

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
**SORRISO - MT / PREVISÃO**

**RELATÓRIO SEMESTRAL  
DE  
INVESTIMENTOS**

**1º SEMESTRE  
2024**

**17 de julho de 2024**

## SUMÁRIO EXECUTIVO

O Sumário Executivo apresenta as principais informações do Relatório Mensal de Investimentos de 2024 do PREVISÓ.

**Índice Inflacionário:** IPCA – Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo

**Taxa de Juros (anual):** 5,06% a.a.

**Taxa de Juros (mensal):** 0,41%

**Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice):** 5,06% a.a. + IPCA a.a.

**Previsão da Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice):** 9,51%

Data Focal: 28/06/2024

MENSAL												
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN						
<b>RENTABILIDADE DA CARTEIRA</b>	0,02%	0,62%	0,43%	-0,97%	1,07%	-0,21%						
TAXA DE JUROS	0,41%	0,41%	0,41%	0,41%	0,41%	0,41%						
VARIAÇÃO IPCA	0,42%	0,83%	0,16%	0,38%	0,46%	0,21%						
<b>META ATUARIAL</b>	0,83%	1,24%	0,57%	0,79%	0,87%	0,62%						
<b>CDI</b>	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%						

ACUMULADO												
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN						
<b>RENTABILIDADE DA CARTEIRA</b>	0,02%	0,65%	1,08%	0,10%	1,17%	0,96%						
TAXA DE JUROS	0,41%	0,83%	1,24%	1,66%	2,08%	2,50%						
VARIAÇÃO IPCA	0,42%	1,25%	1,42%	1,80%	2,27%	2,48%						
<b>META ATUARIAL</b>	0,83%	2,08%	2,67%	3,48%	4,38%	5,03%						
<b>CDI</b>	0,97%	1,78%	2,62%	3,54%	4,40%	5,22%						

## SUMÁRIO (ÍNDICE)

<b>1 – INTRODUÇÃO .....</b>	<b>4</b>
<b>2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS ....</b>	<b>5</b>
<b>3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO .....</b>	<b>7</b>
<b>4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA .....</b>	<b>12</b>
<b>5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS .....</b>	<b>19</b>
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	21
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	22
<b>6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO .....</b>	<b>23</b>
<b>7 – CONCLUSÃO .....</b>	<b>24</b>
7.1 - Rentabilidade da Carteira Semestral .....	24
7.2 - Meta Atuarial .....	25
7.3 - Perfil de Risco do Investidor .....	26
7.4 - Avaliação de Desempenho no 1º Semestre .....	27
7.5 - Orientação para a Carteira de Investimento no 2º Semestre .....	28

## 1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Semestral dos investimentos, referente ao 1º SEMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do PREVISÓ.

Este relatório vem atender o **Art. 129 da Portaria MTP 1.467/2022**, que deverá emitir Relatórios, no mínimo, **Semestralmente**, que contemplem:

***Art. 129.** Deverão ser emitidos relatórios, no mínimo, semestralmente, que contemplem:*

*I - as conclusões dos exames efetuados, inclusive sobre a aderência da gestão dos recursos do RPPS às normas em vigor e à política de investimentos;*

*II - as recomendações a respeito de eventuais deficiências, com estabelecimento de cronograma para seu saneamento, quando for o caso; e*

*III - análise de manifestação dos responsáveis pelas correspondentes áreas, a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores, bem como análise das medidas efetivamente adotadas para saná-las.*

***Parágrafo único.** As conclusões, recomendações, análises e manifestações deverão ser levadas em tempo hábil ao conhecimento dos órgãos ou instâncias com atribuições para determinar as providências necessárias.*

## 2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2024 - PREVISO

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	346.985.777,83	2.200.000,00	-	-	1.568.713,90	(1.492.205,45)	76.508,45	349.262.286,28
2	FEVEREIRO	349.262.286,28	-	-	-	2.178.461,57	-	2.178.461,57	351.440.747,85
3	MARÇO	351.440.747,85	4.062.814,67	-	-	1.758.003,40	(253.671,66)	1.504.331,74	357.007.894,26
4	ABRIL	357.007.894,26	2.491.849,16	-	-	338.419,91	(3.813.013,11)	(3.474.593,20)	356.025.150,22
5	MAIO	356.025.150,22	3.490.629,49	(1.759.834,91)	-	4.072.702,15	(273.675,65)	3.799.026,50	361.554.971,30
6	JUNHO	361.554.971,30	583.333,34	-	-	1.074.127,35	(1.826.579,00)	(752.451,65)	361.385.852,99
7	JULHO	361.385.852,99	-	-	-	-	-	-	361.385.852,99
8	AGOSTO	361.385.852,99	-	-	-	-	-	-	361.385.852,99
9	SETEMBRO	361.385.852,99	-	-	-	-	-	-	361.385.852,99
10	OUTUBRO	361.385.852,99	-	-	-	-	-	-	361.385.852,99
11	NOVEMBRO	361.385.852,99	-	-	-	-	-	-	361.385.852,99
12	DEZEMBRO	361.385.852,99	-	-	-	-	-	-	361.385.852,99
13	ANO	346.985.777,83	12.828.626,66	(1.759.834,91)	-	10.990.428,28	(7.659.144,87)	3.331.283,41	361.385.852,99

\*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

## 2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2024 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVISO

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
<b>RENDA FIXA</b>								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	87,3%	100,0%	87,5%	317.999.816,08	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operação	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	8,6%	40,0%	8,2%	29.831.484,72	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (60%)	0,0%	0,0%	40,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de 'Crédito Privado'	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	<b>TOTAL - RENDA FIXA</b>					<b>95,7%</b>	<b>347.831.300,80</b>	
<b>RENDA VARIÁVEL</b>								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	1,9%	12,0%	2,3%	8.394.537,20	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	1,0%	10,0%	0,0%	-	-
14	<b>TOTAL - RENDA VARIÁVEL</b>	Art. 8º (30%)				<b>2,3%</b>	<b>8.394.537,20</b>	
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	0,8%	10,0%	1,0%	3.524.165,66	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	<b>TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	Art. 10 (15%)				<b>1,0%</b>	<b>3.524.165,66</b>	
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
20	<b>TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>	Art. 11 (5%)				<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	0,3%	10,0%	0,4%	1.635.849,33	-
24	<b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	Art. 9º (10%)				<b>0,4%</b>	<b>1.635.849,33</b>	
<b>EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	<b>TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>	Art. 12 (5%)				<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
27	<b>DESENQUADRADO</b>	-		100,0%		<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
28	<b>DISPONIBILIDADE FINANCEIRA</b>	-				<b>0,6%</b>	<b>2.145.849,40</b>	
29	<b>PATRIMÔNIO TOTAL</b>					<b>100,0%</b>	<b>363.531.702,39</b>	<b>6</b>

