

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS JUNHO - 2024



Carteira Consolidada

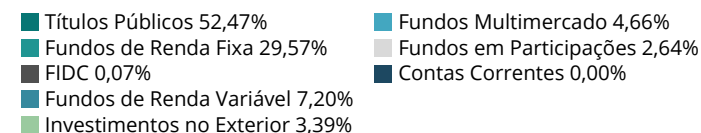
Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Joinville - SC



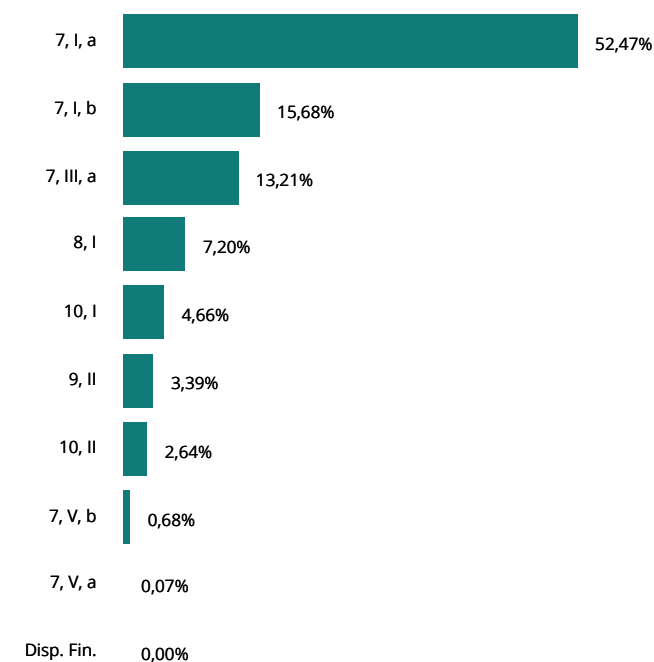
Distribuição da Carteira	3
Retorno da Carteira por Ativo	10
Rentabilidade da Carteira (em %)	18
Rentabilidade e Risco dos Ativos	19
Análise do Risco da Carteira	27
Liquidez e Custos das Aplicações	29
Movimentações	32
Enquadramento da Carteira	34
Comentários do Mês	39

ATIVOS	%	JUNHO	MAIO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	13,1%	513.375.883,38	519.112.444,92
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	0,0%	1.261.293,35	1.251.293,98
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	0,0%	840.862,23	834.195,99
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	0,2%	6.829.245,64	6.773.911,04
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	0,0%	60.057,62	59.585,61
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	0,0%	750.720,30	744.820,08
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	0,2%	6.021.101,93	5.972.722,27
LFT 01/09/2026 (Compra em 13/05/2024)	0,1%	3.015.822,29	2.991.293,18
LFT 01/09/2026 (Compra em 15/05/2024)	0,0%	810.220,91	803.631,00
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	0,2%	6.473.313,04	6.432.462,03
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 19/02/2024) 0063A36	0,1%	4.690.994,19	4.661.390,82
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	0,1%	2.135.113,12	2.135.206,10
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	0,1%	3.843.203,61	3.843.370,98
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	0,3%	10.248.542,97	10.248.989,29
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	0,1%	4.270.226,24	4.270.412,20
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	0,0%	292.113,35	296.925,47
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	0,1%	4.173.047,94	4.241.792,58
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	0,3%	12.519.143,82	12.725.377,76
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	0,1%	4.339.969,86	4.411.464,29
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	0,0%	1.155.934,28	1.174.976,55
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/04/2024) 006560D	1,1%	41.354.905,08	42.036.164,53
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	0,1%	2.712.481,16	2.757.165,18
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 15/05/2024)	0,0%	951.454,93	967.128,71
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/05/2024)	0,0%	734.456,44	746.555,50
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	0,0%	976.493,22	992.579,47
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	0,1%	3.547.090,75	3.605.523,70
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	0,0%	1.126.722,94	1.145.284,00
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	0,1%	4.173.047,94	4.241.792,59
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	0,7%	27.959.421,19	28.420.010,33
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/05/2024) 006704C	0,0%	292.113,36	296.925,48
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/05/2024) 006704D	1,1%	41.730.479,39	42.417.925,86
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	0,2%	9.176.532,42	9.327.701,90
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	0,5%	18.477.657,18	19.008.479,03
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	0,0%	615.921,91	633.615,97
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	0,1%	3.079.609,53	3.168.079,84
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/05/2022) 344518	0,0%	1.437.151,11	1.478.437,26

POR SEGMENTO

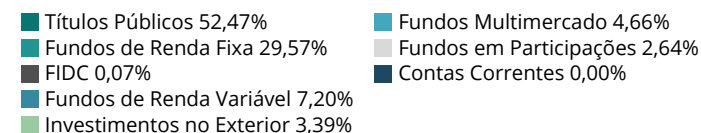


POR TIPO DE ATIVO

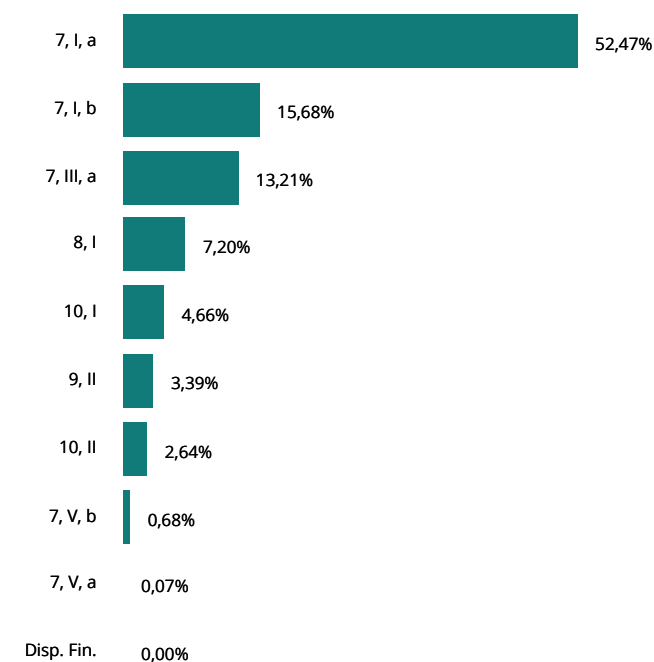


ATIVOS	%	JUNHO	MAIO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	13,1%	513.375.883,38	519.112.444,92
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	0,1%	3.695.531,44	3.801.695,81
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	0,1%	3.490.224,13	3.590.490,48
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/05/2024)	0,0%	32.629,95	33.738,51
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	0,0%	693.386,39	716.943,60
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	0,0%	383.401,89	396.427,64
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	0,4%	15.319.669,67	15.141.328,26
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	0,0%	1.348.130,93	1.332.436,88
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)	0,0%	639.049,08	631.609,69
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549	0,1%	4.814.753,32	4.758.703,17
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	0,0%	932.311,33	921.457,98
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	0,0%	351.929,18	351.172,00
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	0,1%	3.693.083,94	3.685.138,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	0,1%	3.779.980,03	3.771.847,40
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	0,1%	3.258.603,47	3.251.592,59
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	0,1%	3.258.603,47	3.251.592,59
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	0,1%	3.693.083,94	3.685.138,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	0,2%	6.147.898,55	6.134.671,35
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	0,2%	8.689.609,26	8.670.913,57
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	0,1%	4.344.804,63	4.335.456,79
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	0,1%	3.171.707,38	3.164.883,45
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	0,0%	782.064,83	780.382,22
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	0,0%	191.171,40	190.760,10
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	0,0%	434.480,46	433.545,68
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	0,0%	477.928,51	476.900,25
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	0,1%	2.932.743,13	2.926.433,33
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	0,1%	5.172.067,64	5.186.957,98
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	0,0%	1.939.525,36	1.945.109,24
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	0,2%	8.620.112,73	8.644.929,97
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 14/05/2024)	0,0%	905.111,84	907.717,65
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	0,0%	1.232.676,12	1.236.224,99
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/05/2024)	0,0%	86.201,13	86.449,30
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	0,0%	922.352,06	925.007,51
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	0,0%	1.461.109,11	1.465.315,63
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	0,2%	8.620.112,73	8.644.929,97
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	0,1%	5.172.067,64	5.186.957,98

POR SEGMENTO

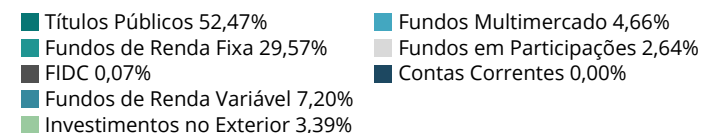


POR TIPO DE ATIVO

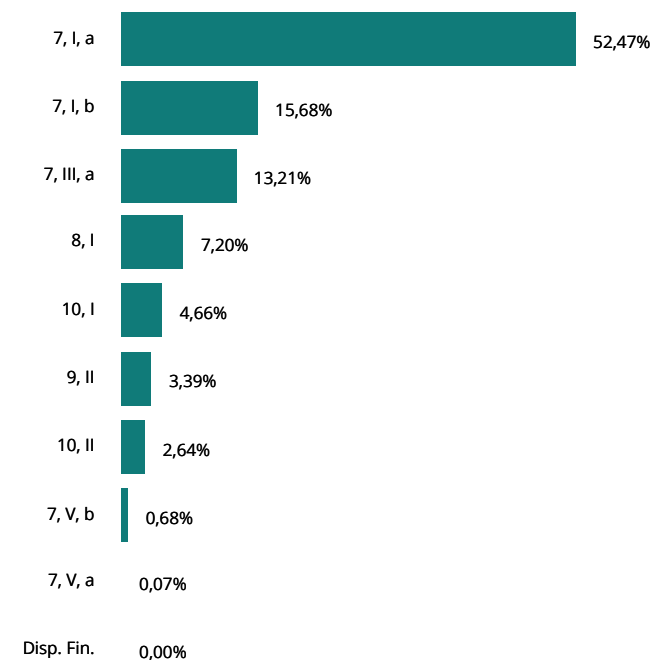


ATIVOS	%	JUNHO	MAIO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	13,1%	513.375.883,38	519.112.444,92
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819	0,2%	8.620.112,73	8.644.929,97
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	0,3%	10.344.135,28	10.373.915,97
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	0,0%	862.011,27	864.493,00
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	0,3%	12.632.456,10	12.721.661,31
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	0,2%	8.602.285,40	8.663.031,19
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	0,2%	6.451.714,05	6.497.273,40
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	0,1%	3.655.971,29	3.681.788,26
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	0,2%	7.096.885,45	7.147.000,74
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	0,4%	17.040.198,48	17.254.616,05
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2	0,5%	21.300.248,11	21.568.270,06
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	0,5%	21.300.248,11	21.568.270,06
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	0,1%	3.164.455,82	3.229.431,43
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	0,0%	828.507,06	854.849,28
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	0,1%	2.692.647,93	2.778.260,17
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/05/2024)	0,0%	965.210,72	995.899,40
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	0,6%	23.198.197,55	23.935.779,90
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/04/2024) 0065A5E	0,2%	9.664.534,80	9.971.816,87
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	0,0%	488.819,16	504.361,08
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	0,2%	7.456.563,50	7.693.643,54
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	0,0%	103.563,38	106.856,16
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	0,1%	4.142.535,28	4.274.246,41
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	39,4%	1.544.922.119,15	1.476.138.537,17
NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)	1,4%	53.661.999,80	53.204.095,49
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	0,4%	16.132.708,20	15.993.299,52
NTN-B XP 2030-08 (Compra 01/11/23 Tx 5.8570)	0,8%	31.212.102,12	30.952.125,32
NTN-B XP 2030-08 (Compra 09/10/23 Tx 5.8465)	0,8%	31.440.495,96	31.178.870,35
NTN-B XP 2030-08 (Compra 10/06/24 Tx 6.1900)	0,3%	10.062.753,61 ▲	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/06/24 Tx 6.4400)	0,5%	21.082.806,45 ▲	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	0,8%	29.476.036,51	29.225.757,47
NTN-B XP 2030-08 (Compra 22/04/24 Tx 6.0500)	0,9%	35.696.211,08	35.393.768,87
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	0,5%	20.899.322,36	20.729.814,70
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	0,6%	21.804.255,77	21.616.198,08
NTN-B XP 2030-08 (Compra 25/04/24 Tx 6.1200)	0,4%	16.288.779,16	16.149.925,86
NTN-B XP 2030-08 (Compra 25/04/24 Tx 6.1200) i	0,0%	13.114,96	13.003,16
NTN-B XP 2032-08 (Compra 11/04/24 Tx 5.9010)	0,4%	16.357.397,91	16.220.611,13

POR SEGMENTO

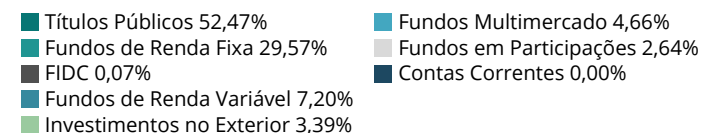


POR TIPO DE ATIVO

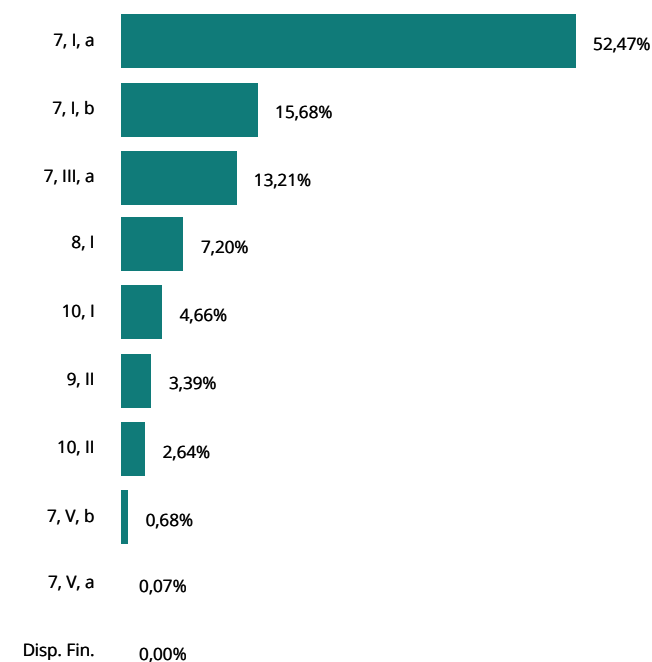


ATIVOS	%	JUNHO	MAIO
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	39,4%	1.544.922.119,15	1.476.138.537,17
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	0,8%	32.267.351,27	31.988.892,10
NTN-B XP 2035-05 (Compra 03/05/24 Tx 6.2200)	0,6%	24.685.572,50	24.473.283,59
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	0,8%	31.083.226,16	30.819.297,34
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	0,7%	29.269.931,04	29.013.731,57
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	0,0%	1.079.353,19	1.070.714,40
NTN-B XP 2035-05 (Compra 09/05/24 Tx 6.2100)	0,6%	24.645.050,25	24.433.279,73
NTN-B XP 2035-05 (Compra 10/06/24 Tx 6.2500)	0,3%	10.060.439,69 ▲	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	0,0%	912.304,35	904.836,28
NTN-B XP 2035-05 (Compra 16/04/24 Tx 6.0000)	1,3%	49.613.722,13	49.195.232,69
NTN-B XP 2035-05 (Compra 16/05/24 Tx 6.1500)	0,5%	20.269.751,06	20.096.507,03
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	0,4%	16.375.219,61	16.234.646,71
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	0,8%	30.923.227,60	30.661.121,13
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	0,4%	15.830.883,89	15.693.638,94
NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	1,4%	54.183.643,93	53.736.244,08
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	1,4%	54.182.267,11	53.711.030,67
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	0,1%	5.461.711,71	5.416.976,23
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	1,0%	37.320.258,05	36.992.975,36
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	2,7%	107.160.139,94	106.270.065,32
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	0,7%	26.918.805,99	26.689.436,82
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	0,3%	10.862.421,16	10.774.340,27
NTN-B XP 2045-05 (Compra 09/04/24 Tx 5.9600)	1,3%	49.670.824,34	49.253.249,61
NTN-B XP 2045-05 (Compra 12/04/24 Tx 6.0300)	1,3%	49.648.209,04	49.228.291,28
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	2,8%	108.169.700,17	107.278.035,67
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	0,4%	14.294.277,12	14.175.544,81
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/24 Tx 6.1400)	0,1%	5.320.870,67	5.275.432,39
NTN-B XP 2045-05 (Compra 20/06/24 Tx 6.3800)	0,1%	5.008.761,09 ▲	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 21/06/24 Tx 6.3300)	0,3%	10.017.269,27 ▲	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	0,8%	32.707.184,75	32.424.233,01
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	1,4%	55.042.552,88	54.584.698,37
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	1,4%	54.972.989,01	54.514.074,78
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	1,4%	54.096.870,02	53.643.751,27
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	1,4%	55.412.546,34	54.953.561,73
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	1,4%	55.272.964,34	54.814.092,59
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	2,8%	108.053.835,59	107.139.851,45

