



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS
SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

FUNSERV

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

RESUMO

Trata-se do Parecer do Comitê de Investimentos sobre os Investimentos dos Recursos da Previdência

Em referência ao mês de Junho de 2024

Sumário

1.	INTRODUÇÃO	2
2.	ANEXOS	3
3.	PARECER DO COMITÊ	3
3.1	Análise do Cenário Econômico	3
3.1.1	Resenha Macro Brasil	4
3.1.2	Perspectivas Econômicas	6
3.1.3	Boletim Focus – Relatório de Mercado	8
3.1.4	Resumo do Cenário Econômico pelo Comitê de Investimentos da FUNSERV	10
3.2	Evolução da Execução Orçamentária do RPPS	10
3.3	Análise da Carteira de Investimentos	11
3.3.1	Enquadramento da Carteira Consolidada de Investimentos na Resolução CMN nº 4.963/2021 e Política de Investimentos	11
3.3.3	Rentabilidade Mensal por Segmento –Junho/2024	12
3.3.4	Distribuição por Sub-segmento.	14
3.3.5	Retorno da Total da Carteira x Meta Atuarial	16
3.3.6	Evolução da Reserva Administrativa	16
3.3.7	Evolução Patrimonial	17
3.3.8	Fluxo de Caixa dos Investimentos	19
3.3.9	Análise das Autorizações de Aplicação e Resgate – APR	19
3.4	Análises de novos Fundos de Investimentos para credenciamento	22
3.5	Propostas de aplicações e migrações:	23
4.	CONCLUSÃO	25

1. INTRODUÇÃO

O Comitê de Investimentos é o órgão colegiado da FUNSERV que tem por atribuição específica participar do processo decisório de formulação e execução da Política de Investimentos, tendo seus requisitos básicos de instituição e funcionamento estabelecidos no art. 3º-A da Portaria MPS nº 519/2011. Sua atuação é disciplinada por regimento interno (Res. FUNSERV nº 06, de 14/12/2020), o qual foi aprovado pelo Conselho Administrativo, e seus membros devem atender aos requisitos de qualificação, padrões éticos de conduta e autonomia nas decisões.

O Comitê de Investimentos se reúne com periodicidade mínima mensal, conforme calendário anual definido na primeira reunião do ano, para deliberar sobre as alocações dos recursos financeiros, observados os limites estabelecidos na Resolução CMN nº 4.963/2021 e na Política de Investimentos, e para apresentação dos resultados financeiros, avaliação da conjuntura econômica e do desempenho da carteira de investimentos.

Dessa forma, na busca por uma gestão previdenciária de qualidade e principalmente no que diz respeito às Aplicações dos Recursos, dispomos do parecer de deliberação e análise, promovida por este Comitê de Investimentos da FUNSERV.

Foram utilizados para a emissão deste Parecer: o Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco referente ao mês de Junho de 2024, elaborado pela empresa Crédito e Mercado, as análises de mercado de Instituições Financeiras e outros documentos complementares internos da FUNSERV.

2. ANEXOS

Item	Documento
ANEXO I	Relatório Analítico Investimentos_JUNHO-2024
ANEXO II	Balancete_Analítico_Prev_JUNHO-2024

3. PARECER DO COMITÊ

3.1 Análise do Cenário Econômico

1. "BOLETIM RPPS –JUNHO/2024" elaborado pela Ger. Nac. de Relacionamento e Distribuição da Caixa Asset.
2. "BOLETIM FOCUS" – Relatório de Mercado", referente a 17/05/2024, publicado em 21/05/2024.

3.1.1 Resenha Macro Brasil

ATIVIDADE: Em junho, a confiança teve predomínio positivo. Destaque para a confiança do consumidor (-4,3% para 2,1%, M/M). Nos dados da economia real, houve números favoráveis em maio, com destaque para taxa de desemprego, recuando de 7,5% para 7,1%. Dentre os meses de maio, essa é a menor taxa desde maio de 2014. Sobre os vetores positivos, destaque para a expansão da população ocupada (+527 mil), mesmo com o desastre natural do Rio Grande do Sul (RS). Acerca da renda, destaque para a massa salarial real (7,9% para 9,0%, A/A), refletindo os reajustes do salário-mínimo, negociações salariais mais favoráveis, o avanço robusto da população ocupada e a forte expansão do emprego público. Com ajuste sazonal, a taxa de desemprego recuou de 7,3% para 7,0%. O saldo de empregos formais (CAGED) decepcionou um pouco, ao apresentar saldo de 131.800 vagas, mas teve saldo positivo generalizado entre os setores. Em abril, a indústria recuou 0,5% (M/M), prejudicado por bens intermediários (-1,2%), que tem o maior peso do setor. Entre os ramos, destaque para indústria extrativa (-3,4%), produtos têxteis (-2,8%) e informática (-2,6%). O IBC-Br de abril ficou estável na margem mensal. De um lado, destaque positivo para serviços. De outro lado, destaque negativo para varejo ampliado e indústria.

INFLAÇÃO: O IPCA avançou +0,21% (M/M) em junho, desacelerando em relação ao avanço de +0,46% (M/M) observado no mês anterior. Sendo que a variação foi inferior a projeção de mercado de +0,32%. Com isso, o índice acumulou alta de +4,23% em 12 meses (ante +3,93% em maio), acelerando assim nessa base comparação. Os grupos que mais contribuíram vieram dos grupos de Alimentação e bebidas (variação de +0,44% ante projeção de +0,71%) e Saúde e cuidados pessoais (+0,54% ante projeção de +0,7%). A maior contribuição para a variação do índice contudo, partiu do grupo Alimentação e bebidas influenciado pelo aumento dos itens de Alimentação no domicílio com destaque para Leites e derivados. Os preços administrados avançaram +0,33% em junho ante +0,55% de maio, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Pedágio (+3,35% ante -4,99% na leitura anterior). Já os preços livres desaceleraram +0,16%, ainda se mantendo como os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres, produtos industriais, alimentos e serviços desaceleraram de +0,29% para +0,13% de +0,66% para +0,47% e +0,4% para +0,04% respectivamente. A média dos núcleos desacelerou na comparação mensal (de +0,39% para +0,23%), enquanto quando observada a variação acumulada em 12 meses acelerou para +3,58%.

POLÍTICA MONETÁRIA: Na reunião de 19/06, o BCB decidiu, por unanimidade, manter a taxa básica de juros (Selic) em 10,50% a.a. A manutenção foi em linha com o mercado. No âmbito externo, o Comitê avaliou que o ambiente se manteve adverso, em função da incerteza elevada sobre a flexibilização monetária nos EUA. No ambiente doméstico, o Copom avaliou que o mercado de trabalho segue com dinamismo maior do que o esperado. As projeções de inflação do Copom no cenário de referência foram revisadas para cima (3,8% para 4,0% em 2024; 3,3% para 3,4% em 2025). Os itens do balanço de riscos para a inflação não se alteraram e o parágrafo sobre a condução da política fiscal teve poucas alterações, trazendo a preocupação com o impacto nos ativos financeiros. No que concerne aos próximos passos, não foi fornecido um guidance.

GERAL: O resultado primário do governo central de maio foi de -R\$61 bilhões, com destaque para a despesa primária (14%, A/A).

COPOM: SELIC em 10,50% a.a.

Próximo COPOM: 30 e 31 de julho de 2024.

IPCA Junho/2024: O IPCA avançou 0,21% (M/M) em Junho acumulando alta de 4,23% em 12 meses.

Resenha Macro Internacional

EUA: A inflação medida pelo índice CPI em maio variou 0,0% (M/M), ante o crescimento de 0,3% (M/M) em abril. Com o dado de maio, o índice acumulado em 12 meses reduziu de 3,4% para 3,3% (A/A). Enquanto isso o núcleo do CPI, apresentou crescimento de 0,2% (M/M), após avançar 0,3% em abril, e o índice acumulado em 12 meses permanece elevado com inflação de 3,4% (A/A), ante 3,6% (A/A). Já a inflação medida pelo PCE de maio apresentou estabilidade, ante o crescimento de 0,3% (M/M) em abril, com desaceleração da inflação anualizada de 2,7% para 2,6%. O núcleo do PCE apresentou crescimento de 0,1% (M/M), com redução do índice acumulado em 12 meses de 2,8% para 2,6%, em linha com a projeção mediana de mercado. Em sua reunião de junho, o FOMC decidiu novamente por manter os juros básicos estáveis no intervalo [5,25% a 5,50%] a.a. em linha com o consenso de mercado. O comunicado trouxe apenas revisões marginais em relação ao anterior, com o comitê atualizando a avaliação do cenário apenas por meio da indicação de que foi observado um modesto progresso em direção ao objetivo de uma inflação de 2% a.a. O presidente do FED, Jerome Powell, assumiu uma postura bastante moderada, transparecendo a necessidade de manter a cautela diante de um quadro de atividade ainda forte, mercado de trabalho robusto, um pouco mais equilibrado e de uma inflação que acomoda, mas que segue em patamar elevado.

EUROPA: Na Zona do Euro, a inflação medida pelo do CPI de maio acelerou para 2,6% (A/A), acima das expectativas de mercado (2,5%). Olhando para os principais grupos, destaque para alta da inflação de serviços 4,1% (A/A), voltando a acelerar e atingindo o maior valor dos últimos 6 meses. Por outro lado, registrando redução, a inflação de alimentos marcou 2,6% ante 2,8% A/A. Olhando para as principais economias do bloco, observou-se aceleração na Alemanha (2,8% A/A), na Espanha (3,8% A/A) e na França (2,7% A/A); em sentido oposto, houve desaceleração na Itália (0,8% A/A). O Banco Central Europeu (BCE) reduziu suas três taxas de juros diretoras em 25 bps, em linha com a expectativa do mercado. Assim, as taxas de juros das operações principais de refinanciamento, de cedência de liquidez e de depósito foram reduzidas para, respectivamente, 4,25%, 4,50% e 3,75% a partir de 12 de junho de 2024. No comunicado, a autoridade monetária justificou que a decisão pelo corte foi tomada com base em uma "avaliação atualizada das perspectivas para a inflação, da dinâmica da inflação subjacente e da força da transmissão da política monetária", considerando ser apropriado "moderar o nível de restrição após nove meses de taxas constantes". Pela sétima reunião consecutiva, o Comitê de Política Monetária (MPC) do Bank of England (BoE) manteve sua taxa básica de juros em 5,25% a.a., sendo esse o maior nível de juros desde 2008.

ÁSIA: A produção industrial na China desacelerou de 6,7% (A/A) em março para 5,6% (A/A) em maio, vindo abaixo do consenso de mercado, que previa uma desaceleração aos 6,2% (A/A). Houve crescimento em 33 das 41 principais indústrias. Enquanto as vendas no varejo na China aumentaram, de 2,3% em março para 3,7% (A/A) em maio, número acima das estimativas do mercado (3,0%).

GLOBAL: A Guerra da Ucrânia completou 28 meses, sem perspectivas de novas negociações diplomáticas.

A tensão no oriente médio se mantém, desta vez com a apreensão sobre um possível conflito entre Israel e Hezbollah.

3.1.2 Perspectivas Econômicas

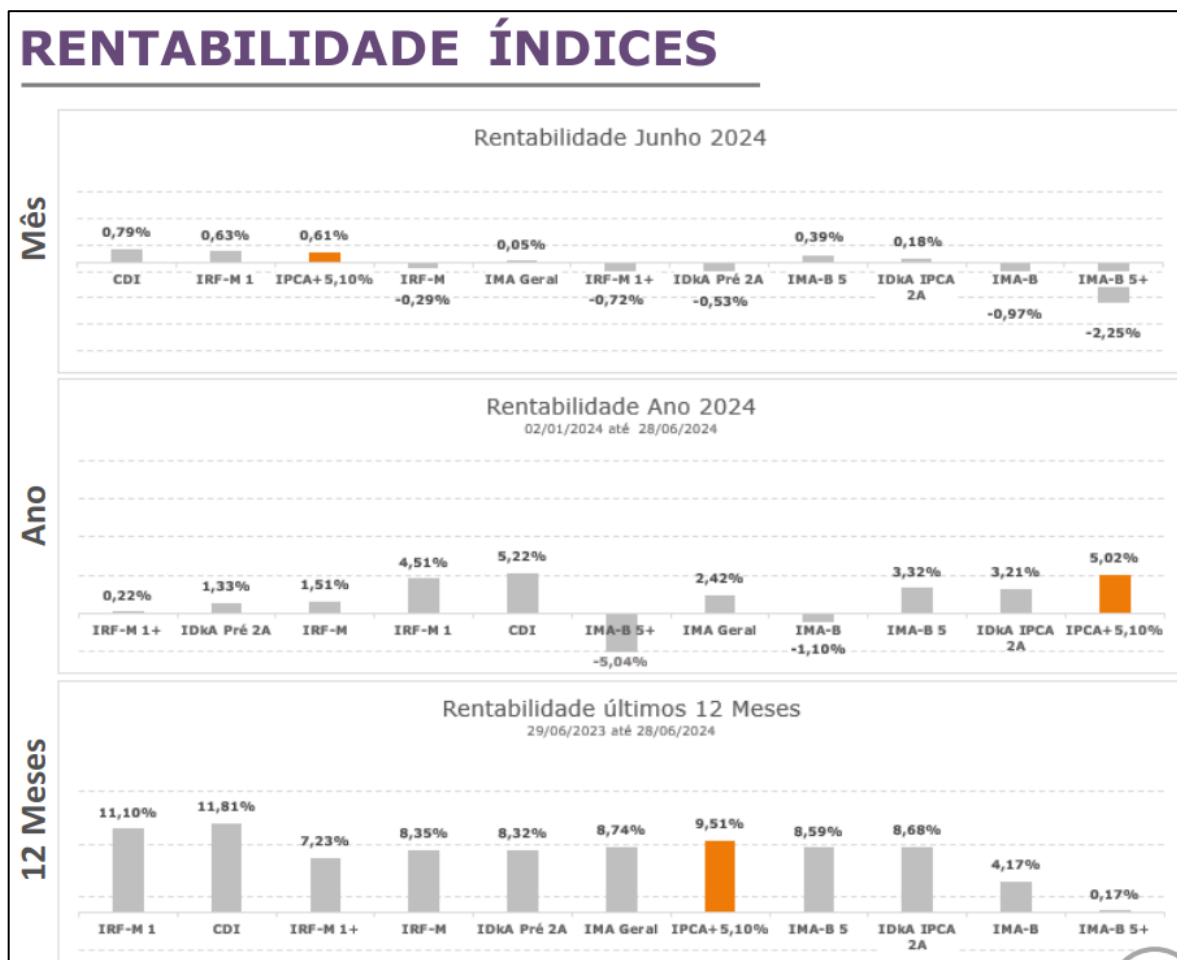
Renda Fixa

Em junho, os dados de atividade para a economia americana se mostraram ligeiramente mais frágeis, indicando que a política monetária mais restritiva pode começar a ser sentida de maneira mais pronunciada nos próximos meses. Os dados de inflação divulgados ao longo do mês seguiram mostrando acomodação, apesar de ainda estarem distantes do objetivo do Fed, enquanto os indicadores do mercado de trabalho se mostraram mistos, mas ainda sinalizando um aperto relevante. O presidente do Fed ratificou que o panorama atual ainda demanda cautela na condução da política monetária, reforçando a percepção de que o início do ciclo de flexibilização requererá um maior número de dados favoráveis de inflação e mercado de trabalho. No Brasil, foi observada uma nova rodada de deterioração da percepção em relação à condução da política econômica, mesmo em um momento no qual o COPOM manteve a taxa básica de juros estável de maneira unânime em sua última decisão. Em que pese o tom cauteloso adicional, por ora, as projeções do COPOM não indicam a necessidade de um novo ciclo de elevação da taxa básica de juros, com a inflação convergindo para a meta em 2025 caso a Selic seja mantida estável. Com o aumento dos fatores de incerteza, ao longo do mês houve uma intensificação da reprecificação da curva de juros futuros iniciada em maio, que abriu de maneira expressiva em toda a sua extensão, especialmente nos vértices intermediários. A curva de juros real se moveu na mesma direção, mas em menor magnitude, refletindo a expectativa de uma inflação mais elevada, também aprofundando a tendência verificada em maio. Já as LFTs, mostraram virtual estabilidade, com os vértices curtos mostrando fechamento bastante modesto. Como consequência, observando os subíndices da ANBIMA, apenas o IMAS mostrou performance ligeiramente superior ao CDI, com os demais índices rendendo negativamente ou significativamente abaixo do CDI. O destaque negativo foi o IMA-B5+, influenciado pela abertura da curva de juros reais em seus vértices mais longos.

PERPECTIVAS JULHO: Apesar do ambiente se mostrar mais volátil, ainda atribuímos a abertura expressiva da curva de juros a um aumento do prêmio de risco, mesmo nos vértices mais curtos, motivo pelo qual nossa estratégia macro manteve como principais posições de renda fixa no Brasil aplicação na ponta curta da curva juro nominal. Além disso, mantivemos posição em inflação implícita e abrimos



trade de valor relativo na curva de juro nominal. No que diz respeito ao cenário prospectivo, seguimos com uma postura cautelosa diante do ruído em torno dos próximos passos da política econômica doméstica, mesmo com dados marginalmente mais favoráveis externamente. Assim, acreditamos que, tal qual sinalizado, o BCB será cauteloso na condução da política monetária, mantendo a taxa de juros estável até que se tenha maior clareza sobre a convergência da inflação e das expectativas para a sua meta.

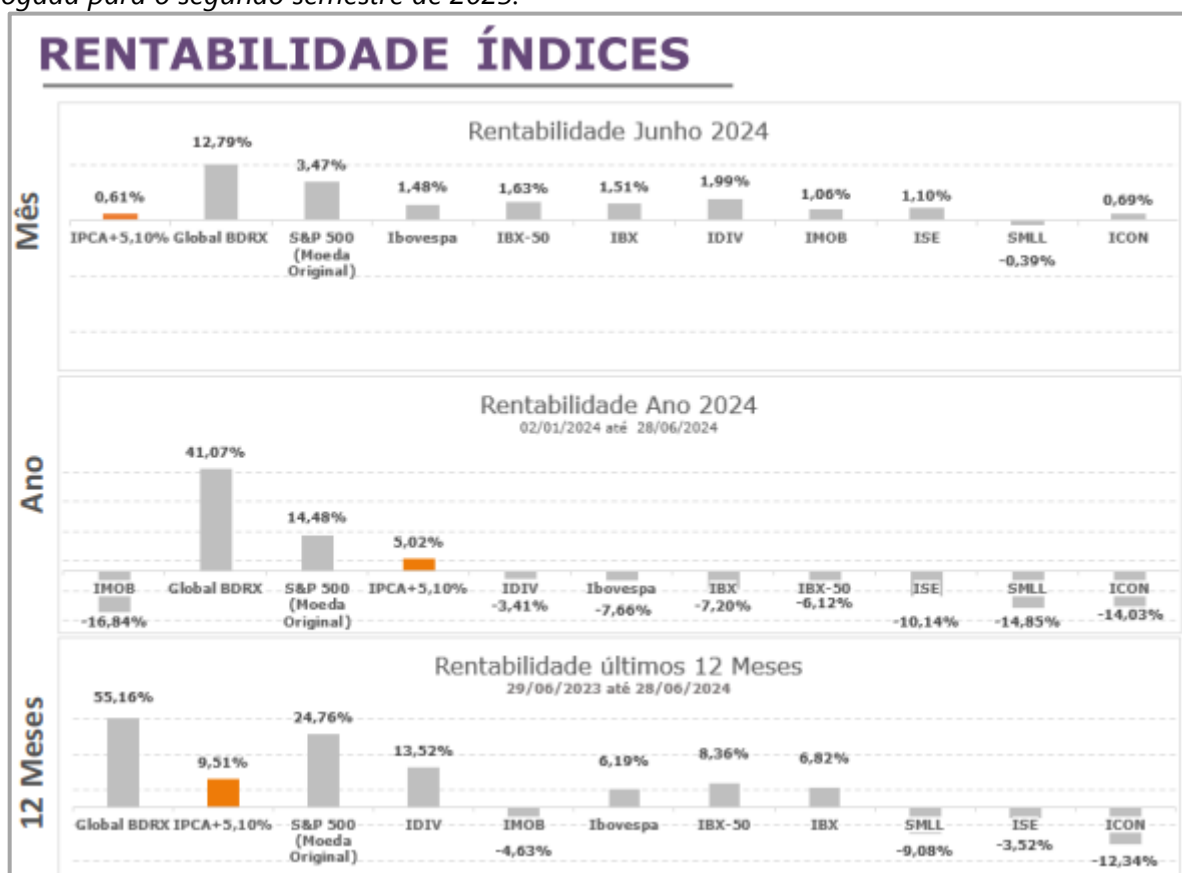


Renda Variável:

Comentários do Gestor – RV: Em junho, o Ibovespa apresentou valorização de 1,48% em relação ao mês anterior, fechando aos 123.906 pontos. No ano, o índice acumula queda de 7,6%, se descolando das principais bolsas do mundo. Neste contexto, a performance desfavorável no ano continua sendo explicada, sobretudo, pela possível necessidade de os Estados Unidos permanecerem com uma política monetária contracionista, o que acaba pressionando os juros dos países emergentes, como o Brasil, e dificultando a performance dos ativos de risco. Além disso, no âmbito doméstico, os agentes do mercado permanecem com dúvidas sobre a sustentabilidade do arcabouço fiscal, bem como de que forma se dará a condução da política monetária do próximo presidente do Banco Central, fazendo com que haja estresse nos juros domésticos, no câmbio e no prêmio de risco do país, impactando negativamente a bolsa. No mês, a valorização do Ibovespa foi impulsionada, majoritariamente, por ações ligadas à

commodities, em função da apreciação do dólar frente ao real, que beneficia a receita dessas companhias. Os segmentos de Papel e Celulose (+13,7%), Industrial (+9,4%) e Alimentos e Bebidas (+6,1%) foram os destaques positivos. Em termos de ações, os melhores desempenhos foram dos papéis de SMT03 (+22,3%), BRF3 (+22,0%) e SUZB3 (+14,1%), explicados, em grande parte, pela valorização do dólar frente ao real no período observado, cujo impacto é positivo para as receitas das companhias e, no caso da Suzano, também pela desistência da aquisição da Internation Paper que, na visão do mercado, não traria sinergia à companhia e elevaria seu endividamento. Por outro lado, os destaques negativos foram dos papéis de BHIA3 (-23,1%), AZUL4 (-22,5%) e ASAI3 (-15,1%), justificados, principalmente, pelas taxas de juros em patamares elevados em decorrência dos riscos internos e externos

PERPECTIVAS JULHO: Nossa visão para o horizonte de 12 meses passou para neutra, dado o aumento de riscos e incertezas no cenário base e baixa probabilidade de ocorrência de gatilhos positivos no curto prazo. Ainda no curto prazo o cenário deve seguir volátil e desfavorável à alocação em equities até que se tenha uma maior certeza acerca do início de cortes de juros pelo Fed. A política monetária norte-americana segue tendo grande influência no desempenho da bolsa brasileira e tem se mostrado o principal fator que dita o apetite a risco de emergentes. Espera-se que o fluxo estrangeiro para o Brasil aumente a partir de uma maior definição do início de cortes pelo FOMC. Internamente, é esperado que o fluxo doméstico aumente a partir de uma Selic mais próxima a um dígito, expectativa que foi prorrogada para o segundo semestre de 2025.



O Relatório Focus resume as estatísticas calculadas considerando as expectativas de mercado coletadas até a sexta-feira anterior à sua divulgação. Ele é divulgado toda segunda-feira. O relatório traz a evolução gráfica e o comportamento semanal das projeções para índices de preços, atividade econômica, câmbio, taxa Selic, entre outros indicadores. As projeções são do mercado, não do BC. O relatório apresenta as medianas (valor que divide um conjunto de valores ordenados em partes iguais) das expectativas de mercado para:

- O IPCA, o crescimento do PIB, a taxa de câmbio média de Janeiro, a meta da Taxa Selic de fim de ano, o IGP-M, os preços administrados, a conta corrente, a balança comercial, o investimento direto no país, a dívida líquida do setor público, os resultados primário e nominal, todos para o ano corrente e os três anos subsequentes;
- A inflação suavizada dos próximos 12 meses para o IPCA e para o IGP-M; e
- O IPCA, a taxa de câmbio média do mês, a meta da Taxa Selic do fim do mês e o IGP-M, todos para o mês corrente e os dois meses subsequentes.

Mediana - Agregado	2024							2025						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***
IPCA (variação %)	3,98	4,00	4,05	▲ (1)	150	4,07	105	3,85	3,90	3,90	▲ (1)	147	3,96	105
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,09	2,11	2,15	▲ (3)	111	2,19	68	2,00	1,97	1,93	▼ (1)	103	1,92	65
Câmbio (R\$/US\$)	5,15	5,22	5,30	▲ (2)	124	5,30	80	5,15	5,20	5,23	▲ (1)	121	5,25	80
Selic (% a.a)	10,50	10,50	10,50	▲ (5)	141	10,50	84	9,50	9,50	9,50	▲ (5)	138	9,50	84
IGP-M (variação %)	3,22	3,42	3,49	▲ (12)	78	3,52	56	3,81	3,90	3,95	▲ (1)	72	4,00	51
IPCA Administrados (variação %)	3,94	4,11	4,59	▲ (2)	98	4,59	75	3,85	3,90	3,90	▲ (3)	90	3,92	69
Conta corrente (US\$ bilhões)	-38,35	-40,40	-40,00	▲ (1)	29	-40,00	17	-42,80	-43,60	-43,50	▲ (1)	27	-43,80	15
Balança comercial (US\$ bilhões)	81,78	82,00	82,00	▲ (2)	27	81,20	15	76,01	76,30	78,00	▲ (2)	23	76,01	12
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	70,00	70,00	69,59	▼ (1)	27	69,80	14	73,00	74,00	72,10	▼ (1)	26	70,00	13
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,68	63,70	63,70	▲ (1)	30	63,70	17	66,50	66,00	66,00	▲ (1)	29	66,00	17
Resultado primário (% do PIB)	-0,70	-0,70	-0,70	▲ (4)	46	-0,70	27	-0,60	-0,66	-0,67	▼ (2)	45	-0,70	27
Resultado nominal (% do PIB)	-7,20	-7,25	-7,20	▲ (1)	29	-7,20	16	-6,48	-6,50	-6,50	▲ (3)	28	-6,50	16

Mediana - Agregado	2026						2027					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **		Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	
IPCA (variação %)	3,60	3,60	3,60	▲ (7)	133		3,50	3,50	3,50	▲ (55)	126	
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,00	2,00	2,00	▲ (50)	79		2,00	2,00	2,00	▲ (52)	76	
Câmbio (R\$/US\$)	5,15	5,20	5,23	▲ (1)	94		5,18	5,21	5,21	▲ (1)	88	
Selic (% a.a)	9,00	9,00	9,00	▲ (10)	116		9,00	9,00	9,00	▲ (9)	109	
IGP-M (variação %)	3,83	3,84	3,92	▲ (2)	62		3,70	3,70	3,70	▲ (1)	57	
IPCA Administrados (variação %)	3,50	3,50	3,50	▲ (23)	61		3,50	3,50	3,50	▲ (42)	57	
Conta corrente (US\$ bilhões)	-45,60	-45,80	-45,25	▲ (1)	20		-48,30	-48,30	-47,75	▲ (2)	16	
Balança comercial (US\$ bilhões)	77,64	77,82	80,00	▲ (2)	17		77,00	80,00	80,11	▲ (2)	14	
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	79,41	80,00	79,41	▼ (1)	20		79,00	80,00	80,00	▲ (3)	17	
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	68,35	68,38	68,38	▲ (2)	25		70,39	69,90	70,20	▲ (1)	23	
Resultado primário (% do PIB)	-0,50	-0,60	-0,55	▲ (1)	37		-0,45	-0,50	-0,41	▲ (1)	30	
Resultado nominal (% do PIB)	-6,00	-6,00	-6,00	▲ (5)	25		-5,85	-5,90	-6,00	▼ (1)	21	

Mediana - Agregado	jul/2024						ago/2024					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis
IPCA (variação %)	0,15	0,23	0,28	▲ (6)	146	0,28	0,10	0,11	0,15	▲ (2)	146	0,15
Câmbio (R\$/US\$)	5,27	5,40	5,45	▲ (6)	118	5,49	5,25	5,35	5,40	▲ (1)	118	5,44
Selic (% a.a)	-	-	-	-	-	-	10,50	10,50	10,50	▲ (5)	138	10,50
IGP-M (variação %)	0,31	0,36	0,44	▲ (3)	73	0,44	0,28	0,29	0,34	▲ (1)	72	0,35

Mediana - Agregado	set/2024							Infl. 12 m suav.						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis		Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	
IPCA (variação %)	0,19	0,19	0,20	▲ (1)	146	0,19		3,58	3,68	3,74	▲ (2)	129	3,75	
Câmbio (R\$/US\$)	5,23	5,30	5,37	▲ (1)	118	5,40								
Selic (% a.a)	10,50	10,50	10,50	= (5)	138	10,50								
IGP-M (variação %)	0,40	0,39	0,39	= (3)	71	0,39		4,28	4,17	4,27	▲ (1)	63	4,28	

Fonte: Banco Central do Brasil.

Disponível em: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>. Acesso em: 22/07/2024.

3.1.4 Resumo do Cenário Econômico pelo Comitê de Investimentos da FUNSERV

A respeito da política monetária, no Cenário Econômico referente ao mês de Junho conforme o Boletim Focus a Selic Final 2024 prevê em 10,50% estabilizado, e para 2025, está em 9,50% estabilizou. O COPOM decidiu manter a taxa de juros para 10,50% a.a. na última reunião realizada nos dias 18 e 19 de junho. A respeito da inflação, o IPCA avançou 0,21% (M/M) em Junho, desacelerando em relação ao avanço de 0,46% observado no mês anterior, o índice acumulou alta de 4,23% em 12 meses. A expectativa é de que o IPCA seja de: Julho: 0,28%, Agosto: 0,15%, Setembro 0,20%. Na reunião do FOMC de junho, ele manteve os juros inalterados no intervalo de (5,25% - 5,50%), em linha ao consenso, no cenário global. Em Junho, a confiança teve predomínio positivo. Destaque para a confiança do consumidor (-4,3 para 2,1 M/M). Nos dados da economia real, houve números favoráveis em maio, com destaque para taxa de desemprego, recuando de 7,5% para 7,1%. O presidente do FED, Jerome Powell, assumiu uma postura bastante moderada, transparecendo a necessidade de manter a cautela diante de um quadro de atividade ainda forte, mercado de trabalho robusto, um pouco mais equilibrado e de uma inflação que acomoda, mas que segue em patamar elevado. Na China houve crescimento em 33 das 41 principais indústrias. Enquanto as vendas no varejo na China aumentaram, de 2,3% em março para 3,7% (A/A) em maio, número acima das estimativas do mercado (3,0%). Quanto a diversificação de investimentos, a decisão do Comitê foi diversificar a carteira no primeiro momento em renda variável a escolha foi para aplicação em S&P 500, conforme detalhado neste Parecer.

3.2 Evolução da Execução Orçamentária do RPPS

Segue em anexo (ANEXO II) o balancete analítico da Receita Orçamentária Maio de 2024 que demonstra que todas as contribuições dos servidores foram repassadas de acordo com a legislação vigente e as despesas com pagamento de benefícios e despesas de administração foram devidamente contabilizadas.

Os rendimentos das aplicações financeiras são lançados em Variação Patrimonial Aumentativa e, as desvalorizações, como Variação Patrimonial Diminutiva, sendo que só é lançada a receita patrimonial orçamentária quando o resgate do investimento é efetivado. Ocorreram resgates parciais dos fundos abaixo relacionados, destinados ao pagamento de benefícios previdenciários e custeio administrativo, bem como migrações detalhadas nas análises das APRs, os quais geraram receita orçamentária:

ATIVO	Plano/Fundo Banco/Ag/Conta	Receita Orçamentária sobre Resgates
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CNPJ: 13.077.418/0001-49	Reserva Administrativa BB/2923-8/55.338-7	R\$57.691,51
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CNPJ: 13.077.418/0001-49	Conta Vinculada BB/2923-8/58.211-5	R\$1.592,78
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CNPJ: 13.077.418/0001-49	Fundo Previdenciário BB/2923-8/58.669-2	R\$1.536.452,20
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CNPJ: 13.077.418/0001-49	CONSOLIDADO	R\$ 1.595.736,49
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 CNPJ: 17.098.794/0001-70	Fundo Previdenciário CEF/0356/006.063-4	R\$8.850,00
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 CNPJ: 17.098.794/0001-70	Fundo de Reserva CEF/0356/006.002-2	R\$8.850,00
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 CNPJ: 17.098.794/0001-70	CONSOLIDADO	R\$17.700,00
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CNPJ: 13.077.415/0001-05	Conta Vinculada BB/2923-8/58.211-5	R\$7.264,86
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CNPJ: 13.077.415/0001-05	Fundo Previdenciário BB/2923-8/58.669-2	R\$2.964,25
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES CNPJ: 13.077.415/0001-05	CONSOLIDADO	R\$ 10.229,11

Dessa forma, o total de receita orçamentária gerada no mês de Junho/2024, decorrente dos resgates dos rendimentos de valores mobiliários totalizou R\$1.623.665,60 (um milhão, seiscentos e vinte e três mil, seiscentos e sessenta e cinco reais e sessenta centavos). Este procedimento é adotado atendendo as regras do Manual de Contabilidade Aplicada ao Setor Público – MCASP/STN(1) e Tribunal de Contas do Estado de São Paulo.

⁽¹⁾ Regulamentações: Portaria Conjunta STN/SOF nº 06, de 18 de dezembro de 2018, Portaria Conjunta STN/SPREV nº 07, de 18 de dezembro de 2018 e Portaria STN nº 877, de 18 de dezembro de 2018.

3.3 Análise da Carteira de Investimentos

3.3.1 Enquadramento da Carteira Consolidada de Investimentos na Resolução CMN nº 4.963/2021 e Política de Investimentos

Ao analisar o enquadramento segundo os limites permitidos da Resolução e Política de Investimentos, verifica-se que todos estão enquadrados.

Tipo de Ativo	Enquadramento Resolução CMN Nº 4.963/2021	Enquadramento Política de Investimentos 2024
Renda Fixa	Enquadrado	Enquadrado
Renda Variável e Investimento no Exterior	Enquadrado	Enquadrado
Enquadramento por Gestor de Recursos	Enquadrado	Enquadrado



A aplicação em um mesmo fundo de investimento não excede a 20% (vinte por cento) das aplicações da Funserv e o total das aplicações da Funserv em um mesmo fundo de investimento estão abaixo do limite de 15% (quinze por cento) do patrimônio líquido do fundo, conforme Art. 18 e 19 da Res. CMN nº 4.963/2021. No período em análise, verifica-se que a distribuição, por segmento, se encontra da seguinte forma:

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Junho / 2024)							
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	1.055.335.987,38	39,77%	10,00%	60,00%	100,00%	1.598.364.129,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	108.576.472,99	4,09%	0,00%	3,00%	90,00%	2.279.753.632,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.388.330.105,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	714.968.243,91	26,94%	2,00%	3,00%	65,00%	1.009.936.831,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.724.905.075,87
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.685.005,84
Total Renda Fixa	100,00%	1.878.880.704,28	70,80%	12,00%	66,00%	415,00%	



RENDA FIXA	1.878.880.704,28
RENDA VARIÁVEL	348.956.482,61
EXTERIOR	167.432.730,54
ESTRUTURADOS	255.970.199,29
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.460.000,00

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2024)							
Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	348.956.482,61	13,15%	0,00%	18,20%	35,00%	579.838.558,24
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	928.795.040,85
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	255.970.199,29	9,65%	0,00%	9,50%	10,00%	9.399.812,38
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.685.005,84
Artigo 11º	5,00%	2.460.000,00	0,09%	0,00%	0,30%	5,00%	130.225.005,84
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	607.386.681,90	22,89%	0,00%	28,00%	90,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	125.930.684,37	4,75%	0,00%	4,30%	10,00%	139.439.327,30
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	41.502.046,17	1,56%	0,00%	1,70%	10,00%	223.667.965,50
Total Exterior	10,00%	167.432.730,54	6,31%	0,00%	6,00%	20,00%	

3.3.2 Rentabilidade Mensal por Segmento –Junho/2024

Considerando os retornos apresentados pelos fundos de investimentos, podemos identificar que todos estão dentro do contexto do mercado financeiro, considerando o cenário econômico atual, tanto em âmbito nacional como global, bem como os riscos atrelados a eles.

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2024								FUNDOS DE RENDA FIXA	
Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês	
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.177.147,06	0,00	0,00	11.306.394,81	129.247,75	1,16%	1,16%	0,48%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.538.972,79	0,00	0,00	3.579.879,90	40.907,11	1,16%	1,16%	0,48%	
TÍTULOS PÚBLICOS	1.046.288.128,46	0,00	0,00	1.055.335.987,38	9.047.858,92	0,86%	-	-	
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	125.028.387,62	0,00	0,00	126.060.190,68	1.031.803,06	0,83%	0,83%	0,02%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	472.986.929,87	156.330.341,16	44.959.273,87	588.670.425,00	4.312.427,84	0,69%	0,79%	0,02%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.712.929,67	0,00	2.485.530,55	237.628,23	10.229,11	0,38%	0,71%	0,01%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	93.489.971,20	17.700,00	0,00	93.690.198,28	182.527,08	0,20%	0,20%	0,98%	
Total Renda Fixa	1.755.222.466,67	156.348.041,16	47.444.804,42	1.878.880.704,28	14.755.000,87	0,79%		0,14%	

Conforme quadro acima, os fundos de investimentos classificados como renda fixa, representam um montante de R\$1.878.880.704,28 (um bilhão, oitocentos e setenta e oito milhões, oitocentos e oitenta mil, setecentos e quatro reais e vinte e oito centavos), apresentaram no mês um retorno positivo de R\$14.755.000,87 (quatorze milhões, setecentos e cinquenta e cinco mil e oitenta e sete centavos), o que corresponde ao retorno de 0,79 %. A rentabilidade dos fundos de renda fixa acompanharam os principais índices do mercado, a saber: CDI: 0,79%; IDkA IPCA 2A: 0,18% e IPCA: 0,21%.

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2024					FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL			
Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.351.700,00	0,00	17.700,00	2.460.000,00	126.000,00	5,36%	5,40%	9,73%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	124.493.534,62	0,00	0,00	129.427.737,36	4.934.202,74	3,96%	3,96%	2,95%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	54.862.923,99	0,00	0,00	57.027.274,25	2.164.350,26	3,95%	3,95%	3,30%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	121.792.050,80	0,00	0,00	126.542.461,93	4.750.411,13	3,90%	3,90%	2,97%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	35.465.412,20	0,00	0,00	36.137.773,12	672.360,92	1,90%	1,90%	5,03%
ITAÚ DUNAMIS FI AÇÕES	56.942.334,75	0,00	0,00	57.967.105,08	1.024.770,33	1,80%	1,80%	5,15%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	35.781.948,07	0,00	0,00	36.331.135,44	549.187,37	1,53%	1,53%	6,32%
BRANCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	26.976.663,77	0,00	0,00	27.389.829,80	413.166,03	1,53%	1,53%	5,86%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	46.032.921,51	0,00	0,00	46.542.765,52	509.844,01	1,11%	1,11%	6,26%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	34.070.853,11	0,00	0,00	34.411.175,31	340.322,20	1,00%	1,00%	6,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FI AÇÕES	8.275.518,21	0,00	0,00	8.343.103,88	67.585,67	0,82%	0,82%	6,84%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FI AÇÕES	1.709.567,80	0,00	0,00	1.715.996,40	6.428,60	0,38%	0,38%	6,71%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	42.136.530,57	0,00	0,00	42.090.333,41	-46.197,16	-0,11%	-0,11%	8,59%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.001.693,22	0,00	0,00	999.990,40	-1.702,82	-0,17%	-0,17%	7,78%
BRANCO SELECTION FIC AÇÕES	60.329.923,24	0,00	59.896.958,49	0,00	-432.964,75	-0,72%	-0,13%	7,28%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	63.818.194,65	0,00	63.117.596,97	0,00	-700.597,68	-1,10%	1,49%	5,74%
Total Renda Variável	716.041.770,51	0,00	123.032.255,46	607.386.681,90	14.377.166,85	2,01%		4,61%

Os fundos de investimentos classificados como renda variável, investimentos estruturados e fundos imobiliários, indicados no quadro acima, representam um montante de R\$607.386.681,90 (seiscentos e sete milhões, trezentos e oitenta e seis mil, seiscentos e oitenta e um reais e noventa centavos), apresentaram no mês um retorno positivo de R\$14.377.166,85 (quatorze milhões, trezentos e setenta e sete mil, cento e sessenta e seis reais e oitenta e cinco centavos), o que representou resultado de 2,01%. A rentabilidade dos fundos de renda variável acompanharam o mercado, visto que o Ibovespa, principal índice da bolsa brasileira, teve 1,48% o S&P500®, benchmark dos fundos multimercado, 3,47%, o IFIX, índice de fundos de Investimento Imobiliário, retorno de -1,04%.

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Junho / 2024)						FUNDOS EXTERIOR		
Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	30.454.485,28	0,00	0,00	34.332.086,13	3.877.600,85	12,73%	12,73%	8,26%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	40.760.460,95	0,00	0,00	45.067.279,66	4.306.818,71	10,57%	10,57%	6,15%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6.128.032,79	0,00	0,00	6.772.933,56	644.900,77	10,52%	10,52%	7,40%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.491.804,04	0,00	0,00	7.169.960,04	678.156,00	10,45%	10,45%	6,55%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	35.334.334,14	0,00	0,00	38.316.762,89	2.982.428,75	8,44%	8,44%	5,69%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	33.744.784,11	0,00	0,00	35.773.708,26	2.028.924,15	6,01%	6,01%	6,58%
Total Exterior	152.913.901,31	0,00	0,00	167.432.730,54	14.518.829,23	9,49%		6,64%

O quadro acima evidencia os fundos de investimentos classificados como exterior, os quais representam um montante de R\$167.432.730,54 (cento e sessenta e sete milhões, quatrocentos e trinta e dois mil, setecentos e trinta reais e cinquenta e quatro centavos), apresentaram no período



um retorno positivo de R\$14.518.829,23 (quatorze milhões, quinhentos e dezoito mil, oitocentos e vinte e nove reais e vinte e três centavos), o que representou resultado positivo de 9,49%.

No mesmo período, os principais índices de investimento no exterior apresentaram os seguintes resultados: Global BDRX: 12,79%, MSCI World: 8,10%.

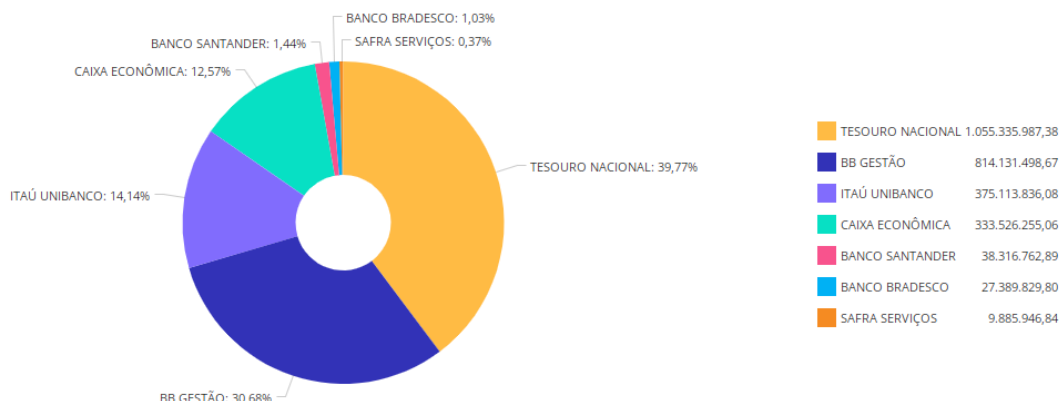
	Renda Fixa		Renda Variável		Investimento no Exterior		META (IPCA + 5,26%a.a.)	
	Mensal	Proporção	Mensal	Proporção	Mensal	Proporção	Mensal	Acumulado
jan/24	1,03%	67,41%	-2,03%	26,94%	2,36%	5,65%	0,87%	0,87%
fev/24	0,93%	68,58%	3,03%	25,68%	5,35%	5,74%	1,22%	2,10%
mar/24	0,97%	68,58%	1,06%	25,68%	3,86%	5,74%	0,57%	2,68%
abr/24	0,75%	69,35%	-3,69%	25,13%	0,31%	5,52%	0,83%	3,53%
mai/24	0,90%	69,16%	0,11%	25,34%	4,90%	5,50%	0,89%	3,60%
jun/24	0,79%	68,20%	2,01%	26,49%	9,49%	5,30%	0,62%	4,18%
Principais Indicadores - Por Segmento - Acumulado do Ano 2024								
RENDA FIXA - 2024			RENDA VARIÁVEL - 2024		INVESTIMENTO EXTERIOR - 2024			
CDI	5,22%		IBOV	-7,66%	GBL BDRX		41,07%	
IPCA	2,48%		SMLL	-14,85%	S&P500		14,48%	
IRF-M 1	4,51%		IBX-50	-6,12%	MSCI World		27,24%	
IRF-M 1+	0,22%		IBX	-7,20%	MSCI ACWI		26,67%	
IRF-M	1,51%		ISE	-10,14%				
IDkA Pré 2A	1,33%		IMOB	-16,84%				
IDkA IPCA 2A	3,21%		ICON	-14,03%				
IMA-B 5	3,32%		IDIV	-3,41%				
IMA-B 5+	-5,04%		S&P500	14,48%				
IMA B	-1,10%		IFIX	1,08%				
IMA GERAL	2,42%							

3.3.3 Distribuição por Sub-segmento.

Ao analisar a distribuição da carteira de investimentos do mês em referência, podemos destacar que a atual distribuição corresponde ao planejamento da FUNSERV, conforme previsto na política de investimentos, e efetivamente busca o entendimento da análise de cenário econômico. Segue quadro de Distribuição da Carteira de Investimentos:



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



Comparativo: Posição em Carteira x Estudo ALM de Dezembro/2021

PLANO FINANCEIRO (FUNDO DE RESERVA)									
ALOCÇÃO INDICADA PELO ESTUDO ALM CONCLUÍDO EM NOVEMBRO/2021									
MÉDIO PRAZO						Saldo Set/2021:	R\$	645.601.528,64	
Ano Vencimento	2026	2028	2030/2032	2035	2040	2045	2050	2055	
% Alocação	7,21%	6,96%	6,75%	5,83%	4,68%	3,59%	2,67%	4,92%	
Valor Alocado	48.811.079,42	47.119.832,93	45.654.421,78	39.480.732,77	31.686.775,43	24.303.193,24	18.084.580,15	33.280.978,60	
Qt.	12.641	12.086	11.592	9.719	7.811	5.871	4.404	7.966	
PU	3.861,34	3.898,79	3.938,36	4.062,20	4.056,84	4.139,77	4.106,22	4.177,88	
Taxa	5,30%	5,30%	5,29%	5,29%	5,31%	5,33%	5,35%	5,36%	
% Alocação Cumulativo	42,61%	35,40%	28,44%	21,69%	15,86%	11,18%	7,59%	4,92%	
LONGO E LONGUÍSSIMO PRAZO						Saldo Set/2021:	R\$	645.601.528,64	
Ano Vencimento	2026	2028	2030/2032	2035	2040	2045	2050	2055	
% Alocação	1,79%	1,72%	1,67%	1,45%	1,16%	0,89%	0,66%	1,22%	
Valor Alocado	12.088.593,71	11.669.734,91	11.306.799,88	9.777.815,42	7.847.540,27	6.018.927,65	4.478.834,35	8.242.361,52	
Qt.	3.131	2.993	2.871	2.407	1.934	1.454	1.091	1.973	
PU	3.861,34	3.898,79	3.938,36	4.062,20	4.056,84	4.139,77	4.106,22	4.177,88	
Taxa	5,30%	5,30%	5,29%	5,29%	5,31%	5,33%	5,35%	5,36%	
% Alocação Cumulativo	10,56%	8,77%	7,05%	5,38%	3,93%	2,77%	1,88%	1,22%	
ALOCÇÃO INDICADA PELO ESTUDO ALM CONCLUÍDO EM NOVEMBRO/2021						Saldo Set/2021:	R\$	645.601.528,64	
Ano Vencimento	2026	2028	2030/2032	2035	2040	2045	2050	2055	
% Alocação	9,00%	8,68%	8,42%	7,28%	5,84%	4,48%	3,33%	6,14%	
Valor Alocado	60.899.673,13	58.789.567,84	56.961.221,66	49.258.548,19	39.534.315,70	30.322.120,89	22.563.414,50	41.523.340,12	
Qt.	15.772	15.079	14.463	12.126	9.745	7.325	5.495	9.939	
PU	3.861,34	3.898,79	3.938,36	4.062,20	4.056,84	4.139,77	4.106,22	4.177,88	
Taxa	5,30%	5,30%	5,29%	5,29%	5,31%	5,33%	5,35%	5,36%	
% Alocação Cumulativo	53,17%	44,17%	35,49%	27,07%	19,79%	13,95%	9,47%	6,14%	
VALOR APLICADOS EM TPF						Saldo Jun/2024:	R\$	346.733.015,94	
Ano Vencimento	Até 2026	2028	2030/2032	2035	2040	2045	2050	2055	
% Alocação	29,86%	0,00%	34,44%	13,17%	13,15%	9,38%	0,00%	0,00%	
Qt.	42.085	0	27.153	10.343	10.225	7.373	0	0	
Valor Total Aplicado	R\$ 94.999.970,65	R\$ -	R\$ 109.999.144,49	R\$ 41.195.661,81	R\$ 39.994.357,14	R\$ 30.399.600,93	R\$ -	R\$ -	
Valor Total Atualizado	R\$ 103.547.526,86	R\$ -	R\$ 119.406.644,83	R\$ 45.678.793,36	R\$ 45.592.599,41	R\$ 32.507.451,48	R\$ -	R\$ -	
% Alocação Cumulativo	100,00%	70,14%	70,14%	35,70%	22,52%	9,38%	0,00%	0,00%	
ANÁLISE DE POSSIBILIDADE DE NOVAS APLICAÇÕES									
Ano Vencimento	Até 2026	2028	2030/2032	2035	2040	2045	2050	2055	
R\$ Disponível	-R\$ 72.341.555,42	R\$ 30.096.425,78	-R\$ 90.211.724,89	-R\$ 20.436.629,80	-R\$ 25.343.391,28	-R\$ 16.973.812,37	R\$ 11.546.209,43	R\$ 21.289.407,18	
R\$ Disponível (Acum)	-R\$ 162.375.071,36	-R\$ 90.033.515,94	-R\$ 120.129.941,72	-R\$ 29.918.216,84	-R\$ 9.481.587,04	R\$ 15.861.804,24	R\$ 32.835.616,61	R\$ 21.289.407,18	



Sugestão de Alocação – Estudo ALM – Junho/2022

Fundo Financeiro (Fundo Reserva)

Tabela 11 – Simulação da Carteira Ótima							
	Qnt.	P.U Utilizado	Taxa Utilizada	Duração (meses) (1)	R\$	(2)	Duração (1) x (2)
LFT 2025	4000	11.665,586303	0,1193%	33,89285367	46.662.345,21	7,00%	2,372120
LFT 2026	4000	11.636,454748	0,1544%	45,96296567	46.545.818,99	6,98%	3,208859
LFT 2027	5000	11.608,388229	0,1732%	57,98478817	58.041.941,15	8,71%	5,047984
LFT 2028	5000	11.588,104976	0,1734%	70,19973217	57.940.524,88	8,69%	6,100703
NTN-B 2032	27.362	4.139,804099	5,5967%	94,153721	113.273.319,76	16,99%	15,996578
NTN-B 2035	10.047	4.048,760797	5,7600%	112,6323448	40.677.899,73	6,10%	6,872007
NTN-B 2040	10.225	4.078,602241	5,8700%	136,9850353	41.703.707,91	6,26%	8,568598
S&P	-	-	-	18,15	55.652.164,34	8,35%	1,514937
IDKa 2	-	-	-	23,53	206.213.906,77	30,93%	7,277829
Fundo de Reserva Previdenciária: Patrimônio em 30/04/2022					666.711.628,73		56,959616

Fundo Previdenciário

Vencimento	2040	2040	2045	2050	2055	2060
P.U Limite	R\$ 4.100,370	R\$ 4.044,112	R\$ 4.064,611	R\$ 4.141,746	R\$ 4.087,150	R\$ 4.135,721
Quantidade	15046	3890	48797	60111	62132	53448
Taxa Utilizada	5,82%	5,95%	5,80%	5,78%	5,79%	5,82%
Duration NTN-B (anos)		14,2				
Duration Passivo (anos)		23,7				

3.3.4 Retorno da Total da Carteira x Meta Atuarial

No mês de Junho de 2024, o resultado obtido foi um retorno de 1,57%, correspondente ao montante de R\$43.593.305,44 (quarenta e três milhões, quinhentos e noventa e três mil, trezentos e cinco reais e quarenta e quatro centavos), sendo o retorno de 0,79% no total de renda fixa, retorno de 2,01% no total de renda variável e retorno positivo de 9,49% no total de investimento no exterior.

Dessa forma, o retorno acumulado no ano representou 5,11% contra a meta atuarial de 5,10%, ou seja, uma distância de 0,01 % do cumprimento da meta para o exercício de 2024.

Dessa forma, até o momento, no acumulado do ano houve um superávit nas aplicações que corresponde ao total de R\$134.285.738,35 (cento e trinta e quatro milhões, duzentos e oitenta e cinco mil, setecentos e trinta e oito reais e trinta e cinco centavos).

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024												
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	2.567.523.344,80	45.095.927,70	48.822.037,76	2.569.922.536,57	6.125.301,83	6.125.301,83	0,23%	0,23%	0,87%	0,87%	26,94%	3,19%
Fevereiro	2.569.922.536,57	58.312.581,69	62.821.601,41	2.610.448.028,88	44.834.512,03	50.959.813,86	1,71%	1,94%	1,22%	2,10%	92,52%	3,53%
Março	2.610.448.028,88	33.594.187,36	44.184.187,36	2.629.918.510,18	30.060.481,30	81.020.295,16	1,14%	3,10%	0,57%	2,68%	115,72%	2,91%
Abril	2.629.918.510,18	40.962.954,53	48.037.406,87	2.608.903.881,39	-13.940.376,45	67.079.918,71	-0,52%	2,57%	0,83%	3,53%	72,58%	3,59%
Mai	2.608.903.881,39	36.565.347,44	51.724.247,54	2.617.357.295,49	23.612.514,20	90.692.432,91	0,89%	3,48%	0,89%	4,46%	78,11%	2,76%
Junho	2.617.357.295,49	155.428.054,88	169.999.188,01	2.646.377.469,80	43.593.305,44	134.285.738,35	1,57%	5,11%	0,62%	5,10%	100,11%	2,52%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

5,11%

5,10%

0 1 2 3 4 5

■ Investimentos ■ IPCA + 5,26% a.a.

3.3.5 Evolução da Reserva Administrativa

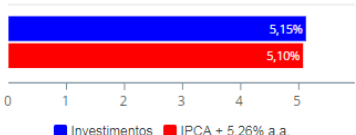
O patrimônio total da Funserv compreende os recursos previdenciários e, a partir de Janeiro de 2024, em função da Lei Municipal nº 12.656, de 29/09/2022, de forma segregada, a carteira dos recursos da Reserva Administrativa.

Conforme quadro que segue, ao final do mês em análise, o saldo dos recursos investidos na reserva administrativa era de R\$7.322.646,92 (sete milhões, trezentos e vinte e dois mil, seiscentos e quarenta e seis reais e noventa e dois centavos), com retorno de R\$57.691,51 (cinquenta e sete mil, seiscentos e noventa e um reais e cinquenta e um centavos), o que representou retorno de 0,79 %.

No acumulado do ano, o retorno é de R\$311.063,23 (trezentos e onze mil, sessenta e três reais e vinte e três centavos), o que representou retorno de 5,15%.

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024												
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	4.141.751,29	1.556.451,93	585.469,58	5.100.623,24	47.889,80	47.889,80	0,94%	0,94%	0,87%	0,87%	107,61%	0,01%
Fevereiro	5.160.623,24	952.000,00	493.550,06	5.663.622,97	44.549,79	92.439,39	0,79%	1,74%	1,22%	2,10%	82,65%	0,01%
Março	5.663.622,97	1.445.000,00	1.144.275,53	6.015.693,44	51.346,00	143.785,39	0,86%	2,61%	0,57%	2,68%	97,43%	0,01%
Abril	6.015.693,44	1.077.000,00	643.436,77	6.501.642,26	52.385,59	196.170,98	0,81%	3,45%	0,83%	3,53%	97,51%	0,01%
Maio	6.501.642,26	794.000,00	532.000,00	6.820.843,00	57.200,74	253.371,72	0,85%	4,32%	0,99%	4,46%	96,98%	0,02%
Junho	6.820.843,00	921.986,28	477.873,87	7.322.646,92	57.691,51	311.063,23	0,79%	5,15%	0,62%	5,10%	100,93%	0,02%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



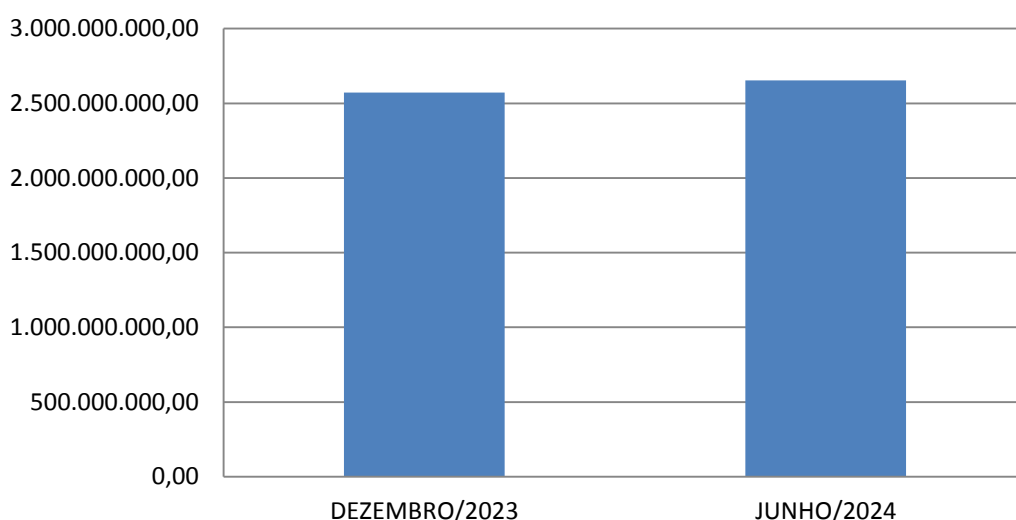
■ Investimentos ■ IPCA + 5,26% a.a.

3.3.6 Evolução Patrimonial

Evolução Patrimonial - CONSOLIDADO		
DEZEMBRO/2023	JUNHO/2024	VARIAÇÃO PATRIMONIAL
2.571.693.190,69	2.653.783.500,57	R\$ 82.090.309,88



Evolução Patrimonial - CONSOLIDADO



Ao final de 2023, a FUNSERV apresentava um patrimônio líquido total, ou seja, somando ativos enquadrados na Res. 4.963/2021 e disponibilidades financeiras, no valor de R\$2.571.693.190,69 (dois bilhões, quinhentos setenta e um milhões, seiscentos e noventa e três mil, cento e noventa reais e sessenta e nove centavos).

No final do mês de Junho de 2024, a FUNSERV apresentou um patrimônio líquido total de R\$2.653.783.500,57 (dois bilhões, seiscentos e cinquenta e três milhões, setecentos e oitenta e três mil, quinhentos reais e cinquenta e sete centavos).

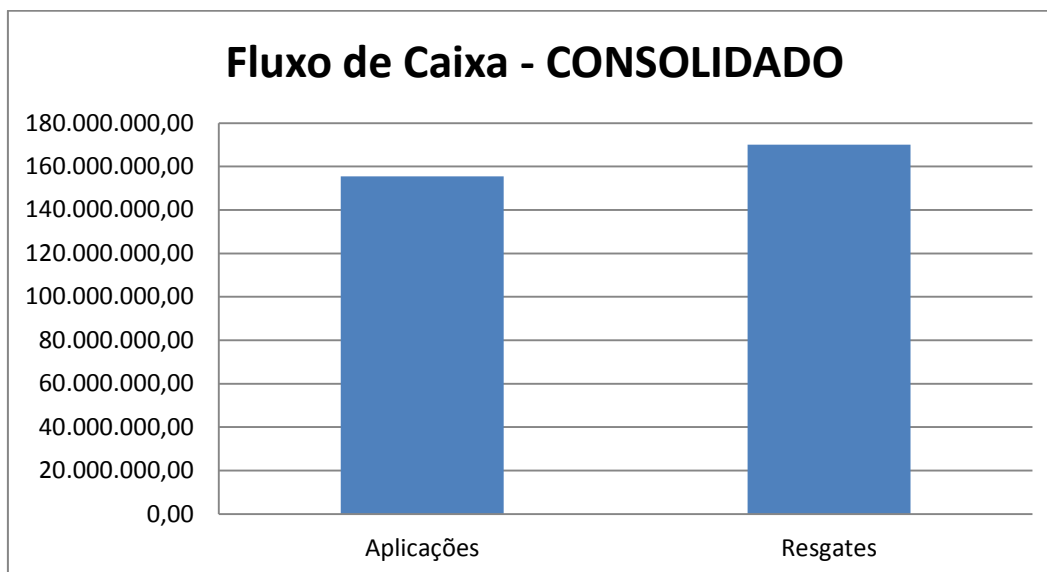
Dessa forma, houve aumento do patrimônio sob gestão da FUNSERV de R\$ R\$82.090.309,88 (oitenta e dois milhões, noventa mil, trezentos e nove reais e oitenta e oito centavos). Este superávit, na carteira de ativos da Funserv no mês de Junho de 2024, decorre dos rendimentos das aplicações financeiras.

O quadro abaixo detalha a evolução patrimonial por segmento de aplicação:

SEGMENTO	DEZEMBRO/2023	JUNHO/2024	VARIAÇÃO
Renda Fixa	R\$ 1.701.962.418,20	R\$ 1.878.880.704,28	R\$ 176.918.286,08
Renda Variável/Estruturados/FII	R\$ 728.076.400,48	R\$ 607.386.681,90	-R\$ 20.689.718,58
Investimentos no Exterior	R\$ 141.626.277,41	R\$ 167.432.730,54	R\$ 5.806.453,13
Disponibilidades Financeiras	R\$ 28.094,60	R\$ 83.383,85	R\$ 55.289,25
Patrimônio Líquido Total	R\$ 2.571.693.190,69	R\$ 2.653.783.500,57	R\$ 82.090.309,88

3.3.7 Fluxo de Caixa dos Investimentos

Fluxo de Caixa - CONSOLIDADO		
Aplicações	Resgates	Saldo
155.426.054,88	R\$ 169.999.186,01	-R\$ 14.573.131,13



3.3.8 Análise das Autorizações de Aplicação e Resgate – APR

No mês de Junho de 2024 foram emitidas 54 (cinquenta e quatro) APRs, numeradas, sequencialmente, de 266 a 319, correspondentes ao ano de 2024. As APRs se encontram publicadas no site da FUNSERV (<https://funservsorocaba.sp.gov.br/administracao-e-planejamento/movimentacoes-financeiras/2024>) e as vias assinadas, mantidas em arquivo, à disposição do Comitê, bem como dos demais órgãos internos e externos de fiscalização e controle.

Em análise, verificamos que as aplicações e resgates ocorreram em consonância com as propostas do Comitê de Investimentos, em reunião realizada em 23/04/2024, as quais foram aprovadas pelo Conselho Administrativo, em reunião realizada em 30/04/2024.

Ademais, verificamos que respeitaram também as definições para todo o exercício financeiro de 2024, conforme proposto pelo Comitê de Investimentos, em reunião realizada em 26/01/2024, as quais foram aprovadas pelo Conselho Administrativo, em reunião realizada em 30/01/2024, conforme resumo que segue:

- a)** Aplicação dos rendimentos pagos pelo fundo imobiliário CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 – CNPJ: 17.098.794/0001-70.

ATIVO: CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 – CNPJ: 17.098.794/0001-70:			
Data	Nº da APR	Tipo de Operação	Valor (R\$)
10/06/2024	278/2024	Amortização	8.850,00
10/06/2024	279/2024	Amortização	8.850,00
TOTAL			17.700,00

ATIVO: CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP - CNPJ: 14.386.926/0001-71			
Data	Nº da APR	Tipo de Operação	Valor (R\$)
13/06/2024	290/2024	Aplicação	8.850,00
13/06/2024	291/2024	Aplicação	8.850,00
TOTAL			17.700,00

a) Resgate do valor total dos fundos devido a desenquadramento:

ATIVO: BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES - CNPJ: 03.660.879/0001-96			
Data	Nº da APR	Tipo de Operação	Valor (R\$)
11/06/2024	281/2024	Resgate	48.494.958,42
11/06/2024	282/2024	Resgate	11.402.000,07
TOTAL			134.615.653,37

ATIVO: CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES - CNPJ: 13.058.816/0001-18			
Data	Nº da APR	Tipo de Operação	Valor (R\$)
12/06/2024	283/2024	Resgate	26.094.200,58
12/06/2024	284/2024	Resgate	37.023.396,39
TOTAL			137.836.291,85

d) Recursos das contribuições previdenciárias que são utilizados para pagamento de benefícios previdenciários e despesas de administração do Fundo Financeiro, dos inativos de responsabilidades dos entes e do Fundo Previdenciário:

ATIVO: BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO- CNPJ: 13.077.415/0001-05			
Data	Nº da APR	Tipo de Operação	Valor (R\$)
07/06/2024	277/2024	Resgate	1.655.530,55
27/06/2024	311/2024	Resgate	780.000,00
28/06/2024	318/2024	Resgate	50.000,00
TOTAL			74.768.694,88

ATIVO: BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP - CNPJ:13.077.418/0001-49			
Data	Nº da APR	Tipo de Operação	Valor (R\$)
04/06/2024	270/2024	Aplicação	106.000,00
04/06/2024	272/2024	Aplicação	8.230.000,00
07/06/2024	274/2024	Aplicação	703.986,28
07/06/2024	276/2024	Aplicação	16.290.000,00
12/06/2024	286/2024	Aplicação	26.128.000,00
12/06/2024	289/2024	Aplicação	37.023.396,39
18/06/2024	295/2024	Aplicação	11.402.000,07
18/06/2024	296/2024	Aplicação	48.494.958,42
20/06/2024	301/2024	Aplicação	20.000,00
21/06/2024	302/2024	Aplicação	5.055.000,00
21/06/2024	303/2024	Aplicação	85.000,00
21/06/2024	304/2024	Aplicação	25.000,00
27/06/2024	312/2024	Aplicação	1.030.000,00
27/06/2024	314/2024	Aplicação	280.000,00
27/06/2024	314/2024	Aplicação	280.000,00
28/06/2024	317/2024	Aplicação	67.000,00
28/06/2024	319/2024	Aplicação	1.390.000,00
TOTAL			244.252.141,36

03/06/2024	266/2024	Resgate	12.000,00
03/06/2024	267/2024	Resgate	38.000,00

03/06/2024	268/2024	Resgate	2.310.000,00
04/06/2024	269/2024	Resgate	42.000,00
04/06/2024	271/2024	Resgate	30.000,00
05/06/2024	273/2024	Resgate	2.167.000,00
07/06/2024	275/2024	Resgate	300.000,00
10/06/2024	280/2024	Resgate	35.000,00
12/06/2024	285/2024	Resgate	5.235.000,00
12/06/2024	287/2024	Resgate	128.000,00
12/06/2024	288/2024	Resgate	70.000,00
14/06/2024	292/2024	Resgate	24.000,00
17/06/2024	293/2024	Resgate	500,00
17/06/2024	294/2024	Resgate	7.000,00
19/06/2024	297/2024	Resgate	6.000,00
19/06/2024	298/2024	Resgate	40.500,00
20/06/2024	299/2024	Resgate	1.106.400,00
20/06/2024	300/2024	Resgate	6.000,00
24/06/2024	305/2024	Resgate	106.000,00
24/06/2024	306/2024	Resgate	9.000,00
25/06/2024	307/2024	Resgate	7.000,00
27/06/2024	308/2024	Resgate	5.000,00
27/06/2024	309/2024	Resgate	213.873,87
27/06/2024	310/2024	Resgate	23.000,00
27/06/2024	313/2024	Resgate	32.600.000,00
28/06/2024	315/2024	Resgate	418.000,00
28/06/2024	316/2024	Resgate	20.000,00
TOTAL			119.677.968,75

Em se tratando de risco de liquidez da carteira de investimentos da FUNSERV, verifica-se que, ao final do mês de Junho de 2024, 35,17% possuem liquidez e 47,28% possuem carência para resgate. Da parcela com liquidez, destacamos que 15,79% é imediata e 35,17% do total de recursos possuem o prazo de disponibilidade de resgate de até 5 (cinco) dias úteis. O quadro a seguir contém o detalhamento do volume de recurso por prazo de liquidez, destacando ainda aqueles que possuem prazo maior do que 25 (vinte e cinco) dias úteis:

Prazo de Disponibilidade	R\$	%
D+0	808.658.442,19	30,50%
D+1 até D+5	590.230.941,47	22,26%
D+6 até D+10	38.316.762,89	1,45%
D+11 até D+15	42.090.333,41	1,59%
D+16 até D+20	0,00	0,00%
D+21 até D+25	100.721.384,27	3,80%
Acima de D+25	1.071.249.646,31	40,41%
Recursos Acima de D+25	1.071.249.646,31	40,41%
Fundos de Investimento s/ Carência	999.990,40	0,04%
Fundos de Investimento - Carência: 15/08/2024	14.886.274,71	0,56%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/05/2023	0,00	0,00%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/08/2024	168.901.621,91	6,37%

Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/08/2030	45.551.345,22	1,72%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/08/2032	119.406.644,81	4,50%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/05/2035	114.294.939,80	4,31%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/08/2040	108.408.886,69	4,09%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/05/2045	112.097.946,96	4,23%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/08/2050	150.299.761,20	5,67%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/05/2055	63.669.936,83	2,40%
Títulos Públicos - NTN-B - Vcto: 15/08/2060	172.732.297,78	6,52%
TOTAL	2.651.267.510,54	100,00%

Considerando os estudos de ALM, realizados em Dezembro/2021 e Junho/2022, verifica-se que o prazo de disponibilidade dos recursos é compatível com as obrigações presentes e futuras deste RPPS.

Quanto ao risco de crédito, não houve aplicações em fundos de investimentos que possuem em sua carteira ativos de risco de crédito.

No que se refere ao risco de mercado, consideramos a relação risco x retorno observando o indicador de desempenho VaR – Value at Risk, adotado pela FUNSERV na nossa Política de Investimentos.

Retorno Mensal	VaR da Carteira	VaR de RF	VaR de RV	VaR de IE
1,57%	2,52%	0,14%	4,61%	6,64%

O VaR da carteira de investimentos, por segmento, encontra-se em conformidade com sua estratégia de risco de mercado traçada na Política de Investimentos para 2024, no segmento de renda fixa, renda variável e investimento no exterior:

- Segmento de Renda Fixa: 2,65% (dois inteiros e sessenta e cinco centésimos por cento) do valor alocado neste segmento;
- Segmento de Renda Variável: 14,46% (quatorze inteiros e quarenta e seis centésimos por cento) do valor alocado neste segmento, e;
- Segmento de Investimento no Exterior: 15,00% (quinze por cento) do valor alocado neste segmento.

3.4 Análises de novos Fundos de Investimentos para credenciamento

Na reunião do Comitê de Investimentos, realizada em 21/06/2024, não foi analisado novo fundo para credenciamento.

3.5 Propostas de aplicações e migrações:

Para a realização da análise de destinação dos recursos e eventuais migrações foi solicitado aos Bancos que nos enviassem os seus melhores fundos: BTG Pactual S&P 500 Brl FI MM – CNPJ 36.499.594/0001-74 em 12 meses 33,94%, 24 meses 32,45%, 36 meses 18,71%, com taxa administrativa de 0,20%; Safra S&P Reais FICFI MM - em 12 meses 31,66%, 24 meses 27,56%, 36 meses 15,29%, com taxa administrativa de 0,75%; Itaú Private MM S&P 500 Brl FICFI - em 12 meses 33,24%, 24 meses 29,16%, 36 meses 16,56%, com taxa administrativa de 0,80%; Bradesco FICFI MM S&P 500 Mais - em 12 meses 30,92%, 24 meses 25,73%, 36 meses 14,14%, com taxa administrativa de 1,50%; BB Ações Bolsa Americana FIA - em 12 meses 30,86%, 24 meses 25,60%, 36 meses 13,67%, com taxa administrativa de 1,00%; Sicredi – FICFI MM Bolsa Americana LP – CNPJ 24.633.818/0001-00 em 12 meses 33,95%, 24 meses 29,76%, 36 meses 16,99%, com taxa administrativa de 0,30%; FI Caixa Indexa Bolsa Americana MM LP em 12 meses 33,24%, 24 meses 29,15%, 36 meses 16,58%, com taxa administrativa de 0,80%

Realizado assim, um comparativo entre esses bancos, realizado no sistema ComDinheiro, entre 12 e 36 meses , com as informações referentes ao retorno, volatilidade e Sharpe (onde Sharpe é o indicado que representa os riscos, e quanto maior o valor menor o risco) de cada um destes fundos.

O Comitê entendeu pertinente, após a análise dos recursos apresentados que sejam aplicados 12% dos rendimentos que se encontram no BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP CNPJ: 13.077.418/0001-49, onde consta o valor total no Fundo Previdenciário R\$ 157.599.233,66, em Renda Variável Benchmark S&P500, nos 2 fundos mais rentáveis, conforme segue: BTG Pactual S&P 500 Brl FI MM – CNPJ 36.499.594/0001-74 em 12 meses 33,94%, 24 meses 32,45%, 36 meses 18,71%, com taxa administrativa de 0,20%; Sicredi – FICFI MM Bolsa Americana LP – CNPJ 24.633.818/0001-00 em 12 meses 33,95%, 24 meses 29,15%, 36 meses 16,99%, com taxa administrativa de 0,30%.

Conforme analisado o fundo BB Seleção Fatorial FIC Ações – CNPJ 07.882.792/0001-14, o mesmo encontra-se com retornos negativos desde o início do ano, entramos em contato com os gestores do fundo os quais nos passaram que o mesmo teria um rentabilidade positiva após 60 meses.

Conforme avaliado pelo Comitê, migraremos o valor total do BB Seleção Fatorial FIC Ações – CNPJ 07.882.792/0001-14, para o Fundo de Investimento em Participações – FIP, o qual tem apresentado características importantes para a composição de um portfólio equilibrado e rentável. Deixando nossa carteira mais diversificada, com alto potencial de retorno e baixa volatilidade.

Na análise de Títulos Públicos, a proposta é migrar pelo menos metade em 2026 e 2027, pois as taxas indicadas estão 6,57% e 6,56%, acima da nossa meta.

ANÁLISE DE COMPARATIVO DOS FUNDOS – VARIÁVEIS

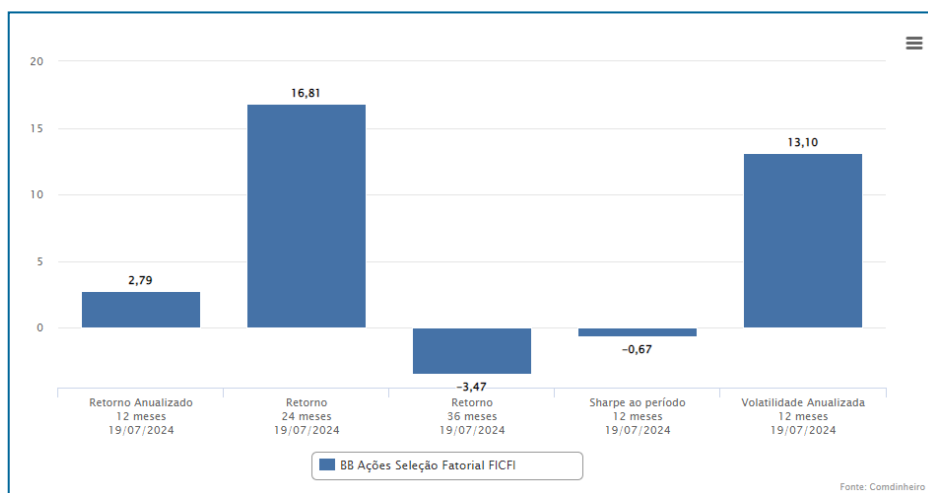
INFORMAÇÕES RETIRADAS DO SISTEMA COMDINHEIRO – 05/07/2024

nome_fundo	Retorno Anualizado 12 meses 05/07/2024	Retorno Anualizado 24 meses 05/07/2024	Retorno Anualizado 36 meses 05/07/2024	Retorno Anualizado 48 meses 05/07/2024	Patrimônio R\$ milhões 05/07/2024	Número Cotistas 05/07/2024	Captação no Dia R\$ milhões 05/07/2024	Resgate no Dia R\$ milhões 05/07/2024	Volatilidade Anualizada 24 meses 05/07/2024	Sharpe ao período 12 meses 05/07/2024
BTG Pactual S&P 500 Brl FI MM	33,94	32,45	18,71	23,41	721,65	5.442,00	0,91	0,85	15,56	2,00
Safra S&P Reais FICFI MM	31,66	27,56	15,29	20,03	333,89	4.184,00	2,37	0,23	15,63	1,80
Itaú Private MM S&P500® Brl FICFI	33,24	29,16	16,56	21,45	1.352,42	800,00	0,02	0,04	15,78	1,94
Bradesco FICFI MM S&P 500 Mais	30,92	25,73	14,14	19,37	198,81	480,00	0,01	0,01	15,88	1,72
Safra S&P Reais Pb FICFI MM	32,72	28,68	16,27	21,03	834,47	103,00	2,38	0,24	15,65	1,90
BB Ações Bolsa Americana FIA	30,86	25,60	13,67	18,91	1.454,63	21.004,00	1,71	54,88	15,18	1,73
Sicredi - FICFI MM Bolsa Americana LP	33,95	29,76	16,99		423,16	13.394,00	5,82	0,48	15,79	2,00
FI Caixa Indexa Bolsa Americana MM LP	33,24	29,15	16,58	21,29	2.030,70	7.730,00	1,61	0,18	15,79	1,93



Migração do valor total de Recursos : BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES

BANCO DO BRASIL							
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES - 07.882.792/0001-14							
MÊS	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	
dez/23	R\$ -	R\$ -	R\$ 40.652.732,95	R\$ 2.016.739,66	5,22%	5,22%	
jan/24	R\$ -	R\$ -	R\$ 38.025.999,75	-R\$ 2.626.733,20	-6,46%	-6,46%	
fev/24	R\$ -	R\$ -	R\$ 38.228.837,62	R\$ 202.837,87	0,53%	0,53%	
mar/24	R\$ -	R\$ -	R\$ 37.623.329,72	-R\$ 605.507,90	-1,58%	-1,58%	
abr/24	R\$ -	R\$ -	R\$ 36.524.576,87	-R\$ 1.098.752,85	-2,92%	-2,92%	
mai/24	R\$ -	R\$ -	R\$ 35.465.412,20	-R\$ 1.059.164,67	-2,90%	-2,90%	
jun/24	R\$ -	R\$ -	R\$ 36.137.773,12	R\$ 672.360,92	1,90%	1,90%	



4. CONCLUSÃO

Em relação às aplicações do RPPS, referente aos recursos de renda fixa, quanto às migrações que visam aquisições de Títulos Públicos Federais, parte dos recursos, se encontra aplicado em fundo referenciado DI (fluxo de caixa), aguardando melhor oportunidade de alocação. Para os vértices médios (IMA-B 5 e IDkA IPCA 2A) entendemos pertinente a manutenção de uma exposição próxima de 10% do total da carteira, atualmente, não há valores aplicados em fundos que possuem estes benchmarks. Já para os vértices de curto prazo, representados pelos fundos DI, em função do aumento na taxa SELIC, entendemos pertinente a manutenção dos recursos aplicados, além dos recursos destinados à posterior aquisição de títulos públicos e dos valores para honrar os compromissos atuais do instituto, pois as despesas com o Fundo Financeiro estão sendo cobertas pelos entes, através da cobertura do déficit, conforme preconiza a Lei 8.336/2007.

O Fundo de Reserva está em fase de Capitalização e do Fundo Previdenciário, atualmente são utilizados apenas 10% dos recursos de contribuição para honrar os compromissos com pagamento de benefícios previdenciários e os 90% restantes estão sendo Capitalizados para honrar pagamentos futuros. Quanto à renda variável, nossa política de investimentos, definida em Dezembro de 2022, previu uma exposição máxima de 35%, pela sua importância como fator de diversificação de portfólio. Neste momento, contudo, com a alta da taxa de juros, pertinente a manutenção dos recursos alocados, com a perspectiva de longo prazo. Neste segmento, ao final de Dezembro de 2023, havia 28,45% de recursos alocados e entendemos que no longo prazo serão os que ajudarão a honrar os compromissos.

No contexto geral da análise proferida e após conferência das APR's de Junho de 2024, por estarem em concordância com o que foi definido em reunião ordinária deste Comitê e aprovadas pelo Conselho Administrativo da Funserv, entendemos que não há indícios ou números que prejudique a aprovação das aplicações dos recursos da FUNSERV mencionadas nesse parecer.

Sem mais,

Gêmina Maria Pires

Membro do Comitê de Investimentos

Jean Michel Mascheto Marins

Membro do Comitê de Investimento

Edgar Aparecido Ferreira da Silva

Membro do Comitê de Investimento

Marco Antonio Leite Massari

Membro do Comitê de Investimento

Gilmar Ezequiel de Souza Oliveira

Membro Suplente do Comitê de
Investimento

Cilsa Regina Guedes Silva

Gestora de Recursos do RPPS

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

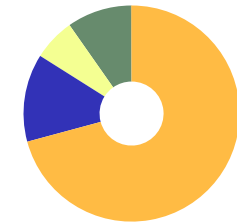
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.055.335.987,38	39,77%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	3.579.879,90	0,13%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	11.306.394,81	0,43%	92	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	93.690.198,28	3,53%	820	2,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	237.628,23	0,01%	1.007	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	588.670.425,00	22,18%	1.148	3,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	126.060.190,68	4,75%	407	2,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	57.027.274,25	2,15%	20.809	3,87%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	36.331.135,44	1,37%	22.759	5,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	36.137.773,12	1,36%	16.298	3,26%	Artigo 8º, Inciso I
BRANCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	27.389.829,80	1,03%	47	11,69%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	34.411.175,31	1,30%	864	6,28%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	42.090.333,41	1,59%	200	5,56%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	57.967.105,08	2,18%	11.978	4,26%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	46.542.765,52	1,75%	33	12,00%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	8.343.103,88	0,31%	16	7,23%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	999.990,40	0,04%	3.097	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.715.996,40	0,06%	112	1,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	45.067.279,66	1,70%	110	2,88%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	35.773.708,26	1,35%	42	8,85%	Artigo 9º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	6.772.933,56	0,26%	59	9,99%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	38.316.762,89	1,44%	3.746	5,39%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	34.332.086,13	1,29%	448	1,25%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.169.960,04	0,27%	326	0,93%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	126.542.461,93	4,77%	7.627	6,42%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	129.427.737,36	4,88%	599	9,76%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.460.000,00	0,09%		1,73%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.653.700.116,72				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			83.383,85	Artigo 6º			
PL Total			2.653.783.500,57				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	1.055.335.987,38	39,77%	10,00%	60,00%	100,00%	1.598.364.129,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	108.576.472,99	4,09%	0,00%	3,00%	90,00%	2.279.753.632,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.388.330.105,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	714.968.243,91	26,94%	2,00%	3,00%	65,00%	1.009.936.831,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.724.905.075,87
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.685.005,84
Total Renda Fixa	100,00%	1.878.880.704,28	70,80%	12,00%	66,00%	415,00%	

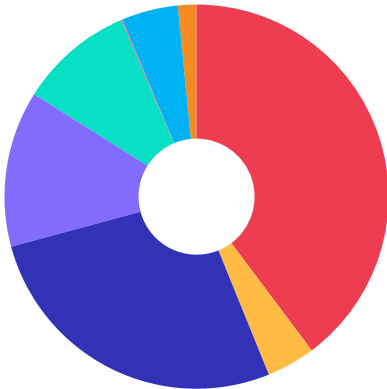


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	348.956.482,61	13,15%	0,00%	18,20%	35,00%	579.838.558,24
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	928.795.040,85
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	255.970.199,29	9,65%	0,00%	9,50%	10,00%	9.399.812,38
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.685.005,84
Artigo 11º	5,00%	2.460.000,00	0,09%	0,00%	0,30%	5,00%	130.225.005,84
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	607.386.681,90	22,89%	0,00%	28,00%	90,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	125.930.684,37	4,75%	0,00%	4,30%	10,00%	139.439.327,30
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	41.502.046,17	1,56%	0,00%	1,70%	10,00%	223.867.965,50
Total Exterior	10,00%	167.432.730,54	6,31%	0,00%	6,00%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	1.055.335.987,38	39,77	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	108.576.472,99	4,09	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	714.968.243,91	26,94	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	348.956.482,61	13,15	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	125.930.684,37	4,75	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	41.502.046,17	1,56	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	255.970.199,29	9,65	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.460.000,00	0,09	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	1.055.335.987,38	39,77	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	814.131.498,67	30,68	-
CAIXA DTVM	333.526.255,06	12,57	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	320.227.966,68	12,07	-
ITAU DTVM	54.885.869,40	2,07	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	38.316.762,89	1,44	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	27.389.829,80	1,03	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	9.885.946,84	0,37	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	2,96%	0,86%	2,96%	8,08%	18,05%	0,98%	1,71%

CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83%	5,49%	2,62%	5,49%	12,54%	27,99%	0,02%	0,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	5,24%	2,53%	5,24%	11,71%	26,83%	0,02%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,71%	2,27%	4,71%	10,59%	24,34%	0,01%	0,06%

IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,71%	2,85%	5,71%	11,30%	21,33%	0,48%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,70%	2,85%	5,70%	11,31%	21,59%	0,48%	0,87%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,73%	39,52%	21,34%	39,52%	52,18%	72,57%	8,26%	13,94%
Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1,11%	-10,19%	-6,16%	-10,19%	-0,28%	18,71%	6,26%	13,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	0,82%	-10,10%	-7,39%	-10,10%	-3,02%	12,38%	6,84%	14,65%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,11%	-6,86%	-7,64%	-6,86%	4,76%	26,67%	8,59%	15,61%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	0,38%	-8,87%	-7,45%	-8,87%	1,55%	15,85%	6,71%	14,65%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1,00%	-9,38%	-6,70%	-9,38%	-1,76%	13,42%	6,71%	14,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,80%	-0,81%	-2,22%	-0,81%	12,30%	27,30%	5,15%	12,90%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,54%	-12,65%	-6,03%	-12,65%	-0,46%	5,66%	6,32%	14,36%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
BRDESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1,53%	-7,74%	-3,29%	-7,74%	4,89%	25,82%	5,86%	13,71%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-0,17%	-10,33%	-9,53%	-10,33%	-0,35%	17,20%	7,78%	15,49%
IFIX (Benchmark)	-1,04%	1,08%	-1,78%	1,08%	6,09%	19,73%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,61%	2,37%	2,19%	2,37%	4,22%	29,58%	9,73%	38,90%
MSCI ACWI (Benchmark)	8,28%	26,67%	13,94%	26,67%	35,48%	42,62%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,90%	16,70%	5,01%	16,70%	29,37%	66,02%	2,97%	11,08%

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

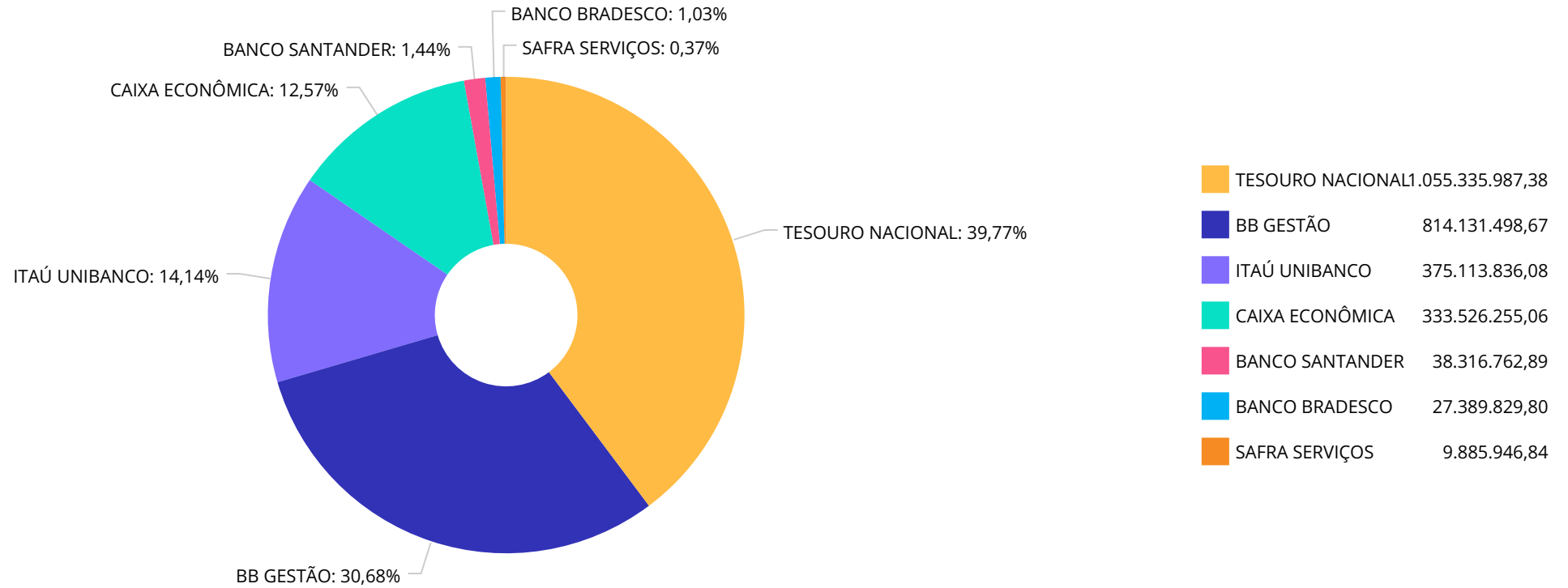
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,47%	14,48%	3,92%	14,48%	22,70%	44,25%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,95%	16,24%	5,15%	16,24%	27,39%	56,34%	3,30%	11,16%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3,96%	16,75%	5,07%	16,75%	29,39%	66,04%	2,95%	11,07%

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

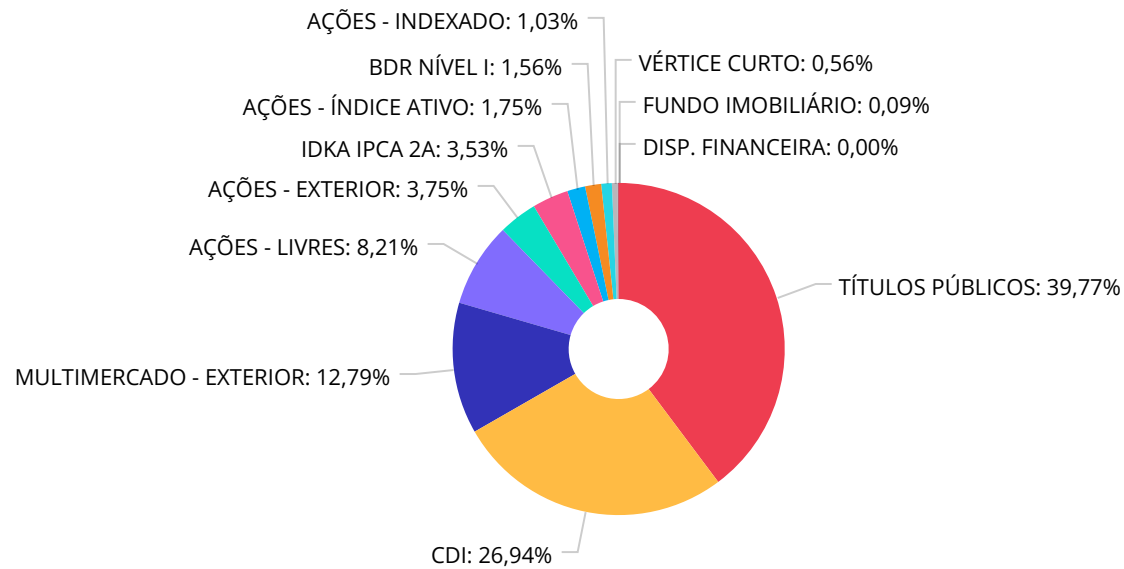
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,73%	39,52%	21,34%	39,52%	52,18%	72,57%	8,26%	13,945%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,45%	28,06%	16,10%	28,06%	39,91%	49,16%	6,55%	12,450%

MSCI WORLD (Benchmark)	8,10%	27,24%	13,69%	27,24%	36,54%	46,37%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	8,44%	26,69%	13,22%	26,69%	37,16%	47,09%	5,69%	10,586%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	10,52%	23,76%	17,26%	23,76%	31,56%	25,76%	7,40%	12,638%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	6,01%	22,20%	10,70%	22,20%	26,37%	31,91%	6,58%	13,464%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	10,57%	31,47%	15,78%	31,47%	46,24%	65,37%	6,15%	12,977%

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



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



TÍTULOS PÚBLICOS	1.055.335.987,38	CDI	714.968.243,91	MULTIMERCADO - EXTERIOR	39.354.241,84	AÇÕES - LIVRES	217.996.613,04
AÇÕES - EXTERIOR	99.573.916,07	IDKA IPCA 2A	93.690.198,28	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	46.542.765,52	BDR NÍVEL I	41.502.046,17
AÇÕES - INDEXADO	27.389.829,80	VÉRTICE CURTO	14.886.274,71	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.460.000,00	DISP. FINANCEIRA	83.383,85

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/06/2022	9.875	3.971,848591	4.388,101423	39.222.004,84	43.332.501,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	29/08/2022	7.642	3925,476529	4.384,041946	29.998.491,63	33.502.848,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	3.761	3988,237004	4.383,651033	14.999.759,37	16.486.911,53	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	1.254	3.988,237004	4.383,651033	5.001.249,20	5.497.098,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	2.515	3977,260022	4.381,992876	10.002.808,96	11.020.712,08	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	3.771	3.977,260022	4.381,992876	14.998.247,54	16.524.495,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/05/2023	9.712	4.118,503984	4.379,845005	39.998.910,69	42.537.054,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3.855,205568	4.407,483815	39.843.549,55	45.551.345,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4089,215327	4.396,9034	40.000.704,33	43.010.509,05	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4062,955171	4.370,441624	30.000.860,98	32.271.340,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4004,964372	4.418,223172	39.997.579,18	44.124.794,81	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.417,935358	39.997.709,63	44.386.996,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.404,412359	58.915.192,29	66.462.582,49	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4047,135758	4.364,17843	1.197.952,18	1.291.796,81	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.324,425625	1.984.874,49	2.153.563,96	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.480,880879	39.862.509,79	45.606.405,58	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.458,933928	39.994.357,14	45.592.599,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.424,134115	15.078.262,63	17.209.881,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.444,0277	58.961.325,11	66.727.075,91	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.413,368983	9.639.666,59	10.592.085,55	Curva

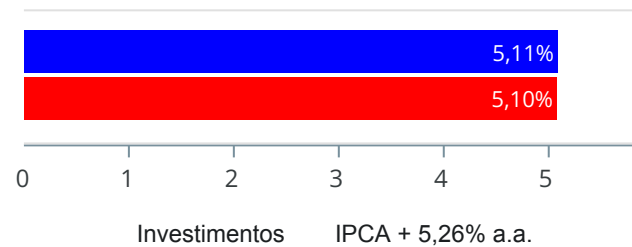
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4039,820802	4.367,950093	900.880,04	974.052,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.367,950093	2.086.995,07	2.271.334,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.444,0277	58.961.325,11	66.727.075,91	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.413,368983	9.639.666,59	10.592.085,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.452,473131	19.725.991,27	21.995.217,26	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.435,689663	39.229.327,99	43.425.401,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/02/2023	10.000	3.785,199052	4.144,69174	37.851.990,52	41.446.917,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3816,987204	4.144,69174	39.998.208,91	43.432.224,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.270,977991	19.846.240,66	21.568.438,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3851,268116	4.053,677834	39.999.270,65	42.101.497,98	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.379,406839	19.568.465,57	21.612.372,75	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.288,912718	19.536.375,31	21.547.497,49	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.271,192779	40.000.529,76	43.621.691,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	4.117,203281	38.836.282,35	42.518.358,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3792,196447	4.117,203281	40.003.880,32	43.432.377,41	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

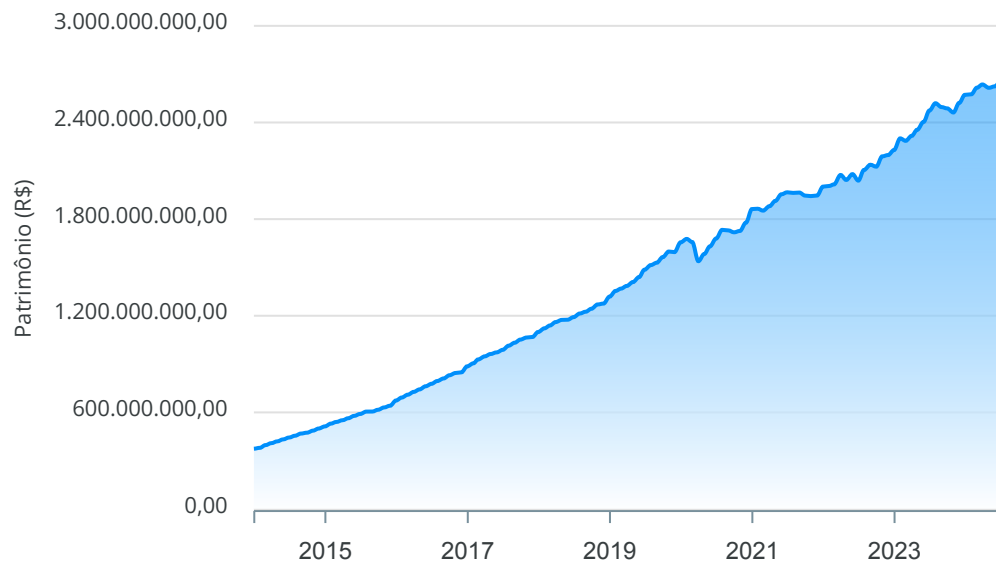
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	2.567.523.344,80	45.095.927,70	48.822.037,76	2.569.922.536,57	6.125.301,83	6.125.301,83	0,23%	0,23%	0,87%	0,87%	26,94%	3,19%
Fevereiro	2.569.922.536,57	58.312.581,69	62.621.601,41	2.610.448.028,88	44.834.512,03	50.959.813,86	1,71%	1,94%	1,22%	2,10%	92,52%	3,53%
Março	2.610.448.028,88	33.594.187,36	44.184.187,36	2.629.918.510,18	30.060.481,30	81.020.295,16	1,14%	3,10%	0,57%	2,68%	115,72%	2,91%
Abril	2.629.918.510,18	40.962.954,53	48.037.406,87	2.608.903.681,39	-13.940.376,45	67.079.918,71	-0,52%	2,57%	0,83%	3,53%	72,58%	3,59%
Mai	2.608.903.681,39	36.565.347,44	51.724.247,54	2.617.357.295,49	23.612.514,20	90.692.432,91	0,89%	3,48%	0,89%	4,46%	78,11%	2,76%
Junho	2.617.357.295,49	155.426.054,88	169.999.186,01	2.646.377.469,80	43.593.305,44	134.285.738,35	1,57%	5,11%	0,62%	5,10%	100,11%	2,52%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

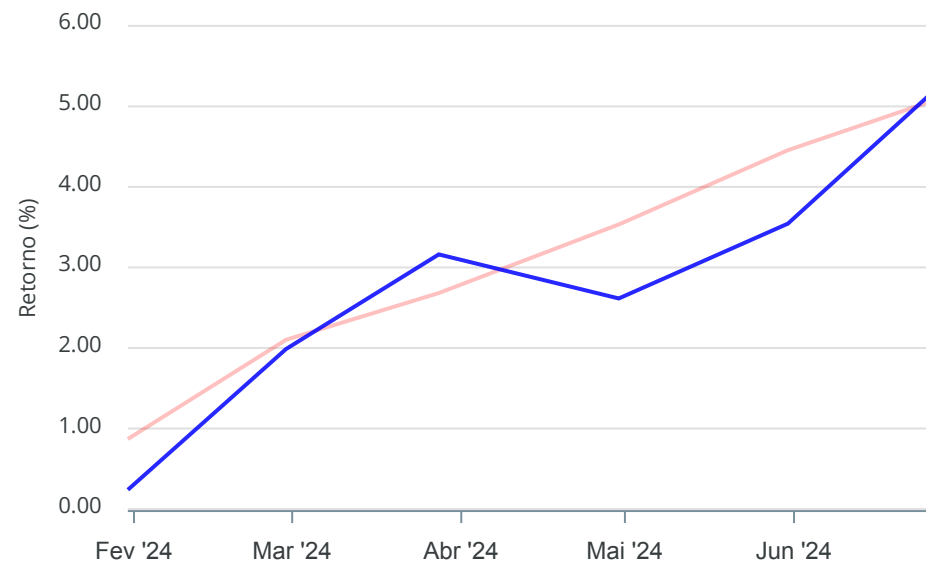
Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO

36M



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.177.147,06	0,00	0,00	11.306.394,81	129.247,75	1,16%	1,16%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.538.972,79	0,00	0,00	3.579.879,90	40.907,11	1,16%	1,16%	0,48%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.046.288.128,46	0,00	0,00	1.055.335.987,38	9.047.858,92	0,86%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	125.028.387,62	0,00	0,00	126.060.190,68	1.031.803,06	0,83%	0,83%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	472.986.929,87	156.330.341,16	44.959.273,87	588.670.425,00	4.312.427,84	0,69%	0,79%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.712.929,67	0,00	2.485.530,55	237.628,23	10.229,11	0,38%	0,71%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	93.489.971,20	17.700,00	0,00	93.690.198,28	182.527,08	0,20%	0,20%	0,98%
Total Renda Fixa	1.755.222.466,67	156.348.041,16	47.444.804,42	1.878.880.704,28	14.755.000,87	0,79%		0,14%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.351.700,00	0,00	17.700,00	2.460.000,00	126.000,00	5,36%	5,40%	9,73%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	124.493.534,62	0,00	0,00	129.427.737,36	4.934.202,74	3,96%	3,96%	2,95%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	54.862.923,99	0,00	0,00	57.027.274,25	2.164.350,26	3,95%	3,95%	3,30%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	121.792.050,80	0,00	0,00	126.542.461,93	4.750.411,13	3,90%	3,90%	2,97%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	35.465.412,20	0,00	0,00	36.137.773,12	672.360,92	1,90%	1,90%	5,03%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	56.942.334,75	0,00	0,00	57.967.105,08	1.024.770,33	1,80%	1,80%	5,15%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	35.781.948,07	0,00	0,00	36.331.135,44	549.187,37	1,53%	1,53%	6,32%
BRANCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	26.976.663,77	0,00	0,00	27.389.829,80	413.166,03	1,53%	1,53%	5,86%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	46.032.921,51	0,00	0,00	46.542.765,52	509.844,01	1,11%	1,11%	6,26%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	34.070.853,11	0,00	0,00	34.411.175,31	340.322,20	1,00%	1,00%	6,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	8.275.518,21	0,00	0,00	8.343.103,88	67.585,67	0,82%	0,82%	6,84%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.709.567,80	0,00	0,00	1.715.996,40	6.428,60	0,38%	0,38%	6,71%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	42.136.530,57	0,00	0,00	42.090.333,41	-46.197,16	-0,11%	-0,11%	8,59%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.001.693,22	0,00	0,00	999.990,40	-1.702,82	-0,17%	-0,17%	7,78%
BRANCO SELECTION FIC AÇÕES	60.329.923,24	0,00	59.896.958,49	0,00	-432.964,75	-0,72%	-0,13%	7,28%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	63.818.194,65	0,00	63.117.596,97	0,00	-700.597,68	-1,10%	1,49%	5,74%
Total Renda Variável	716.041.770,51	0,00	123.032.255,46	607.386.681,90	14.377.166,85	2,01%		4,61%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	30.454.485,28	0,00	0,00	34.332.086,13	3.877.600,85	12,73%	12,73%	8,26%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	40.760.460,95	0,00	0,00	45.067.279,66	4.306.818,71	10,57%	10,57%	6,15%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6.128.032,79	0,00	0,00	6.772.933,56	644.900,77	10,52%	10,52%	7,40%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.491.804,04	0,00	0,00	7.169.960,04	678.156,00	10,45%	10,45%	6,55%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	35.334.334,14	0,00	0,00	38.316.762,89	2.982.428,75	8,44%	8,44%	5,69%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	33.744.784,11	0,00	0,00	35.773.708,26	2.028.924,15	6,01%	6,01%	6,58%
Total Exterior	152.913.901,31	0,00	0,00	167.432.730,54	14.518.829,23	9,49%		6,64%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	1.037.338.026,53	0,00	8.417.647,44	1.055.335.987,38	26.415.608,29	2,55%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	480.453.165,87	232.982.543,13	137.443.617,61	588.670.425,00	12.678.333,61	1,78%	2,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	122.846.769,62	0,00	0,00	126.060.190,68	3.213.421,06	2,62%	2,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	92.841.158,53	52.800,00	0,00	93.690.198,28	796.239,75	0,86%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.992.922,22	0,00	0,00	11.306.394,81	313.472,59	2,85%	2,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.480.561,77	0,00	0,00	3.579.879,90	99.318,13	2,85%	2,85%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.712.000,00	2.485.530,55	237.628,23	11.158,78	0,41%	2,27%
Total Renda Fixa	1.747.952.604,54	235.747.343,13	148.346.795,60	1.878.880.704,28	43.527.552,21	2,37%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	123.183.593,52	0,00	0,00	129.427.737,36	6.244.143,84	5,07%	5,07%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	120.502.222,77	0,00	0,00	126.542.461,93	6.040.239,16	5,01%	5,01%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	54.233.015,70	0,00	0,00	57.027.274,25	2.794.258,55	5,15%	5,15%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.407.200,00	0,00	52.800,00	2.460.000,00	105.600,00	4,39%	2,19%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.105.371,23	0,00	0,00	999.990,40	-105.380,83	-9,53%	-9,53%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.854.095,08	0,00	0,00	1.715.996,40	-138.098,68	-7,45%	-7,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	9.009.257,82	0,00	0,00	8.343.103,88	-666.153,94	-7,39%	-7,39%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	28.322.081,79	0,00	0,00	27.389.829,80	-932.251,99	-3,29%	-3,29%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	59.282.882,66	0,00	0,00	57.967.105,08	-1.315.777,58	-2,22%	-2,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	37.623.329,72	0,00	0,00	36.137.773,12	-1.485.556,60	-3,95%	-3,95%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	38.660.326,92	0,00	0,00	36.331.135,44	-2.329.191,48	-6,02%	-6,02%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	36.881.095,64	0,00	0,00	34.411.175,31	-2.469.920,33	-6,70%	-6,70%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	49.596.905,87	0,00	0,00	46.542.765,52	-3.054.140,35	-6,16%	-6,16%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	45.573.654,25	0,00	0,00	42.090.333,41	-3.483.320,84	-7,64%	-7,64%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	66.998.128,07	0,00	63.117.596,97	0,00	-3.880.531,10	-5,79%	-3,32%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	67.419.371,39	0,00	59.896.958,49	0,00	-7.522.412,90	-11,16%	-10,63%
Total Renda Variável	742.652.532,43	0,00	123.067.355,46	607.386.681,90	-12.198.495,07	-1,64%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	38.924.186,42	0,00	0,00	45.067.279,66	6.143.093,24	15,78%	15,78%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28.294.423,54	0,00	0,00	34.332.086,13	6.037.662,59	21,34%	21,34%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	33.844.089,02	0,00	0,00	38.316.762,89	4.472.673,87	13,22%	13,22%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	32.315.002,97	0,00	0,00	35.773.708,26	3.458.705,29	10,70%	10,70%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.775.818,85	0,00	0,00	6.772.933,56	997.114,71	17,26%	17,26%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.175.545,85	0,00	0,00	7.169.960,04	994.414,19	16,10%	16,10%
Total Exterior	145.329.066,65	0,00	0,00	167.432.730,54	22.103.663,89	15,21%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	1.027.100.861,07	0,00	30.406.829,16	1.055.335.987,38	58.641.955,47	0,06%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	449.971.628,62	371.718.512,18	258.517.904,97	588.670.425,00	25.498.189,17	4,92%	5,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	119.499.057,62	0,00	0,00	126.060.190,68	6.561.133,06	5,49%	5,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	90.897.189,55	105.300,00	0,00	93.690.198,28	2.687.708,73	2,97%	2,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.007.009,00	0,00	315.562,44	11.306.394,81	614.948,25	5,69%	5,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.486.672,34	0,00	101.493,51	3.579.879,90	194.701,07	5,69%	5,70%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.879.679,63	4.654.517,65	237.628,23	12.466,25	0,59%	4,71%
Total Renda Fixa	1.736.035.199,28	156.348.041,16	77.851.633,58	1.878.880.704,28	64.349.097,42	3,55%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	110.858.752,44	0,00	0,00	129.427.737,36	18.568.984,92	16,74%	16,75%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	108.435.905,72	0,00	0,00	126.542.461,93	18.106.556,21	16,71%	16,70%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	49.060.170,84	0,00	0,00	57.027.274,25	7.967.103,41	16,23%	16,24%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.403.000,00	0,00	105.300,00	2.460.000,00	162.300,00	6,75%	2,37%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.115.156,72	0,00	0,00	999.990,40	-115.166,32	-10,33%	-10,33%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.883.025,51	0,00	0,00	1.715.996,40	-167.029,11	-8,87%	-8,87%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	58.441.863,72	0,00	0,00	57.967.105,08	-474.758,64	-0,82%	-0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	9.280.021,25	0,00	0,00	8.343.103,88	-936.917,37	-10,09%	-10,10%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	29.687.505,36	0,00	0,00	27.389.829,80	-2.297.675,56	-7,75%	-7,74%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	45.190.558,44	0,00	0,00	42.090.333,41	-3.100.225,03	-6,86%	-6,86%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	37.973.518,37	0,00	0,00	34.411.175,31	-3.562.343,06	-9,39%	-9,38%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	40.652.732,95	0,00	0,00	36.137.773,12	-4.514.959,83	-11,10%	-11,11%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	41.590.726,13	0,00	0,00	36.331.135,44	-5.259.590,69	-12,65%	-12,65%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	51.822.647,47	0,00	0,00	46.542.765,52	-5.279.881,95	-10,19%	-10,19%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	70.161.258,64	0,00	63.117.596,97	0,00	-7.043.661,67	-10,03%	-7,68%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	69.519.556,92	0,00	59.896.958,49	0,00	-9.622.598,43	-13,84%	-13,33%
Total Renda Variável	716.041.770,51	0,00	123.032.255,46	607.386.681,90	14.377.166,85	2,01%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	34.279.759,63	0,00	0,00	45.067.279,66	10.787.520,03	31,47%	31,47%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	24.607.913,48	0,00	0,00	34.332.086,13	9.724.172,65	39,52%	39,52%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	30.243.770,76	0,00	0,00	38.316.762,89	8.072.992,13	26,69%	26,69%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	29.274.412,08	0,00	0,00	35.773.708,26	6.499.296,18	22,20%	22,20%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.598.759,95	0,00	0,00	7.169.960,04	1.571.200,09	28,07%	28,06%
ITAU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.472.551,94	0,00	0,00	6.772.933,56	1.300.381,62	23,76%	23,76%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	12.149.109,57	0,00	12.149.109,57	0,00	0,00	0,00%	22,71%
Total Exterior	165.063.010,88	0,00	12.149.109,57	167.432.730,54	14.518.829,23	8,80%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.



Fundacao Segur. Soc. Serv.Publ.Munic. de Sorocaba

RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

BANCO 0001 BCO BRASIL CONTA BANCARIA 0110 INATIVOS PMS/CAMARA AG 029238 C/C 0000000582115 FONTE 01 COD APLICACAO 6010000

INVESTIMENTO	1.1.1.1.1.51.00.00 - APLICACOES FINANCEIRAS DE LIQUIDEZ IMEDIATA - RPPS			SALDO ANTERIOR	1.258.748,87
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
03/06/2024	Resgate de Aplicacao		38.000,00	1.220.748,87	
04/06/2024	Resgate de Aplicacao		30.000,00	1.190.748,87	
12/06/2024	Resgate de Aplicacao		128.000,00	1.062.748,87	
27/06/2024	Transferencia para Aplicacao	1.030.000,00		2.092.748,87	
27/06/2024	Resgate de Aplicacao		780.000,00	1.312.748,87	
28/06/2024	Resgate de Aplicacao		50.000,00	1.262.748,87	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	1.030.000,00	1.026.000,00	1.262.748,87	

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.05.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA (F)			SALDO ANTERIOR	96.586,23
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Transferencia para Aplicacao	8.857,64		105.443,87	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	8.857,64	0,00	105.443,87	
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	1.038.857,64	1.026.000,00	1.368.192,74	

BANCO 0001 BCO BRASIL CONTA BANCARIA 0111 FUNDO PREVIDENCIARIO AG 029238 C/C 0000000586692 FONTE 04 COD APLICACAO 6020000

INVESTIMENTO	1.1.1.1.1.52.00.00 - APLICACOES FINANCEIRAS DE LIQUIDEZ IMEDIATA - RPPS			SALDO ANTERIOR	1.794,49
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Transferencia para Aplicacao	2.964,25		4.758,74	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	2.964,25	0,00	4.758,74	

INVESTIMENTO	1.1.1.1.1.53.00.00 - APLICACOES FINANCEIRAS DE LIQUIDEZ IMEDIATA - RPPS			SALDO ANTERIOR	150.032.811,16
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
03/06/2024	Resgate de Aplicacao		2.310.000,00	147.722.811,16	
04/06/2024	Transferencia para Aplicacao	8.230.000,00		155.952.811,16	
05/06/2024	Resgate de Aplicacao		2.167.000,00	153.785.811,16	
07/06/2024	Transferencia para Aplicacao	16.290.000,00		170.075.811,16	
07/06/2024	Resgate de Aplicacao		1.955.530,55	168.120.280,61	
12/06/2024	Transferencia para Aplicacao	26.128.000,00		194.248.280,61	
12/06/2024	Resgate de Aplicacao		5.235.000,00	189.013.280,61	
14/06/2024	Resgate de Aplicacao		24.000,00	188.989.280,61	
17/06/2024	Resgate de Aplicacao		7.000,00	188.982.280,61	



RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

18/06/2024	Transferencia para Aplicacao	48.494.958,42		237.477.239,03
19/06/2024	Resgate de Aplicacao		6.000,00	237.471.239,03
20/06/2024	Resgate de Aplicacao		1.112.400,00	236.358.839,03
21/06/2024	Transferencia para Aplicacao	5.140.000,00		241.498.839,03
24/06/2024	Resgate de Aplicacao		106.000,00	241.392.839,03
27/06/2024	Transferencia para Aplicacao	280.000,00		241.672.839,03
27/06/2024	Resgate de Aplicacao		32.600.000,00	209.072.839,03
28/06/2024	Transferencia para Aplicacao	1.390.000,00		210.462.839,03
28/06/2024	Resgate de Aplicacao		418.000,00	210.044.839,03
30/06/2024	Transferencia para Aplicacao	1.536.452,20		211.581.291,23
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	107.489.410,62	45.940.930,55	211.581.291,23
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.01.02.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE APLICAM EXCLUSIVAMENTE	SALDO ANTERIOR		8.815.432,05
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	8.815.432,05
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.01.12.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE APLICAM EXCLUSIVAMENTE	SALDO ANTERIOR		5.900.687,80
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	170.154,86		6.070.842,66
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	170.154,86	0,00	6.070.842,66
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)	SALDO ANTERIOR		69.631.257,99
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	621.775,71		70.253.033,70
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	621.775,71	0,00	70.253.033,70
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)	SALDO ANTERIOR		11.132.432,54
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	2.027.543,24		13.159.975,78
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	2.027.543,24	0,00	13.159.975,78



Fundacao Segur. Soc. Serv.Publ.Munic. de Sorocaba

RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.12.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM INDICE DE MERCADO DE REN		SALDO ANTERIOR		6.242.623,72
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		0,00	0,00	6.242.623,72
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.02.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO		SALDO ANTERIOR		54.379.312,06
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		0,00	0,00	54.379.312,06
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.12.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO		SALDO ANTERIOR		7.870.567,27
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	5.317.129,83		13.187.697,10	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	5.317.129,83	0,00	13.187.697,10	
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	115.628.978,51	45.940.930,55	383.694.967,04	
BANCO 0001 BCO BRASIL CONTA BANCARIA 0112 FUNDO DE RESERVA PREV AG 029238 C/C 000000058939X FONTE 04 COD APLICACAO 6010000					
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.05.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA (F)		SALDO ANTERIOR		112.101.781,21
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		0,00	0,00	112.101.781,21
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.15.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA (P)		SALDO ANTERIOR		204.168.128,17
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
12/06/2024	Transferencia para Aplicacao	37.023.396,39		241.191.524,56	
18/06/2024	Transferencia para Aplicacao	11.402.000,07		252.593.524,63	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	2.716.691,35		255.310.215,98	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	51.142.087,81	0,00	255.310.215,98	



RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)		SALDO ANTERIOR		37.451.191,58
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	277.402,61		37.728.594,19	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	277.402,61	0,00	37.728.594,19	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)		SALDO ANTERIOR		2.871.944,84
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	459.176,99		3.331.121,83	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	459.176,99	0,00	3.331.121,83	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.02.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO		SALDO ANTERIOR		11.225.988,54
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	11.225.988,54	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.12.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO		SALDO ANTERIOR		1.029.377,19
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	1.018.613,03		2.047.990,22	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	1.018.613,03	0,00	2.047.990,22	
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	52.897.280,44	0,00	421.745.691,97	
BANCO 0001 BCO BRASIL CONTA BANCARIA 0113 CONTA TAXA DE ADMINISTRACAO AG 029238 C/C 0000000553387 FONTE 04 COD APLICACAO 6900000					
INVESTIMENTO	1.1.1.1.1.52.00.00 - APLICACOES FINANCEIRAS DE LIQUIDEZ IMEDIATA - RPPS		SALDO ANTERIOR		6.820.843,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
03/06/2024	Resgate de Aplicacao		12.000,00	6.808.843,00	
04/06/2024	Transferencia para Aplicacao	106.000,00		6.914.843,00	
04/06/2024	Resgate de Aplicacao		42.000,00	6.872.843,00	
07/06/2024	Transferencia para Aplicacao	703.986,28		7.576.829,28	
10/06/2024	Resgate de Aplicacao		35.000,00	7.541.829,28	
12/06/2024	Resgate de Aplicacao		70.000,00	7.471.829,28	
17/06/2024	Resgate de Aplicacao		500,00	7.471.329,28	
19/06/2024	Resgate de Aplicacao		40.500,00	7.430.829,28	



RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

20/06/2024	Transferencia para Aplicacao	20.000,00		7.450.829,28
21/06/2024	Transferencia para Aplicacao	25.000,00		7.475.829,28
24/06/2024	Resgate de Aplicacao		9.000,00	7.466.829,28
25/06/2024	Resgate de Aplicacao		7.000,00	7.459.829,28
27/06/2024	Resgate de Aplicacao		241.873,87	7.217.955,41
28/06/2024	Transferencia para Aplicacao	67.000,00		7.284.955,41
28/06/2024	Resgate de Aplicacao		20.000,00	7.264.955,41
30/06/2024	Transferencia para Aplicacao	57.691,51		7.322.646,92
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	979.677,79	477.873,87	7.322.646,92
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	979.677,79	477.873,87	7.322.646,92
	SUBTOTAL DO BANCO	170.544.794,38	47.444.804,42	814.131.498,67

BANCO 0033 SANTANDER CONTA BANCARIA 0115 FUNDO PREVIDENCIARIO AG 000062 C/C 0000450005073 FONTE 04 COD APLICACAO 6020000				
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.02.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO	SALDO ANTERIOR		30.887.891,37
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	30.887.891,37
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.12.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO	SALDO ANTERIOR		2.361.610,52
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	2.806.456,47		5.168.066,99
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	2.806.456,47	0,00	5.168.066,99
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	2.806.456,47	0,00	36.055.958,36


BANCO 0033 SANTANDER CONTA BANCARIA 0116 FUNDO DE RESERVA AG 000062 C/C 0000450002881 FONTE 04 COD APLICACAO 6010000				
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.02.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO	SALDO ANTERIOR		2.084.832,25
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	2.084.832,25



Fundacao Segur. Soc. Serv.Publ.Munic. de Sorocaba
RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.12.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO		SALDO ANTERIOR		0,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	175.972,28		175.972,28	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	175.972,28	0,00	175.972,28	
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	175.972,28	0,00	2.260.804,53	
	SUBTOTAL DO BANCO	2.982.428,75	0,00	38.316.762,89	
BANCO 0102 XP INVEST CONTA BANCARIA 0117 FUNDO DE RESERVA AG 000001 C/C 0000000807907 FONTE 04 COD APLICACAO 6010000					
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.01.00 - TITULOS PUBLICOS DE EMISSAO DO TESOIRO NACIONAL (F		SALDO ANTERIOR		316.588.735,02
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	316.588.735,02	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.11.00 - TITULOS PUBLICOS DE EMISSAO DO TESOIRO NACIONAL (P		SALDO ANTERIOR		27.151.606,81
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	2.992.674,10		30.144.280,91	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	2.992.674,10	0,00	30.144.280,91	
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	2.992.674,10	0,00	346.733.015,93	
BANCO 0102 XP INVEST CONTA BANCARIA 0118 FUNDO PREVIDENCIARIO AG 000001 C/C 0000000808023 FONTE 04 COD APLICACAO 6020000					
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.01.01.00 - TITULOS PUBLICOS DE EMISSAO DO TESOIRO NACIONAL (F		SALDO ANTERIOR		648.138.318,61
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	648.138.318,61	

CN-SIFPM



FUNSERV
SOROCABA

Fundacao Segur. Soc. Serv.Publ.Munic. de Sorocaba

RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO

CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999

MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

23/07/2024

PAGINA7


INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.01.11.00 - TITULOS PUBLICOS DE EMISSAO DO TESOURO NACIONAL (P			SALDO ANTERIOR	54.409.468,02
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	6.055.184,82		60.464.652,84	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	6.055.184,82	0,00	60.464.652,84	
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	6.055.184,82	0,00	708.602.971,45	
	SUBTOTAL DO BANCO	9.047.858,92	0,00	1.055.335.987,38	
BANCO 0104 BCO CEF CONTA BANCARIA 0120 FUNDO PREVIDENCIARIO AG 000356 C/C 0000006000022 FONTE 04 COD APLICACAO 6020000					
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.01.02.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE APLICAM EXCLUSIVAMENTE			SALDO ANTERIOR	80.660.858,42
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	80.660.858,42	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.01.12.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE APLICAM EXCLUSIVAMENTE			SALDO ANTERIOR	3.442.317,37
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
13/06/2024	Transferencia para Aplicacao	8.850,00		3.451.167,37	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	164.188,55		3.615.355,92	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	173.038,55	0,00	3.615.355,92	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)			SALDO ANTERIOR	56.906.794,91
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
12/06/2024	Resgate de Aplicacao		26.094.200,58	30.812.594,33	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	-220.800,53		30.591.793,80	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	-220.800,53	26.094.200,58	30.591.793,80	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)			SALDO ANTERIOR	1.073.535,60
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	-27.085,20		1.046.450,40	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	-27.085,20	0,00	1.046.450,40	



RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.02.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO			SALDO ANTERIOR	0,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	0,00	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.03.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO DA CLASSE			SALDO ANTERIOR	9.681.405,83
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	9.681.405,83	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.13.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO DA CLASSE			SALDO ANTERIOR	3.682.547,90
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	1.701.558,18		5.384.106,08	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	1.701.558,18	0,00	5.384.106,08	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.04.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (F)			SALDO ANTERIOR	63.701.890,11
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	63.701.890,11	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.04.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (P)			SALDO ANTERIOR	30.662.029,78
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	3.680.596,66		34.342.626,44	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	3.680.596,66	0,00	34.342.626,44	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.05.01.00 - APLICACOES EM FUNDOS DO SEGMENTO IMOBILIARIO - RPP			SALDO ANTERIOR	919.050,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	919.050,00	

CN-SIFPM



FUNSERV
SOROCABA

Fundacao Segur. Soc. Serv.Publ.Munic. de Sorocaba

RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO

CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999

MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

CONAM

23/07/2024

PAGINA9

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.05.11.00 - APLICACOES EM FUNDOS DO SEGMENTO IMOBILIARIO - RPP		SALDO ANTERIOR	265.500,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	265.500,00

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.15.01.00 - APLICACOES EM FUNDOS DO SEGMENTO IMOBILIARIO - RPP		SALDO ANTERIOR	0,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	54.150,00		54.150,00
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	54.150,00	0,00	54.150,00
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	5.361.457,66	26.094.200,58	230.263.187,00

BANCO 0104 BCO CEF CONTA BANCARIA 0121 FUNDO DE RESERVA AG 000356 C/C 0000060000634 FONTE 04 COD APLICACAO 6010000

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.05.01.00 - APLICACOES EM FUNDOS DO SEGMENTO IMOBILIARIO - RPP		SALDO ANTERIOR	0,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	54.150,00		54.150,00
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	54.150,00	0,00	54.150,00

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.02.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE APLICAM EXCLUSIVAMENTE		SALDO ANTERIOR	1.871.674,95
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	1.871.674,95

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.12.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE APLICAM EXCLUSIVAMENTE		SALDO ANTERIOR	7.506.420,44
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
13/06/2024	Transferencia para Aplicacao	8.850,00		7.515.270,44
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	18.338,53		7.533.608,97
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	27.188,53	0,00	7.533.608,97



RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)			SALDO ANTERIOR	72.959.181,49
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
12/06/2024	Resgate de Aplicacao		37.023.396,39	35.935.785,10	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	-139.474,95		35.796.310,15	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	-139.474,95	37.023.396,39	35.796.310,15	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)			SALDO ANTERIOR	9.086.066,34
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	-19.111,96		9.066.954,38	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	-19.111,96	0,00	9.066.954,38	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.02.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO			SALDO ANTERIOR	0,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	0,00	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.03.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO DA CLASSE			SALDO ANTERIOR	12.648.968,20
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	12.648.968,20	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.12.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO			SALDO ANTERIOR	0,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	0,00	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.13.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO DA CLASSE			SALDO ANTERIOR	4.441.563,36
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	2.176.042,67		6.617.606,03	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	2.176.042,67	0,00	6.617.606,03	



RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.14.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (F)		SALDO ANTERIOR	18.367.959,05
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	18.367.959,05
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.14.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (P)		SALDO ANTERIOR	9.060.171,86
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	1.069.814,47		10.129.986,33
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	1.069.814,47	0,00	10.129.986,33
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.15.01.00 - APLICACOES EM FUNDOS DO SEGMENTO IMOBILIARIO - RPP		SALDO ANTERIOR	910.350,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	910.350,00
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.15.11.00 - APLICACOES EM FUNDOS DO SEGMENTO IMOBILIARIO - RPP		SALDO ANTERIOR	265.500,00
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	265.500,00
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	3.168.608,76	37.023.396,39	103.263.068,06
	SUBTOTAL DO BANCO	8.530.066,42	63.117.596,97	333.526.255,06
BANCO 0237 BCO BRADESCO CONTA BANCARIA 0122 FUNDO DE RESERVA AG 001338 C/C 0000000005800 FONTE 04 COD APLICACAO 6010000				
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)		SALDO ANTERIOR	779.039,89
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
11/06/2024	Resgate de Aplicacao		779.039,89	0,00
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	779.039,89	0,00




Fundacao Segur. Soc. Serv.Publ.Munic. de Sorocaba

RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO

CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999

MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)		SALDO ANTERIOR	10.491.661,84
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
11/06/2024	Resgate de Aplicacao		10.491.661,84	0,00
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	10.491.661,84	0,00
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)		SALDO ANTERIOR	213.717,62
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
11/06/2024	Resgate de Aplicacao		131.298,34	82.419,28
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	-82.419,28		0,00
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	-82.419,28	131.298,34	0,00
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	-82.419,28	11.402.000,07	0,00
BANCO 0237 BCO BRADESCO CONTA BANCARIA 0123 FUNDO PREVIDENCIARIO AG 001338 C/C 0000000058017 FONTE 04 COD APLICACAO 6020000				
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)		SALDO ANTERIOR	70.936.462,43
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
11/06/2024	Resgate de Aplicacao		48.494.958,42	22.441.504,01
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	-350.545,47		22.090.958,54
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	-350.545,47	48.494.958,42	22.090.958,54
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)		SALDO ANTERIOR	4.885.705,23
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	413.166,03		5.298.871,26
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	413.166,03	0,00	5.298.871,26
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	62.620,56	48.494.958,42	27.389.829,80
	SUBTOTAL DO BANCO	-19.798,72	59.896.958,49	27.389.829,80

CN-SIFPM		Fundacao Segur. Soc. Serv.Publ.Munic. de Sorocaba			CONAM	
		RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO				
		CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999				
		MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024				
23/07/2024					PAGINA	13
BANCO 0341 BCO ITAU CONTA BANCARIA 0124 FUNDO DE RESERVA AG 000076 C/C 0000000022102 FONTE 04 COD APLICACAO 6010000						
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.05.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA (F)				SALDO ANTERIOR	3.844.887,47
DATA	HISTORICO		APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		0,00	0,00	3.844.887,47	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.11.15.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA (P)				SALDO ANTERIOR	1.002.833,75
DATA	HISTORICO		APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos		40.006,06		1.042.839,81	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		40.006,06	0,00	1.042.839,81	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)				SALDO ANTERIOR	9.367.925,04
DATA	HISTORICO		APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos		67.585,67		9.435.510,71	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		67.585,67	0,00	9.435.510,71	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)				SALDO ANTERIOR	1.012.069,63
DATA	HISTORICO		APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos		51.322,05		1.063.391,68	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		51.322,05	0,00	1.063.391,68	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.02.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO				SALDO ANTERIOR	2.431.333,40
DATA	HISTORICO		APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos		261.179,84		2.692.513,24	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		261.179,84	0,00	2.692.513,24	

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.13.12.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO		SALDO ANTERIOR		50.472,65
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		0,00	0,00	50.472,65
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.14.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (F)		SALDO ANTERIOR		12.863.692,75
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		0,00	0,00	12.863.692,75
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.14.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (P)		SALDO ANTERIOR		4.844.433,87
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	672.229,66		5.516.663,53	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	672.229,66	0,00	5.516.663,53	
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	1.092.323,28	0,00	36.509.971,84	
BANCO 0341 BCO ITAU CONTA BANCARIA 0125 FUNDO PREVIDENCIARIO AG 000076 C/C 0000000910397 FONTE 04 COD APLICACAO 6020000					
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.01.05.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA (F)		SALDO ANTERIOR		99.074.387,91
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO		0,00	0,00	99.074.387,91
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.01.15.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA (P)		SALDO ANTERIOR		21.106.278,49
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	991.797,00		22.098.075,49	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	991.797,00	0,00	22.098.075,49	



Fundacao Segur. Soc. Serv.Publ.Munic. de Sorocaba

RELATORIO DE INVESTIMENTOS POR CONTA BANCARIA - ANALITICO
CONTA INICIAL : 0000 CONTA FINAL : 9999
MOVIMENTACAO ENTRE 01/06/2024 A 30/06/2024

INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)			SALDO ANTERIOR	81.994.163,52
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	81.994.163,52	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (P)			SALDO ANTERIOR	18.129.334,15
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	1.483.292,29		19.612.626,44	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	1.483.292,29	0,00	19.612.626,44	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.02.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO			SALDO ANTERIOR	3.316.565,52
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	383.720,93		3.700.286,45	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	383.720,93	0,00	3.700.286,45	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.12.00 - FUNDO DE INVESTIMENTO - SUFIXO			SALDO ANTERIOR	329.661,22
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	329.661,22	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.04.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (F)			SALDO ANTERIOR	80.879.267,82
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	4.261.973,08		85.141.240,90	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	4.261.973,08	0,00	85.141.240,90	
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.04.11.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (P)			SALDO ANTERIOR	26.653.422,31
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL	
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	26.653.422,31	
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	7.120.783,30	0,00	338.603.864,24	
	SUBTOTAL DO BANCO	8.213.106,58	0,00	375.113.836,08	

BANCO 0422 BCO SAFRA CONTA BANCARIA 0126 FUNDO DE RESERVA AG 004100 C/C 0000000285153 FONTE 04 COD APLICACAO 6010000				
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.12.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)			SALDO ANTERIOR 1.001.693,22
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	-1.702,82		999.990,40
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	-1.702,82	0,00	999.990,40
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	-1.702,82	0,00	999.990,40
BANCO 0422 BCO SAFRA CONTA BANCARIA 0127 FUNDO PREVIDENCIARIO AG 004100 C/C 0000000285161 FONTE 04 COD APLICACAO 6020000				
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.02.01.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM ACOES (F)			SALDO ANTERIOR 1.922.745,31
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	6.428,60		1.929.173,91
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	6.428,60	0,00	1.929.173,91
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.03.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO DA CLASSE			SALDO ANTERIOR 5.756.596,07
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	0,00	0,00	5.756.596,07
INVESTIMENTO	1.1.4.4.1.03.13.00 - FUNDOS DE INVESTIMENTO DA CLASSE			SALDO ANTERIOR 522.030,46
DATA	HISTORICO	APLICACAO/GANHOS	RESGATE/PERDAS	SALDO ATUAL
30/06/2024	Ganhos em Investimentos	678.156,00		1.200.186,46
	SUBTOTAL DO INVESTIMENTO	678.156,00	0,00	1.200.186,46
	SUBTOTAL CONTA BANCARIA	684.584,60	0,00	8.885.956,44
	SUBTOTAL DO BANCO	682.881,78	0,00	9.885.946,84
	TOTAL GERAL	199.981.338,11	170.459.359,88	2.653.700.116,72