### 3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI
<b>CNPJ</b>	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	49.963.829/0001-89
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Renda Fixa Duração Livre Soberano
<b>ÍNDICE</b>	CDI	IRF - M 1	IDKA 2	IPCA + 5,00% a.a.
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Investidor Qualificado
<b>ADMINISTRADOR</b>	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
<b>CNPJ ADM</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
<b>GESTOR</b>	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
<b>CNPJ GESTOR</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
<b>CUSTODIANTE</b>	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
<b>CNPJ CUSTODIANTE</b>	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
<b>CNPJ DISTRIBUIDOR</b>	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
<b>AUDITORIA</b>	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
<b>CNPJ AUDITORIA</b>	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20	49.928.567/0001-11
<b>DATA DE CONSTITUIÇÃO</b>	12/04/2011	16/11/2009	20/04/2011	16/05/2023
<b>DATA DE INÍCIO</b>	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	16/05/2023
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,10% a.a.	0,20% a.a.	0,10% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não possui
<b>TAXA DE ENTRADA</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não possui
<b>TAXA DE SAÍDA</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não possui
<b>PRAZO DE DURAÇÃO DO F.I.</b>	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Até o dia 15/05/2035
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO *</b>	<b>2 - Baixo</b>	<b>2 - Baixo</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>3 - Médio</b>
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## Continuação.....

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO
<b>CNPJ</b>	07.111.384/0001-69	07.861.554/0001-22	07.442.078/0001-05	03.737.206/0001-97
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
<b>ÍNDICE</b>	IRF - M	IMA - B	IMA - B	CDI
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
<b>ADMINISTRADOR</b>	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ ADM</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.
<b>CNPJ GESTOR</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	42.040.639/0001-40
<b>CUSTODIANTE</b>	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ CUSTODIANTE</b>	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ DISTRIBUIDOR</b>	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
<b>CNPJ AUDITORIA</b>	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20	61.562.112/0001-20	57.755.217/0001-29
<b>DATA DE CONSTITUIÇÃO</b>	24/11/2004	01/03/2006	17/06/2005	27/06/2006
<b>DATA DE INÍCIO</b>	08/12/2004	09/03/2006	24/07/2005	05/07/2006
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,30% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>TAXA DE ENTRADA</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>TAXA DE SAÍDA</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>PRAZO DE DURAÇÃO DO F.I.</b>	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO *</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>4 - Alto</b>	<b>4 - Alto</b>	<b>1 - Muito Baixo</b>
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## Continuação.....

3

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP
<b>CNPJ</b>	14.386.926/0001-71	11.060.913/0001-10	50.569.054/0001-40	14.508.605/0001-00
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
<b>ÍNDICE</b>	IDKA 2	IMA - B 5	IPCA + 5,00% a.a.	IRF - M
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Investidor Qualificado	Público Geral
<b>ADMINISTRADOR</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ ADM</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.
<b>CNPJ GESTOR</b>	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40
<b>CUSTODIANTE</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ CUSTODIANTE</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
<b>CNPJ DISTRIBUIDOR</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
<b>CNPJ AUDITORIA</b>	57.755.217/0001-29	49.928.567/0001-11	49.928.567/0001-11	49.928.567/0001-11
<b>DATA DE CONSTITUIÇÃO</b>	13/09/2011	30/07/2009	05/05/2023	13/09/2011
<b>DATA DE INÍCIO</b>	16/08/2012	09/07/2010	05/05/2023	16/08/2012
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,15% a.a.	0,20% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>TAXA DE ENTRADA</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>TAXA DE SAÍDA</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>PRAZO DE DURAÇÃO DO F.I.</b>	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Até o dia 16/05/2033	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO *</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>3 - Médio</b>
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## Continuação.....

4

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES
<b>CNPJ</b>	10.740.658/0001-93	13.058.816/0001-18	15.154.220/0001-47	40.209.029/0001-00
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Variável</b>	<b>Renda Variável</b>	<b>Renda Variável</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Ações	Fundo de Ações	Fundo de Ações
<b>ÍNDICE</b>	IMA - B	IBOV	SMLL	IFNC
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
<b>ADMINISTRADOR</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ ADM</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.
<b>CNPJ GESTOR</b>	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40
<b>CUSTODIANTE</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ CUSTODIANTE</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ DISTRIBUIDOR</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
<b>CNPJ AUDITORIA</b>	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001-29
<b>DATA DE CONSTITUIÇÃO</b>	03/03/2009	13/12/2010	26/01/2012	17/11/2020
<b>DATA DE INÍCIO</b>	08/03/2010	29/07/2011	01/11/2012	26/01/2021
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,50% a.a.	1,50% a.a.	0,80% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>TAXA DE ENTRADA</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>TAXA DE SAÍDA</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>PRAZO DE DURAÇÃO DO F.I.</b>	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO *</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>4 - Alto</b>	<b>5 - Muito Alto</b>	<b>4 - Alto</b>
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## Continuação.....

5

INFORMAÇÕES	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		
<b>CNPJ</b>	30.036.235/0001-02	17.502.937/0001-68		
<b>SEGMENTO</b>	<b>Investimentos Estruturados</b>	<b>Investimento no Exterior</b>		
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo Multimercado	Fundo de Ações		
<b>ÍNDICE</b>	S&P500	BDR		
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral		
<b>ADMINISTRADOR</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ ADM</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04		
<b>GESTOR</b>	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.		
<b>CNPJ GESTOR</b>	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40		
<b>CUSTODIANTE</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ CUSTODIANTE</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04		
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal		
<b>CNPJ DISTRIBUIDOR</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04		
<b>AUDITORIA</b>	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.		
<b>CNPJ AUDITORIA</b>	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001-29		
<b>DATA DE CONSTITUIÇÃO</b>	07/02/2018	28/12/2012		
<b>DATA DE INÍCIO</b>	16/10/2018	24/06/2013		
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,80% a.a.	0,70% a.a.		
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui		
<b>TAXA DE ENTRADA</b>	Não Possui	Não Possui		
<b>TAXA DE SAÍDA</b>	Não Possui	Não Possui		
<b>PRAZO DE DURAÇÃO DO F.I.</b>	Indeterminado	Indeterminado		
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui		
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)		
<b>RISCO DE MERCADO *</b>	<b>4 - Alto</b>	<b>4 - Alto</b>		
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9, III (10%)		

