP ON NM - STBP3	6.835,79	1,75	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	6.529,95	1,67	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	6.232,27	1,60	Ações
Outros Valores a receber	5.884,95	1,51	Valores a pagar/receber
POSITIVO INF ON NM - POSI3	5.067,86	1,30	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.
Gestão
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.
Taxa de Administração
1,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+5
Quantidade de Cotistas
326
Patrimônio Líquido Fundo
771.250.758,76

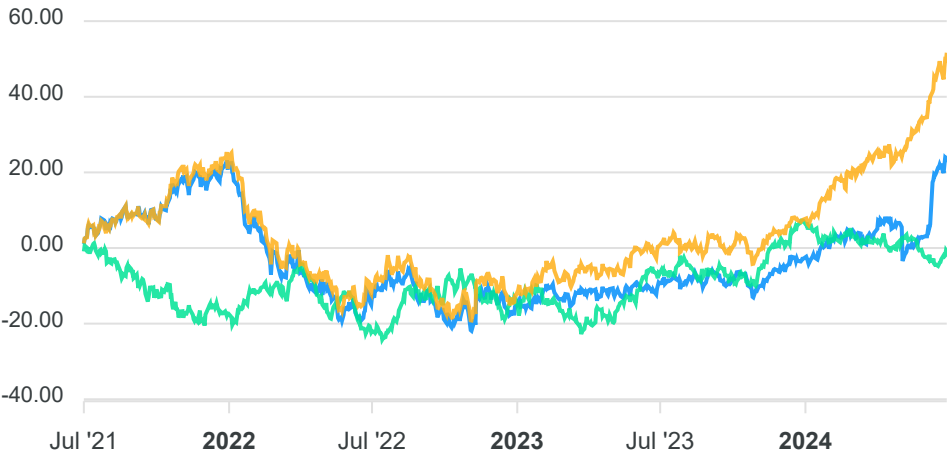
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III
Benchmark
Global BDRX
Classificação ANBIMA
Ações Livre
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em depósitos de valores mobiliários BDRs Nível 1, do setor de consumo.

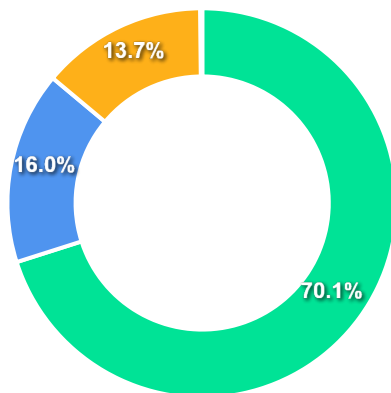
COMPARATIVO

28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	10,45%	28,06%	16,10%	28,06%	39,91%	49,16%	6,55%	13,79%
Benchmark	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%		
IBOVESPA	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depository Receipts	488.841,07	70.09%
Títulos Privados	111.523,26	15.99%
Títulos Federais	95.838,51	13.74%
Derivativos	1.107,32	0.16%
Valores a pagar/receber	113,80	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	111.523,26	15,99	Títulos Privados
Brazilian Depository Receipt - BDR - MSFT34	48.438,14	6,95	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - AAPL34	40.320,20	5,78	Brazilian Depository Rece...
LFT - Venc.: 01/09/2024	35.093,29	5,03	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	29.151,89	4,18	Títulos Federais
Brazilian Depository Receipt - BDR - GOGL34	27.027,40	3,88	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - AMZO34	23.130,91	3,32	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - UNHH34	20.650,19	2,96	Brazilian Depository Rece...
LFT - Venc.: 01/03/2026	15.311,26	2,20	Títulos Federais
Brazilian Depository Receipt - BDR - EXXO34	14.849,12	2,13	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - BERK34	14.631,75	2,10	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - VISA34	14.531,40	2,08	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - MSCD34	13.844,74	1,99	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - CMCS34	13.720,31	1,97	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - CHVX34	13.123,64	1,88	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - DHER34	12.785,88	1,83	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - LILY34	12.205,44	1,75	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - MCD34	12.187,86	1,75	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - FDXB34	11.007,52	1,58	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - MRCK34	10.918,79	1,57	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - UPSS34	10.499,44	1,51	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - M1NS34	10.298,88	1,48	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - CHCM34	9.534,93	1,37	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - BKNG34	8.782,63	1,26	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - TMOS34	8.743,80	1,25	Brazilian Depository Rece...
LFT - Venc.: 01/09/2025	8.406,96	1,21	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	7.875,11	1,13	Títulos Federais