POR SEGMENTO

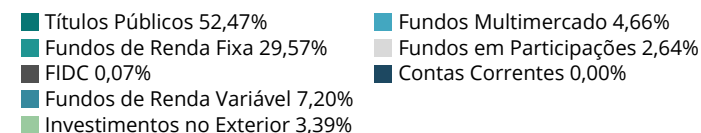


POR TIPO DE ATIVO

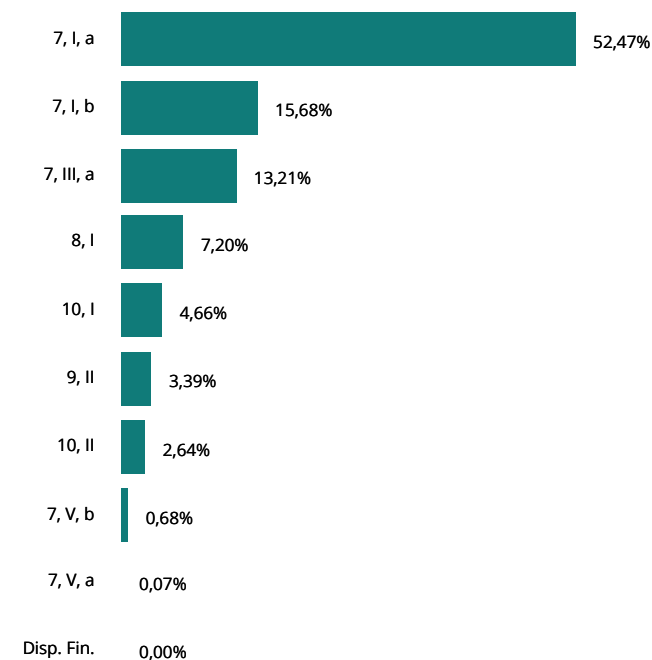


ATIVOS	%	JUNHO	MAIO
FUNDOS DE RENDA FIXA	29,6%	1.160.231.884,22	1.235.202.592,78
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	4,0%	155.065.654,56 ▼	207.465.926,21
BB FIC Previdenciário Fluxo	0,1%	2.339.969,69 ▲	2.058.072,17
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	0,4%	16.165.488,23 ▼	31.118.403,75
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	2,0%	80.139.802,50	80.937.241,69
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	3,7%	144.187.770,48 ▼	152.629.568,25
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	0,1%	2.981.976,39	2.947.901,50
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	1,6%	61.950.756,15 ▼	62.506.990,27
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	0,6%	23.838.381,53	23.842.729,35
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	0,9%	33.726.373,99	33.606.198,54
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	0,4%	14.693.974,91	15.040.881,02
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	0,5%	19.262.646,72	19.096.505,59
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	0,2%	6.344.311,99	6.366.605,22
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	0,0%	12.591,70	12.497,48
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	3,9%	154.614.647,46 ▲	153.039.240,86
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	0,2%	7.356.645,00	7.336.380,00
Caixa Brasil Referenciado	0,4%	13.814.086,77	13.701.925,19
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	1,0%	38.391.699,60	37.952.625,20
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	0,3%	10.670.445,03	10.777.693,45
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	0,1%	2.926.776,68	2.994.063,43
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	0,0%	4.111,62 ▼	4.436,56
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	1,1%	41.601.416,06	41.685.153,17
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	0,6%	22.518.998,81	22.319.105,31
Itaú FIC IMA-B 5+	1,3%	52.900.045,88	54.124.280,14
Itaú FIC Institucional IMA-B	0,4%	16.818.339,26	16.985.097,11
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	0,4%	16.904.319,19	16.709.513,16
Trend Cash FIC Simples	0,0%	28.483,41	28.264,24
Vinci Institucional Referenciado	0,1%	2.977.554,93 ▲	2.369.539,22
Western Asset Ativo IMA-B	0,6%	21.910.378,05 ▼	24.207.793,67
Western Asset Ativo IMA-B 5	1,4%	53.978.721,95 ▼	56.524.230,65
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	0,8%	33.106.103,60 ▲	28.186.085,91
Western Ativo Max	0,2%	6.899.629,95 ▼	7.139.610,32
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	1,3%	49.979.524,90	49.564.479,74
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	0,1%	3.651.562,66	3.622.851,31
XP Inflação Referenciado IPCA	0,5%	21.523.154,92	21.567.686,65
XP Trend Simples	0,7%	26.945.539,65	26.733.016,45

POR SEGMENTO

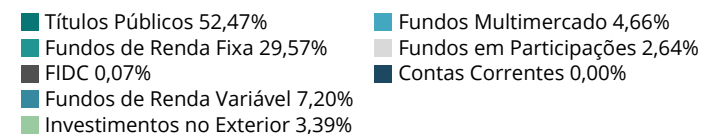
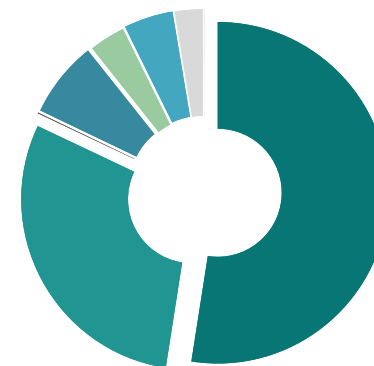


POR TIPO DE ATIVO

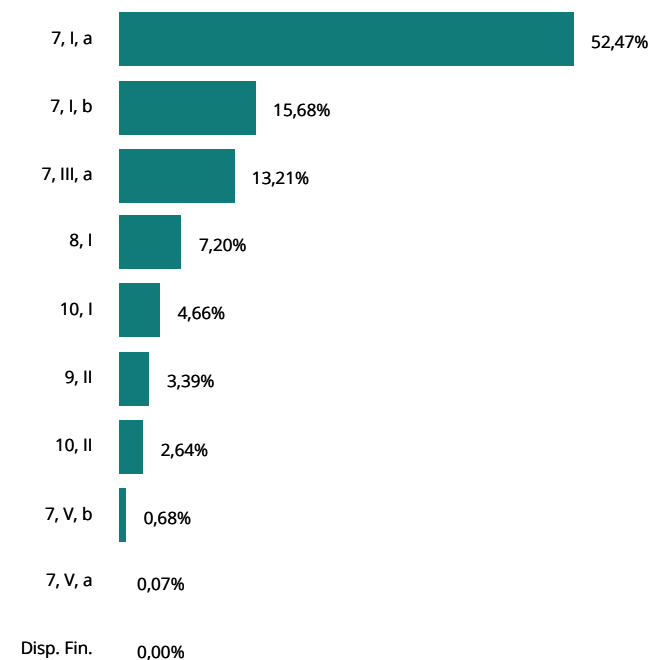


ATIVOS	%	JUNHO	MAIO
FIDC	0,1%	2.682.485,95	2.663.737,78
BRPP FIDC Multisetorial Master	0,0%	41.895,70	40.557,25
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	0,1%	2.640.590,25	2.623.180,53
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	7,2%	282.578.691,06	272.784.573,79
BB FIA ESG BDR Nível I	0,6%	23.293.570,84	21.220.144,20
BB FIA Governança	0,1%	2.822.062,77	2.778.865,67
BB FIC FIA Dividendos	1,4%	56.446.280,83	55.560.623,95
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	0,2%	6.190.027,90	5.563.660,33
Bradesco FIA MID Small Cap	0,1%	2.881.357,91	2.882.378,84
Bradesco FIA Selection	0,2%	8.744.024,14	8.755.253,14
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	0,5%	21.146.795,44 ▲	19.854.538,83
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	0,8%	30.334.192,90	26.908.129,83
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	0,3%	12.941.754,52	12.715.868,05
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	0,3%	12.500.556,20	12.331.153,79
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	1,4%	55.745.742,89	55.135.086,57
Occam FIC FIA	0,3%	10.971.754,71	10.748.290,82
Trend FIA Bolsa Americana	0,1%	2.693.542,78	2.594.598,29
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	0,0%	1.335.196,63	1.333.406,45
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	0,0%	- ▼	5.066.983,81
Vinci FIA Mosaico Institucional	0,2%	7.316.311,22 ▲	2.779.856,46
Vinci FIA Selection Equities	0,4%	17.608.812,70	17.463.520,91
Western Asset FIA BDR Nível I	0,1%	4.132.877,93	3.693.278,38
Western Asset FIA Valuation	0,1%	5.185.756,67	5.114.485,56
XP FIC FIA Investor 30	0,0%	288.072,08	284.449,91
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	3,4%	133.106.180,80	103.703.261,99
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	1,4%	55.738.280,23 ▲	31.773.880,09
BB Schroder Multimercado IE	0,1%	4.890.881,23	4.428.622,29
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	0,1%	2.247.612,03	2.057.591,67
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	0,7%	27.849.598,94	25.681.893,78
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	0,1%	4.769.357,92	4.883.237,86
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	0,1%	3.610.110,44	3.358.148,54
Western Macro Opportunities Multimercado IE	0,2%	6.505.094,17	6.485.613,98
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	0,1%	3.945.196,38	3.924.906,19
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	0,6%	23.550.049,46	21.109.367,59

POR SEGMENTO



POR TIPO DE ATIVO



ATIVOS	%	JUNHO	MAIO
FUNDOS MULTIMERCADO	4,7%	182.693.635,24	179.012.307,48
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	0,7%	28.593.290,48	28.447.288,60
Caixa Bolsa Americana Multimercado	1,1%	42.310.884,36	40.722.531,38
Itaú FIC Private Multimercado SP500	0,9%	33.752.995,68	32.466.222,64
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	0,2%	6.886.222,59	6.818.270,12
Vinci Multiestratégia Multimercado	0,7%	29.252.413,86	29.105.713,53
Vinci Valorem Multimercado	1,1%	41.452.932,13	41.011.452,09
Western Long Short Multimercado	0,0%	444.896,14	440.829,12
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES	2,6%	103.388.522,29	102.584.643,74
BTG FIP Economia Real II	0,0%	933.785,92 ▲	552.475,33
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	0,0%	94.578,16	98.602,38
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	0,0%	22.116,74 ▼	73.553,98
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	0,1%	2.219.630,40 ▼	2.215.289,98
Kinea FIC FIP Equity Infraestrutura I Feeder	1,1%	43.866.754,76	43.907.846,44
Kinea FIP Private Equity II	0,0%	1.961.077,23 ▼	2.051.899,34
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	1,2%	46.749.206,42 ▲	46.147.686,28
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	0,1%	2.457.357,72	2.474.913,17
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	0,1%	5.084.014,94	5.062.376,84
CONTAS CORRENTES	0,0%	148.436,28	86.037,05
Banco do Brasil	0,0%	5.031,16	85.036,23
BNP Paribas	0,0%	1.000,82	1.000,82
Bradesco	0,0%	-	-
Brasil Plural	0,0%	-	-
BRL	0,0%	-	-
BTG Pactual	0,0%	-	-
Caixa Econômica Federal	0,0%	-	-
Daycoval	0,0%	142.404,27	-
Itaú Unibanco	0,0%	-	-
Santander	0,0%	-	-
XP Investimentos	0,0%	0,03	-
TOTAL DA CARTEIRA	100,0%	3.923.127.838,37	3.891.288.136,70

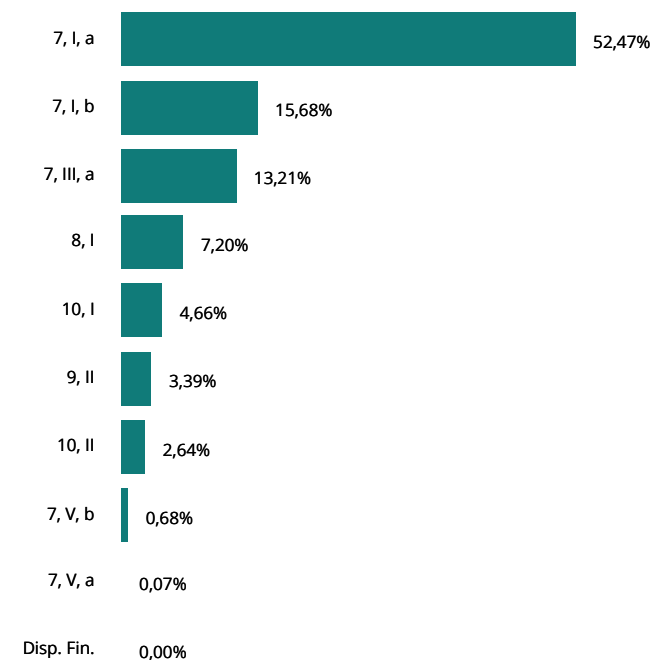
▲ Entrada de Recursos
 ▲ Nova Aplicação
 ▼ Saída de Recursos
 ▼ Resgate Total

POR SEGMENTO



■ Títulos Públicos 52,47%
 ■ Fundos Multimercado 4,66%
■ Fundos de Renda Fixa 29,57%
 ■ Fundos em Participações 2,64%
■ FIDC 0,07%
 ■ Contas Correntes 0,00%
■ Fundos de Renda Variável 7,20%
■ Investimentos no Exterior 3,39%

POR TIPO DE ATIVO



ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2024
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	(1.717.500,13)	3.103.398,10	958.722,38	(8.538.032,15)	7.204.486,83	(5.736.561,54)	(4.725.486,51)
LFT 01/03/2024 (Compra em 17/02/2023)	9.928,76	8.317,33	440,82	-	-	-	18.686,91
LFT 01/03/2024 (Compra em 21/11/2022)	9.652,97	8.086,29	428,57	-	-	-	18.167,83
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	11.604,64	9.930,04	10.029,08	10.884,37	10.273,19	9.999,37	62.720,69
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	7.736,43	6.620,02	6.686,06	7.256,25	6.848,79	6.666,24	41.813,79
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	63.766,05	53.186,82	54.858,11	59.504,57	56.124,83	55.334,60	342.774,98
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	552,30	470,62	475,41	519,35	489,45	472,01	2.979,14
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	6.903,63	5.882,75	5.942,71	6.491,97	6.117,96	5.900,22	37.239,24
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	54.879,55	47.462,27	48.017,71	52.469,52	49.806,48	48.379,66	301.015,19
LFT 01/09/2026 (Compra em 13/05/2024)	-	-	-	-	15.264,70	24.529,11	39.793,81
LFT 01/09/2026 (Compra em 15/05/2024)	-	-	-	-	3.460,88	6.589,91	10.050,79
LTN 01/01/2024 (Compra em 13/12/2021)	0,44	-	-	-	-	-	0,44
LTN 01/01/2026 (Compra em 25/07/2023) 000075647	13.113,54	-	-	-	-	-	13.113,54
LTN 01/01/2026 (Compra em 28/07/2023) 00007565E	19.982,55	-	-	-	-	-	19.982,55
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 14/06/2023) 005D3D3	138.361,73	92.813,90	155.737,72	36.010,63	-	-	422.923,98
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	57.064,23	38.279,04	64.230,57	26.316,11	73.599,56	40.851,01	300.340,52
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 19/02/2024) 0063A36	-	17.887,77	62.089,55	22.664,54	53.335,16	29.603,37	185.580,39
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 24/01/2024) 0062FAB	(5.636,46)	102.077,43	171.281,51	39.604,76	-	-	307.327,24
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 26/01/2024) 00630E8	(8.881,42)	51.038,72	85.640,76	19.802,38	-	-	147.600,44
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 02/09/2022) 00565EE	122.535,28	127.952,89	137.708,89	(169.458,62)	206.757,34	-	425.495,78
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	12.253,52	12.795,29	13.770,89	(16.945,86)	22.877,41	(92,98)	44.658,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	122.535,28	127.952,89	137.708,89	(169.458,62)	210.720,35	(167,37)	429.291,42
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	58.816,94	61.417,38	66.100,27	(81.340,14)	109.811,56	(446,32)	214.359,69
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 19/08/2022) 00560B1	22.056,35	23.031,52	24.787,60	(30.502,55)	37.216,32	-	76.589,24
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	24.507,06	25.590,57	27.541,78	(33.891,72)	45.754,81	(185,96)	89.316,54
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	(3.693,33)	1.867,80	(1.152,19)	(7.895,35)	5.144,91	(4.812,12)	(10.540,28)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	(52.761,78)	26.682,89	(16.459,93)	(112.790,74)	73.498,94	(68.744,64)	(150.575,26)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	(158.285,34)	80.048,66	(49.379,77)	(338.372,23)	220.496,84	(206.233,94)	(451.725,78)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	(54.872,25)	27.750,20	(17.118,32)	(117.302,37)	76.438,91	(71.494,43)	(156.598,26)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	(14.615,01)	7.391,16	(4.559,39)	(31.243,05)	20.359,21	(19.042,27)	(41.709,35)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/04/2024) 006560D	-	-	-	(948.354,57)	728.374,56	(681.259,45)	(901.239,46)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	(34.295,15)	17.343,87	(10.698,95)	(73.313,98)	47.774,32	(44.684,02)	(97.873,91)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 15/05/2024)	-	-	-	-	2.152,78	(15.673,78)	(13.521,00)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/05/2024)	-	-	-	-	789,14	(12.099,06)	(11.309,92)

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2024
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	(1.717.500,13)	3.103.398,10	958.722,38	(8.538.032,15)	7.204.486,83	(5.736.561,54)	(4.725.486,51)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	(12.346,26)	6.243,80	(3.851,62)	(26.393,04)	17.198,76	(16.086,25)	(35.234,61)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	(44.847,51)	22.680,45	(13.990,93)	(95.872,14)	62.474,11	(58.432,95)	(127.988,97)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	(14.245,68)	7.204,38	(4.444,18)	(30.453,50)	19.844,72	(18.561,06)	(40.655,32)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	(52.761,78)	26.682,89	(16.459,93)	(112.790,74)	73.498,95	(68.744,65)	(150.575,26)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	(353.503,92)	178.775,34	(110.281,49)	(755.697,97)	492.442,95	(460.589,14)	(1.008.854,23)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/05/2024) 006704C	-	-	-	-	1.121,21	(4.812,12)	(3.690,91)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/05/2024) 006704D	-	-	-	-	127.821,16	(687.446,47)	(559.625,31)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	(116.023,15)	58.675,66	(36.195,38)	(248.026,83)	161.624,18	(151.169,48)	(331.115,00)
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	(320.609,90)	96.382,48	(139.949,69)	(587.540,70)	293.503,99	(530.821,85)	(1.189.035,67)
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	(10.687,00)	3.212,75	(4.664,99)	(19.584,69)	9.783,47	(17.694,06)	(39.634,52)
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	(53.434,98)	16.063,74	(23.324,94)	(97.923,45)	48.917,33	(88.470,31)	(198.172,61)
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/05/2022) 344518	(24.936,32)	7.496,41	(10.884,97)	(45.697,61)	22.828,08	(41.286,15)	(92.480,56)
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	(64.121,98)	19.276,49	(27.989,93)	(117.508,14)	58.700,80	(106.164,37)	(237.807,13)
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	(60.559,65)	18.205,58	(26.434,94)	(110.979,91)	55.439,64	(100.266,35)	(224.595,63)
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/05/2024)	-	-	-	-	92,32	(1.108,56)	(1.016,24)
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	(15.812,74)	2.510,61	(6.477,72)	(27.919,03)	11.650,55	(23.557,21)	(59.605,54)
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	(8.743,50)	1.388,22	(3.581,80)	(15.437,57)	6.442,07	(13.025,75)	(32.958,33)
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	167.866,09	111.794,28	137.878,41	120.380,71	135.638,46	178.341,41	851.899,36
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	14.772,21	9.837,89	12.133,29	10.593,50	11.936,19	15.694,05	74.967,13
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)	7.002,41	4.663,43	5.751,50	5.021,59	5.658,06	7.439,39	35.536,38
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549	52.757,91	35.135,35	43.333,21	37.833,94	42.629,23	56.050,15	267.739,79
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	10.215,86	6.803,48	8.390,89	7.326,03	8.254,56	10.853,35	51.844,17
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	2.217,36	1.315,72	3.096,61	(1.612,54)	3.634,41	757,18	9.408,74
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	23.268,67	13.806,86	32.495,28	(16.921,73)	38.138,88	7.945,67	98.733,63
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 09/08/2017) 244294	27.374,90	16.243,35	38.229,74	(24.789,08)	-	-	57.058,91
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	23.816,17	14.131,72	33.259,87	(17.319,88)	39.036,26	8.132,63	101.056,77
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	20.531,17	12.182,52	28.672,30	(14.930,93)	33.651,95	7.010,88	87.117,89
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	20.531,17	12.182,52	28.672,30	(14.930,93)	33.651,95	7.010,88	87.117,89
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	23.268,67	13.806,86	32.495,28	(16.921,73)	38.138,88	7.945,67	98.733,63
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	38.735,49	22.984,35	54.095,08	(28.169,69)	63.490,01	13.227,20	164.362,44
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	54.749,81	32.486,72	76.459,48	(39.815,82)	89.738,53	18.695,69	232.314,41
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	27.374,90	16.243,36	38.229,74	(19.907,91)	44.869,27	9.347,84	116.157,20
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	19.983,68	11.857,66	27.907,70	(14.532,77)	32.754,56	6.823,93	84.794,76

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2024
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	(1.717.500,13)	3.103.398,10	958.722,38	(8.538.032,15)	7.204.486,83	(5.736.561,54)	(4.725.486,51)
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	4.927,49	2.923,80	6.881,35	(3.583,42)	8.076,47	1.682,61	20.908,30
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	1.204,49	714,70	1.682,11	(875,95)	1.974,26	411,30	5.110,91
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 22/11/2022) 0058918	27.374,90	16.243,36	38.229,74	(24.789,08)	-	-	57.058,92
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	2.737,50	1.624,33	3.822,97	(1.990,79)	4.486,93	934,78	11.615,72
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	3.011,23	1.786,78	4.205,27	(2.189,87)	4.935,61	1.028,26	12.777,28
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	27.374,90	16.243,36	38.229,74	(21.494,29)	30.286,76	6.309,80	96.950,27
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	4.689,74	34.403,92	16.631,28	(66.135,30)	59.441,47	(14.890,34)	34.140,77
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	1.758,66	12.901,47	6.236,73	(24.800,74)	22.290,55	(5.583,88)	12.802,79
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	7.816,24	57.339,87	27.718,80	(110.225,49)	99.069,11	(24.817,24)	56.901,29
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 14/05/2024)	-	-	-	-	794,21	(2.605,81)	(1.811,60)
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	1.117,71	8.199,60	3.963,80	(15.762,25)	14.166,89	(3.548,87)	8.136,88
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/05/2024)	-	-	-	-	89,39	(248,17)	(158,78)
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	836,34	6.135,37	2.965,91	(11.794,12)	10.600,39	(2.655,45)	6.088,44
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	1.324,86	9.719,11	4.698,34	(18.683,22)	16.792,21	(4.206,52)	9.644,78
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	7.816,24	57.339,86	27.718,80	(110.225,49)	99.069,11	(24.817,24)	56.901,28
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	4.689,75	34.403,92	16.631,28	(66.135,30)	59.441,47	(14.890,34)	34.140,78
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819	7.816,24	57.339,87	27.718,80	(110.225,49)	99.069,11	(24.817,24)	56.901,29
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	9.379,49	68.807,84	33.262,56	(132.270,59)	118.882,94	(29.780,69)	68.281,55
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	781,62	5.733,98	2.771,89	(11.022,55)	9.906,91	(2.481,73)	5.690,12
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	(43.420,93)	79.631,01	2.156,53	(218.534,24)	176.470,70	(89.205,21)	(92.902,14)
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	(29.568,22)	54.226,09	1.468,52	(148.814,60)	120.170,72	(60.745,79)	(63.263,28)
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	(22.176,16)	40.669,56	1.101,40	(111.610,95)	90.128,04	(45.559,35)	(47.447,46)
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	(12.566,50)	23.046,09	624,13	(63.246,21)	51.072,56	(25.816,97)	(26.886,90)
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	(24.393,77)	44.736,50	1.211,54	(122.772,05)	99.140,85	(50.115,29)	(52.192,22)
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	(142.866,82)	137.125,79	(29.527,94)	(377.801,16)	284.103,03	(214.417,57)	(343.384,67)
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2	(178.583,52)	171.407,23	(36.909,92)	(472.251,45)	355.128,78	(268.021,95)	(429.230,83)
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	(178.583,52)	171.407,24	(36.909,92)	(472.251,45)	355.128,78	(268.021,95)	(429.230,82)
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	(55.959,92)	19.431,22	(24.339,57)	(88.988,16)	51.088,19	(64.975,61)	(163.743,85)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	(17.979,08)	3.996,66	(7.030,73)	(31.515,53)	13.493,01	(26.342,22)	(65.377,89)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	(58.432,01)	12.989,15	(22.849,87)	(102.425,47)	43.852,30	(85.612,24)	(212.478,14)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/05/2024)	-	-	-	-	3.492,05	(30.688,68)	(27.196,63)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	(503.414,19)	111.906,55	(196.860,47)	(882.434,78)	377.804,41	(737.582,35)	(1.830.580,83)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/04/2024) 0065A5E	-	-	-	(79.563,25)	157.396,01	(307.282,07)	(229.449,31)

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2024
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	(1.717.500,13)	3.103.398,10	958.722,38	(8.538.032,15)	7.204.486,83	(5.736.561,54)	(4.725.486,51)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	(10.607,66)	2.358,04	(4.148,13)	(18.594,16)	7.960,88	(15.541,92)	(38.572,95)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	(161.811,71)	35.969,95	(63.276,58)	(283.639,76)	121.437,14	(237.080,04)	(588.401,00)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	(2.247,38)	499,59	(878,85)	(3.939,44)	1.686,63	(3.292,78)	(8.172,23)
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	(89.895,39)	19.983,30	(35.153,65)	(157.577,64)	67.465,07	(131.711,13)	(326.889,44)
NTN-F 01/01/2027 (Compra em 17/08/2023) 0046601	3.884,78	-	-	-	-	-	3.884,78
NTN-F 01/01/2031 (Compra em 05/10/2022) 003FA75	(108.578,14)	-	-	-	-	-	(108.578,14)
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	12.249.190,25	11.951.893,78	11.898.382,98	9.655.438,28	12.986.923,33	12.787.288,37	71.529.116,99
NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)	555.751,36	537.371,95	532.461,23	395.896,39	477.723,90	457.904,31	2.957.109,14
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	168.914,33	163.118,09	161.735,72	120.891,54	145.433,33	139.408,68	899.501,69
NTN-B XP 2030-08 (Compra 01/11/23 Tx 5.8570)	316.604,36	306.890,74	303.701,03	223.521,82	271.295,05	259.976,80	1.681.989,80
NTN-B XP 2030-08 (Compra 09/10/23 Tx 5.8465)	318.670,10	308.895,90	305.708,01	224.900,32	273.025,51	261.625,61	1.692.825,45
NTN-B XP 2030-08 (Compra 10/06/24 Tx 6.1900)	-	-	-	-	-	60.849,90	60.849,90
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/06/24 Tx 6.4400)	-	-	-	-	-	83.917,64	83.917,64
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	304.022,56	294.076,54	291.328,96	216.151,86	261.135,28	250.279,04	1.616.994,24
NTN-B XP 2030-08 (Compra 22/04/24 Tx 6.0500)	-	-	-	82.166,14	315.551,03	302.442,21	700.159,38
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	207.196,74	201.377,93	199.034,10	144.753,54	176.924,82	169.507,66	1.098.794,79
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	227.936,03	220.130,92	218.241,85	163.007,69	196.168,40	188.057,69	1.213.542,58
NTN-B XP 2030-08 (Compra 25/04/24 Tx 6.1200)	-	-	-	18.468,79	144.855,51	138.853,30	302.177,60
NTN-B XP 2030-08 (Compra 25/04/24 Tx 6.1200) i	-	-	-	14,88	116,63	111,80	243,31
NTN-B XP 2032-08 (Compra 11/04/24 Tx 5.9010)	-	-	-	78.519,47	142.732,69	136.786,78	358.038,94
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	337.477,00	325.925,41	323.083,71	241.403,10	290.421,30	278.459,17	1.796.769,69
NTN-B XP 2035-05 (Compra 03/05/24 Tx 6.2200)	-	-	-	-	204.579,86	212.288,91	416.868,77
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	320.603,41	315.548,96	316.325,64	234.706,35	279.338,35	263.928,82	1.730.451,53
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	310.010,07	304.299,38	305.555,54	229.630,89	271.153,36	256.199,47	1.676.848,71
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	10.574,65	10.468,10	10.457,57	7.561,19	9.142,10	8.638,79	56.842,40
NTN-B XP 2035-05 (Compra 09/05/24 Tx 6.2100)	-	-	-	-	164.067,95	211.770,52	375.838,47
NTN-B XP 2035-05 (Compra 10/06/24 Tx 6.2500)	-	-	-	-	-	61.183,54	61.183,54
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	9.115,52	9.002,97	9.005,92	6.576,57	7.904,39	7.468,07	49.073,44
NTN-B XP 2035-05 (Compra 16/04/24 Tx 6.0000)	-	-	-	196.613,15	442.915,42	418.489,44	1.058.018,01
NTN-B XP 2035-05 (Compra 16/05/24 Tx 6.1500)	-	-	-	-	85.262,03	173.244,03	258.506,06
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	170.501,21	167.652,88	168.167,57	125.340,83	148.763,78	140.572,90	920.999,17
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	318.482,61	313.511,19	314.206,06	233.010,00	277.394,11	262.106,47	1.718.710,44
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	166.262,74	163.334,41	163.914,70	122.704,22	145.247,76	137.244,95	898.708,78

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2024
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	12.249.190,25	11.951.893,78	11.898.382,98	9.655.438,28	12.986.923,33	12.787.288,37	71.529.116,99
NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	545.353,93	529.128,14	523.579,76	383.823,41	466.936,26	447.399,85	2.896.221,35
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	570.707,00	550.600,60	545.995,75	409.205,45	491.437,61	471.236,44	3.039.182,85
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	54.577,85	53.007,48	52.432,91	38.296,66	46.687,81	44.735,48	289.738,19
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	395.969,23	381.727,18	378.597,42	284.752,45	341.288,93	327.282,69	2.109.617,90
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	1.084.032,80	1.069.117,59	1.070.337,11	786.720,39	941.778,71	890.074,62	5.842.061,22
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	278.516,24	274.037,16	274.787,12	204.157,72	242.763,69	229.369,17	1.503.631,10
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	107.577,67	106.354,09	106.324,04	77.318,13	93.182,63	88.080,89	578.837,45
NTN-B XP 2045-05 (Compra 09/04/24 Tx 5.9600)	-	-	-	249.823,55	441.897,58	417.574,73	1.109.295,86
NTN-B XP 2045-05 (Compra 12/04/24 Tx 6.0300)	-	-	-	232.846,84	444.387,66	419.917,76	1.097.152,26
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	1.086.840,22	1.072.694,45	1.073.491,28	786.362,54	943.364,11	891.664,50	5.854.417,10
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	144.605,05	142.615,00	142.777,91	104.946,17	125.629,45	118.732,31	779.305,89
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/24 Tx 6.1400)	-	-	-	-	22.359,46	45.438,28	67.797,74
NTN-B XP 2045-05 (Compra 20/06/24 Tx 6.3800)	-	-	-	-	-	11.339,63	11.339,63
NTN-B XP 2045-05 (Compra 21/06/24 Tx 6.3300)	-	-	-	-	-	18.445,79	18.445,79
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	342.936,88	337.003,22	338.161,78	252.884,80	299.479,85	282.951,74	1.853.418,27
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	557.480,76	540.510,68	535.033,54	393.493,35	477.804,17	457.854,51	2.962.177,01
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	558.500,87	541.297,63	535.880,37	394.672,55	478.827,93	458.914,23	2.968.093,58
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	551.257,26	534.127,00	528.796,77	390.094,31	472.808,60	453.118,75	2.930.202,69
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	559.123,64	542.388,52	536.810,69	394.080,97	479.017,63	458.984,61	2.970.406,06
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	558.865,39	541.991,15	536.409,57	394.137,59	478.881,10	458.871,75	2.969.156,55
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	1.110.722,77	1.093.688,52	1.096.039,35	811.982,66	967.237,59	913.984,14	5.993.655,03
FUNDOS DE RENDA FIXA	848.990,12	9.502.741,57	6.221.574,28	(4.687.949,05)	13.033.599,94	(1.136.452,22)	23.782.504,64
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	1.622.158,75	1.596.866,59	1.860.286,67	2.080.943,02	1.770.381,63	1.422.835,93	10.353.472,59
BB FIC Previdenciário Fluxo	241.013,11	167.487,02	103.919,24	35.192,58	29.952,68	41.486,86	619.051,49
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	291.723,42	256.038,33	288.850,14	(69.141,80)	316.220,67	47.084,48	1.130.775,24
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	(1.151.302,89)	1.262.382,73	142.549,60	(1.874.283,78)	1.043.016,00	(797.439,19)	(1.375.077,53)
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	(3.006.499,87)	956.627,42	(1.152.856,73)	(5.204.117,53)	2.358.234,88	(3.441.797,77)	(9.490.409,60)
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	32.070,42	21.228,66	26.153,22	22.831,39	25.823,96	34.074,89	162.182,54
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	565.106,40	474.998,87	493.493,02	532.477,81	500.356,10	487.765,88	3.054.198,08
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	95.318,21	139.129,31	111.635,20	(60.770,89)	217.718,33	(4.347,82)	498.682,34
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	(124.881,48)	105.520,24	-	-	-	-	(19.361,24)
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	213.949,19	185.340,11	244.365,64	(75.441,86)	341.224,69	120.175,45	1.029.613,22
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	(232.017,43)	73.469,44	(89.657,06)	(452.461,92)	231.594,37	(346.906,11)	(815.978,71)

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2024
FUNDOS DE RENDA FIXA	848.990,12	9.502.741,57	6.221.574,28	(4.687.949,05)	13.033.599,94	(1.136.452,22)	23.782.504,64
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	222.347,42	171.526,80	181.768,74	186.124,57	171.413,91	166.141,13	1.099.322,57
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	42.725,55	27.825,97	32.306,22	(38.724,70)	40.218,04	(22.293,23)	82.057,85
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	108,76	92,82	94,66	102,24	95,93	94,22	588,63
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	1.428.788,58	1.133.349,66	1.362.275,92	1.530.255,61	1.439.740,61	1.369.478,12	8.263.888,50
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	47.742,00	40.587,00	55.632,00	(35.445,00)	76.383,00	20.265,00	205.164,00
Caixa Brasil Referenciado	11.748,75	225.078,10	542.458,11	561.680,28	135.280,08	112.161,58	1.588.406,90
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	413.055,40	273.959,18	338.588,80	294.453,80	332.743,00	439.074,40	2.091.874,58
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	(189.941,15)	174.912,06	6.121,30	(176.933,81)	138.313,57	(107.248,42)	(154.776,45)
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	(486.570,58)	152.007,70	(17.073,57)	(88.389,57)	45.953,91	(67.286,75)	(461.358,86)
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	131,45	1.400,89	95,56	606,51	18.213,00	262,96	20.710,37
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	194.116,97	228.705,22	227.869,22	(96.486,99)	309.028,93	(83.737,11)	779.496,24
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	193.605,52	110.216,02	137.931,47	259.510,84	192.774,32	199.893,50	1.093.931,67
Itaú FIC IMA-B 5+	(825.932,96)	271.656,44	(313.901,39)	(1.604.639,19)	838.202,34	(1.224.234,26)	(2.858.849,02)
Itaú FIC Institucional IMA-B	(79.481,86)	89.897,33	10.238,87	(277.380,89)	219.813,24	(166.757,85)	(203.671,16)
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	141.636,59	110.724,55	153.823,77	163.260,31	181.455,31	194.806,03	945.706,56
Trend Cash FIC Simples	7.534,09	6.325,67	22.564,83	25.123,39	11.453,83	219,17	73.220,98
Vinci Institucional Referenciado	9.950,12	8.565,12	9.005,76	7.116,25	10.595,86	20.915,71	66.148,82
Western Asset Ativo IMA-B	(146.261,60)	80.355,32	(11.250,91)	(560.705,28)	304.821,14	(347.415,62)	(680.456,95)
Western Asset Ativo IMA-B 5	318.306,60	208.056,20	379.056,73	(527.590,87)	565.247,01	(45.508,70)	897.566,97
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	264.060,41	195.388,79	194.120,90	213.014,42	219.589,10	245.017,69	1.331.191,31
Western Ativo Max	57.165,43	22.620,54	44.880,97	(49.191,68)	51.868,20	(14.980,37)	112.363,09
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	324.222,13	285.130,31	331.321,50	360.378,41	434.633,95	415.045,16	2.150.731,46
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	5.944,85	75.520,93	146.356,93	72.910,39	27.903,45	28.711,35	357.347,90
XP Inflação Referenciado IPCA	22.605,10	99.072,53	71.467,39	(148.814,98)	202.184,84	(44.531,73)	201.983,15
XP Trend Simples	324.744,72	270.677,70	287.081,56	306.589,87	231.150,06	212.523,20	1.632.767,11
FIDC	19.794,62	27.079,87	9.139,12	15.083,74	15.886,38	18.748,17	105.731,90
BRPP FIDC Multisetorial Master	432,87	7.976,20	976,33	(6.361,35)	3.434,02	1.338,45	7.796,52
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	19.361,75	19.103,67	8.162,79	21.445,09	12.452,36	17.409,72	97.935,38
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	(7.843.258,72)	6.089.351,58	307.818,24	(7.695.069,93)	(2.983.278,24)	9.337.217,27	(2.787.219,80)
BB FIA ESG BDR Nível I	776.346,02	1.269.779,48	446.830,20	(416.836,22)	1.250.304,55	2.073.426,64	5.399.850,67
BB FIA Governança	(138.259,26)	25.890,90	(14.472,96)	(43.677,92)	(83.286,72)	43.197,10	(210.608,86)
BB FIC FIA Dividendos	(2.345.942,05)	521.957,38	(506.402,16)	(1.110.878,63)	(991.258,30)	885.656,88	(3.546.866,88)

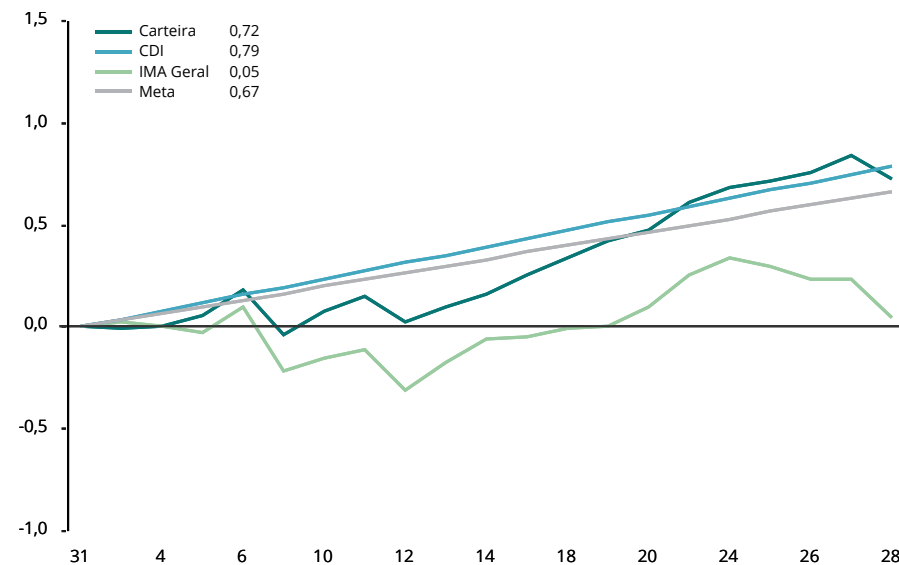
ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2024
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	(7.843.258,72)	6.089.351,58	307.818,24	(7.695.069,93)	(2.983.278,24)	9.337.217,27	(2.787.219,80)
BB FIC FIA Seleção Fatorial	(441.717,57)	34.109,69	(101.823,62)	(100.873,37)	-	-	(610.304,87)
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	173.906,38	245.013,57	168.291,13	(6.853,41)	311.718,86	626.367,57	1.518.444,10
Bradesco FIA MID Small Cap	(227.519,42)	63.107,44	(3.455,96)	(248.095,46)	(6.838,69)	(1.020,93)	(423.823,02)
Bradesco FIA Selection	(395.797,24)	185.886,83	(60.976,23)	(656.114,60)	(370.239,44)	(11.229,00)	(1.308.469,68)
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	(1.034.914,66)	186.898,60	(199.040,88)	(473.095,35)	(711.194,95)	248.256,61	(1.983.090,63)
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	991.635,15	1.425.354,21	840.234,98	200.429,55	1.708.097,92	3.426.063,07	8.591.814,88
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	(411.537,86)	233.316,50	(133.374,19)	(175.765,59)	(192.610,79)	225.886,47	(454.085,46)
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	(566.705,91)	135.306,01	(58.256,11)	(400.505,96)	(488.147,56)	169.402,41	(1.208.907,12)
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	(2.777.761,44)	270.780,22	(158.859,94)	(2.067.236,66)	(2.201.460,17)	610.656,32	(6.323.881,67)
Occam FIC FIA	(451.111,03)	131.680,64	(173.244,18)	(303.292,75)	(349.351,11)	223.463,89	(921.854,54)
Trend FIA Bolsa Americana	64.008,82	128.461,01	80.171,94	(101.695,12)	129.065,64	98.944,49	398.956,78
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	(64.094,97)	6.875,74	24.717,65	(100.621,16)	(68.507,31)	1.790,18	(199.839,87)
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	(285.328,17)	72.134,85	(22.954,24)	(218.608,29)	(207.899,23)	2.700,07	(659.955,01)
Vinci FIA Gas Dividendos	(121.411,90)	32.552,91	(20.400,33)	(29.659,59)	-	-	(138.918,91)
Vinci FIA Mosaico Institucional	-	-	-	(4.605,36)	(90.938,18)	53.870,88	(41.672,66)
Vinci FIA Selection Equities	(1.027.397,54)	200.867,84	58.672,26	(735.446,36)	(471.669,57)	145.291,79	(1.829.681,58)
Western Asset FIA BDR Nível I	696.671,70	822.363,49	150.017,95	(221.459,97)	184.184,57	439.599,55	2.071.377,29
Western Asset FIA Valuation	(146.840,37)	44.233,94	20.493,77	(339.165,00)	(322.423,47)	71.271,11	(672.430,02)
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	(102.757,11)	45.816,93	(25.128,25)	(118.469,69)	-	-	(200.538,12)
XP FIC FIA Investor 30	(6.730,29)	6.963,40	(3.222,59)	(22.543,02)	(10.824,29)	3.622,17	(32.734,62)
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	2.514.458,13	4.204.928,44	3.333.803,05	(657.592,80)	2.717.597,13	9.402.918,81	21.516.112,76
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	840.388,04	1.196.588,66	1.253.237,96	25.974,13	1.444.497,63	3.964.400,14	8.725.086,56
BB Schroder Multimercado IE	171.138,13	146.921,84	172.723,10	15.741,80	193.683,60	462.258,94	1.162.467,41
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	35.148,78	86.380,11	64.825,82	1.525,07	114.230,87	190.020,36	492.131,01
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	678.070,56	1.025.382,04	913.350,38	(62.887,76)	1.146.035,86	2.167.705,16	5.867.656,24
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	(42.946,98)	250.549,83	231.431,14	48.409,49	(203.905,89)	(113.879,94)	169.657,65
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	74.154,49	79.469,84	49.302,58	88.354,80	57.973,15	251.961,90	601.216,76
Western Macro Opportunities Multimercado IE	(163.077,62)	(173.010,91)	130.880,67	(534.276,61)	177.243,41	19.480,19	(542.760,87)
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	161.070,15	(90.561,81)	19.777,93	(106.062,31)	(105.006,59)	20.290,19	(100.492,44)
XP FIC Moneda Latam Credit Advisory Mult. IE	11.695,38	60.039,47	46.126,19	(11.515,23)	15.285,50	-	121.631,31
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	748.817,20	1.623.169,37	452.147,28	(122.856,18)	(122.440,41)	2.440.681,87	5.019.519,13

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2024
FUNDOS MULTIMERCADO	1.728.067,13	4.347.665,99	3.297.216,42	(3.072.048,66)	4.548.095,99	3.681.327,76	14.530.324,63
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	244.929,07	220.381,87	235.492,23	(11.838,53)	165.636,23	146.001,88	1.000.602,75
BB FIC Macro Multimercado	(2.773,07)	-	-	-	-	-	(2.773,07)
BB FIC Quantitativo Multimercado	8.024,51	-	-	-	-	-	8.024,51
Caixa Bolsa Americana Multimercado	611.040,74	2.100.675,30	1.322.791,72	(1.532.738,69)	1.964.007,09	1.588.352,98	6.054.129,14
Itaú FIC Private Multimercado SP500	482.963,03	1.669.107,41	1.062.080,69	(1.223.137,89)	1.564.752,73	1.286.773,04	4.842.539,01
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	(7.564,32)	60.921,63	176.924,44	(79.691,05)	38.029,89	67.952,47	256.573,06
Vinci Multiestratégia Multimercado	176.789,17	153.852,83	219.818,50	50.646,32	265.188,85	146.700,33	1.012.996,00
Vinci Valorem Multimercado	207.406,84	142.073,67	268.926,42	(269.228,35)	545.233,23	441.480,04	1.335.891,85
Western Long Short Multimercado	7.251,16	653,28	11.182,42	(6.060,47)	5.247,97	4.067,02	22.341,38
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES	(26.285,57)	1.349.190,86	(200.673,57)	24.893.524,73	(138.895,51)	18.925,38	25.895.786,32
BTG FIP Economia Real II	(15.403,43)	(13.334,27)	(14.225,79)	(15.451,85)	(14.865,66)	(35.356,03)	(108.637,03)
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	(5.814,24)	(6.839,08)	(5.508,77)	(4.361,58)	(3.854,83)	(4.024,22)	(30.402,72)
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	2.087,11	(179,53)	6.567,10	1.312,26	(1.709,83)	46.951,37	55.028,48
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	(603,50)	(554,75)	(95.529,59)	(1.181,35)	(636,86)	146.744,69	48.238,64
Kinea FIC FIP Equity Infraestrutura I Feeder	-	-	-	25.026.060,44	(29.364,33)	(41.091,68)	24.955.604,43
Kinea FIP Private Equity II	18.431,44	(14.657,73)	15.709,15	14.533,92	3.141,54	14.832,46	51.990,78
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	(73.195,68)	1.364.496,22	48.665,13	(113.862,35)	(55.831,08)	(113.213,86)	1.057.058,38
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	(19.074,36)	(12.192,22)	195.531,43	(15.600,99)	(18.322,80)	(17.555,45)	112.785,61
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	67.287,09	32.452,22	(351.882,23)	2.076,23	(17.451,66)	21.638,10	(245.880,25)
TOTAL	7.773.455,83	40.576.250,19	25.825.982,90	9.913.354,16	37.384.415,85	28.373.412,00	149.846.870,93

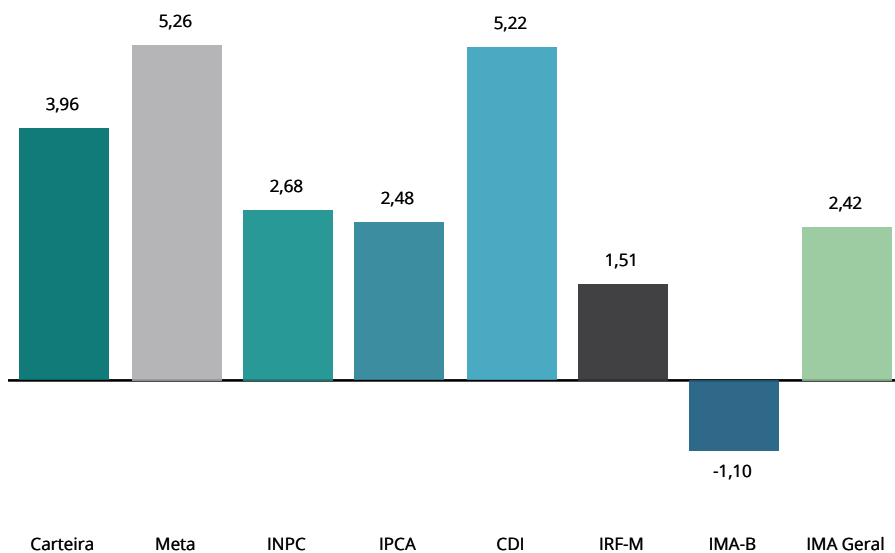
RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META ATUARIAL (INPC + 5,09% A.A.)

MÊS	CARTEIRA	META	CDI	IMA-G	% META	% CDI	% IMA-G
Janeiro	0,20	0,99	0,97	0,47	21	21	44
Fevereiro	1,07	1,23	0,80	0,64	87	133	167
Março	0,67	0,61	0,83	0,52	111	81	129
Abril	0,25	0,79	0,89	(0,22)	32	29	-116
Maio	0,97	0,88	0,83	0,95	111	116	103
Junho	0,72	0,67	0,79	0,05	109	92	1.539
Julho							
Agosto							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							
TOTAL	3,96	5,26	5,22	2,42	75	76	164

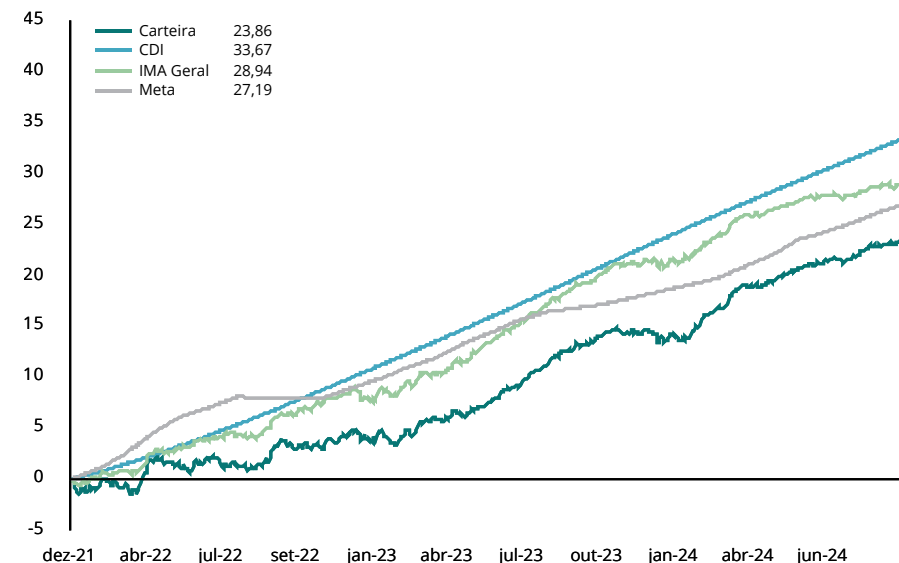
RENTABILIDADE ACUMULADA NO MÊS



CARTEIRA x INDICADORES EM 2024



RENTABILIDADE ACUMULADA DESDE DEZEMBRO/2021



RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	Sem bench	0,80	120%	5,23	100%	11,71	132%	0,01	0,06	0,02	0,11	71,47	1,41	0,00	0,00
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	Sem bench	0,80	120%	5,23	100%	11,71	132%	0,01	0,06	0,02	0,11	71,47	1,41	0,00	0,00
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	Sem bench	0,82	123%	5,28	100%	11,85	133%	0,02	0,08	0,04	0,13	96,91	11,19	0,00	0,00
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	Sem bench	0,79	119%	5,22	99%	11,69	131%	0,01	0,07	0,01	0,11	59,49	-0,13	0,00	0,00
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	Sem bench	0,79	119%	5,22	99%	11,69	131%	0,01	0,07	0,01	0,11	59,49	-0,13	0,00	0,00
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	Sem bench	0,81	122%	5,26	100%	11,72	132%	0,03	0,07	0,05	0,11	59,66	2,82	0,00	0,00
LFT 01/09/2026 (Compra em 13/05/2024)	Sem bench	0,82	123%	5,36	102%	11,89	134%	0,02	0,08	0,04	0,13	104,43	14,42	0,00	0,00
LFT 01/09/2026 (Compra em 15/05/2024)	Sem bench	0,82	123%	5,36	102%	11,89	134%	0,02	0,08	0,04	0,13	104,43	14,42	0,00	0,00
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	Sem bench	0,64	95%	4,31	82%	9,60	108%	0,88	4,24	1,45	6,98	-13,68	-10,81	-0,09	-2,88
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 19/02/2024) 0063A36	Sem bench	0,64	95%	4,31	82%	9,60	108%	0,88	4,24	1,45	6,98	-13,68	-10,81	-0,09	-2,88
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	Sem bench	-0,00	-1%	1,66	32%	5,87	66%	2,89	4,71	4,75	7,74	-21,60	-14,37	-0,61	-3,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	Sem bench	-0,00	-1%	1,66	32%	5,87	66%	2,89	4,71	4,75	7,74	-21,60	-14,37	-0,61	-3,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	Sem bench	-0,00	-1%	1,66	32%	5,87	66%	2,89	4,71	4,75	7,74	-21,60	-14,37	-0,61	-3,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	Sem bench	-0,00	-1%	1,66	32%	5,87	66%	2,89	4,71	4,75	7,74	-21,60	-14,37	-0,61	-3,27
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/04/2024) 006560D	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 15/05/2024)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/05/2024)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/05/2024) 006704C	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/05/2024) 006704D	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	Sem bench	-1,62	-243%	-3,83	-73%	-0,75	-8%	5,52	6,31	9,08	10,39	-34,59	-17,11	-1,78	-7,40
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	Sem bench	-2,79	-420%	-6,34	-121%	-2,50	-28%	7,31	7,31	12,01	12,01	-39,05	-16,28	-2,79	-9,77
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	Sem bench	-2,79	-420%	-6,34	-121%	-2,50	-28%	7,31	7,31	12,01	12,01	-39,05	-16,28	-2,79	-9,77