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## 4.1 - MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>1</b>						
JANEIRO	13.399.536,41	2.200.000,00	-	97.744,43	15.697.280,84	0,729%
FEVEREIRO	15.697.280,84	-	-	68.915,46	15.766.196,30	0,439%
MARÇO	15.766.196,30	-	-	141.587,67	15.907.783,97	0,898%
ABRIL	15.907.783,97	-	-	57.599,20	15.850.184,77	-0,362%
MAIO	15.850.184,77	-	-	162.718,41	16.012.903,18	1,027%
JUNHO	16.012.903,18	-	-	31.250,71	16.044.153,89	0,195%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.0000034-0	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>2</b>						
JANEIRO	6.706.455,96	-	-	31.202,07	6.675.253,89	-0,465%
FEVEREIRO	6.675.253,89	-	-	35.935,88	6.711.189,77	0,538%
MARÇO	6.711.189,77	-	-	3.800,24	6.714.990,01	0,057%
ABRIL	6.714.990,01	-	-	109.844,16	6.605.145,85	-1,636%
MAIO	6.605.145,85	145.245,27	-	86.210,48	6.836.601,60	1,305%
JUNHO	6.836.601,60	-	-	68.030,77	6.768.570,83	-0,995%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>3</b>						
JANEIRO	26.670.084,72	-	-	124.083,74	26.546.000,98	-0,465%
FEVEREIRO	26.546.000,98	-	-	142.909,04	26.688.910,02	0,538%
MARÇO	26.688.910,02	-	-	15.112,69	26.704.022,71	0,057%
ABRIL	26.704.022,71	-	-	436.825,78	26.267.196,93	-1,636%
MAIO	26.267.196,93	439.713,29	-	342.514,65	27.049.424,87	1,304%
JUNHO	27.049.424,87	-	-	269.167,79	26.780.257,08	-0,995%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
4						
JANEIRO	54.839.382,38	-	-	364.070,70	55.203.453,08	0,664%
FEVEREIRO	55.203.453,08	-	-	318.362,97	55.521.816,05	0,577%
MARÇO	55.521.816,05	-	-	417.906,89	55.939.722,94	0,753%
ABRIL	55.939.722,94	-	-	123.385,72	55.816.337,22	-0,221%
MAIO	55.816.337,22	-	-	573.620,88	56.389.958,10	1,028%
JUNHO	56.389.958,10	-	-	209.974,48	56.599.932,58	0,372%

FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
5						
JANEIRO	26.979.136,22	-	-	181.209,05	27.160.345,27	0,672%
FEVEREIRO	27.160.345,27	-	-	117.997,01	27.278.342,28	0,434%
MARÇO	27.278.342,28	-	-	136.416,12	27.414.758,40	0,500%
ABRIL	27.414.758,40	-	-	151.631,08	27.263.127,32	-0,553%
MAIO	27.263.127,32	-	-	172.254,17	27.435.381,49	0,632%
JUNHO	27.435.381,49	-	-	87.372,62	27.348.008,87	-0,318%

FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
6						
JANEIRO	6.910.578,73	-	-	69.320,51	6.979.899,24	1,003%
FEVEREIRO	6.979.899,24	-	-	57.564,83	7.037.464,07	0,825%
MARÇO	7.037.464,07	-	-	61.117,13	7.098.581,20	0,868%
ABRIL	7.098.581,20	-	-	63.282,85	7.161.864,05	0,891%
MAIO	7.161.864,05	-	-	60.238,40	7.222.102,45	0,841%
JUNHO	7.222.102,45	-	-	59.118,87	7.281.221,32	0,819%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
7						
JANEIRO	15.560.246,50	-	-	114.983,04	15.445.263,46	-0,739%
FEVEREIRO	15.445.263,46	-	-	99.500,94	15.544.764,40	0,644%
MARÇO	15.544.764,40	-	-	44.467,20	15.500.297,20	-0,286%
ABRIL	15.500.297,20	-	-	362.947,99	15.137.349,21	-2,342%
MAIO	15.137.349,21	-	439.713,29	256.398,06	14.954.033,98	1,744%
JUNHO	14.954.033,98	-	-	205.890,58	14.748.143,40	-1,377%

BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI						
AGÊNCIA	1917-8			CONTA	12598-9	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
8						
JANEIRO	26.297.309,85	-	-	187.192,68	26.484.502,53	0,712%
FEVEREIRO	26.484.502,53	-	-	117.815,15	26.602.317,68	0,445%
MARÇO	26.602.317,68	1.538.176,21	-	240.098,81	28.380.592,70	0,903%
ABRIL	28.380.592,70	591.849,16	-	73.582,19	28.898.859,67	-0,254%
MAIO	28.898.859,67	574.817,52	-	303.897,95	29.777.575,14	1,052%
JUNHO	29.777.575,14	583.333,34	-	76.190,04	30.437.098,52	0,256%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI						
AGÊNCIA	1917-8			CONTA	17002-X	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
9						
JANEIRO	1.037.884,90	-	-	5.115,00	1.032.769,90	-0,493%
FEVEREIRO	1.032.769,90	-	-	5.353,71	1.038.123,61	0,518%
MARÇO	1.038.123,61	-	-	449,88	1.038.573,49	0,043%
ABRIL	1.038.573,49	-	-	17.028,61	1.021.544,88	-1,640%
MAIO	1.021.544,88	-	-	13.217,09	1.034.761,97	1,294%
JUNHO	1.034.761,97	-	-	10.149,99	1.024.611,98	-0,981%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
AGÊNCIA	1917-8			CONTA	17002-X	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>10</b>						
JANEIRO	27.601.463,52	-	-	181.672,15	<b>27.783.135,67</b>	0,658%
FEVEREIRO	27.783.135,67	-	-	121.655,80	<b>27.904.791,47</b>	0,438%
MARÇO	27.904.791,47	-	-	140.488,37	<b>28.045.279,84</b>	0,503%
ABRIL	28.045.279,84	-	-	155.793,48	<b>27.889.486,36</b>	-0,556%
MAIO	27.889.486,36	-	-	177.720,27	<b>28.067.206,63</b>	0,637%
JUNHO	28.067.206,63	-	-	88.633,42	<b>27.978.573,21</b>	-0,316%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI						
AGÊNCIA	1917-8			CONTA	17002-X	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>11</b>						
JANEIRO	37.241.934,04	-	-	179.389,56	<b>37.062.544,48</b>	-0,482%
FEVEREIRO	37.062.544,48	-	-	196.697,40	<b>37.259.241,88</b>	0,531%
MARÇO	37.259.241,88	-	-	22.211,27	<b>37.281.453,15</b>	0,060%
ABRIL	37.281.453,15	-	-	608.621,92	<b>36.672.831,23</b>	-1,633%
MAIO	36.672.831,23	-	-	478.762,38	<b>37.151.593,61</b>	1,305%
JUNHO	37.151.593,61	-	-	366.038,38	<b>36.785.555,23</b>	-0,985%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI						
AGÊNCIA	1917-8			CONTA	17002-X	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>12</b>						
JANEIRO	13.645.544,65	-	-	117.979,13	<b>13.763.523,78</b>	0,865%
FEVEREIRO	13.763.523,78	-	-	101.971,66	<b>13.865.495,44</b>	0,741%
MARÇO	13.865.495,44	-	-	111.389,27	<b>13.976.884,71</b>	0,803%
ABRIL	13.976.884,71	1.900.000,00	-	78.740,32	<b>15.955.625,03</b>	0,563%
MAIO	15.955.625,03	-	-	118.790,02	<b>16.074.415,05</b>	0,745%
JUNHO	16.074.415,05	-	-	97.322,17	<b>16.171.737,22</b>	0,605%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI						
AGÊNCIA	1917-8			CONTA	17002-X	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>13</b>						
JANEIRO	9.471.264,28	-	-	67.419,49	9.538.683,77	0,712%
FEVEREIRO	9.538.683,77	-	-	42.432,42	9.581.116,19	0,445%
MARÇO	9.581.116,19	2.524.638,46	-	89.729,33	12.195.483,98	0,937%
ABRIL	12.195.483,98	-	-	31.619,15	12.163.864,83	-0,259%
MAIO	12.163.864,83	2.330.853,41	-	130.011,02	14.624.729,26	1,069%
JUNHO	14.624.729,26	-	-	37.419,40	14.662.148,66	0,256%

BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI						
AGÊNCIA	1917-8			CONTA	17002-X	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>14</b>						
JANEIRO	20.453.798,81	-	-	197.734,38	20.651.533,19	0,967%
FEVEREIRO	20.651.533,19	-	-	165.856,42	20.817.389,61	0,803%
MARÇO	20.817.389,61	-	-	177.531,66	20.994.921,27	0,853%
ABRIL	20.994.921,27	-	-	185.588,06	21.180.509,33	0,884%
MAIO	21.180.509,33	-	-	176.609,02	21.357.118,35	0,834%
JUNHO	21.357.118,35	-	-	168.533,07	21.525.651,42	0,789%

BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI						
AGÊNCIA	1917-8			CONTA	17002-X	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>15</b>						
JANEIRO	46.597.495,96	-	-	556.605,69	46.040.890,27	-1,194%
FEVEREIRO	46.040.890,27	-	-	275.134,41	46.316.024,68	0,598%
MARÇO	46.316.024,68	-	-	177.466,67	46.138.558,01	-0,383%
ABRIL	46.138.558,01	-	-	1.183.980,88	44.954.577,13	-2,566%
MAIO	44.954.577,13	-	1.320.121,62	764.039,35	44.398.494,86	1,751%
JUNHO	44.398.494,86	-	-	722.858,27	43.675.636,59	-1,628%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>16</b>						
JANEIRO	2.229.949,46	-	-	146.930,02	<b>2.083.019,44</b>	-6,589%
FEVEREIRO	2.083.019,44	-	-	7.944,66	<b>2.090.964,10</b>	0,381%
MARÇO	2.090.964,10	-	-	43.791,09	<b>2.134.755,19</b>	2,094%
ABRIL	2.134.755,19	-	-	167.177,57	<b>1.967.577,62</b>	-7,831%
MAIO	1.967.577,62	-	-	66.255,59	<b>1.901.322,03</b>	-3,367%
JUNHO	1.901.322,03	-	-	8.437,18	<b>1.892.884,85</b>	-0,444%

CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>17</b>						
JANEIRO	2.469.531,38	-	-	112.387,57	<b>2.357.143,81</b>	-4,551%
FEVEREIRO	2.357.143,81	-	-	8.402,82	<b>2.365.546,63</b>	0,356%
MARÇO	2.365.546,63	-	-	882,95	<b>2.366.429,58</b>	0,037%
ABRIL	2.366.429,58	-	-	125.962,70	<b>2.240.466,88</b>	-5,323%
MAIO	2.240.466,88	-	-	74.575,11	<b>2.165.891,77</b>	-3,329%
JUNHO	2.165.891,77	-	-	13.600,83	<b>2.179.492,60</b>	0,628%

FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
<b>18</b>						
JANEIRO	1.172.513,63	-	-	53.476,47	<b>1.225.990,10</b>	4,561%
FEVEREIRO	1.225.990,10	-	-	76.865,89	<b>1.302.855,99</b>	6,270%
MARÇO	1.302.855,99	-	-	45.311,83	<b>1.348.167,82</b>	3,478%
ABRIL	1.348.167,82	-	-	10.808,68	<b>1.358.976,50</b>	0,802%
MAIO	1.358.976,50	-	-	92.113,57	<b>1.451.090,07</b>	6,778%
JUNHO	1.451.090,07	-	-	184.759,26	<b>1.635.849,33</b>	12,732%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

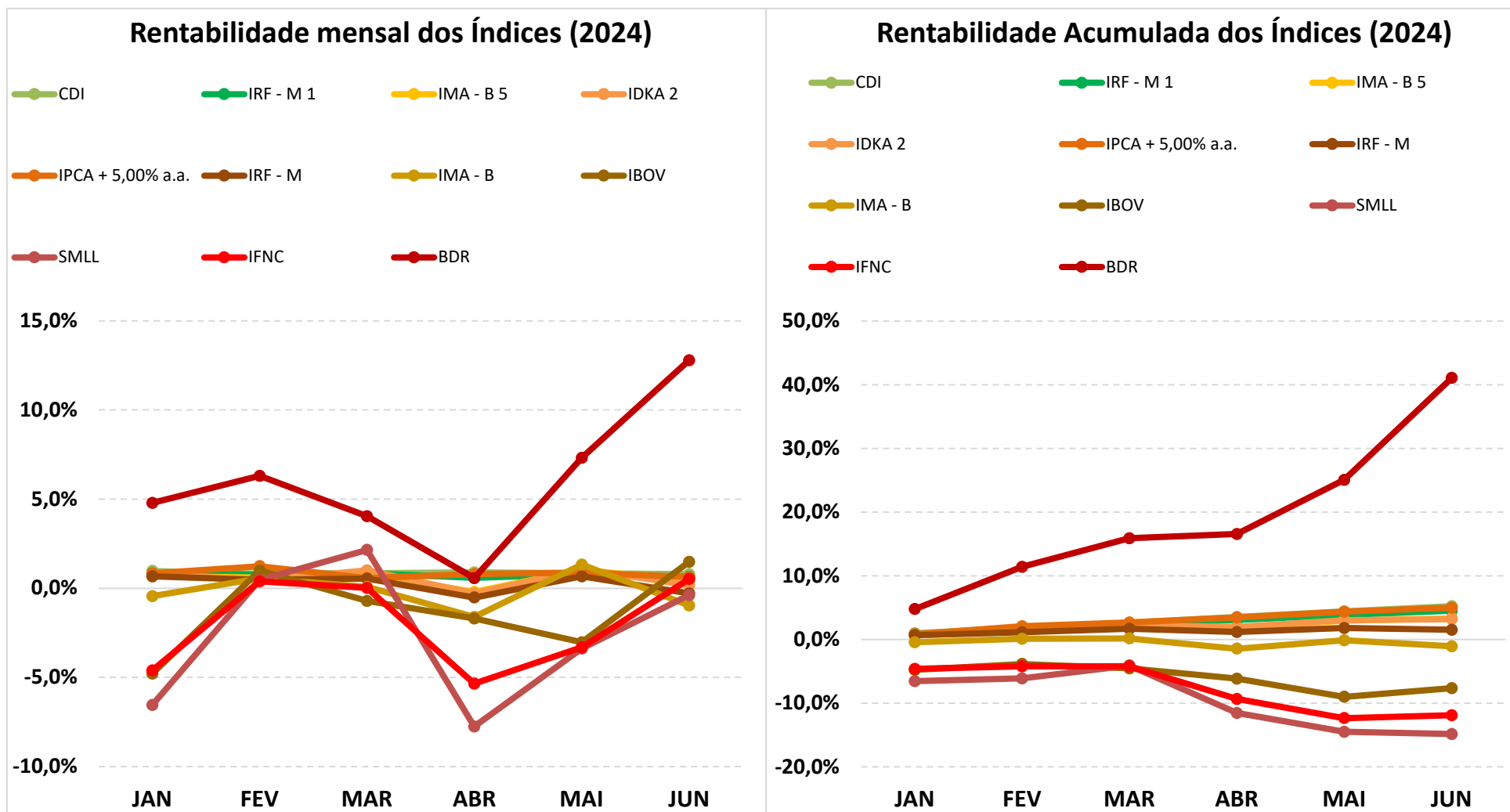
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
19	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	3.019.904,07	-	-	50.894,91	3.070.798,98	1,685%
FEVEREIRO	3.070.798,98	-	-	174.969,82	3.245.768,80	5,698%
MARÇO	3.245.768,80	-	-	110.178,20	3.355.947,00	3,395%
ABRIL	3.355.947,00	-	-	127.665,14	3.228.281,86	-3,804%
MAIO	3.228.281,86	-	-	163.586,43	3.391.868,29	5,067%
JUNHO	3.391.868,29	-	-	132.297,37	3.524.165,66	3,900%

CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES						
AGÊNCIA	2756			CONTA	006.000007-3	
20	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	4.681.762,36	-	-	221.508,76	4.460.253,60	-4,731%
FEVEREIRO	4.460.253,60	-	-	42.175,28	4.502.428,88	0,946%
MARÇO	4.502.428,88	-	-	31.737,79	4.470.691,09	-0,705%
ABRIL	4.470.691,09	-	-	79.347,54	4.391.343,55	-1,775%
MAIO	4.391.343,55	-	-	132.844,95	4.258.498,60	-3,025%
JUNHO	4.258.498,60	-	-	63.661,15	4.322.159,75	1,495%

## 5-TABELA DE RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

Nº	CNPJ	INVESTIMENTOS	SEGMENTO	RENTABILIDADE MENSAL						ACUMULADO
				JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	
1	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Renda Fixa	0,97%	0,80%	0,85%	0,88%	0,83%	0,79%	<b>5,24%</b>
2	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	Renda Fixa	0,86%	0,74%	0,80%	0,56%	0,74%	0,61%	<b>4,40%</b>
3	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	Renda Fixa	0,71%	0,44%	0,88%	-0,26%	1,05%	0,26%	<b>3,11%</b>
4	49.963.829/0001-89	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI	Renda Fixa	-1,19%	0,60%	-0,38%	-2,57%	1,71%	-1,63%	<b>-3,47%</b>
5	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	Renda Fixa	0,66%	0,44%	0,50%	-0,56%	0,64%	-0,32%	<b>1,37%</b>
6	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	Renda Fixa	-0,49%	0,52%	0,04%	-1,64%	1,29%	-0,98%	<b>-1,28%</b>
7	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	Renda Fixa	-0,48%	0,53%	0,06%	-1,63%	1,31%	-0,99%	<b>-1,22%</b>
8	03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	Renda Fixa	1,00%	0,82%	0,87%	0,89%	0,84%	0,82%	<b>5,36%</b>
9	14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	Renda Fixa	0,73%	0,44%	0,90%	-0,36%	1,03%	0,20%	<b>2,96%</b>
10	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	Renda Fixa	0,66%	0,58%	0,75%	-0,22%	1,03%	0,37%	<b>3,21%</b>
11	50.569.054/0001-40	FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF	Renda Fixa	-0,74%	0,64%	-0,29%	-2,34%	1,69%	-1,38%	<b>-2,45%</b>
12	14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	Renda Fixa	0,67%	0,43%	0,50%	-0,55%	0,63%	-0,32%	<b>1,36%</b>
13	10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	Renda Fixa	-0,47%	0,54%	0,06%	-1,64%	1,30%	-1,00%	<b>-1,23%</b>
14	13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	Renda Variável	-4,73%	0,95%	-0,70%	-1,77%	-3,03%	1,49%	<b>-7,68%</b>
15	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Renda Variável	-6,59%	0,38%	2,09%	-7,83%	-3,37%	-0,44%	<b>-15,11%</b>
16	40.209.029/0001-00	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	Renda Variável	-4,55%	0,36%	0,04%	-5,32%	-3,33%	0,63%	<b>-11,74%</b>
17	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	Investimentos Estruturados	1,69%	5,70%	3,39%	-3,80%	5,07%	3,90%	<b>16,71%</b>
18	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Investimento no Exterior	4,56%	6,27%	3,48%	0,80%	6,78%	12,73%	<b>39,52%</b>
1		<b>CDI</b>		<b>0,97%</b>	<b>0,80%</b>	<b>0,83%</b>	<b>0,89%</b>	<b>0,83%</b>	<b>0,79%</b>	<b>5,22%</b>
2		<b>IRF - M 1</b>		<b>0,83%</b>	<b>0,77%</b>	<b>0,84%</b>	<b>0,58%</b>	<b>0,78%</b>	<b>0,63%</b>	<b>4,51%</b>
3		<b>IMA - B 5</b>		<b>0,68%</b>	<b>0,59%</b>	<b>0,77%</b>	<b>-0,20%</b>	<b>1,05%</b>	<b>0,39%</b>	<b>3,32%</b>
4		<b>IDKA 2</b>		<b>0,81%</b>	<b>0,42%</b>	<b>0,99%</b>	<b>-0,29%</b>	<b>1,07%</b>	<b>0,18%</b>	<b>3,21%</b>
5		<b>IPCA + 5,00% a.a.</b>		<b>0,83%</b>	<b>1,24%</b>	<b>0,57%</b>	<b>0,79%</b>	<b>0,87%</b>	<b>0,62%</b>	<b>5,00%</b>
6		<b>IRF - M</b>		<b>0,67%</b>	<b>0,46%</b>	<b>0,54%</b>	<b>-0,52%</b>	<b>0,66%</b>	<b>-0,29%</b>	<b>1,51%</b>
7		<b>IMA - B</b>		<b>-0,45%</b>	<b>0,55%</b>	<b>0,08%</b>	<b>-1,61%</b>	<b>1,33%</b>	<b>-0,97%</b>	<b>-1,10%</b>
8		<b>IBOV</b>		<b>-4,79%</b>	<b>0,99%</b>	<b>-0,71%</b>	<b>-1,70%</b>	<b>-3,04%</b>	<b>1,48%</b>	<b>-7,66%</b>
9		<b>SMLL</b>		<b>-6,55%</b>	<b>0,47%</b>	<b>2,15%</b>	<b>-7,76%</b>	<b>-3,38%</b>	<b>-0,39%</b>	<b>-14,86%</b>
10		<b>IFNC</b>		<b>-4,61%</b>	<b>0,38%</b>	<b>0,02%</b>	<b>-5,35%</b>	<b>-3,31%</b>	<b>0,52%</b>	<b>-11,90%</b>
11		<b>BDR</b>		<b>4,78%</b>	<b>6,30%</b>	<b>4,04%</b>	<b>0,57%</b>	<b>7,32%</b>	<b>12,79%</b>	<b>41,07%</b>

## GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES



## 5.1-MELHOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

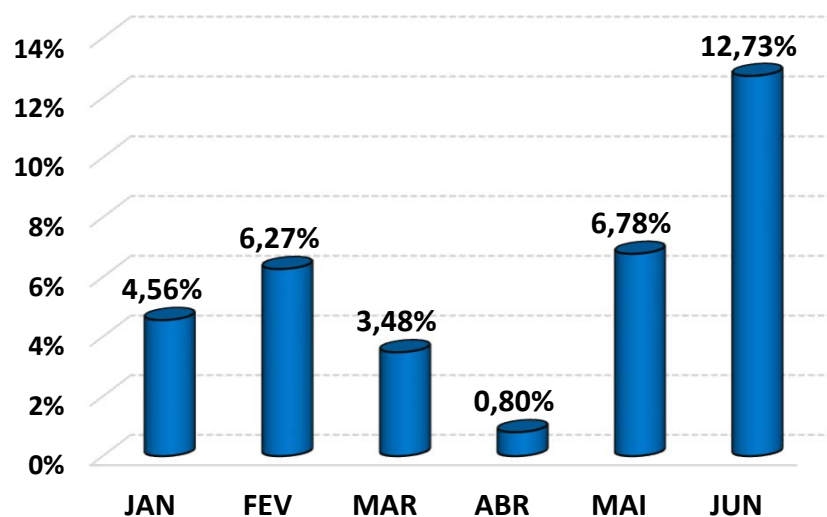
<b>FUNDO DE INVESTIMENTO</b>	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
<b>CNPJ</b>	17.502.937/0001-68
<b>SEGMENTO</b>	Investimento no Exterior

### COMPORTAMENTO MENSAL

JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
4,56%	6,27%	3,48%	0,80%	6,78%	12,73%

#### Comportamento MENSAL no Semestre

■ FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

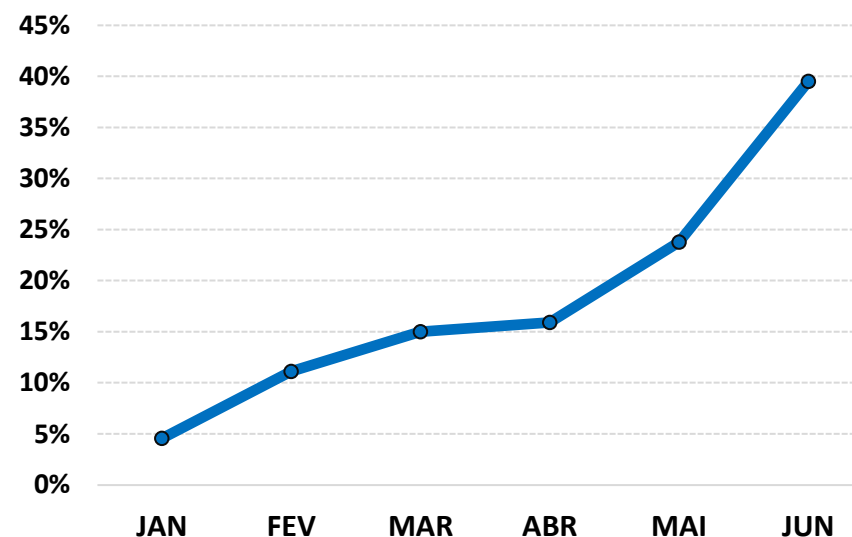


### COMPORTAMENTO ACUMULADO

JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
4,56%	11,12%	14,98%	15,90%	23,76%	39,52%

#### Comportamento ACUMULADO no Semestre

● FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I



## 5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

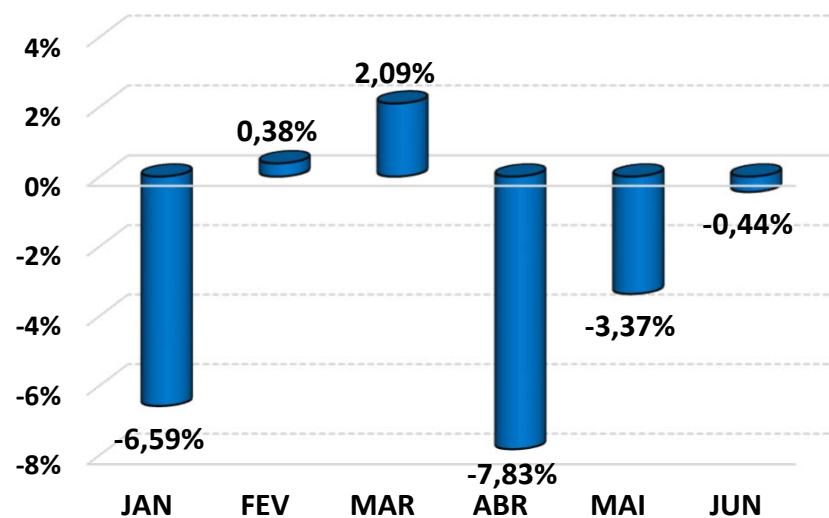
FUNDO DE INVESTIMENTO	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO
CNPJ	15.154.220/0001-47
SEGMENTO	Renda Variável

### COMPORTAMENTO MENSAL

JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
-6,59%	0,38%	2,09%	-7,83%	-3,37%	-0,44%