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	Sem bench	-2,79	-420%	-6,34	-121%	-2,50	-28%	7,31	7,31	12,01	12,01	-39,05	-16,28	-2,79	-9,77
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/05/2022) 344518	Sem bench	-2,79	-420%	-6,34	-121%	-2,50	-28%	7,31	7,31	12,01	12,01	-39,05	-16,28	-2,79	-9,77
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	Sem bench	-2,79	-420%	-6,34	-121%	-2,50	-28%	7,31	7,31	12,01	12,01	-39,05	-16,28	-2,79	-9,77
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	Sem bench	-2,79	-420%	-6,34	-121%	-2,50	-28%	7,31	7,31	12,01	12,01	-39,05	-16,28	-2,79	-9,77
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/05/2024)	Sem bench	-3,29	-494%	-8,17	-155%	-4,40	-50%	8,31	8,33	13,65	13,71	-39,14	-15,72	-3,29	-11,70
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	Sem bench	-3,29	-494%	-8,17	-155%	-4,40	-50%	8,31	8,33	13,65	13,71	-39,14	-15,72	-3,29	-11,70
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	Sem bench	-3,29	-494%	-8,17	-155%	-4,40	-50%	8,31	8,33	13,65	13,71	-39,14	-15,72	-3,29	-11,70
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	Sem bench	1,18	177%	5,40	103%	11,11	125%	1,02	4,12	1,68	6,78	30,10	-9,08	-0,02	-2,83
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	Sem bench	1,18	177%	5,40	103%	11,11	125%	1,02	4,12	1,68	6,78	30,10	-9,08	-0,02	-2,83
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)	Sem bench	1,18	177%	5,40	103%	11,11	125%	1,02	4,12	1,68	6,78	30,10	-9,08	-0,02	-2,83
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549	Sem bench	1,18	177%	5,40	103%	11,11	125%	1,02	4,12	1,68	6,78	30,10	-9,08	-0,02	-2,83
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	Sem bench	1,18	177%	5,40	103%	11,11	125%	1,02	4,12	1,68	6,78	30,10	-9,08	-0,02	-2,83
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	Sem bench	0,22	32%	2,30	44%	6,95	78%	2,06	4,55	3,39	7,49	-21,91	-13,38	-0,39	-4,27
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 14/05/2024)	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/05/2024)	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	Sem bench	-0,29	-43%	0,24	5%	4,20	47%	3,31	5,00	5,45	8,22	-25,60	-15,42	-0,83	-5,39
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	Sem bench	-0,70	-105%	-1,13	-21%	2,34	26%	4,12	5,46	6,77	8,97	-28,58	-16,14	-1,11	-6,29
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	Sem bench	-0,70	-105%	-1,13	-21%	2,34	26%	4,12	5,46	6,77	8,97	-28,58	-16,14	-1,11	-6,29
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	Sem bench	-0,70	-105%	-1,13	-21%	2,34	26%	4,12	5,46	6,77	8,97	-28,58	-16,14	-1,11	-6,29
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	Sem bench	-0,70	-105%	-1,13	-21%	2,34	26%	4,12	5,46	6,77	8,97	-28,58	-16,14	-1,11	-6,29
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	Sem bench	-0,70	-105%	-1,13	-21%	2,34	26%	4,12	5,46	6,77	8,97	-28,58	-16,14	-1,11	-6,29
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	Sem bench	-1,24	-187%	-2,36	-45%	0,64	7%	4,64	5,92	7,63	9,73	-34,70	-16,64	-1,41	-6,65
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2	Sem bench	-1,24	-187%	-2,36	-45%	0,64	7%	4,64	5,92	7,63	9,73	-34,70	-16,64	-1,41	-6,65
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	Sem bench	-1,24	-187%	-2,36	-45%	0,64	7%	4,64	5,92	7,63	9,73	-34,70	-16,64	-1,41	-6,65
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	Sem bench	-2,01	-302%	-5,26	-100%	-1,39	-16%	6,44	7,04	10,58	11,57	-34,55	-15,74	-2,11	-8,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/05/2024)	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/04/2024) 0065A5E	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	Sem bench	-3,08	-463%	-7,64	-145%	-3,80	-43%	7,50	8,06	12,32	13,26	-41,19	-15,64	-3,08	-10,65
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)	Sem bench	0,86	129%	5,77	110%	10,45	117%	0,28	4,11	0,46	6,76	20,53	-10,64	-0,00	-2,86
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	Sem bench	0,87	131%	5,84	111%	10,60	119%	0,28	4,13	0,46	6,80	23,34	-10,41	-0,00	-2,87
NTN-B XP 2030-08 (Compra 01/11/23 Tx 5.8570)	Sem bench	0,84	126%	5,63	107%	-	-	0,48	-	0,78	-	8,55	-	-0,05	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 09/10/23 Tx 5.8465)	Sem bench	0,84	126%	5,63	107%	-	-	0,47	-	0,78	-	8,50	-	-0,04	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 10/06/24 Tx 6.1900)	Sem bench	0,63	95%	0,63	12%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/06/24 Tx 6.4400)	Sem bench	0,40	60%	0,40	8%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	Sem bench	0,86	129%	5,74	109%	10,43	117%	0,43	4,11	0,70	6,76	12,59	-10,66	-0,03	-2,85
NTN-B XP 2030-08 (Compra 22/04/24 Tx 6.0500)	Sem bench	0,85	128%	2,10	40%	-	-	0,53	-	0,87	-	9,91	-	-0,06	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	Sem bench	0,82	123%	5,49	104%	9,90	111%	0,43	4,00	0,70	6,58	5,43	-11,48	-0,04	-2,78
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	Sem bench	0,87	131%	5,83	111%	10,62	119%	0,44	4,15	0,72	6,82	14,74	-10,38	-0,04	-2,88
NTN-B XP 2030-08 (Compra 25/04/24 Tx 6.1200)	Sem bench	0,86	129%	1,99	38%	-	-	0,53	-	0,88	-	10,56	-	-0,06	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 25/04/24 Tx 6.1200) i	Sem bench	0,86	129%	1,99	38%	-	-	0,53	-	0,88	-	10,57	-	-0,06	-
NTN-B XP 2032-08 (Compra 11/04/24 Tx 5.9010)	Sem bench	0,84	127%	2,24	43%	-	-	0,17	-	0,28	-	25,46	-	0,00	-
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	Sem bench	0,87	131%	5,83	111%	10,66	120%	0,56	4,17	0,91	6,85	11,66	-10,30	-0,06	-2,89
NTN-B XP 2035-05 (Compra 03/05/24 Tx 6.2200)	Sem bench	0,87	130%	1,69	32%	-	-	0,17	-	0,28	-	36,68	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	Sem bench	0,86	129%	5,74	109%	10,48	118%	0,67	4,12	1,10	6,78	8,06	-10,56	-0,08	-2,85
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	Sem bench	0,88	133%	5,92	113%	10,85	122%	0,69	4,23	1,14	6,97	10,81	-10,01	-0,09	-2,93
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	Sem bench	0,81	121%	5,42	103%	9,80	110%	0,55	3,92	0,90	6,44	2,67	-11,67	-0,06	-2,71
NTN-B XP 2035-05 (Compra 09/05/24 Tx 6.2100)	Sem bench	0,87	130%	1,51	29%	-	-	0,19	-	0,32	-	32,22	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 10/06/24 Tx 6.2500)	Sem bench	0,60	91%	0,60	11%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	Sem bench	0,83	124%	5,54	105%	10,05	113%	0,63	3,99	1,04	6,57	4,62	-11,24	-0,08	-2,76
NTN-B XP 2035-05 (Compra 16/04/24 Tx 6.0000)	Sem bench	0,85	128%	2,28	43%	-	-	0,74	-	1,21	-	6,69	-	-0,10	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 16/05/24 Tx 6.1500)	Sem bench	0,86	130%	1,28	24%	-	-	0,18	-	0,29	-	32,88	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	Sem bench	0,87	130%	5,80	110%	10,61	119%	0,65	4,16	1,07	6,85	9,43	-10,37	-0,08	-2,88
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	Sem bench	0,85	128%	5,73	109%	10,46	118%	0,67	4,12	1,10	6,77	7,88	-10,60	-0,08	-2,85
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	Sem bench	0,87	131%	5,86	111%	10,73	121%	0,68	4,20	1,12	6,91	10,04	-10,19	-0,08	-2,90
NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	Sem bench	0,83	125%	5,59	106%	10,18	114%	0,75	4,01	1,23	6,59	4,67	-11,02	-0,10	-2,77
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	Sem bench	0,88	132%	5,87	112%	10,80	121%	0,84	4,25	1,38	6,99	8,36	-10,05	-0,12	-2,94
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	Sem bench	0,83	124%	5,54	105%	10,09	113%	0,74	3,97	1,21	6,53	4,03	-11,18	-0,10	-2,75
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	Sem bench	0,88	133%	5,92	113%	10,91	123%	0,86	4,29	1,42	7,06	8,83	-9,90	-0,12	-2,97
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	Sem bench	0,84	126%	5,62	107%	10,29	116%	0,90	4,03	1,48	6,63	4,33	-10,83	-0,13	-2,78
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	Sem bench	0,86	129%	5,76	110%	10,60	119%	0,95	4,17	1,56	6,86	5,95	-10,35	-0,14	-2,87
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	Sem bench	0,82	123%	5,49	104%	10,01	113%	0,87	3,91	1,43	6,44	2,66	-11,31	-0,13	-2,69
NTN-B XP 2045-05 (Compra 09/04/24 Tx 5.9600)	Sem bench	0,85	127%	2,44	46%	-	-	1,04	-	1,71	-	4,55	-	-0,15	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 12/04/24 Tx 6.0300)	Sem bench	0,85	128%	2,43	46%	-	-	1,08	-	1,77	-	4,76	-	-0,16	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	Sem bench	0,83	125%	5,58	106%	10,20	115%	0,89	3,99	1,47	6,57	3,81	-10,98	-0,13	-2,75
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	Sem bench	0,84	126%	5,62	107%	10,29	116%	0,98	4,03	1,61	6,64	4,00	-10,83	-0,15	-2,78
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/24 Tx 6.1400)	Sem bench	0,86	129%	1,28	24%	-	-	0,18	-	0,30	-	31,41	-	0,00	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 20/06/24 Tx 6.3800)	Sem bench	0,23	34%	0,23	4%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B XP 2045-05 (Compra 21/06/24 Tx 6.3300)	Sem bench	0,16	24%	0,16	3%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	Sem bench	0,87	131%	5,85	111%	10,78	121%	0,99	4,25	1,64	6,99	6,71	-10,07	-0,15	-2,93
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	Sem bench	0,84	126%	5,63	107%	10,33	116%	1,02	4,04	1,68	6,65	3,91	-10,75	-0,15	-2,78
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	Sem bench	0,84	126%	5,64	107%	10,37	117%	1,03	4,06	1,69	6,68	4,13	-10,68	-0,16	-2,79
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	Sem bench	0,84	127%	5,66	108%	10,41	117%	1,04	4,08	1,72	6,71	4,28	-10,61	-0,16	-2,81
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	Sem bench	0,84	125%	5,60	107%	10,28	116%	1,02	4,02	1,68	6,61	3,65	-10,83	-0,15	-2,76
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	Sem bench	0,84	126%	5,61	107%	10,31	116%	1,02	4,03	1,68	6,63	3,80	-10,79	-0,15	-2,77
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	Sem bench	0,85	128%	5,72	109%	10,55	119%	1,14	4,14	1,88	6,82	4,50	-10,38	-0,18	-2,84
FUNDOS DE RENDA FIXA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	CDI	0,79	119%	5,24	100%	11,83	133%	0,04	0,07	0,07	0,11	1,52	1,46	0,00	0,00
BB FIC Previdenciário Fluxo	CDI	0,71	107%	4,71	90%	10,69	120%	0,01	0,06	0,02	0,10	-462,31	-100,31	0,00	0,00
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	IMA-B 5	0,37	56%	3,20	61%	8,34	94%	1,72	1,72	2,82	2,84	-19,02	-12,48	-0,29	-0,93
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	IMA-B	-0,99	-148%	-1,23	-23%	3,86	43%	3,99	3,81	6,56	6,26	-35,22	-13,84	-1,25	-3,60
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	IMA-B 5+	-2,28	-343%	-5,21	-99%	-0,16	-2%	6,40	5,96	10,52	9,80	-38,17	-13,51	-2,29	-6,19
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	IPCA	1,16	174%	5,70	108%	11,40	128%	1,01	0,86	1,67	1,42	28,52	-2,52	-0,03	-0,31
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	CDI	0,78	117%	5,10	97%	11,50	129%	0,02	0,06	0,02	0,10	-38,29	-28,27	0,00	0,00
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	IMA Geral	-0,02	-3%	2,14	41%	7,91	89%	2,00	1,96	3,29	3,23	-31,82	-12,83	-0,44	-1,02
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	IMA-B 5	0,36	54%	3,15	60%	8,24	93%	1,77	1,73	2,92	2,84	-19,12	-12,77	-0,30	-0,94
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	IMA-B 5+	-2,31	-347%	-5,26	-100%	-0,24	-3%	6,44	5,97	10,59	9,82	-38,23	-13,59	-2,31	-6,19
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	CDI	0,87	131%	6,05	115%	13,68	154%	0,06	0,15	0,10	0,25	104,99	67,80	0,00	0,00
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	IRF-M	-0,35	-53%	1,31	25%	8,12	91%	3,77	2,57	6,20	4,23	-23,82	-9,07	-0,77	-1,13
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	CDI	0,75	113%	4,90	93%	11,10	125%	0,04	0,07	0,06	0,12	-74,53	-56,26	0,00	0,00
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	CDI	0,83	125%	5,69	108%	12,83	144%	0,05	0,11	0,08	0,18	77,07	52,78	0,00	0,00
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	IPCA + 6%	0,28	41%	2,87	55%	8,64	97%	1,88	1,89	3,10	3,11	-21,43	-10,42	-0,34	-0,98
Caixa Brasil Referenciado	CDI	0,82	123%	5,36	102%	12,31	138%	0,04	0,09	0,06	0,14	64,07	33,04	0,00	0,00
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	IPCA	1,16	174%	5,71	109%	11,31	127%	1,02	3,87	1,67	6,37	28,56	-9,31	-0,03	-2,73
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	IMA-B	-1,00	-149%	-1,22	-23%	3,95	44%	4,00	3,79	6,57	6,24	-35,33	-13,71	-1,25	-3,55
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	IMA-B 5+	-2,25	-338%	-5,08	-97%	0,16	2%	6,31	5,89	10,37	9,69	-38,27	-13,33	-2,25	-6,01
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	CDI	0,71	106%	4,70	89%	10,70	120%	0,00	0,06	0,00	0,10	-9.410,00	-101,85	0,00	0,00
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	IMA Geral	-0,20	-30%	1,91	36%	7,77	87%	3,45	2,70	5,68	4,44	-22,58	-9,96	-0,90	-1,67
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	CDI	0,90	135%	5,11	97%	10,80	121%	0,38	0,79	0,63	1,30	22,04	-7,96	0,00	-0,30
Itaú FIC IMA-B 5+	IMA-B 5+	-2,26	-340%	-5,13	-97%	-0,04	0%	6,39	5,95	10,51	9,79	-37,95	-13,41	-2,26	-6,15

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
FUNDOS DE RENDA FIXA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Itaú FIC Institucional IMA-B	IMA-B	-0,98	-148%	-1,20	-23%	3,95	44%	3,98	3,80	6,55	6,26	-35,19	-13,71	-1,25	-3,58
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	CDI	1,17	175%	5,93	113%	12,05	135%	0,91	0,57	1,50	0,94	32,59	1,26	-0,01	-0,06
Trend Cash FIC Simples	CDI	0,78	117%	5,11	97%	11,56	130%	0,01	0,06	0,02	0,10	-110,39	-22,58	0,00	0,00
Vinci Institucional Referenciado	CDI	0,80	121%	5,34	102%	-	-	0,12	-	0,20	-	10,09	-	0,00	-
Western Asset Ativo IMA-B	IMA-B	-1,48	-223%	-2,79	-53%	2,39	27%	5,21	4,79	8,57	7,88	-34,54	-13,13	-1,63	-4,86
Western Asset Ativo IMA-B 5	IMA-B 5	-0,08	-12%	1,56	30%	6,65	75%	3,04	2,81	5,00	4,62	-22,49	-11,67	-0,60	-2,00
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	Selic	0,80	120%	5,20	99%	11,74	132%	0,03	0,07	0,06	0,12	24,10	-5,28	0,00	0,00
Western Ativo Max	CDI	-0,21	-31%	1,52	29%	7,92	89%	2,90	2,68	4,77	4,41	-27,05	-9,50	-0,54	-1,32
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	CDI	0,84	126%	5,57	106%	12,68	143%	0,06	0,09	0,09	0,15	70,02	54,94	0,00	0,00
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	CDI	0,79	119%	5,20	99%	11,73	132%	0,02	0,07	0,03	0,11	15,71	-6,85	0,00	0,00
XP Inflação Referenciado IPCA	IMA-B 5	-0,21	-31%	1,22	23%	6,73	76%	3,44	2,95	5,65	4,86	-22,80	-11,35	-0,92	-2,30
XP Trend Simples	CDI	0,79	119%	5,27	100%	11,89	134%	0,03	0,07	0,05	0,12	18,09	6,92	0,00	0,00
FIDC	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BRPP FIDC Multisetorial Master	Sem bench	3,30	496%	20,14	383%	4.320,33	48553%	-	-	-	-	-	-	-	-
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	Sem bench	0,66	100%	3,72	71%	283,60	3187%	-	-	-	-	-	-	-	-
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIA ESG BDR Nível I	Ibov.	9,77	1468%	30,18	574%	43,08	484%	13,31	13,65	21,95	22,47	51,44	11,77	-2,60	-7,67
BB FIA Governança	IGC	1,55	234%	-6,94	-132%	6,44	72%	12,53	13,82	20,62	22,74	5,18	-2,40	-3,15	-10,72
BB FIC FIA Dividendos	Sem bench	1,59	239%	-6,31	-120%	7,58	85%	11,98	12,80	19,72	21,05	5,64	-2,21	-3,20	-9,85
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	Ibov.	11,26	1691%	32,50	618%	44,89	504%	15,02	12,48	24,79	20,54	52,81	13,34	-2,40	-7,69
Bradesco FIA MID Small Cap	IBrX	-0,04	-5%	-12,82	-244%	-11,18	-126%	17,80	19,38	29,28	31,87	-3,13	-7,77	-4,22	-20,35
Bradesco FIA Selection	Ibov.	-0,13	-19%	-13,33	-253%	-6,04	-68%	15,33	14,90	25,21	24,50	-4,27	-7,67	-4,81	-16,44
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	IBrX	1,27	190%	-8,79	-167%	2,75	31%	12,56	14,06	20,66	23,13	3,37	-3,86	-3,27	-12,24
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	Sem bench	12,73	1913%	39,52	751%	52,73	593%	17,39	13,99	28,71	23,04	51,79	14,54	-3,14	-7,79
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	IDIV	1,78	267%	-3,39	-64%	10,11	114%	10,94	11,93	18,01	19,63	7,41	-1,15	-2,84	-6,47
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	Ibov.	1,37	206%	-8,82	-168%	3,86	43%	12,61	14,11	20,75	23,20	4,02	-3,48	-3,37	-12,13
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	Ibov.	1,11	166%	-10,19	-194%	1,17	13%	13,19	13,68	21,70	22,50	2,30	-4,86	-3,44	-13,27
Occam FIC FIA	Sem bench	2,08	312%	-7,75	-147%	3,38	38%	9,12	13,16	15,01	21,65	11,36	-3,93	-1,93	-10,48
Trend FIA Bolsa Americana	CRSP US	3,81	573%	16,30	310%	30,86	347%	7,18	11,45	11,83	18,85	32,93	8,35	-0,76	-9,06
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	Ibov.	0,13	20%	-13,02	-248%	-5,46	-61%	16,39	16,34	26,96	26,88	-2,66	-7,07	-4,33	-15,55
Vinci FIA Mosaico Institucional	Ibov.	0,51	77%	-7,52	-143%	5,41	61%	13,35	14,98	21,97	24,64	-1,24	-3,03	-3,64	-10,41
Vinci FIA Selection Equities	Ibov.	0,83	125%	-8,88	-169%	2,27	25%	13,90	14,24	22,87	23,42	0,66	-4,21	-3,92	-12,51

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Western Asset FIA BDR Nível I	Ibov.	11,90	1788%	34,25	651%	49,29	554%	16,78	15,20	27,69	25,02	50,14	12,38	-2,74	-8,86
Western Asset FIA Valuation	Ibov.	1,39	209%	-13,55	-258%	-5,91	-66%	13,53	15,08	22,27	24,81	3,92	-7,41	-3,39	-16,24
XP FIC FIA Investor 30	Ibov.	1,27	191%	-10,20	-194%	2,65	30%	18,44	14,57	30,34	23,97	2,62	-4,09	-4,54	-14,58
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	Sem bench	9,36	1406%	28,63	544%	40,33	453%	13,47	10,96	22,21	18,04	48,61	13,45	-1,40	-6,84
BB Schroder Multimercado IE	MSCI World	10,44	1568%	31,18	593%	42,94	483%	12,30	12,99	20,29	21,39	59,53	12,45	-1,50	-5,50
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	Sem bench	9,24	1387%	28,03	533%	37,43	421%	13,75	11,00	22,68	18,12	46,97	12,19	-1,99	-7,71
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	Sem bench	8,44	1268%	26,69	508%	37,43	421%	11,98	10,57	19,76	17,39	48,93	12,73	-1,29	-7,56
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	Sem bench	-2,33	-350%	3,69	70%	6,80	76%	13,44	12,57	22,08	20,68	-18,17	-2,87	-6,77	-9,60
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	Ibov.	7,50	1127%	19,98	380%	25,60	288%	11,73	9,48	19,34	15,60	44,06	8,21	-1,15	-4,72
Western Macro Opportunities Multimercado IE	Sem bench	0,30	45%	-5,36	-102%	4,05	46%	9,59	13,25	15,77	21,80	-3,73	-2,58	-2,09	-13,45
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	Sem bench	0,52	78%	-2,48	-47%	0,06	1%	8,44	6,50	13,89	10,68	-2,28	-11,34	-1,72	-7,02
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	Ibov.	11,56	1737%	27,09	515%	43,09	484%	9,65	18,13	15,92	29,84	84,07	9,54	-1,27	-11,20
FUNDOS MULTIMERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	CDI	0,51	77%	3,63	69%	9,99	112%	0,69	0,76	1,14	1,26	-31,26	-13,93	-0,08	-0,50
Caixa Bolsa Americana Multimercado	SP 500	3,90	586%	16,70	318%	31,71	356%	6,25	11,08	10,29	18,23	38,86	8,81	-0,69	-8,82
Itaú FIC Private Multimercado SP500	SP 500	3,96	595%	16,75	319%	31,74	357%	6,22	11,06	10,25	18,20	39,80	8,83	-0,64	-8,80
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	CDI	1,00	150%	3,87	74%	11,57	130%	2,58	3,48	4,25	5,73	6,43	-0,90	-0,49	-1,59
Vinci Multiestratégia Multimercado	CDI	0,50	76%	3,63	69%	9,02	101%	0,61	0,71	1,01	1,17	-36,66	-24,08	-0,09	-0,36
Vinci Valorem Multimercado	IMA-B 5	1,08	162%	3,33	63%	7,46	84%	0,72	1,47	1,19	2,41	31,44	-18,27	-0,04	-1,19
Western Long Short Multimercado	CDI	0,92	139%	5,29	101%	9,37	105%	2,96	3,94	4,86	6,49	3,66	-3,46	-0,72	-1,58
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BTG FIP Economia Real II	IPCA + 8%	8,69	1306%	-4,03	-77%	-16,22	-182%	173,51	108,49	287,02	178,62	8,20	1,64	-28,75	-28,75
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	IPCA + 15%	-4,08	-613%	-23,85	-454%	-34,33	-386%	0,05	10,79	0,09	17,73	-7.217,20	-38,46	-4,28	-42,14
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	Sem bench	63,83	9590%	83,42	1586%	93,87	1055%	-	-	-	-	-	-	-	-
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	IPCA + 9,5%	6,62	995%	2,08	40%	1,91	21%	32,79	9,97	53,94	16,40	-0,45	-9,53	-6,03	-6,03
Kinea FIC FIP Equity Infraestrutura I Feeder	IPCA + 7%	-0,09	-14%	131,96	2509%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Kinea FIP Private Equity II	IPCA + 10%	0,72	109%	2,58	49%	-0,64	-7%	0,81	1,76	1,33	2,90	-499,13	-61,10	-4,43	-6,22
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	Sem bench	-0,65	-97%	1,94	37%	3,72	42%	-	-	-	-	-	-	-	-
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	Sem bench	-0,71	-107%	4,81	91%	4,14	46%	-	-	-	-	-	-	-	-
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	Sem bench	0,43	64%	-4,49	-85%	1,82	20%	-	-	-	-	-	-	-	-

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
	INDICADORES	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %
Carteira	0,72	109%	3,96	75%	9,45	106%	1,39	2,14	2,29	3,53	-3,57	-5,96	-0,22	-1,24
IPCA	0,21	32%	2,48	47%	4,23	48%	-	-	-	-	-	-	-	-
INPC	0,25	38%	2,68	51%	3,70	42%	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	0,79	118%	5,22	99%	11,69	131%	0,00	0,06	-	-	-	-	-	-
IRF-M	-0,29	-44%	1,51	29%	7,89	89%	3,49	2,50	5,74	4,11	-24,46	-7,87	-0,73	-1,02
IRF-M 1	0,63	95%	4,51	86%	10,95	123%	0,49	0,36	0,81	0,59	-24,55	-11,12	-0,05	-0,12
IRF-M 1+	-0,72	-107%	0,22	4%	6,61	74%	4,88	3,51	8,02	5,77	-24,30	-7,42	-1,03	-1,64
IMA-B	-0,97	-145%	-1,10	-21%	3,07	34%	3,89	3,87	6,40	6,37	-35,73	-11,44	-1,24	-3,56
IMA-B 5	0,39	59%	3,32	63%	8,23	92%	1,67	1,72	2,75	2,84	-18,65	-10,64	-0,29	-0,91
IMA-B 5+	-2,25	-338%	-5,04	-96%	-1,43	-16%	6,24	6,06	10,26	9,96	-38,71	-11,29	-2,26	-6,14
IMA Geral	0,05	7%	2,42	46%	8,23	93%	1,86	1,72	3,05	2,83	-31,51	-10,18	-0,41	-0,67
IDkA 2A	0,18	26%	3,21	61%	8,37	94%	1,99	1,79	3,28	2,95	-24,19	-9,96	-0,34	-0,99
IDkA 20A	-5,03	-755%	-12,09	-230%	-8,64	-97%	10,72	10,46	17,61	17,21	-43,60	-10,08	-5,03	-12,10
IGCT	1,42	214%	-6,95	-132%	5,79	65%	12,46	13,88	20,50	22,83	4,40	-1,48	-3,25	-10,74
IBrX 50	1,63	244%	-6,12	-116%	7,39	83%	12,09	13,63	19,90	22,43	5,81	-1,02	-3,13	-10,01
Ibovespa	1,48	223%	-7,66	-146%	4,93	55%	12,07	13,69	19,86	22,52	4,89	-1,95	-3,06	-11,22
META ATUARIAL - INPC + 5,09% A.A.	0,67		5,26		8,90									

São apresentadas apenas as informações dos fundos que possuem histórico completo no período.

A rentabilidade do fundo Caixa FIC FIA Valor Dividendos RPPS não considera o pagamento de dividendos.

NOTAS METODOLÓGICAS E EXPLICATIVAS

Introdução

O risco está associado ao grau de incerteza sobre um investimento no futuro, havendo diversas formas de mensurá-lo. A tabela "Medidas de Risco da Carteira" traz algumas das métricas mais tradicionais de análise de risco, que serão brevemente explicadas a seguir.

Volatilidade Anualizada

Volatilidade é o nome que se dá ao Desvio Padrão dos retornos de um ativo. Dessa forma, a Volatilidade mede o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período analisado. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio.

Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em 2,1441% do retorno diário médio dos últimos 12 meses. Como base para comparação, o IRF-M, que tende a ser menos volátil, apresentou um coeficiente de 2,50% no mesmo período. Já o IMA-B, que habitualmente manifesta alta volatilidade, ficou com 3,87% em 12 meses.

Value at Risk - VaR (95%)

Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal.

Dado o desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de 3,5275%. No mesmo período, o IRF-M detém um VaR de 4,11%, e o IMA-B de 6,37%.

Draw-Down

Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período.

Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

Analisando os últimos 12 meses, percebe-se que a maior queda ocorrida na Carteira foi de 1,2413%. Já os índices IRF-M e IMA-B sofreram quedas de 1,02% e 3,56%, respectivamente.

Beta

Avalia a sensibilidade da Carteira em relação ao risco do mercado como um todo, representado pelo Índice Ibovespa. Dessa forma, assume-se que o Ibovespa possui um Beta igual a 100%. Calculando o Beta da Carteira, tem-se uma estimativa da sua exposição ao total desse risco.

Ou seja, nos últimos 12 meses, estima-se que a carteira está exposta a 12,4705% do risco experimentado pelo mercado.

Tracking Error

Mensura o quão aderente a Carteira é ao seu Benchmark, nesse caso, representado pela Meta do Instituto. Vistos os retornos dos últimos 12 meses, pode-se afirmar que há 66% de chance de que o retorno diário da Carteira fique entre 0,1348% e -0,1348% da Meta.

Sharpe

Quantifica a relação entre a Volatilidade da Carteira e seu retorno excedente a um ativo livre de risco, nesse caso, o CDI. Assim, esse indicador aponta o percentual de rentabilidade que a Carteira teve acima do CDI devido à sua maior exposição ao risco. Logo, quanto maior o Sharpe, melhor o desempenho da Carteira, enquanto valores negativos significam que o CDI superou a rentabilidade da Carteira no período.

Em 12 meses, o indicador apontou que para cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs, houve uma rentabilidade 5,9647% menor que aquela realizada pelo CDI.

Treynor

Similar ao Sharpe, porém, utiliza o risco do mercado (Beta) no cálculo em vez da Volatilidade da Carteira. Valores negativos indicam que a Carteira teve rentabilidade menor do que a alcançada pelo mercado.

Em 12 meses, cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs foram convertidos em uma rentabilidade 0,0646% menor que a do mercado.

Alfa de Jensen

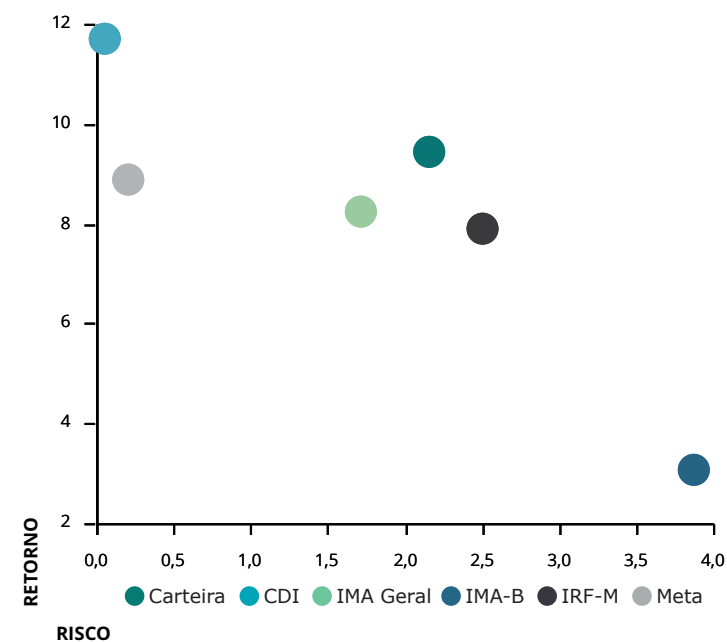
É uma medida do desempenho da Carteira, indicando uma boa performance caso o coeficiente seja significativamente positivo. Valores próximos de zero (tanto positivos quanto negativos) são neutros, devendo ser desconsiderados. Um coeficiente significativamente negativo aponta que o risco da Carteira não tem se convertido em maiores retornos.

MEDIDAS DE RISCO E DESEMPENHO DA CARTEIRA (%)

MEDIDA	NO MÊS	3 MESES	12 MESES
Volatilidade Anualizada	1,3892	1,5367	2,1441
VaR (95%)	2,2855	2,5282	3,5275
Draw-Down	-0,2164	-0,4790	-1,2413
Beta	9,0270	9,3246	12,4705
Tracking Error	0,0875	0,0966	0,1348
Sharpe	-3,5683	-9,1086	-5,9647
Treynor	-0,0346	-0,0946	-0,0646
Alfa de Jensen	-0,0065	-0,0004	-0,0054

RELAÇÃO RISCO X RETORNO EM 12 MESES (%)

Em geral, há uma forte relação entre o risco e o retorno de um ativo: quanto maior o risco, maior a probabilidade de um retorno (ou perda) mais elevado. O gráfico representa as métricas dessa correlação para a Carteira e para os principais índices. Pontos mais acima no gráfico representam um retorno mais elevado, enquanto pontos mais à direita indicam maior risco.



METODOLOGIA DO STRESS TEST

O Stress Test é comumente utilizado para mensurar como situações de estresse no mercado podem vir a impactar uma Carteira de Investimentos. Por se tratar de uma medida de risco não estatística, esse teste é indicado como um complemento às métricas de risco mais usuais, como Volatilidade e VaR, por exemplo.

Em geral, o teste é formulado em duas etapas. A primeira consiste na elaboração de um cenário de estresse em que são aplicados choques exógenos aos fatores de risco que influenciam a Carteira. Na segunda etapa, analisa-se o impacto do cenário de estresse sobre os investimentos, como é apresentado na tabela "Stress Test" ao lado.

Contabilizamos os retornos mensais, dos últimos 24 meses, de todos os ativos presentes na Carteira. Dadas essas estatísticas, selecionamos a pior rentabilidade de cada ativo e, então, construímos um cenário hipotético no qual todos os ativos entregariam, juntos, as suas respectivas piores rentabilidades experimentadas ao longo do período.

Visando uma apresentação mais concisa, agrupamos os resultados por fatores de risco, que são os índices aos quais os ativos estão vinculados. A coluna Exposição denota o percentual do Patrimônio da Carteira que está atrelado a cada um desses fatores.

As duas colunas mais à direita mostram o impacto do cenário de estresse, em reais e em percentual do patrimônio, estimados para um intervalo de um mês a partir do período atual. Valores positivos indicam que, mesmo frente ao cenário projetado, os ativos atrelados ao respectivo fator de risco incorreriam em ganhos ao Instituto.

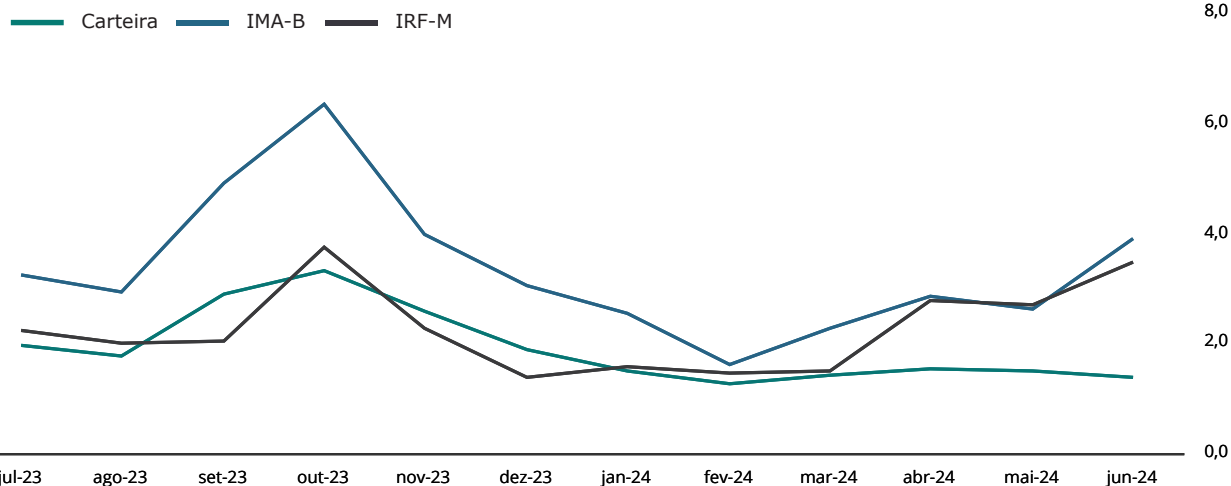
No mês atual, a maior exposição da Carteira é em IMA-B, com 66,55% de participação. Dado o cenário de estresse, haveria uma perda de R\$16.190.825,46 nos ativos atrelados a este índice.

No cenário como um todo, o Instituto perderia R\$57.656.555,13, equivalente a uma queda de 1,47% no patrimônio investido.

Já o gráfico abaixo ilustra a trajetória da Volatilidade Mensal Anualizada da Carteira, em comparação com dois índices do mercado: o IRF-M, mais conservador, e o IMA-B, que apresenta volatilidade mais elevada.

Devido à relação intrínseca entre o risco e o retorno dos ativos, ao mesmo tempo que estar exposto a uma maior volatilidade traz a possibilidade de retornos mais elevados, aumenta-se também a exposição ao risco. Daí a importância de se manter uma Carteira diversificada, conforme a conjuntura do mercado.

VOLATILIDADE MENSAL ANUALIZADA (%)



STRESS TEST (24 MESES)

FATORES DE RISCO	EXPOSIÇÃO	RESULTADOS DO CENÁRIO	
IRF-M	0,16%	-42.727,55	-0,00%
IRF-M	0,16%	-42.727,55	-0,00%
IRF-M 1	0,00%	0,00	0,00%
IRF-M 1+	0,00%	0,00	0,00%
Carência Pré	0,00%	0,00	0,00%
IMA-B	66,55%	-16.190.825,46	-0,41%
IMA-B	3,30%	-2.257.541,95	-0,06%
IMA-B 5	4,25%	-1.405.724,56	-0,04%
IMA-B 5+	5,47%	-6.290.048,09	-0,16%
Carência Pós	53,52%	-6.237.510,86	-0,16%
IMA GERAL	1,67%	-489.827,11	-0,01%
IDKA	0,00%	0,00	0,00%
IDkA 2 IPCA	0,00%	0,00	0,00%
IDkA 20 IPCA	0,00%	0,00	0,00%
Outros IDkA	0,00%	0,00	0,00%
FIDC	0,07%	-409.083,24	-0,01%
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	0,00%	0,00	0,00%
FUNDOS PARTICIPAÇÕES	2,64%	-3.803.401,35	-0,10%
FUNDOS DI	18,58%	-2.739.437,77	-0,07%
F. Crédito Privado	0,68%	131.842,69	0,00%
Fundos RF e Ref. DI	14,77%	4.222.524,23	0,11%
Multimercado	3,13%	-7.093.804,69	-0,18%
OUTROS RF	0,00%	0,00	0,00%
RENDA VARIÁVEL	10,34%	-33.981.252,66	-0,87%
Ibov., IBrX e IBrX-50	5,05%	-18.844.105,22	-0,48%
Governança Corp. (IGC)	0,00%	0,00	0,00%
Dividendos	1,77%	-6.715.249,29	-0,17%
Small Caps	0,07%	-439.206,68	-0,01%
Setorial	0,00%	0,00	0,00%
Outros RV	3,45%	-7.982.691,46	-0,20%
TOTAL	100,00%	-57.656.555,13	-1,47%

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
FUNDOS DE RENDA FIXA			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
BB FIC Previdenciário Fluxo	13.077.415/0001-05	Geral	D+0	D+0	1,00	Não há	Não há
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	03.543.447/0001-03	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	07.442.078/0001-05	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	Geral	D+2	D+2	0,20	Não há	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	19.303.795/0001-35	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2024	Não há
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	03.256.793/0001-00	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	08.246.318/0001-69	Geral	D+1	D+1	0,25	Não há	Não há
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	20.216.216/0001-04	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	13.400.077/0001-09	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	44.961.198/0001-45	Geral	D+4	D+5	0,00	Não há	Não há
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	18.085.876/0001-43	Geral	D+0	D+0	0,00	Não há	Não há
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	08.246.263/0001-97	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	03.399.411/0001-90	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	21.918.896/0001-62	Geral	D+0	D+0	0,20	1080 dias	Não há
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	18.598.288/0001-03	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2024	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	10.740.658/0001-93	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	Geral	D+0	D+0	0,80	Não há	Não há
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	21.838.150/0001-49	Geral	D+0	D+1	0,40	Não há	Não há
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	32.972.942/0001-28	Geral	D+0	D+1	0,50	Não há	20% exc CDI
Itaú FIC IMA-B 5+	14.437.684/0001-06	Geral	D+1	D+2	0,18	Não há	Não há
Itaú FIC Institucional IMA-B	10.474.513/0001-98	Geral	D+0	D+1	0,18	Não há	Não há
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	40.635.061/0001-40	Geral	D+0	D+1	0,50	Não há	20% exc CDI
Trend Cash FIC Simples	45.823.918/0001-79	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Vinci Institucional Referenciado	51.415.957/0001-30	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
Western Asset Ativo IMA-B	09.087.301/0001-79	Geral	D+0	D+1	0,50	Não há	Não há
Western Asset Ativo IMA-B 5	17.517.577/0001-78	Geral	D+0	D+1	0,40	Não há	Não há
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	22.773.421/0001-98	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
Western Ativo Max	04.192.419/0001-43	Geral	D+0	D+1	0,80	Não há	Não há

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
FUNDOS DE RENDA FIXA			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	05.090.727/0001-20	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	26.559.284/0001-44	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
XP Inflação Referenciado IPCA	14.146.491/0001-98	Geral	D+4	D+5	0,50	Não há	Não há
XP Trend Simples	32.893.503/0001-20	Geral	D+0	D+0	0,00	Não há	Não há
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BRPP FIDC Multisetorial Master	12.138.813/0001-21	Qualificado	Vide regulamento	No vencimento	0,38	180 dias	Vide regulamento
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	13.990.000/0001-28	Qualificado	Vide regulamento	No vencimento	0,39	No vencimento	Não há
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BB FIA ESG BDR Nível I	21.470.644/0001-13	Geral	D+1	D+4	0,50	Não há	Não há
BB FIA Governança	10.418.335/0001-88	Geral	D+1	D+3	1,00	Não há	Não há
BB FIC FIA Dividendos	05.100.191/0001-87	Geral	D+1	D+3	2,00	Não há	Não há
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	21.321.454/0001-34	Geral	D+1	D+4	0,80	Não há	Não há
Bradesco FIA MID Small Cap	06.988.623/0001-09	Geral	D+1	D+3	1,50	Não há	Não há
Bradesco FIA Selection	03.660.879/0001-96	Geral	D+1	D+3	1,50	Não há	Não há
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	14.099.976/0001-78	Geral	D+0	D+2	0,90	Não há	20% exc IBrX+2%aa
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	17.502.937/0001-68	Geral	D+1	D+3	0,70	Não há	Não há
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	15.154.441/0001-15	Geral	D+30	D+32	1,72	Não há	Não há
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	14.507.699/0001-95	Geral	D+21	D+23	1,72	Não há	Não há
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	08.817.414/0001-10	Geral	D+2	D+4	1,50	Não há	Não há
Occam FIC FIA	11.628.883/0001-03	Geral	D+15	D+17	2,00	Não há	20% exc Ibov
Trend FIA Bolsa Americana	31.145.826/0001-72	Geral	D+0	D+2	0,50	Não há	Não há
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	26.277.595/0001-10	Geral	D+30	D+32	2,90	Não há	Não há
Vinci FIA Mosaico Institucional	28.470.587/0001-11	Geral	D+30	D+32	1,97	Não há	20% exc Ibov
Vinci FIA Selection Equities	15.603.945/0001-75	Geral	D+60	D+62	0,97	Não há	20% exc Ibov
Western Asset FIA BDR Nível I	19.831.126/0001-36	Geral	D+1	D+4	1,50	Não há	Não há
Western Asset FIA Valuation	09.087.523/0001-91	Geral	D+1	D+3	2,50	Não há	Não há
XP FIC FIA Investor 30	26.718.169/0001-75	Geral	D+30	D+32	2,00	Não há	20% exc Ibov
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	31.964.961/0001-40	Qualificado	D+1	D+5	0,07	Não há	Não há
BB Schroder Multimercado IE	17.431.816/0001-72	Qualificado	D+1	D+5	0,08	Não há	Não há

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	18.085.924/0001-01	Qualificado	D+1	D+8	0,75	Não há	Não há
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	17.804.792/0001-50	Qualificado	D+1	D+8	1,00	Não há	Não há
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	39.723.347/0001-06	Qualificado	D+3	D+8	0,60	Não há	Não há
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	19.587.174/0001-20	Qualificado	D+30	D+32	1,00	Não há	10% exc Dólar PTAX
Western Macro Opportunities Multimercado IE	22.282.992/0001-20	Qualificado	D+1	D+5	0,10	Não há	Não há
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	39.818.102/0001-54	Qualificado	D+1	D+6	0,55	Não há	Não há
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	33.913.562/0001-85	Qualificado	D+1	D+6	0,80	Não há	Não há
FUNDOS MULTIMERCADO			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	06.015.368/0001-00	Geral	D+1	D+1	0,50	Não há	20% exc CDI
Caixa Bolsa Americana Multimercado	30.036.235/0001-02	Geral	D+0	D+1	0,80	Não há	Não há
Itaú FIC Private Multimercado SP500	26.269.692/0001-61	Geral	D+0	D+1	0,80	Não há	Não há
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	35.002.795/0001-51	Geral	D+9	D+10	1,90	Não há	20% exc CDI
Vinci Multiestratégia Multimercado	12.440.825/0001-06	Geral	D+0	D+1	0,96	Não há	20% exc CDI
Vinci Valorem Multimercado	13.396.703/0001-22	Geral	D+1	D+2	0,96	Não há	20% exc IMAB 5
Western Long Short Multimercado	07.672.392/0001-84	Geral	D+1	D+5	2,00	Não há	Não há
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BTG FIP Economia Real II	44.172.951/0001-13	Qualificado	No vencimento	No vencimento	2,10	No vencimento	20% exc IPCA+8%aa
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	14.584.094/0001-06	Qualificado	D+0	D+0	2,00	No vencimento	20% exc IPCA+8%aa
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	11.998.505/0001-03	Qualificado	No vencimento	No vencimento	0,00	No vencimento	Vide regulamento
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	14.737.553/0001-36	Profissional	Vide regulamento	Vide regulamento	0,63	No vencimento	Vide regulamento
Kinea FIC FIP Equity Infraestrutura I Feeder	49.723.694/0001-84	Qualificado	Vide regulamento	Vide regulamento	1,50	No vencimento	Vide regulamento
Kinea FIP Private Equity II	15.039.162/0001-00	Qualificado	Vide regulamento	Vide regulamento	0,00	No vencimento	20% exc IPCA+10%aa
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	27.782.774/0001-78	Qualificado	No vencimento	No vencimento	2,00	No vencimento	20% exc IPCA+6%aa
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	41.745.796/0001-99	Qualificado	No Vencimento	No Vencimento	1,85	No Vencimento	20% exc IPCA+6%aa
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	17.870.798/0001-25	Qualificado	Vide regulamento	Vide regulamento	2,00	No vencimento	Vide regulamento

Considerando o patrimônio total do Instituto, seu prazo de resgate está dividido da seguinte maneira: 57,79% até 90 dias; 39,57% superior a 180 dias; os 2,64% restantes possuem regras mais específicas, ou não puderam ser medidos na data de publicação desse relatório.

APLICAÇÕES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
03/06/2024	260.000,00	Aplicação	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
04/06/2024	64.489,62	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
04/06/2024	1.500.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
05/06/2024	6.846,83	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
06/06/2024	955,85	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
07/06/2024	3.462.005,52	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
10/06/2024	358.901,04	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
10/06/2024	416.666,62	Aplicação	BTG FIP Economia Real II
10/06/2024	10.001.903,71	Compra	NTN-B XP 2030-08 (Compra 10/06/24 Tx 6.1900)
10/06/2024	9.999.256,15	Compra	NTN-B XP 2035-05 (Compra 10/06/24 Tx 6.2500)
12/06/2024	20.000.000,00	Aplicação	BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior
12/06/2024	2.688.635,26	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
12/06/2024	1.200.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
13/06/2024	26.158.316,07	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
14/06/2024	4.939.509,24	Aplicação	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
14/06/2024	1.306,16	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
14/06/2024	487.000,00	Aplicação	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
14/06/2024	20.998.888,81	Compra	NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/06/24 Tx 6.4400)
17/06/2024	2.906,18	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
17/06/2024	25.000.000,00	Aplicação	Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa
18/06/2024	587.100,00	Aplicação	Vinci Institucional Referenciado
19/06/2024	5.000.000,00	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
20/06/2024	714.734,00	Aplicação	Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.
20/06/2024	4.997.421,46	Compra	NTN-B XP 2045-05 (Compra 20/06/24 Tx 6.3800)
20/06/2024	1.225.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
21/06/2024	77.412,22	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
21/06/2024	9.998.823,48	Compra	NTN-B XP 2045-05 (Compra 21/06/24 Tx 6.3300)

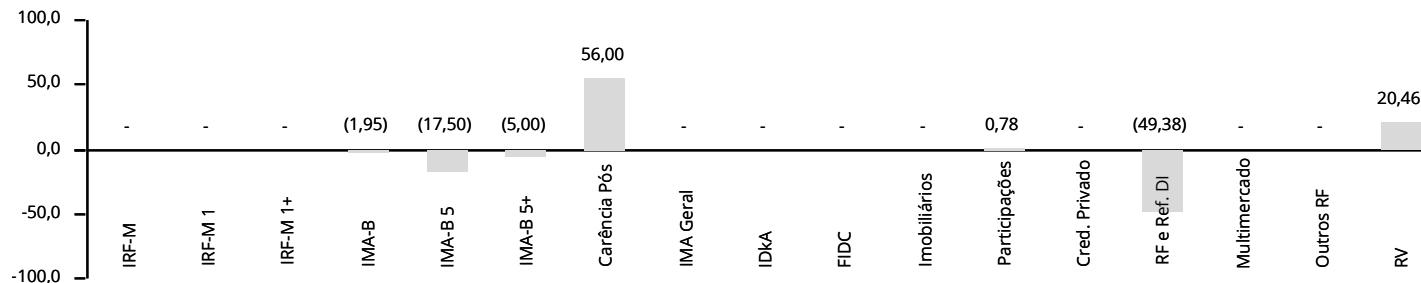
RESGATES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
03/06/2024	211.806,47	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
03/06/2024	1.500.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B 5
05/06/2024	950.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
06/06/2024	23.513,93	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
07/06/2024	2.235,58	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
07/06/2024	15.000.000,00	Resgate	BB FIC Previdenciário IMA-B 5
10/06/2024	5.567.826,49	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
10/06/2024	1.771.838,89	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
11/06/2024	162.399,82	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
11/06/2024	1.200.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B
12/06/2024	20.300.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
13/06/2024	295,37	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
13/06/2024	98.388,61	Amortização	BTG Pactual FIC FIP Principal Investments
14/06/2024	21.148.888,82	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
14/06/2024	4.740.637,41	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
14/06/2024	5.069.683,88	Resgate	Vinci FIA Fatorial Dinâmico
14/06/2024	587.100,00	Resgate	Vinci FIA Mosaico Institucional
17/06/2024	1.200,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
17/06/2024	25.010.519,45	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
17/06/2024	5.000.000,00	Resgate	BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+
17/06/2024	468.387,05	Resgate	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
18/06/2024	4.572,04	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
19/06/2024	32.449,48	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
19/06/2024	1.000.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B 5
19/06/2024	225.000,00	Resgate	Western Ativo Max
20/06/2024	5.616.318,91	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
20/06/2024	105.654,57	Amortização	Kinea FIP Private Equity II

TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	157.443.529,68
Resgates	154.039.639,24
Saldo	3.403.890,44

MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS POR ÍNDICES (DURANTE O MÊS, EM R\$ MILHÕES)



APLICAÇÕES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
24/06/2024	82.624,23	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
25/06/2024	223.880,33	Aplicação	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
25/06/2024	5.069.683,88	Aplicação	Vinci FIA Mosaico Institucional
26/06/2024	6.895,10	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
27/06/2024	4.360,10	Aplicação	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
27/06/2024	186,80	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
27/06/2024	1.044.000,00	Aplicação	Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX
27/06/2024	750.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
28/06/2024	113.821,02	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo

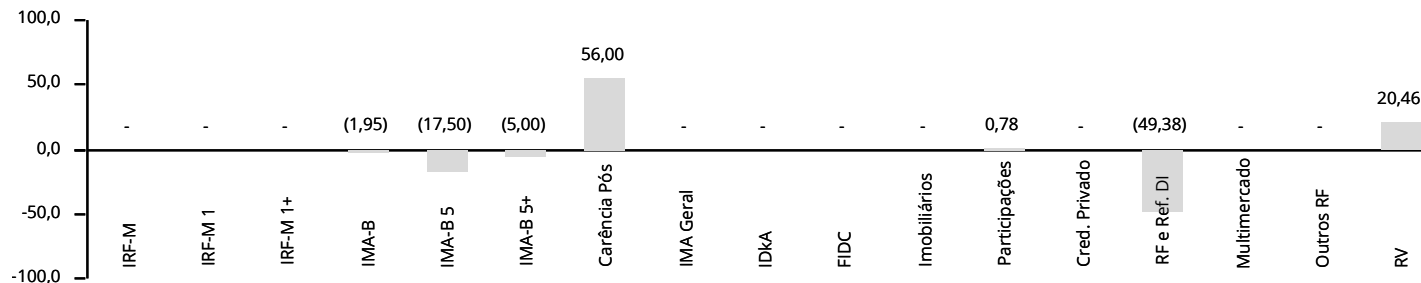
RESGATES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
21/06/2024	9.998.823,48	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
21/06/2024	76.927,74	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
24/06/2024	77.717,75	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
25/06/2024	784.118,46	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
25/06/2024	7.492,32	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
26/06/2024	750.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B
27/06/2024	12.490,87	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
27/06/2024	1.044.000,00	Resgate	Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa
27/06/2024	142.404,27	Amortização	FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia
28/06/2024	500.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
28/06/2024	33.675,21	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
28/06/2024	24.794.071,52	Resgate	Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa
28/06/2024	19.200,85	Resgate	Caixa FIC Brasil Disponibilidades

TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	157.443.529,68
Resgates	154.039.639,24
Saldo	3.403.890,44

MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS POR ÍNDICES (DURANTE O MÊS, EM R\$ MILHÕES)



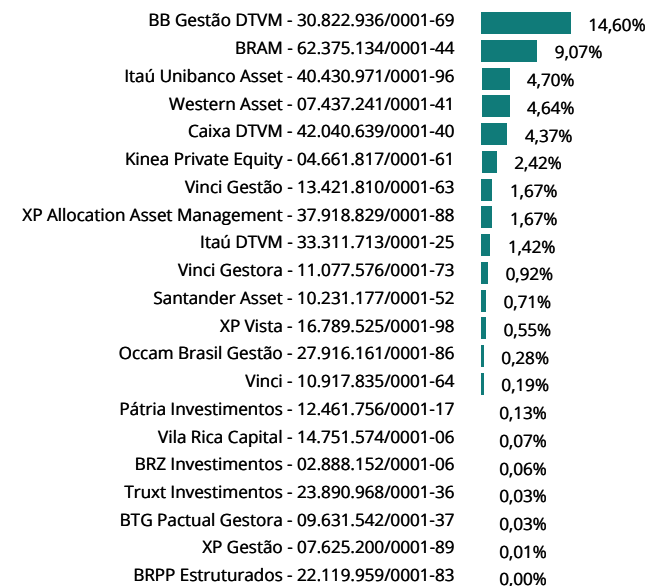
PATRIMÔNIO DOS GESTORES DE RECURSOS

GESTOR	CNPJ	ART. 21	PATRIMÔNIO SOB GESTÃO	% PARTICIPAÇÃO	
BB Gestão DTVM	30.822.936/0001-69	Sim	1.615.981.562.976,30	0,04	✓
BRAM	62.375.134/0001-44	Sim	707.463.153.880,80	0,05	✓
BRPP Estruturados	22.119.959/0001-83	Não	62.581.988.199,41	0,00	✓
BRZ Investimentos	02.888.152/0001-06	Não	2.589.782.422,50	0,09	✓
BTG Pactual Gestora	09.631.542/0001-37	Não	406.765.134.946,65	0,00	✓
Caixa DTVM	42.040.639/0001-40	Não	512.795.169.983,22	0,03	✓
Itaú DTVM	33.311.713/0001-25	Sim	949.861.404.925,75	0,01	✓
Itaú Unibanco Asset	40.430.971/0001-96	Não	949.861.404.925,75	0,02	✓
Kinea Private Equity	04.661.817/0001-61	Não	151.897.787.908,69	0,06	✓
Occam Brasil Gestão	27.916.161/0001-86	Não	8.897.851.784,25	0,12	✓
Pátria Investimentos	12.461.756/0001-17	Não	46.646.529.177,47	0,01	✓
Santander Asset	10.231.177/0001-52	Não	338.474.530.719,80	0,01	✓
Truxt Investimentos	23.890.968/0001-36	Não	4.375.632.942,07	0,03	✓
Vila Rica Capital	14.751.574/0001-06	Não	886.892.644,66	0,30	✓
Vinci	10.917.835/0001-64	Não	52.625.087.541,99	0,01	✓
Vinci Soluções	13.421.810/0001-63	Não	52.625.087.541,99	0,09	✓
Vinci Gestora	11.077.576/0001-73	Não	52.625.087.541,99	0,07	✓
Western Asset	07.437.241/0001-41	Não	40.524.436.810,98	0,45	✓
XP Allocation Asset Management	37.918.829/0001-88	Não	168.100.263.529,99	0,04	✓
XP Gestão	07.625.200/0001-89	Não	168.100.263.529,99	0,00	✓
XP Vista	16.789.525/0001-98	Não	168.100.263.529,99	0,01	✓

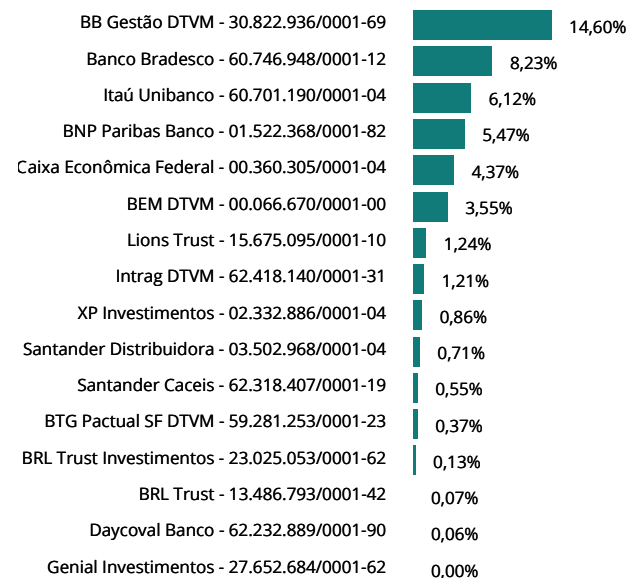
Obs.: Patrimônio em 05/2024, o mais recente divulgado pela Anbima na data de publicação desse relatório.

O % Participação denota o quanto o RPPS detém do PL do Gestor, sendo limitado a 5% pelo Art. 20. O Art. 21 indica se a instituição atende ao disposto no inciso I do parágrafo 2º, sendo necessário que ou o gestor ou o administrador do fundo respeite a regra.

INVESTIMENTOS POR GESTOR DE RECURSOS



INVESTIMENTOS POR ADMINISTRADOR DE RECURSOS



FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
FUNDOS DE RENDA FIXA									
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	7, III, a	17.821.452.916,03	3,95	0,87	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Previdenciário Fluxo	13.077.415/0001-05	7, III, a	5.048.562.747,13	0,06	0,05	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	03.543.447/0001-03	7, I, b	4.972.766.310,86	0,41	0,33	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	07.442.078/0001-05	7, I, b	4.649.802.742,18	2,04	1,72	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	7, I, b	1.195.654.596,88	3,68	12,06	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	19.303.795/0001-35	7, I, b	197.669.973,94	0,08	1,51	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	03.256.793/0001-00	7, I, b	11.531.124.110,68	1,58	0,54	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	08.246.318/0001-69	7, III, a	223.969.630,74	0,61	10,64	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	20.216.216/0001-04	7, III, a	827.438.439,72	0,86	4,08	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	13.400.077/0001-09	7, III, a	126.491.485,84	0,37	11,62	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	44.961.198/0001-45	7, V, b	869.791.556,10	0,49	2,21	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	18.085.876/0001-43	7, III, a	686.817.494,98	0,16	0,92	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	08.246.263/0001-97	7, III, a	431.303.777,84	0,00	0,00	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	03.399.411/0001-90	7, III, a	11.692.368.410,92	3,94	1,32	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	21.918.896/0001-62	7, V, b	190.076.554,55	0,19	3,87	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	7, III, a	16.508.104.382,05	0,35	0,08	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	18.598.288/0001-03	7, I, b	513.008.318,61	0,98	7,48	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	10.740.658/0001-93	7, I, b	4.133.113.700,82	0,27	0,26	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	7, I, b	1.144.374.704,79	0,07	0,26	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	7, III, a	976.883.009,20	0,00	0,00	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	21.838.150/0001-49	7, I, b	2.052.875.038,41	1,06	2,03	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	32.972.942/0001-28	7, III, a	2.177.822.970,57	0,57	1,03	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC IMA-B 5+	14.437.684/0001-06	7, I, b	414.823.089,34	1,35	12,75	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC Institucional IMA-B	10.474.513/0001-98	7, I, b	340.562.033,85	0,43	4,94	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	40.635.061/0001-40	7, III, a	1.270.811.364,72	0,43	1,33	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Trend Cash FIC Simples	45.823.918/0001-79	7, III, a	1.194.183.555,54	0,00	0,00	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
Vinci Institucional Referenciado	51.415.957/0001-30	7, III, a	119.618.909,85	0,08	2,49	Sim	13.421.810/0001-63	59.281.253/0001-23	✓
Western Asset Ativo IMA-B	09.087.301/0001-79	7, I, b	150.880.927,99	0,56	14,52	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset Ativo IMA-B 5	17.517.577/0001-78	7, I, b	364.688.708,04	1,38	14,80	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	22.773.421/0001-98	7, I, b	379.540.045,87	0,84	8,72	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Ativo Max	04.192.419/0001-43	7, I, b	46.943.750,03	0,18	14,70	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓

FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
FUNDOS DE RENDA FIXA									
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	05.090.727/0001-20	7, III, a	714.106.619,40	1,27	7,00	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	26.559.284/0001-44	7, I, b	9.760.844.968,31	0,09	0,04	Sim	37.918.829/0001-88	02.332.886/0001-04	✓
XP Inflação Referenciado IPCA	14.146.491/0001-98	7, III, a	257.171.194,13	0,55	8,37	Sim	16.789.525/0001-98	62.318.407/0001-19	✓
XP Trend Simples	32.893.503/0001-20	7, I, b	3.178.209.570,69	0,69	0,85	Sim	37.918.829/0001-88	02.332.886/0001-04	✓
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS									
BRPP FIDC Multisetorial Master	12.138.813/0001-21	7, V, a	1.195.072,00	0,00	3,51	Não	22.119.959/0001-83	27.652.684/0001-62	✓
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	13.990.000/0001-28	7, V, a	58.595.295,35	0,07	4,51	Não	14.751.574/0001-06	13.486.793/0001-42	✓
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL									
BB FIA ESG BDR Nível I	21.470.644/0001-13	8, I	1.649.294.012,28	0,59	1,41	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIA Governança	10.418.335/0001-88	8, I	649.126.137,40	0,07	0,43	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC FIA Dividendos	05.100.191/0001-87	8, I	567.596.143,42	1,44	9,94	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	21.321.454/0001-34	8, I	187.224.957,02	0,16	3,31	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIA MID Small Cap	06.988.623/0001-09	8, I	572.598.578,35	0,07	0,50	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Bradesco FIA Selection	03.660.879/0001-96	8, I	305.744.233,44	0,22	2,86	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	14.099.976/0001-78	8, I	341.293.906,16	0,54	6,20	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	17.502.937/0001-68	8, I	2.736.870.167,13	0,77	1,11	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	15.154.441/0001-15	8, I	1.013.802.736,53	0,33	1,28	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	14.507.699/0001-95	8, I	748.046.356,69	0,32	1,67	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	08.817.414/0001-10	8, I	387.832.337,38	1,42	14,37	Sim	33.311.713/0001-25	60.701.190/0001-04	✓
Occam FIC FIA	11.628.883/0001-03	8, I	826.454.000,60	0,28	1,33	Sim	27.916.161/0001-86	00.066.670/0001-00	✓
Trend FIA Bolsa Americana	31.145.826/0001-72	8, I	264.617.055,66	0,07	1,02	Sim	37.918.829/0001-88	02.332.886/0001-04	✓
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	26.277.595/0001-10	8, I	306.132.547,92	0,03	0,44	Sim	23.890.968/0001-36	62.418.140/0001-31	✓
Vinci FIA Mosaico Institucional	28.470.587/0001-11	8, I	765.280.133,07	0,19	0,96	Sim	10.917.835/0001-64	00.066.670/0001-00	✓
Vinci FIA Selection Equities	15.603.945/0001-75	8, I	438.012.483,07	0,45	4,02	Sim	13.421.810/0001-63	00.066.670/0001-00	✓
Western Asset FIA BDR Nível I	19.831.126/0001-36	8, I	1.797.571.340,76	0,11	0,23	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset FIA Valuation	09.087.523/0001-91	8, I	45.589.741,13	0,13	11,37	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC FIA Investor 30	26.718.169/0001-75	8, I	341.525.625,87	0,01	0,08	Sim	07.625.200/0001-89	02.332.886/0001-04	✓
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR									
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	31.964.961/0001-40	9, II	440.856.186,67	1,42	12,64	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Schroder Multimercado IE	17.431.816/0001-72	9, II	565.695.571,17	0,12	0,86	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓

FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR									
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	18.085.924/0001-01	9, II	343.725.829,48	0,06	0,65	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	17.804.792/0001-50	9, II	710.330.934,42	0,71	3,92	Sim	10.231.177/0001-52	03.502.968/0001-04	✓
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	39.723.347/0001-06	9, II	138.469.871,84	0,12	3,44	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	19.587.174/0001-20	9, II	117.886.663,77	0,09	3,06	Sim	13.421.810/0001-63	59.281.253/0001-23	✓
Western Macro Opportunities Multimercado IE	22.282.992/0001-20	9, II	118.212.591,23	0,17	5,50	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	39.818.102/0001-54	9, II	19.961.192.475,00	0,10	0,02	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	33.913.562/0001-85	9, II	820.358.590,52	0,60	2,87	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
FUNDOS MULTIMERCADO									
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	06.015.368/0001-00	10, I	12.860.586.060,72	0,73	0,22	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Caixa Bolsa Americana Multimercado	30.036.235/0001-02	10, I	1.972.213.735,46	1,08	2,15	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC Private Multimercado SP500	26.269.692/0001-61	10, I	1.326.345.413,32	0,86	2,54	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	35.002.795/0001-51	10, I	71.646.283,87	0,18	9,61	Sim	11.077.576/0001-73	59.281.253/0001-23	✓
Vinci Multiestratégia Multimercado	12.440.825/0001-06	10, I	195.453.634,60	0,75	14,97	Sim	11.077.576/0001-73	00.066.670/0001-00	✓
Vinci Valorem Multimercado	13.396.703/0001-22	10, I	1.134.804.754,07	1,06	3,65	Sim	13.421.810/0001-63	00.066.670/0001-00	✓
Western Long Short Multimercado	07.672.392/0001-84	10, I	12.837.479,35	0,01	3,47	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES									
BTG FIP Economia Real II	44.172.951/0001-13	10, II	190.264.354,55	0,02	0,49	Sim	09.631.542/0001-37	59.281.253/0001-23	✓
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	14.584.094/0001-06	10, II	14.330.472,42	0,00	0,66	Sim	09.631.542/0001-37	59.281.253/0001-23	✓
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	11.998.505/0001-03	10, II	1.503.836,94	0,00	1,47	Sim	09.631.542/0001-37	62.318.407/0001-19	✓
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	14.737.553/0001-36	10, II	249.687.228,22	0,06	0,89	Sim	02.888.152/0001-06	62.232.889/0001-90	✓
Kinea FIC FIP Equity Infraestrutura I Feeder	49.723.694/0001-84	10, II	694.400.897,70	1,12	6,32	Sim	04.661.817/0001-61	62.418.140/0001-31	✓
Kinea FIP Private Equity II	15.039.162/0001-00	10, II	157.770.319,05	0,05	1,24	Não	04.661.817/0001-61	15.675.095/0001-10	✓
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	27.782.774/0001-78	10, II	372.824.928,44	1,19	12,54	Não	04.661.817/0001-61	15.675.095/0001-10	✓
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	41.745.796/0001-99	10, II	134.171.731,67	0,06	1,83	Sim	04.661.817/0001-61	62.418.140/0001-31	✓
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	17.870.798/0001-25	10, II	121.474.280,58	0,13	4,19	Não	12.461.756/0001-17	23.025.053/0001-62	✓

Art. 18 retrata o percentual do PL do RPPS que está aplicado no fundo, cujo limite é de 20%. Art. 19 denota o percentual do PL do fundo que o RPPS detém, sendo limitado a 5% em fundos enquadrados no Art. 7 V, e de 15% para os demais. Ambos os Art. 18 e 19 não se aplicam aos fundos enquadrados no Art. 7 I. Art. 21 aponta se o administrador ou o gestor atende às exigências, estando destacado o CNPJ da instituição caso ela não atenda.

POR SEGMENTO

ENQUADRAMENTO	SALDO EM R\$	% CARTEIRA	% LIMITE RESOLUÇÃO		% LIMITE PI 2024	
7, I	2.673.524.454,65	68,15	100,0	✓	100,0	✓
7, I, a	2.058.298.002,53	52,47	100,0	✓	100,0	✓
7, I, b	615.226.452,12	15,68	100,0	✓	100,0	✓
7, I, c	-	0,00	100,0	✓	100,0	✓
7, II	-	0,00	5,0	✓	5,0	✓
7, III	518.386.140,38	13,21	75,0	✓	75,0	✓
7, III, a	518.386.140,38	13,21	75,0	✓	75,0	✓
7, III, b	-	0,00	75,0	✓	75,0	✓
7, IV	-	0,00	20,0	✓	20,0	✓
7, V	29.301.777,67	0,75	30,0	✓	30,0	✓
7, V, a	2.682.485,95	0,07	15,0	✓	15,0	✓
7, V, b	26.619.291,72	0,68	15,0	✓	15,0	✓
7, V, c	-	0,00	15,0	✓	15,0	✓
ART. 7	3.221.212.372,70	82,11	100,0	✓	100,0	✓
8, I	282.578.691,06	7,20	45,0	✓	45,0	✓
8, II	-	0,00	45,0	✓	45,0	✓
ART. 8	282.578.691,06	7,20	45,0	✓	45,0	✓
9, I	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
9, II	133.106.180,80	3,39	10,0	✓	10,0	✓
9, III	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
ART. 9	133.106.180,80	3,39	10,0	✓	10,0	✓
10, I	182.693.635,24	4,66	15,0	✓	15,0	✓
10, II	103.388.522,29	2,64	10,0	✓	10,0	✓
10, III	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
ART. 10	286.082.157,53	7,29	20,0	✓	20,0	✓
ART. 11	-	0,00	15,0	✓	15,0	✓
ART. 12	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
ART. 8, 10 E 11	568.660.848,59	14,50	50,0	✓	50,0	✓
PATRIMÔNIO INVESTIDO	3.922.979.402,09					

Obs.: Para fins de enquadramento, são desconsideradas as disponibilidades financeiras mantidas em conta corrente e poupança.

PRÓ GESTÃO

O IPREVILLE comprovou adoção de melhores práticas de gestão previdenciária à Secretaria de Previdência, ao NÍVEL III de aderência na forma por ela estabelecidos.

PARECER SOBRE ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA

- ✓ Enquadrada em relação à Resolução CMN 4.963/2021.
- ✓ Enquadrada em relação à Política de Investimento vigente.
- ✓ O administrador e o gestor dos fundos devem atender ao disposto no parágrafo 2º do Art. 21 da Resolução CMN 4.963/2021. Entretanto, o parágrafo 9º do referido artigo estipula que tais requisitos devem ser observados no momento da aplicação. Assim sendo, os fundos que estiverem irregulares, mas cujo aporte seja anterior a 03/01/2022, podem ser mantidos na carteira com status de enquadrados.

Nos Estados Unidos, o destaque do mês foi a projeção de inflação pelos membros do Comitê Federal de Mercado Aberto (FOMC), com pioras na perspectiva para o final deste ano. A projeção do Índice de Preços para Gastos de Consumo Pessoal (PCE) subiu 0,2 ponto percentual para 2024 e 0,1 ponto percentual para 2025. O Federal Reserve deverá manter a postura conservadora na condução da política monetária e aguardar mais dados de inflação e de mercado de trabalho, com a finalidade de consolidar a possibilidade de corte na taxa de juros.

No entanto, o mercado permanece otimista de que há maiores chances de redução dos juros, iniciando em setembro. O posicionamento dos investidores é justificado pelos dados recentes, que fundamentam uma desaceleração gradual da economia americana. Os índices de inflação indicaram um arrefecimento dos preços de bens e serviços e a atividade econômica retraiu em menor ritmo, sugerindo um processo de *soft landing* (transição suave da conjuntura econômica). A surpresa do mês, foi o resultado preliminar do relatório Payroll que apresentou uma criação de empregos muito acima do esperado, mas a revisão dos meses anteriores elevou a taxa de desemprego.

Na Zona do Euro, a tendência de enfraquecimento econômico permaneceu com o recuo dos dados preliminares dos Índices de Gerente de Compras (PMI's) de junho. O período longo de política monetária contracionista penalizou a atividade econômica, mas atingiu o objetivo de proporcionar a continuidade da tendência de desinflação no bloco. Por essa razão, o Banco Central Europeu iniciou o processo de corte de juros, mas sem sinalizar as próximas decisões, ficando dependente dos próximos dados econômicos.

Na China, observou-se a dependência da demanda externa com a produção industrial. Como contraponto, o consumo das famílias e os investimentos continuam crescendo em um ritmo mais comedido, além da continuidade do enfraquecimento do setor imobiliário. Os sinais divergentes dos PMI's, Caixin e S&P Global, trazem a perspectiva de que não há indicações suficientes para afirmar a capacidade de recuperação saudável do país, uma vez que a demanda interna está aquém do desejado.

No Brasil, o Comitê de Política Monetária (Copom) unanimemente optou por interromper o ciclo de corte de juros, mantendo a taxa Selic em 10,50%. A ata trouxe maiores riscos externos e internos, como início do ciclo de corte de juros nos Estados Unidos, indicadores de atividade econômica e dinamismo do mercado de trabalho brasileiro. Em razão destes riscos, aumentou a perspectiva de uma pressão altista para as expectativas de inflação. Após a volatilidade ocasionada

na reunião de maio, devido à divisão dos votos, a reunião de junho foi essencial para aumentar a credibilidade da autoridade monetária, principalmente para o próximo ano. Diante do contexto atual, a ata do Copom reforçou um cenário de cautela na estratégia de política monetária, destacando a necessidade de manter a taxa Selic atual até que o processo de desinflação e a reancoragem das expectativas se consolidem.

Sobre o governo, a percepção se deteriorou com mais informações que sustentam a possibilidade da consolidação de um desequilíbrio fiscal. As recentes notícias baseadas somente no aumento da arrecadação, além de declarações do presidente Lula criticando o Banco Central, desvalorizaram o real perante o dólar. Dada a repercussão, surgiu a necessidade de a equipe econômica do governo anunciar estudos sobre o gerenciamento do orçamento fiscal.

A atividade econômica brasileira, tema de preocupação do Banco Central, segue resiliente. Com exceção do setor industrial, varejo e serviços avançaram, associados ao mercado de trabalho aquecido e aumento médio salarial. No entanto, os índices de atividade, IBC-Br e Monitor PIB, sugeriram uma desaceleração da economia em abril e que pode ser intensificada em maio devido aos efeitos da tragédia do Rio Grande do Sul. A respeito do mercado de trabalho, os dados da PNAD apresentaram uma redução da taxa de desemprego, enquanto o Caged mostrou uma queda significativa na criação de empregos. Por essa razão, é justificado acreditar que as próximas leituras terão um resultado mais moderado.

No cenário de renda fixa a incerteza fiscal penalizou com alta das curvas de juros ao longo do mês. No entanto, ocorreu um marginal alívio após a decisão unânime do Banco Central na sua última reunião. Internamente, o cenário seguiu indefinido e dependente das perspectivas dos resultados fiscais. Externamente, permaneceu a cautela em relação à direção da inflação e ao processo de corte nos juros nos Estados Unidos.

Por fim, para a renda variável, o excesso de pessimismo do mercado foi corrigido, promovendo um retorno positivo para o Ibovespa. No entanto, a cautela ainda é exigida, diante dos riscos fiscais, dos juros elevados e da perspectiva altista para a inflação no decorrer dos anos avaliados pela autoridade monetária. O fluxo de investimento estrangeiro ainda não é relevante a ponto de impactar profundamente a bolsa brasileira no curto prazo. A conjuntura global apresentou a direção almejada, mas ainda sem confiança necessária para afirmar que os juros dos Estados Unidos cairão.