#### Comportamento MENSAL no Semestre

■ FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO

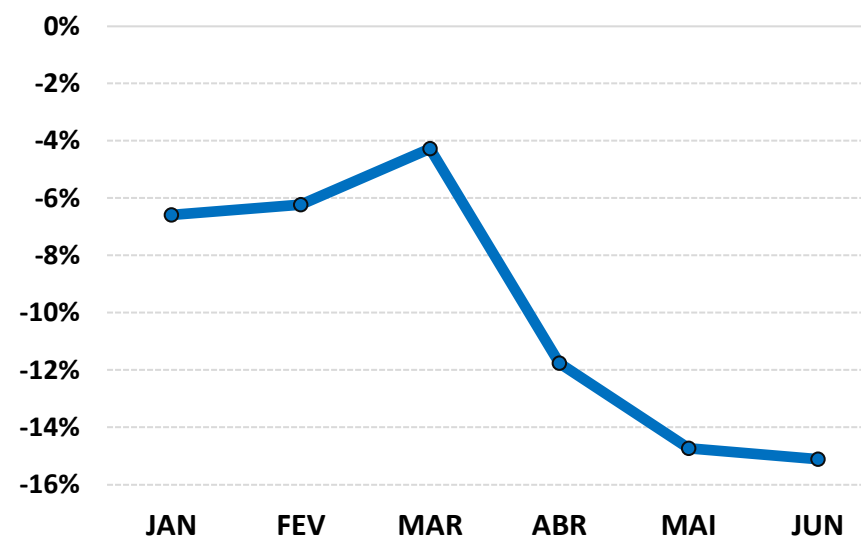


### COMPORTAMENTO ACUMULADO

JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
-6,59%	-6,24%	-4,27%	-11,77%	-14,74%	-15,11%

#### Comportamento ACUMULADO no Semestre

● FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO



## 6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 1º SEMESTRE - 2024

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
<b>MENSAL</b>	0,02%	0,62%	0,43%	-0,97%	1,07%	-0,21%
<b>CDI</b>	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%
<b>IBOVESPA</b>	-4,79%	0,99%	-0,71%	-1,70%	-3,04%	1,48%
<b>META ATUARIAL</b>	0,83%	1,24%	0,57%	0,79%	0,87%	0,62%

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
<b>ACUMULADO DO SEMESTRE</b>	0,02%	0,65%	1,08%	0,10%	1,17%	0,96%
<b>CDI</b>	0,97%	1,78%	2,62%	3,54%	4,40%	5,22%
<b>IBOVESPA</b>	-4,79%	-3,85%	-4,53%	-6,15%	-9,01%	-7,66%
<b>META ATUARIAL</b>	0,83%	2,08%	2,67%	3,48%	4,38%	5,03%

**RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEMESTRE DO PREVISÃO: R\$ 3.331.283,41**

**META ATUARIAL ACUMULADA DO SEMESTRE: R\$ 17.419.998,04**

**DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL: R\$ (14.088.714,63)**

## 7-CONCLUSÃO

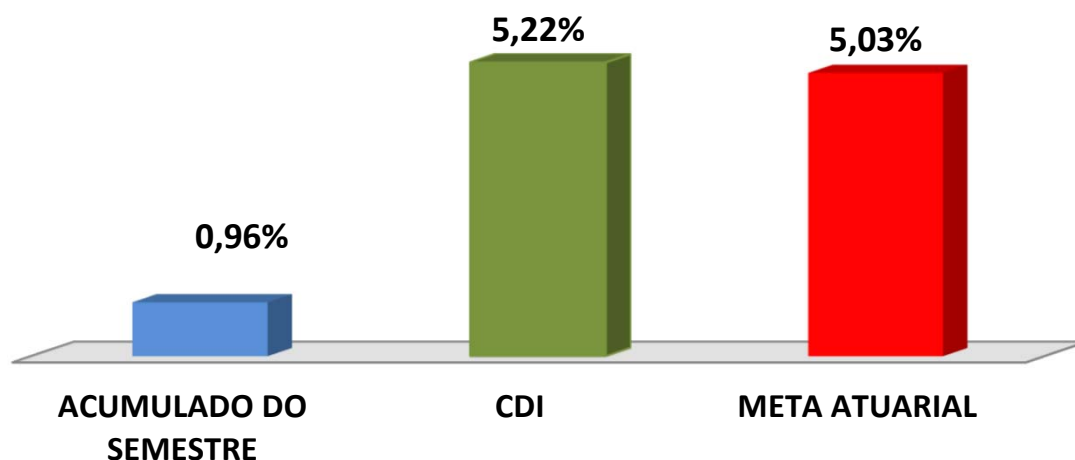
Atendendo o Art. 129, I, da Portaria MTP 1.467/2022, detalhado na página 4 deste relatório, segue uma análise do desempenho da Carteira de Investimento do PREVISÓ, no 1º Semestre/2024, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2024.

### 7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA SEMESTRAL

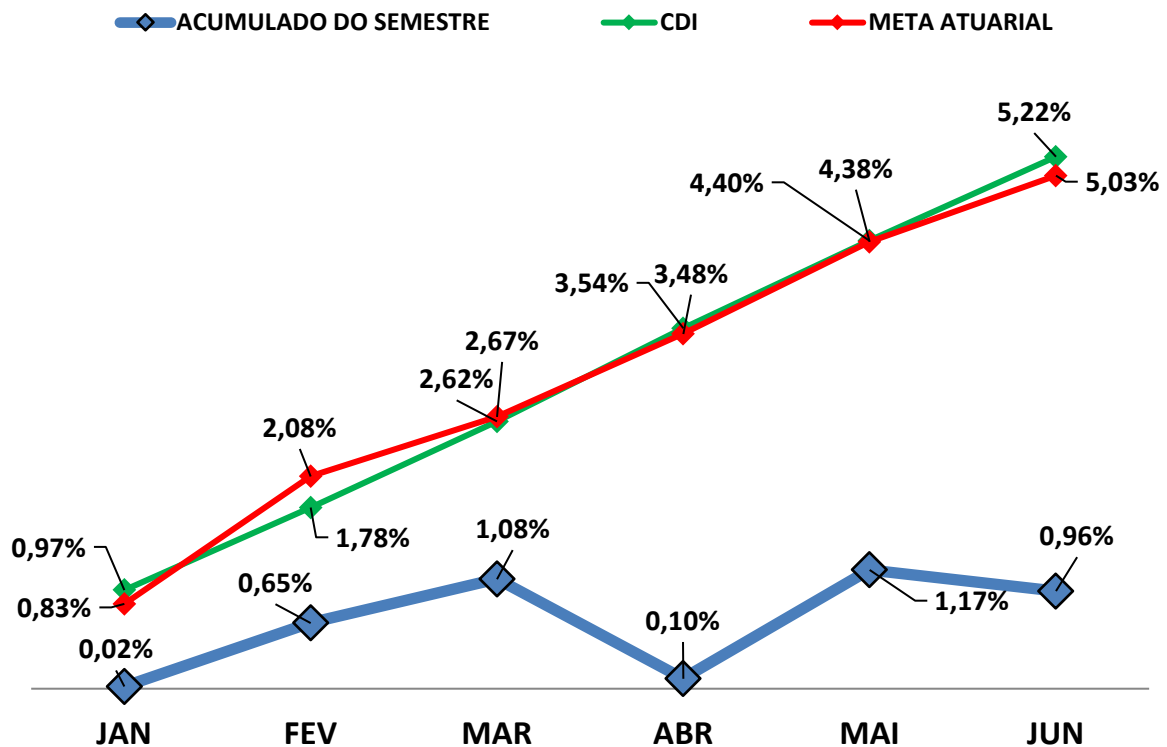
A Carteira de Investimentos do PREVISÓ, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no semestre de 0,96% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no semestre de 5,22% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 18,35% sobre o índice de referência do mercado.

#### GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

##### Rentabilidade Acumulada no Semestre



## Rentabilidade Acumulada no Semestre

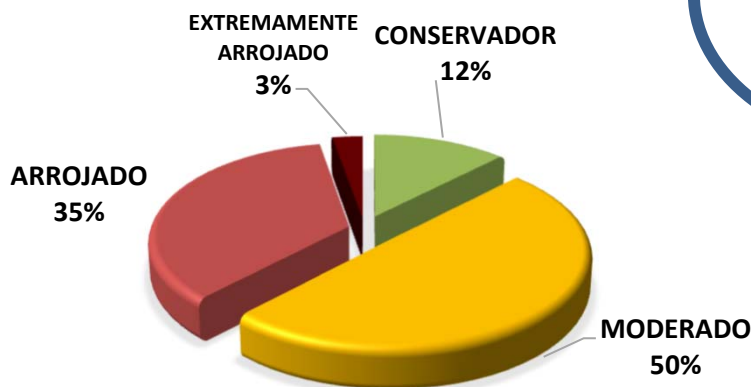


### 7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no semestre do PREVISÓ é de 0,96% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 5,03%, representando 19,02% sobre a Meta Atuarial.

### 7.3-PERFIL DE RISCO DO INVESTIDOR

#### PERFIL DOS INVESTIMENTOS



**PERFIL 6**  
**MODERADO COM**  
**TENDÊNCIA**  
**ARROJADA**

#### Descrição do Perfil de Investidor

##### Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados, mas busca investir um pouco em ativos arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é o perfil mais indicado.

##### Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo é o perfil mais indicado, pois os investimentos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil é o mais equilibrado, entre cumprir a Meta Atuarial e se proteger um pouco das oscilações de mercado.

#### Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

<b>CONSERVADOR</b>	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
<b>MODERADO</b>	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
<b>ARROJADO</b>	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO

## 7.4-AVALIAÇÃO DE DESEMPENHO NO 1º SEMESTRE

No 1º e 2º trimestre, o RPPS optou por uma carteira com Perfil 6 - Moderado com Tendência Arrojada. No primeiro semestre de 2024, o cenário econômico foi marcado por incertezas quanto à política fiscal e a revisão da meta fiscal para 2024, que rompeu com a meta de déficit fiscal zero e gerou apreensão no mercado. A abertura da curva de juros e a valorização do dólar também refletiram o cenário de riscos, juntamente com os conflitos geopolíticos. O Banco Central enfatizou a necessidade de flexibilidade para reduzir o ritmo de cortes de juros, mantendo a Selic em 10,50% a.a., com tendência de estagnação. Internamente, a confiança do mercado foi abalada pelas incertezas fiscais, prejudicando o desempenho da Bolsa e, conseqüentemente, os índices de Renda Variável, no entanto, existe expectativas de recuperação no segundo semestre/2024.

## 7.5-ORIENTAÇÃO PARA A CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO 2º SEMESTRE

Com relação a Renda Fixa, as incertezas quanto a política fiscal, a revisão da meta fiscal para 2024 (que rompeu com a meta de déficit fiscal zero em 2024), abertura da curva de juros, valorização do dólar e apreensão quanto a riscos, refletiram sobre o mercado de renda fixa. Diante desse cenário incerto quanto ao arcabouço fiscal, o Banco Central enfatizou a importância de ganhar flexibilidade para reduções no ritmo de cortes de juros. Atualmente, a Taxa Selic se encontra em 10,50% a.a., tendo a tendência de o Banco Central manter a taxa de juros estagnada por mais tempo. Levando em consideração o patamar elevado da Taxa Selic, é recomendável que a maior parte dos recursos seja aplicado em índices Conservadores (DI e IRF – M 1) e Ativos de Juros Pré-Fixados de Médio Prazo (como os subíndices IDKA 2 e IMA – B 5).

Com relação a Renda Variável, a perspectiva é de recuperação no 2º semestre/2024. No primeiro semestre/2024, a bolsa foi afetada por fatores externos e internos. A expectativa de queda dos juros dos EUA enfraqueceu diante de dados econômicos mais fortes e a inflação pressionada, o que resultou em manutenção de juros elevados e faz com que o Brasil também mantivesse suas taxas de juros mais altas por mais tempo. No âmbito doméstico, a meta do governo em zerar o déficit fiscal em 2024 era importante para reduzir a percepção de risco e atrair investidores, no entanto, com as incertezas sobre a política fiscal, a confiança do mercado diminuiu, prejudicando o desempenho da Bolsa. Apesar disso, as expectativas para o 2º semestre/2024 são de recuperação, com a possibilidade de início de corte de juros americano ainda esse ano, a melhora da inflação e sinais consistentes de desaceleração. Com isso, é recomendado que uma pequena parte das aplicações seja destinada a Renda Variável.

Com relação a Investimento no Exterior, o ambiente externo está apreensivo quanto o início da retomada do crescimento dos países desenvolvidos. As incertezas sobre a redução da taxa de juros dos EUA, fizeram que alguns países mantivessem suas taxas de juros estagnadas, enquanto alguns passaram a reduzir suas taxas de juros levando em conta o cenário político dos EUA e a possibilidade do FED reduzir a taxa de juros, a partir do 2º semestre/2024. Os juros mais altos das economias mais desenvolvidas afetaram negativamente as moedas dos países na América Latina, afetando o nível de estímulos de investimento exterior para países emergentes. Com isso, orientamos o RPPS a aplicar uma pequena parte dos recursos em Investimentos no Exterior.

As orientações e análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Relatório.



Igor França Garcia  
Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA  
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM