



IPOJUCAPEV

A PREVIDÊNCIA DA GENTE

AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

Relatório Semestral de Diligência

2024.1

ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br

FONES: (81) 3551-2523 | 3551-2984

Expediente

Célia Agostinho Lins de Sales
Prefeita do Município do Ipojuca

Helena Patricia Costa Alves
Vice-Prefeita do Ipojuca

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo do IpojucaPrev

Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de Investimentos do IpojucaPrev

Laryssa Pâmela de Andrade Brandão
Superintendente de Investimentos do IpojucaPrev

Mateus Lucas Campos Rocha
Assistente de Investimentos do IpojucaPrev

Sumário	Pág
Expediente	01
1. Introdução	04
1.1 Regulamentação utilizada	04
2. Da Carteira de Investimentos	04
3. Critérios Verificados no Relatório Semestral de Diligência	06
3.1 Critérios referentes às Instituições Financeiras Investidas	06
3.1.1 Credenciamento das Instituições Financeiras	06
3.1.2 Identificação do atendimento ao art. 15.....	10
3.1.3 Volume de Recursos Sob Administração e Gestão.....	12
3.1.4 Qualidade de Gestão e Ratings	14
3.1.5 Solidez Patrimonial.....	19
3.1.6 Padrão ético de conduta e exposição a risco reputacional.....	21
3.1.7 Regularidade Fiscal e Previdenciária	22
3.2 Critérios referentes aos Ativos Investidos	24
3.2.1 Enquadramento das alocações em relação à Política de Investimentos.....	24
3.2.2 Análise dos Riscos	27
3.2.2.1 Risco de Mercado.....	27
3.2.2.2 Risco de Crédito dos Ativos	28
3.2.2.2.1 Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " - Títulos Tesouro Nacional.....	29
3.2.2.2.2 Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " - FI RF Referenciado 100% títulos TN.....	30
3.2.2.2.3 Artigo 7º, III, "a" - FI Renda Fixa.....	32
3.2.2.2.4 Artigo 7º, IV - Ativos Bancários.....	33
3.2.2.2.5 Artigo 7º, V, "a FI Direitos Creditórios (FIDC) – sênior	36
3.2.2.2.6 Artigo 7º, V, "b" - FI Renda Fixa "Crédito Privado"	37
3.2.2.2.7 Artigo 8º, I - FI Ações	39
3.2.2.2.8 Artigo 9º, II - FI Investimento no Exterior	41
3.2.2.2.9 Artigo 9º, III FI Ações - BDR Nível I	42
3.2.2.2.10 Artigo 10, I - FI Multimercado – aberto	43
3.2.2.2.11 Artigo 10, II - FI em Participações	46
3.2.2.2.12 Artigo 11 - FI Imobiliário	47
3.2.2.3 Risco de Liquidez	47
3.2.2.4 Risco de Solvência.....	48
3.2.3 Desempenho dos ativos e aderência ao benchmark	48
3.2.4 Análise das Demonstrações Contábeis dos Fundo	48
3.2.5 Relatório de Avaliação e Monitoramento dos riscos	53
4. Fundos Estressados.....	53
4.1 INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	55
4.2 CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA FIP.....	58
4.3 GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP.....	61
4.4 BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	63

4.5 SINGULARE FII - REIT11 (Antigo SOCOPA FII)	67
4.6 VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	71
5. Considerações Finais	76

Anexos

Anexo 01 – Composição da carteira dos ativos enquadrados como Artigo 7º, I, " b " - FI RF Referenciado 100% títulos TN;

Anexo 02 – Composição da carteira dos ativos enquadrados como Artigo 7º, III, "a" - FI Renda Fixa;

Anexo 03 – Composição da carteira dos ativos enquadrados como Artigo 7º, V, "b" - FI Renda Fixa "Crédito Privado";

Anexo 04 – Composição da carteira dos ativos enquadrados como Artigo 8º, I - FI Ações;

Anexo 05 – Composição da carteira dos ativos enquadrados como Artigo 9º, II - FI Investimento no Exterior;

Anexo 06 – Composição da carteira dos ativos enquadrados como Artigo 9º, III - FI Ações - BDR Nível I;

Anexo 07 – Composição da carteira dos ativos enquadrados como Artigo 10, I - FI Multimercado Aberto.

1. Introdução

O Relatório Semestral de Diligência tem como objetivo evidenciar o acompanhamento da Diretoria de Investimentos e do Comitê de Investimentos das principais informações dos ativos presentes na carteira do Fundo Previdenciário do Município do Ipojuca - FUNPREI, em atendimento à regulamentação referente à gestão dos recursos do Regime Próprio de Previdência Social - RPPS no ano de 2022, em especial a Resolução nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 e a Portaria MTP nº 1.467, de 02 de Junho de 2022. Além disso, também foi considerada a Política de Investimentos vigente para o ano de 2024.

Procurou-se demonstrar que foram atendidos os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e adequação à natureza de suas obrigações e transparência. E que as atividades foram desenvolvidas com boa-fé, lealdade e diligência, além de ter seguido padrões éticos.

Esse relatório também tem o objetivo de atender ao relatório semestral de diligência do nível II do item 3.2.6 do Manual do Pró gestão, em sua versão 3.5 de 17 de Janeiro de 2024.

As fontes das informações constantes nesse relatório foram: Informações repassadas pelas Instituições Financeiras responsáveis pelos ativos, Software Quantum Axis de informações sobre investimentos, Portais especializados em investimentos, Relatórios de rating e Demonstrações Financeiras dos fundos, dentre outros.

1.1. Regulamentação Utilizada

As principais regulamentações para definição dos itens constantes nesse Relatório foram as seguintes:

Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 e demais atualizações;

Portaria do Ministério da Previdência Social nº 1.467, de 02 de junho de 2022 e demais atualizações;

Manual do Pró-Gestão versão 3.5 de 17 de Janeiro de 2024;

Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014; e a

Política de Investimentos do IpojucaPrev para o ano de 2024.

2. Da Carteira de Investimentos

Considerando a periodicidade do relatório, será utilizada a carteira em Junho de 2024, conforme a tabela 1:

Tabela 1

Produto/Fundo	Saldo em 30/06/2024	Participação s/ o total	Resolução CMN 4.963/2021
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 100.718.379,88	19,92%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "a"
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 39.992.979,91	7,91%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF	R\$ 75.101.872,65	14,85%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	R\$ 3.839.169,96	0,76%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	R\$ 2.480.005,40	0,49%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL 2030 III TP FI RF	R\$ 3.422.057,95	0,68%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
BB TP X FI RF PREVID	R\$ 1.107.181,76	0,22%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 2.087.703,51	0,41%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	R\$ 874.860,12	0,17%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	R\$ 12.010.650,26	2,38%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 21.527.533,85	4,26%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 23.004.187,20	4,55%	Artigo 07, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	R\$ 1.332.290,96	0,26%	Artigo 07, Inciso III, Alínea "a"
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	R\$ 11.122.973,83	2,20%	Artigo 07, Inciso III, Alínea "a"
BNB PLUS FIC RF LP	R\$ 1.625.513,23	0,32%	Artigo 07, Inciso III, Alínea "a"
BRABESCO PREMIUM FI RF REF DI	R\$ 20.871.348,30	4,13%	Artigo 07, Inciso III, Alínea "a"
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 19.209.638,05	3,80%	Artigo 07, Inciso III, Alínea "a"
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	R\$ 8.024.064,22	1,59%	Artigo 07, Inciso III, Alínea "a"
TÍTULOS PRIVADOS	R\$ 36.643.298,81	7,25%	Artigo 07, Inciso IV
INVEST DUNAS FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR LP	R\$ 11.512,75	0,00%	Artigo 07, Inciso V "a"
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	R\$ 23.735.124,61	4,69%	Artigo 07, Inciso V "b"
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	R\$ 6.341.730,54	1,25%	Artigo 8, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	R\$ 8.630.539,88	1,71%	Artigo 8, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	R\$ 2.874.534,10	0,57%	Artigo 8, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	R\$ 4.915.868,73	0,97%	Artigo 8, Inciso I
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	R\$ 7.538.376,49	1,49%	Artigo 8, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	R\$ 9.947.681,24	1,97%	Artigo 8, Inciso I
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 3.225.042,46	0,64%	Artigo 8, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.592.913,07	0,91%	Artigo 8, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	R\$ 3.917.637,62	0,77%	Artigo 9, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY FIC FIA IE	R\$ 3.095.558,13	0,61%	Artigo 9, Inciso II
CAIXA EXPERT PIMCO INCOME MULTIMERCADO LP	R\$ 5.530.057,96	1,09%	Artigo 9, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	R\$ 27.090.778,99	5,36%	Artigo 9, Inciso III
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 5.211.402,93	1,03%	Artigo 10, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FIP MULTIESTRATÉGIA	R\$ 2.664.786,45	0,53%	Artigo 10, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	- R\$ 94.267,24	-0,02%	Artigo 10, Inciso II
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - CLASSE B	R\$ 585.627,97	0,12%	Artigo 11
SINGULARE FII - REIT11	R\$ 829.951,62	0,16%	Artigo 11
TOTAL	R\$ 505.640.568,15	100,00%	

3. Critérios Verificados no Relatório Semestral de Diligência

O Relatório de Semestral de Diligência utilizará como base para as análises a posição da carteira referente ao fim do 1º semestre de 2024, conforme informações constantes na tabela 1. A partir disto, serão analisados “critérios referentes às Instituições Financeiras Investidas”, nos quais serão avaliados itens em relação aos prestadores de serviço de administração e gestão dos fundos em carteira e “critérios referentes aos Ativos Investidos”, nos quais serão examinadas as informações e classificações referentes aos fundos em si, comprovando que foi feito o acompanhamento do desempenho ajustado ao risco da carteira de investimentos.

3.1 Critérios referentes às Instituições Financeiras Investidas

Nesse ponto, será demonstrada a diligência realizada pela Diretoria de Investimentos e do Comitê de Investimentos em relação às Instituições Financeiras que prestam serviços de administração e/ou gestão dos ativos presentes em carteira.

3.1.1 Credenciamento das Instituições Financeiras

O processo de Diligência dos investimentos começa a partir do Credenciamento das instituições financeiras que poderão receber aportes dos recursos previdenciários acumulados. De acordo com o inciso IV do § 1º do art. 1º da Resolução nº 4.965/2021, e suas posteriores alterações, os RPPS devem normatizar internamente os critérios, de acordo com o ordenamento legal imposto pelos órgãos reguladores:

*IV - **Adotar regras, procedimentos e controles internos** que visem garantir o cumprimento de suas obrigações, respeitando a política de investimentos estabelecida, observados os segmentos, limites e demais requisitos previstos nesta Resolução e os parâmetros estabelecidos nas normas gerais de organização e funcionamento desses regimes, em regulamentação da Secretaria de Previdência*

As normas internas utilizadas para o credenciamento são as Portarias nº 119, de 09 de novembro de 2017, que foi atualizada pela Portaria nº 69, de 02 de junho de 2021. Além disso, a Portaria nº 70, de 02 de junho de 2021 lista os documentos necessários para que as Instituições Financeiras possam atender aos requisitos exigidos.

Além disso, há um manual com um fluxograma do processo de credenciamento, que atualmente está na sua versão 2.0.

O inciso VI do § 1º do art. 1º da Resolução nº 4.965/2021 preceitua que esse processo deverá ser feito previamente as aplicações, sendo necessário que também seja feito o acompanhamento e avaliação dos requisitos após o aporte:

VI - Realizar o prévio credenciamento, o acompanhamento e a avaliação do gestor e do administrador dos fundos de investimento e das demais

instituições escolhidas para receber as aplicações, observadas os parâmetros estabelecidos de acordo com o inciso IV.

A tabela 2 apresenta a relação das instituições financeiras credenciadas na data-base de Junho de 2024:

Tabela 2

INSTITUIÇÕES CREDENCIADAS	CNPJ	PROCESSO N°	SEGMENTO	DATA CREDENCIAMENTO	CLASSIFICAÇÃO RESOLUÇÃO nº 4.693/2021
CAIXA DTVM S.A.	42.040.639/0001-40	001/2023	GESTOR/ DISTRIBUIDOR	31/01/2023	ATENDE AO ART. 21
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	00.360.305/0001-04	002/2023	ADMINISTRADOR / CUSTODIANTE	24/02/2023	ATENDE AO ART. 21
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM	30.822.936/0001-69	003/2023	ADMINISTRADOR / GESTOR	29/03/2023	ATENDE AO ART. 21
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	37.918.829/0001-88	004/2023	GESTOR	29/03/2023	ATENDE AO ART. 21
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.	27.916.161/0001-86	005/2023	GESTOR	29/03/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	04.506.394/0001-05	006/2023	GESTOR	29/03/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
XP INVESTIMENTOS CCTVM S/A	02.332.886/0001-04	007/2023	DISTRIBUIDOR	29/03/2023	DISTRIBUIDOR
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA.	92.886.662/0001-29	008/2023	GESTOR	27/04/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	03.864.607/0001-08	009/2023	GESTOR	27/04/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	16.500.294/0001-50	010/2023	GESTOR	27/04/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	21.813.291/0001-07	011/2023	GESTOR	27/04/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
PRIVATIZA AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS S/S	00.840.515/0001-08	013/2023	DISTRIBUIDOR	27/04/2023	DISTRIBUIDOR
PERFORME AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS LTDA	10.819.611/0001-10	014/2023	DISTRIBUIDOR	27/04/2023	DISTRIBUIDOR
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM	59.281.253/0001-23	015/2023	ADMINISTRADOR	30/05/2023	ATENDE AO ART. 21
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	29.650.082/0001-00	016/2023	GESTOR	30/05/2023	ATENDE AO ART. 21
BANCO BTG PACTUAL	30.306.294/0001-45	017/2023	ADMINISTRADOR / CUSTODIANTE	30/05/2023	ATENDE AO ART. 21
ITAU UNIBANCO S.A.	60.701.190/0001-04	018/2023	ADMINISTRADOR / DISTRIBUIDOR/ CUSTODIANTE	30/05/2023	ATENDE AO ART. 21
BANCO BRADESCO S.A.	60.746.948/0001-12	019/2023	ADMINISTRADOR	30/05/2023	ATENDE AO ART. 21
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	62.375.134/0001-44	020/2023	GESTOR	30/05/2023	ATENDE AO ART. 21

PRIVATIZA AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS S/S	00.840.515/0001-08	021/2023	DISTRIBUIDOR	30/05/2023	DISTRIBUIDOR
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	03.864.607/0001-08	022/2023	GESTOR	30/05/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE RECURSOS LTDA.	09.630.188/0001-26	023/2023	GESTOR	14/07/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	07.237.373/0001-20	024/2023	GESTOR / DISTRIBUIDOR	27/07/2023	ATENDE AO ART. 21
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S.A	62.318.407/0001-19	025/2023	ADMINISTRADOR / CUSTODIANTE	27/07/2023	ATENDE AO ART. 21
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	03.983.856/0001-12	026/2023	GESTOR	27/07/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
GENIAL GESTAO LTDA.	22.119.959/0001-83	027/2023	GESTOR	27/07/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
RJI CORRETORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA	42.066.258/0001-30	029/2023	ADMINISTRADOR / CUSTODIANTE	29/08/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	07.250.864/0001-00	030/2023	GESTOR	29/08/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	01.522.368/0001-82	031/2023	ADMINISTRADOR / CUSTODIANTE	27/09/2023	ATENDE AO ART. 21
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA	02.562.663/0001-25	032/2023	GESTOR	27/09/2023	ATENDE AO ART. 21
MAGNA AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA	13.426.885/0001-37	034/2023	DISTRIBUIDOR	27/09/2023	DISTRIBUIDOR
BEM - DTVM LTDA	00.066.670/0001-00	035/2023	ADMINISTRADOR	26/10/2023	ATENDE AO ART. 21
ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECURSOS LTDA.	68.622.174/0001-20	036/2023	GESTOR	26/10/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	10.626.543/0001-72	037/2023	GESTOR	26/10/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
GRID AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTO LTDA	17.203.539/0001-40	038/2023	DISTRIBUIDOR	28/11/2023	DISTRIBUIDOR
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	07.078.144/0001-00	001/2024	GESTOR	26/03/2024	ADMINISTRADOR/ GESTOR
BANCO DAYCOVAL	62.232.889/0001-90	002/2024	ADMINISTRADOR	26/03/2024	ATENDE AO ART. 21
EMPIRE CAPITAL AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS	35.796.942/0001-02	003/2024	DISTRIBUIDOR	26/03/2024	DISTRIBUIDOR
INTRAG DTVM	62.418.140/0001-31	004/2024	ADMINISTRADOR	19/06/2024	ATENDE AO ART. 21

Além dessas, as instituições da tabela 3 estão com o credenciamento suspenso por não apresentarem a documentação completa exigida através da regulamentação, não podendo receber recursos. Todas foram notificadas para proceder com a atualização, mas até o momento não foi obtida resposta ou os documentos recebidos não foram suficientes para prosseguir com o credenciamento:

Tabela 3

INSTITUIÇÕES CREDENCIADAS	CNPJ	PROCESSO N°	SEGMENTO	DATA CREDENCIAMENTO	CLASSIFICAÇÃO RESOLUÇÃO nº 4.693/2021
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S/A	02.201.501/0001-61	012/2023	ADMINISTRADOR	27/04/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
PLANNER CORRETORA DE VALORES S/A	00.806.535/0001-54	028/2023	ADMINISTRADOR	29/08/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR
SINGULARE CTVM S.A.	62.285.390/0001-40	033/2023	ADMINISTRADOR / GESTOR	27/09/2023	ADMINISTRADOR/ GESTOR

Os principais critérios que devem ser utilizados também foram descritos pelo § 3º do art. 1º Resolução 4.963/2021. Na seção III do capítulo VI da portaria 1.467/2022, a regulamentação do Credenciamento das Instituições Financeiras foi detalhada, identificando melhor os critérios a serem analisados em seu §§ 2º e 3º do art. 103:

§ 2º Os critérios para o credenciamento das instituições deverão estar relacionados à boa qualidade de gestão, ao ambiente de controle interno, ao histórico e experiência de atuação, à solidez patrimonial, ao volume de recursos sob administração, à exposição a risco reputacional, ao padrão ético de conduta e à aderência da rentabilidade a indicadores de desempenho e a outros destinados à mitigação de riscos e ao atendimento aos princípios de segurança, proteção e prudência financeira.

§ 3º Para o credenciamento da instituição, deverão ser observados e formalmente atestados pela unidade gestora do RPPS:

I - registro ou autorização na forma do § 1º e inexistência de suspensão ou inabilitação pela CVM, pelo Banco Central do Brasil ou por outro órgão competente;

II - observância de elevado padrão ético de conduta nas operações realizadas no mercado financeiro e ausência de restrições que, a critério da CVM, do Banco Central do Brasil ou de outros órgãos competentes, desaconselhem um relacionamento seguro;

III - análise do histórico de sua atuação e de seus principais controladores;

IV - experiência mínima de 5 (cinco) anos dos profissionais diretamente relacionados à gestão de ativos de terceiros; e

V - análise quanto ao volume de recursos sob sua gestão e administração, bem como quanto a qualificação do corpo técnico e segregação de atividades.

Anteriormente, os credenciamentos deveriam ser atualizados 1 vez por ano. Porém, com a emissão da portaria 1.467/2022, esse prazo passou para 2 anos. A Secretaria da Previdência considerou que os credenciamentos válidos até 03/07/2022, ganharam mais um ano. E os novos credenciamentos que forem feitos a partir de 03/07/2022 precisarão ser atualizados a cada dois anos.

Além disso, todos os documentos foram repassados previamente para os membros do Comitê de Investimentos, Conselho Deliberativo e Conselho Fiscal, sendo pauta da reunião destes órgãos colegiados.

3.1.2 Identificação do Atendimento ao art. 21

Visando dar maior segurança aos investimentos realizados pelos RPPS, a Resolução nº 4.963/2021, que sucedeu a Resolução nº 3.922/2010 manteve algumas exigências para que as Instituições Financeiras possam receber recursos de RPPS:

2º Os regimes próprios de previdência social somente poderão aplicar recursos em cotas de fundos de investimento quando atendidas, cumulativamente, as seguintes condições:

I - o administrador ou o gestor do fundo de investimento seja instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos, nos termos da regulamentação do Conselho Monetário Nacional;

A confirmação do atendimento a esse critério é realizada a partir da lista exaustiva emitida pela Secretaria de Previdência da Secretaria Especial de Previdência e Trabalho do Ministério da Economia, que publica a lista de acordo com as informações do BACEN. Na vigência desse relatório, a relação mais atualizada era a que foi atualizada no dia 23 de Setembro de 2022. Posteriormente, na data de 22 de Abril de 2024, a lista foi novamente atualizada pela SPREV.

Conforme IV do art. 106º da Portaria MTP 1467/2022, foram utilizados os Termos de credenciamentos de acordo com os modelos disponibilizados pela SPREV.

A tabela 4 traz a comprovação do atendimento aos itens, de acordo com a lista:

Tabela 4

CNPJ	Instituição Financeira	Conglomerado
00.066.670	BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	BRASESCO
00.360.305	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
01.181.521	BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	BCO COOPERATIVO SICREDI
01.522.368	BANCO BNP PARIBAS BRASIL SA	BNP PARIBAS
01.638.542	SAFRA WEALTH D T V MOB LTDA	SAFRA
02.332.886	XP INVESTIMENTOS CCTVM 5/A	XP INVESTIMENTOS CCTVM 5/A
03.017.677	BANCO J. SAFRA S.A.	SAFRA
03.384.738	BV DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	VOTORANTIM

03.502.968	SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	SANTANDER
07.237.373	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	BCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.
07.397.614	SICOOB DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	BANCOOB
15.213.150	BOCOM BBM CCVM S.A.	BOCOM
16.683.062	MERCANTIL DO BRASIL CORRETORA S/A CTVM	MERCANTIL DO BRASIL
17.364.795	MERCANTIL DO BRASIL DISTRIBUIDORA S/A TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	MERCANTIL DO BRASIL
18.945.670	INTER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	INTER
28.156.057	BANESTES DTVM S/A	BANESTES
29.650.082	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM	BTG PACTUAL
30.822.936	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S. A.	BB
31.597.552	BANCO CLASSICO S.A.	BCO CLASSICO S.A.
33.311.713	ITAU DTVM S.A.	ITAU
33.479.023	BANCO CITIBANK S.A.	CITIBANK
33.850.686	BRB DTVM S/A	BRB
58.160.789	BANCO SAFRA S.A.	SAFRA
59.281.253	BTG PACTUAL PSF	BTG PACTUAL
60.701.190	ITAU UNIBANCO S.A.	ITAU
60.746.948	BANCO BRADESCO S.A.	BRADESCO
60.770.336	BANCO ALFA DE INVESTIMENTO S.A.	ALFA
61.809.182	CREDIT SUISSE HEDGING GRIFFO CORRETORA DE VALORES S.A.	CREDIT SUISSE
62.232.889	BANCO DAYCOVAL S.A	BCO DAYCOVAL S.A.
62.318.407	SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	SANTANDER
62.375.134	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS	BRADESCO
62.418.140	INTRAG DTVM LTDA	ITAU
90.400.888	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	SANTANDER
93.026.847	BANRISUL S.A. CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS E CÂMBIO	BANRISUL
Instituições Elegíveis apenas para emitir ativos do Art. 7, IV		
CNPJ	Instituição Financeira	Conglomerado
31.872.495	BANCO C6 S.A.	BANCO C6 S.A.

Vale ressaltar que embora algumas instituições não estejam presentes na “lista exaustiva”, o inciso I do § 2º ao art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2012 determina que o administrador ou gestor dos fundos seja instituição presente na lista. Portanto, todos os fundos líquidos presentes em carteira estão devidamente enquadrados no que determina a legislação. A exceção são os fundos em processo de liquidação, conforme explicado no item 4 desse relatório.

3.1.3 Volume de Recursos Sob Administração e Gestão

Conforme descrito anteriormente, o volume de recursos sob a gestão e a administração das Instituições Financeiras são alguns dos critérios a serem analisados para evitar o risco de concentração.

Visando reduzir esse risco de concentração, o art. 20º da Resolução CMN nº 4.963/2021 impõe alguns limites sobre os valores investidos por um RPPS em relação ao total de recursos de gestão de terceiros geridos por um mesmo Gestor:

Art. 20. 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 definidas pela CVM em regulamentação específica.

A tabela 5 apresenta um resumo do atendimento a esse requisito da resolução.

Tabela 5

CNPJ da Instituição Gestora	Instituição Gestora	Valor (R\$)	% do PL FUNPREI	% sob o valor total Gerido
42.040.639/0001-40	CAIXA DTVM S.A.	R\$ 176.253.918,15	34,86%	0,03%
30.822.936/0001-69	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S/A	R\$ 68.073.583,32	13,46%	0,00%
29.650.082/0001-00	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM	R\$ 27.484.518,83	5,44%	0,01%
62.375.134/0001-44	BRAM DTVM S/A	R\$ 20.871.348,30	4,13%	0,00%
03.864.607/0001-08	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 13.235.467,15	2,62%	0,13%
68.622.174/0001-20	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 12.010.650,26	2,38%	0,03%
04.506.394/0001-05	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	R\$ 9.947.681,24	1,97%	0,04%
10.626.543/0001-72	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	R\$ 8.630.539,88	1,71%	0,37%
03.983.856/0001-12	4UM GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	R\$ 7.538.376,49	1,49%	0,29%
37.918.829/0001-88	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA.	R\$ 7.013.195,75	1,39%	0,00%
40.430.971/0001-96	ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA.	R\$ 4.915.868,73	0,97%	0,00%
09.630.188/0001-26	PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	R\$ 4.592.913,07	0,91%	0,01%
07.237.373/0001-20	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S/A	R\$ 3.713.216,74	0,73%	0,02%
07.250.864/0001-00	QLZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 3.506.250,82	0,69%	0,72%
62.285.390/0001-40	SINGULARE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	R\$ 585.627,97	0,12%	0,01%
22.119.959/0001-83	GENIAL GESTÃO LTDA.	- R\$ 94.267,244	-0,02%	0,00%
TOTAL		R\$ 368.278.889,46	72,83%*	

* O restante da carteira está investido da seguinte forma: R\$ 100.718.379,88 (19,92%) em compra direta de Título Público Federal, não tendo instituição gestora; R\$ 36.643.298,81 (7,25%) em Títulos Privados emitidos pelo Banco BTG Pactual.

Já no Inciso II do §2º do art. 21º, a Resolução CMN nº 4.963/2021 também limita os percentuais de aplicação dos RPPS em geral em relação ao total de recursos sob administração:

II - O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social;

A tabela 6 apresenta um resumo do atendimento a esse requisito da resolução.

Tabela 6

CNPJ da Instituição ADM	Instituição ADM	Valor FUNPREI	% do PL FUNPREI	% sob o valor total Gerido
00.360.305/0001-04	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	R\$ 176.253.918,15	34,86%	0,03%
30.822.936/0001-69	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	R\$ 68.073.583,32	13,46%	0,00%
00.066.670/0001-00	BEM DTVM	R\$ 46.007.946,85	9,1%	0,01%
59.281.253/0001-23	BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	R\$ 27.484.518,83	5,44%	0,01%
60.746.948/0001-12	BANCO BRADESCO	R\$ 20.871.348,30	4,13%	0,00%
62.418.140/0001-31	INTRAG DTVM LTDA.	R\$ 9.947.681,24	1,97%	0,00%
01.522.368/0001-82	BANCO BNP PARIBAS	R\$ 7.013.195,75	1,39%	0,01%
60.701.190/0001-04	ITAÚ UNIBANCO	R\$ 4.915.868,73	0,97%	0,00%
62.318.407/0001-19	SANTANDER CACEIS DTVM	R\$ 3.713.216,74	0,73%	0,00%
02.201.501/0001-61	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	R\$ 2.664.786,45	0,53%	0,00%
00.806.535/0001-54	PLANNER CORRETORA	R\$ 829.951,62	0,16%	0,01%
62.285.390/0001-40	SINGULARE CTVM	R\$ 597.140,72	0,12%	0,00%
42.066.258/0001-30	RJI CORRETORA DE VALORES	- R\$ 94.267,24	-0,02%	0,00%
TOTAL		R\$ 368.315.739,96	72,83%*	

* O restante da carteira está investido da seguinte forma: R\$ 100.718.379,88 (19,92%) em compra direta de Título Público Federal, não tendo instituição gestora; R\$ 36.643.298,81 (7,25%) em Títulos Privados emitidos pelo Banco BTG Pactual.

Nas tabelas 5 e 6 foram detalhados os valores de investimentos do FUNPREI e dos RPPS, relacionando-os com os valores totais de recursos sob administração e sob gestão. A fonte dos dados da indústria de RPPS e do valor total gerido e administrados pelas Instituições foram tirados dos Rankings da Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais-ANBIM. Esses rankings são atualizados mensalmente e podem ser acessados a partir do link a seguir:

https://www.anbima.com.br/pt_br/informar/ranking/fundos-de-investimento/fundos-de-investimento.htm

3.1.4 Qualidade de Gestão e Ratings

O Inciso III do §2º do art. 21º da Resolução CMN nº 4.963/2021 se refere sobre a necessidade dos investimentos serem feitos em fundos que tenham administradores e gestores considerados como de boa qualidade de gestão pelos responsáveis pela gestão de recursos do RPPS:

*III - o gestor e o administrador do fundo de investimento tenham sido objeto de prévio credenciamento, de que trata o inciso VI do § 1º do art. 1º, e **sejam considerados pelos responsáveis pela gestão de recursos do regime próprio de previdência social como de boa qualidade de gestão e de ambiente de controle de investimento.***

Para padronizar a forma de atendimento a esse critério, o art. 6º da Portaria nº 119/2017 do IpojucaPrev, referente ao credenciamento das Instituições Financeiras, regulamentou que a principal fonte para comprovar esse requisito seria a partir do relatório de rating realizado por uma agência avaliadora de risco independente:

***Art. 6º** Estarão impedidos de participar de qualquer fase do processo de credenciamento regulamentado nesta Portaria, os interessados que se enquadrem em uma ou mais situações a seguir previstas:*

(...)

VI - a Instituição Financeira que apresentar relatório de classificação de risco (Rating Nacional de longo prazo), inferior às classificações a seguir.

Moody's: Baa3;

Standard & Poor's: BBB

Fitch Ratings: BBB-;

Austin Rating: brBBB-;

SR Rating: BBB-;

Liberum Ratings: BBB-;

LF Rating: BBB-.

VII - o Gestor de Fundo de Investimento que apresentar relatório de classificação de boa qualidade de gestão e de ambiente de controle de investimento (Rating de Qualidade de Gestão), inferior às classificações a seguir:

Moody's: MQ3;

Standard & Poor's: AMP-3;

Fitch Ratings: M3;

Austin Rating: QG 3;

SR Rating: A;

Liberum Ratings: AM3;

LF Rating: LFg3.

O §1º do art. 125 da Portaria MPT nº 1.467/2022 também apresenta a importância das agências classificadoras de rating como forma de analisar os riscos das instituições

§ 1º Deverá ser realizada a análise prévia dos riscos dos investimentos, sendo que a utilização de avaliação de agência classificadora de risco registrada na CVM ou reconhecida por essa autarquia constitui um dos elementos a serem considerados, não substituindo a responsabilidade dos participantes dos processos decisórios do RPPS.

A Portaria nº 70/2021 do IpojucaPrev, que discrimina os documentos a serem apresentados para satisfazer as exigências impostas pela Portaria nº119/2017 ainda determina o que deve ser realizado em caso de a Instituição Financeira não apresentar o Relatório de Rating atualizado.

§ 3º Caso a Instituição, que em seu primeiro credenciamento, não possuir o Relatório de Rating atualizado, o documento poderá ser substituído por Parecer Técnico de empresa qualificada e deverá ser apresentado previamente ao Comitê de Investimento.

A tabela 7 discrimina o rating utilizado no processo de credenciamento de cada uma das Instituições Financeiras Investidas, que deverão ser atualizados anualmente.

Tabela 7

Nome da Instituição	Empresa de rating	Nota	Escala Nota	Data Rating	Especificações e detalhamento do Rating	Histórico de Rating
CAIXA DTVM	Fitch Rating	IMQR	Excelente	09/08/2023	Processo de Investimento: Excelente Recursos de Investimento: Excelente Gestão de Risco: Excelente Desempenho dos Investimentos: Consistente Companhia & Atendimento a Clientes: Excelente	Fitch Rating – Ago/23: Forte* Fitch Rating – Ago/20: Forte* Fitch Rating – Set/19: Forte* Fitch Rating – Set/18: Forte* * Histórico da VIART, ligado à CEF
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	Moody's	MQ1	Excelente	06/08/2023	(i) processo disciplinado e bem estabelecido de gestão de investimentos da gestora, (ii) forte posição de mercado e valor de franquia proporcionados por seu controlador, o Banco do Brasil, (iii) fortes fundamentos financeiros da gestora, (iv) forte cultura fiduciária de gestão de risco e controles, e (v) sólido desempenho ajustado ao risco de seus fundos. A Moody's comentou que, as múltiplas camadas de supervisão e o fato de o conglomerado ser propriedade do governo federal aumentam a pressão para que a BB DTVM tenha procedimentos de controle e gestão de riscos muito rigorosos.	Moody's – Out/23: MQ1 Moody's – Mar/23: MQ1 Moody's – Jun/21: MQ1 Moody's – Jan/20: MQ1 Moody's – Dez/18: MQ1

SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	S&P Global Ratings	AMP-1	Muito Forte	19/03/2024	<p>A classificação reflete o perfil de negócios forte, a experiente equipe de gestão e o mix adequado de produtos da SAMI, bem como os benefícios de pertencer ao Grupo SulAmérica ("Grupo"). A classificação também reflete a disciplina em seus processos de investimentos, seus bons princípios fiduciários, e suas boas práticas relativas a operações e controles. Vemos a SAMI como uma gestora consolidada, reconhecida e com forte expertise nos segmentos que compõem a base de seu negócio, quais são atuar junto ao segmento de previdência aberta, fundos de pensão e empresas corporativas, além de gerir os recursos próprios do grupo ao qual pertencem</p>	<p>S&P Global Ratings – Mar/24: AMP-1 S&P Global Ratings – Jul/21: AMP-1 S&P Global Ratings – Jul/20: AMP-1 S&P Global Ratings – Jul/20: AMP-1 S&P Global Ratings – Jun/19: AMP-1 S&P Global Ratings – Abr/18: AMP-1</p>
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	Moody's	MQ1	Excelente	29/02/2024	<p>A avaliação MQ1.br da BRAM é baseada principalmente em: (i) processo disciplinado de gestão de investimentos da gestora, suportado por sólidas operações e procedimentos de gestão de risco, (ii) forte posição de mercado e valor de franquia proporcionados por seu controlador, o Banco Bradesco, (iii) sólidos fundamentos financeiros da gestora, (iv) forte cultura fiduciária de gestão de risco e controles, e (v) no sólido desempenho ajustado ao risco de seus fundos. A avaliação também reflete o portfólio de produtos bem diversificado, a base de clientes pulverizada e pelos canais do banco.</p>	<p>Moody's – Fev/24: MQ1 Moody's – Jun/21: MQ1 Moody's – Jul/20: MQ1 Moody's – Fev/19: MQ1</p>
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	Fitch Rating	5	Excelente	26/07/2024	<p>Processo de Investimento Excelente Recursos de Investimento Excelente Gestão de Risco Excelente Companhia & Atendimento a Clientes: Excelente Desempenho dos Investimentos Consistente</p>	<p>Fitch Rating – Jun/23: Excelente Fitch Rating – Jun/20: Excelente Fitch Rating – Mai/19: Excelente Fitch Rating – Abr/18: Excelente</p>
XP ASSET MANAGEMENT	Moody's	MQ1	Excelente	07/03/2024	<p>A avaliação MQ1.br reflete os atributos de alta qualidade da XP Asset Management, que incluem: (i) resultados de investimentos sólidos e consistentes de seus fundos ao longo de um horizonte de tempo considerável; (ii) crescimento sólido dos seus ativos sob gestão; (iii) suporte e supervisão do Grupo XP e (iv) melhora contínua das suas atividades de gestão através de investimentos em controles e sistemas, assim como fortalecimento das áreas de risco e compliance. A avaliação da XP Asset Management também reflete os processos de investimentos disciplinados, seus controles eficientes de gestão de risco e o alto nível de experiência e qualificação de seus profissionais.</p>	<p>Moody's – Mar/24: MQ1 Moody's – Jun/21: MQ1 Moody's – Dec/20: MQ1</p>

CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	Austin ratings	QG2-	Bom	13/09/2023	(i) muito boa formação acadêmica e experiência profissional da equipe de colaboradores da Gestora, com passagens por instituições financeiras e outras gestoras de recursos (...) (iv) potencial aumento do volume de ativos sob gestão, tendo sido desenvolvido relacionamento comercial com um conjunto variado de aplicadores classificados por categoria de investidor (...) (ix) muito bom processo de investimento na gestão dos fundos longonly e multimercados, combinando, a modelagem, implantação computacional e controle de risco de estratégias sistemáticas(...) (xv) a gestão de riscos encontra-se devidamente sintonizada com o processo de investimento (...) (xvii) a Gestora busca estar em conformidade com as principais práticas e normas que norteiam a atividade de gestão de recursos, baseada em instruções e atos normativos expedidos por órgãos reguladores, dispondo de políticas documentadas e disponíveis ao público investidor.	Austin Ratings - Set/23: Elevação: 'QG2- Austin Ratings - Set/22: Elevação: 'QG2- Austin Ratings - Set/21: Elevação: 'QG2- Austin Ratings - Set/20: Afirmção: 'QG3+ Austin Ratings - Set/19: Elevação: 'QG3+
					Processo de Investimento: Excelente Recursos de Investimento: Excelente Gestão de Risco: Excelente Desempenho dos Investimentos: Consistente Companhia & Atendimento a Clientes: Excelente	
ITAÚ UNIBANCO	Fitch Rating	5	Excelente	21/12/2023		Fitch Rating – Out/20: Excelente Fitch Rating – Out/20: Excelente Fitch Rating – Set/19: Excelente Fitch Rating – Set/18: Excelente
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	Austin ratings	QG3+	Bom	02/02/2021	(i) ampla experiência profissional e boa formação acadêmica da equipe de colaboradores da Gestora (...) (ii) longo tempo de atuação da Gestora, o que permite a avaliação da consistência da estratégia em curso, do volume de recursos sob gestão, do desempenho dos fundos geridos pela empresa, da análise de investimento e dos controles em funcionamento, bem como de seu corpo de colaboradores, da política de recursos humanos e a retenção dos bons colaboradores; (...) (iv) a Gestora apresenta uma prateleira diversificada de produtos, dividida entre veículos locais e externos, entre fundos de investimento, carteiras administradas e clubes de investimento e, entre gestão ativa de carteiras e alocação de recursos (...) (vii) a Gestora conta com bom processo de investimento na gestão de fundos de créditos estressados, sendo realizado um diagnóstico detalhado de cada ativo presente nas carteiras desses fundos segundo a análise dos documentos relativos às operações de crédito, assim como das garantias que respaldam estas operações(...) (ix) a gestão de renda variável se encontra bem organizada em torno do gestor principal que exerce concomitantemente a atividade de análise de investimentos.(...)	Austin Ratings - Fev/21: QG3+ Austin Ratings - Jan/20: QG3+ Austin Ratings - Jan/19: QG3+

SINGULARE INVEST	Não enviou rating atualizado	-	-	-	-	-
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	S&P Global Ratings	BB-	Estável	11/02/2022	<p>A perspectiva estável para os próximos 12 meses do BNB reflete a do Brasil (BB-/Estável/B). As classificações neste último restringem aqueles no banco devido à sua exposição significativa a títulos do governo e à ligação muito forte com o governo, uma vez que o governo federal controla o BNB. Dada a sua importância como banco de desenvolvimento regional e sua propriedade governamental, incorporamos esse suporte em nosso rating, mas ele não reflete nenhum nível de suporte porque o perfil de crédito autônomo (SACP) do banco é superior ao rating do soberano e do BNB. Portanto, esperamos que os ratings do BNB se movam em conjunto com os ratings soberanos.</p>	S&P Global Ratings – Dez/22: BB-
PLURAL	Fitch ratings	IMQR	Forte	02/04/2024	<p>Processo de Investimento: Alterado para Excelente, de Forte</p> <p>Recursos de Investimento: Excelente</p> <p>Gestão de Risco: Forte</p> <p>Companhia e Atendimento ao Cliente: Forte</p> <p>Desempenho do Investimento: Consistente</p>	<p>Fitch Rating – Abr/24: Forte</p> <p>Austin Ratings – Abr/21: 'QG 2'</p> <p>Austin Ratings – Fev/20: 'QG 2'</p> <p>Austin Ratings – Jan/19: 'QG 2'</p>
BNP PARIBAS	Fitch ratings	IMQR	Excelente	22/12/2023	<p>Processo de Investimentos: Excelente</p> <p>Recursos de Investimentos: Excelente</p> <p>Gestão de Risco: Excelente</p> <p>Companhia & Atendimento a Clientes: Excelente</p> <p>Desempenho dos Investimentos: Consistente</p>	<p>Fitch Rating – Dez/23: Excelente</p> <p>S&P Global Ratings – Jun/20: AMP-1</p> <p>S&P Global Ratings – Jul/19: AMP-1</p>
RJI CORRETORA	SR Rating	G3+		10/10/2023	<p>Segurança boa. Fatores de proteção adequados ou, pelo menos razoáveis. Riscos por fatores internos ou ambientais, em geral, baixos. Algumas vulnerabilidades a mudanças bruscas, internas ou do ambiente.</p>	<p>SR Rating – Out/23: G3+</p> <p>SR Rating – Set/22: G3+</p>
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	Austin ratings	QG 2	Estável	13/11/2023	<p>i) larga experiência de seu quadro técnico e sólida formação do quadro de colaboradores, com passagens por instituições financeiras e outras gestoras de recursos; (ii) a empresa apresenta longo tempo de atuação e de <i>track record</i> nos fundos sob gestão, o que permitiu a devida avaliação da consistência da estratégia em curso, da política de recursos humanos e a retenção dos bons colaboradores, bem como do desempenho do volume de recursos sob gestão, da análise de ações, do processo de investimento, da <i>performance</i> dos fundos e dos controles em funcionamento; (iii) foco de atuação bem definido no segmento de gestão de fundos de investimento em ações, notadamente na estratégia <i>long only</i>, com a busca de distribuição dos produtos para uma gama variada de aplicadores classificados por</p>	<p>Austin ratings – Nov/23: Elevação: QG 2</p> <p>Austin ratings – Dez/22: Afirmação: QG 2-</p> <p>Austin ratings – Jan/22: Afirmação: QG 2-</p> <p>Austin ratings – Mar/21: Elevação: QG 2-</p> <p>Austin ratings – Out/20: Atribuição: QG3+</p>

categoria de investidor; **(iv)** entre novembro de 2022 e setembro de 2023, observou-se o aumento da captação líquida de recursos de R\$ 661,1 milhões e a entrada de novos aplicadores com destaque para um investidor institucional; **(v)** a Gestora conta com muito boa pesquisa própria de empresas, com o emprego de metodologia e modelos de análise condizentes com os tipos de companhias alinhadas à sua filosofia de investimento; **(vi)** a gestão de riscos encontra-se devidamente alinhada e faz parte da filosofia e processo de investimento da Guepardo; **(vii)** elevado nível de conformidade com as principais práticas e normas que norteiam a atividade de gestão de recursos, baseada em instruções e atos normativos expedidos por órgãos reguladores, dispondo de manuais e políticas internas documentadas e atualizadas ao público investidor. **(viii)** os fundos de investimento de ações sob gestão da Guepardo têm apresentado muito boa relação risco/retorno e superado sobremaneira seus respectivos *benchmarks*, desde seu início de funcionamento e em janelas de comparação mais curtas. (...)

Perspectiva do ambiente operacional revisada para estável; Forte franquia de nicho; Perfil de risco bem administrado; Qualidade dos ativos sob controle; Rentabilidade resiliente; Capitalização adequada; Captação e liquidez estáveis.

Fitch Rating – Abr/23: AA+

IDRs e ratings nacionais são movidos pelo perfil de crédito individual das entidades, expresso pelo RV, 'bb+'. O RV está um grau acima do rating soberano do Brasil (BB/Estável), refletindo o perfil de crédito individual muito forte do grupo e a visão da Fitch de que estas entidades provavelmente conseguiriam honrar suas obrigações em caso de inadimplência do soberano, sem quaisquer restrições por parte deste. Uma eventual elevação dos ratings é limitada a um grau, devido à alta exposição do grupo ao soberano, principalmente por meio de posições em títulos do governo, e à alta concentração de suas operações no Brasil. A Perspectiva Estável dos IDRs de Longo Prazo reflete a do rating do Brasil.

Fitch Rating – Dez/23: Estável

3.1.5 Solidez Patrimonial

A solidez patrimonial é importante para verificar a capacidade de a Instituição continuar desempenhando bem as suas atividades, fazendo com que tenha a continuidade da gestão/administração dos fundos de investimentos para os quais prestam serviços.

De acordo com a Portaria nº 70/2021, que detalha a documentação para credenciamento, são solicitados os seguintes documentos para as Instituições Financeiras comprovarem a solidez patrimonial:

1.3 Documentos que comprovem solidez patrimonial

1.3.1 Demonstrações Financeiras e Contábeis dos dois exercícios anteriores ao exercício de credenciamento.

1.3.2 Certidão Negativa de Falência ou Concordata expedida pelo distribuidor da Justiça do domicílio ou sede da entidade.

Tabela 8

CNPJ	Instituição	Atribuição	DFs dos dois últimos anos	Certidão Negativa de Falência
42.040.639/0001-40	CAIXA DTVM S.A.	GESTOR/ DISTRIBUIDOR	N/A	OK
00.360.305/0001-04	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	OK	OK
30.822.936/0001-69	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM	ADMINISTRADOR/ GESTOR	OK	OK
37.918.829/0001-88	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	GESTOR	OK	OK
27.916.161/0001-86	OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.	GESTOR	OK	OK
04.506.394/0001-05	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	GESTOR	OK	OK
02.332.886/0001-04	XP INVESTIMENTOS CCTVM S/A	DISTRIBUIDOR	OK	OK
92.886.662/0001-29	SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA.	GESTOR	OK	OK
03.864.607/0001-08	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	GESTOR	OK	OK
16.500.294/0001-50	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	GESTOR	OK	OK
21.813.291/0001-07	SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	GESTOR	OK	OK
02.201.501/0001-61	BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S/A	ADMINISTRADOR	OK	OK
00.840.515/0001-08	PRIVATIZA AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS S/S	DISTRIBUIDOR	OK	OK
10.819.611/0001-10	PERFORME AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS LTDA	DISTRIBUIDOR	N/A	N/A
59.281.253/0001-23	BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM	ADMINISTRADOR	OK	OK
29.650.082/0001-00	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	GESTOR	OK	OK
30.306.294/0001-45	BANCO BTG PACTUAL	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	OK	OK
60.701.190/0001-04	ITAU UNIBANCO S.A.	ADMINISTRADOR/ DISTRIBUIDOR/ CUSTODIANTE	OK	OK
60.746.948/0001-12	BANCO BRADESCO S.A.	ADMINISTRADOR	OK	OK
62.375.134/0001-44	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	GESTOR	OK	OK
09.630.188/0001-26	PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE RECURSOS LTDA.	GESTOR	OK	OK
07.237.373/0001-20	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S/A	GESTOR / DISTRIBUIDOR	OK	OK

62.318.407/0001-19	SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S/A	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	OK	OK
03.983.856/0001-12	4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	GESTOR	OK	OK
22.119.959/0001-83	GENIAL GESTAO LTDA.	GESTOR	OK	OK
00.806.535/0001-54	PLANNER CORRETORA DE VALORES S/A	ADMINISTRADOR	OK	OK
42.066.258/0001-30	RJI CORRETORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	OK	OK
07.250.864/0001-00	QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	GESTOR	OK	OK
01.522.368/0001-82	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	OK	OK
02.562.663/0001-25	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA	GESTOR	OK	OK
62.285.390/0001-40	SINGULARE CTVM S.A.	ADMINISTRADOR/ GESTOR	OK	OK
13.426.885/0001-37	MAGNA AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA	DISTRIBUIDOR	OK	OK
00.066.670/0001-00	BEM - DTVM LTDA	ADMINISTRADOR	OK	OK
68.622.174/0001-20	ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECURSOS LTDA.	GESTOR	OK	OK
10.626.543/0001-72	CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	GESTOR	OK	OK
17.203.539/0001-40	GRID AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTO LTDA	DISTRIBUIDOR	OK	OK
07.078.144/0001-00	GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	GESTOR	OK	OK
62.232.889/0001-90	BANCO DAYCOVAL	ADMINISTRADOR	OK	OK
35.796.942/0001-02	EMPIRE CAPITAL AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS	DISTRIBUIDOR	OK	OK
62.418.140/0001-31	INTRAG DTVM	ADMINISTRADOR	OK	OK

3.1.6 Padrão Ético de Conduta e Exposição a Risco Reputacional

A Portaria nº 70/2021 do IpojucaPrev, que discrimina os documentos a serem apresentados para satisfazer as exigências impostas pela Portaria nº 119/2017 determina que as Instituições Financeiras deverão preencher e assinar uma declaração, sob as penas da lei, constando algumas informações sobre o seguimento de padrões éticos de conduta, tais como:

- a) *Não tem em seu quadro de empregados, menores de 18 anos em trabalho noturno, perigoso ou insalubre, bem como em qualquer trabalho, menores de 16 anos, salvo na condição de aprendiz, a partir de 14 anos, consoante o inciso XXXIII, do artigo 7º da Constituição Federal e o que se estabeleceu no artigo 1º, da Lei nº 9.854, de 27 de outubro de 1999.*
- b) *Não se encontra impedida, nem suspensa, nem foi declarada inidônea para participar de licitações, ou contratar com o Poder Público. Informará, sob as penalidades cabíveis, a superveniência de fato impeditivo ou suspensivo da manutenção do Credenciamento.*
- c) *É possuidora de elevado padrão de ética de conduta nas*

operações realizadas no mercado, a critério do Banco Central do Brasil, da Comissão de Valores Mobiliários ou de outros órgãos competentes desaconselham um relacionamento seguro.

A ANBIMA - Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais representa bancos, corretoras e distribuidoras de valores mobiliários, gestoras de ativos e administradoras de patrimônios. O seu objetivo é fortalecer o setor e permitir a qualificação e a evolução do mercado financeiro nacional. Suas funções estão divididas em torno de quatro compromissos: informar, representar, autorregular e educar.

No campo de autorregulação, com o objetivo de fortalecer o mercado, a ANBIMA desenvolveu um modelo de autorregulação que pode ser utilizado, inclusive, para quem não é associado. Os Códigos de Autorregulação e Melhores Práticas apresentam as normas criadas e atualizadas constantemente, conforme as necessidades e exigências do mercado. A equipe da Anbima acompanha e oferece orientações, com caráter educativo, sempre que preciso. Através da consulta ao site da ANBIMA, é possível verificar quais são os códigos da ANBIMA que são seguidos por cada uma das Instituições Financeiras.

Semestralmente, A ANBIMA emite um relatório de supervisão das instituições aderentes aos seus códigos, trazendo uma relação completa de adesões, cancelamentos, cartas de orientação e penalidades ocorridos durante o período de referência. Até o momento, ainda não havia sido emitido esse relatório da ANBIMA referente ao primeiro semestre de 2024. O relatório mais atualizado é o referente ao segundo semestre de 2023, no qual não foram encontrados apontamentos relevantes em relação às Instituições credenciadas.

3.1.7 Regularidade Fiscal e Previdenciária

A Portaria nº 70/2021 do IpojucaPrev, que discrimina os documentos a serem apresentados para satisfazer as exigências impostas pela Portaria nº 119/2017 determina as certidões que deverão ser apresentadas pelas Instituições Financeiras para comprovar a regularidade fiscal e previdenciária:

1.2 Documentos de Regularidade Fiscal e Previdenciária

1.2.1 Certidão negativa ou positiva com efeito de negativa com a Fazenda Pública Municipal da sede da instituição;

1.2.2 Certidão negativa ou positiva com efeito de negativa com a Fazenda Pública Estadual da sede da instituição;

1.2.3 Certidão negativa ou positiva com efeito de negativa com a Fazenda Pública relativa aos tributos federais e à dívida ativa da União;

1.2.4 Certificado de Regularidade do FGTS – CRF;

A tabela 9 identifica a regularidade fiscal e previdenciária de cada uma das Instituições Investidas no momento do credenciamento.

Tabela 9

Instituições Financeiras				Credenciamento			
CNPJ	Instituição	Atribuição	Data de Credenciamento	CERTIDÃO MUNICIPAL	CERTIDÃO ESTADUAL	CERTIDÃO FEDERAL	CERTIDÃO FGTS
42.040.639/0001-40	CAIXA DTVM S.A.	GESTOR/ DISTRIBUIDOR	31/01/2023	OK	OK	OK	OK
00.360.305/0001-04	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	24/02/2023	OK	OK	OK	OK
30.822.936/0001-69	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM	ADMINISTRADOR/ GESTOR	29/03/2023	OK	OK	OK	OK
37.918.829/0001-88	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	GESTOR	29/03/2023	OK	OK	OK	OK
27.916.161/0001-86	OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.	GESTOR	29/03/2023	OK	OK	OK	OK
04.506.394/0001-05	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	GESTOR	29/03/2023	OK	OK	OK	OK
02.332.886/0001-04	XP INVESTIMENTOS CCTVM S/A	DISTRIBUIDOR	29/03/2023	OK	OK	OK	OK
92.886.662/0001-29	SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA.	GESTOR	27/04/2023	OK	OK	OK	OK
03.864.607/0001-08	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	GESTOR	27/04/2023	OK	OK	OK	OK
16.500.294/0001-50	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	GESTOR	27/04/2023	OK	OK	OK	OK
21.813.291/0001-07	SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	GESTOR	27/04/2023	OK	OK	OK	OK
02.201.501/0001-61	BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S/A	ADMINISTRADOR	27/04/2023	OK	OK	OK	OK
00.840.515/0001-08	PRIVATIZA AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS S/S	DISTRIBUIDOR	27/04/2023	OK	OK	OK	OK
10.819.611/0001-10	PERFORME AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS LTDA	DISTRIBUIDOR	27/04/2023	OK	OK	OK	OK
59.281.253/0001-23	BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM	ADMINISTRADOR	30/05/2023	OK	OK	OK	OK
29.650.082/0001-00	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	GESTOR	30/05/2023	OK	OK	OK	OK
30.306.294/0001-45	BANCO BTG PACTUAL	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	30/05/2023	OK	OK	OK	OK
60.701.190/0001-04	ITAU UNIBANCO S.A.	ADMINISTRADOR/ DISTRIBUIDOR/ CUSTODIANTE	30/05/2023	OK	OK	OK	OK
60.746.948/0001-12	BANCO BRADESCO S.A.	ADMINISTRADOR	30/05/2023	OK	OK	OK	OK
62.375.134/0001-44	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	GESTOR	30/05/2023	OK	OK	OK	OK
09.630.188/0001-26	PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE RECURSOS LTDA.	GESTOR	30/05/2023	OK	OK	OK	OK
07.237.373/0001-20	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S/A	GESTOR / DISTRIBUIDOR	30/05/2023	OK	OK	OK	OK
62.318.407/0001-19	SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S/A	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	14/07/2023	OK	OK	OK	OK
03.983.856/0001-12	4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	GESTOR	27/07/2023	OK	OK	OK	OK
22.119.959/0001-83	GENIAL GESTAO LTDA.	GESTOR	27/07/2023	OK	OK	OK	OK

00.806.535/0001-54	PLANNER CORRETORA DE VALORES S/A	ADMINISTRADOR	29/08/2023	OK	OK	OK	OK
42.066.258/0001-30	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	29/08/2023	OK	OK	OK	OK
07.250.864/0001-00	QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	GESTOR	29/08/2023	OK	OK	OK	OK
01.522.368/0001-82	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	ADMINISTRADOR/ CUSTODIANTE	27/09/2023	OK	OK	OK	OK
02.562.663/0001-25	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA	GESTOR	27/09/2023	OK	OK	OK	OK
62.285.390/0001-40	SINGULARE CTVM S.A.	ADMINISTRADOR/ GESTOR	27/09/2023	OK	OK	OK	OK
13.426.885/0001-37	MAGNA AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA	DISTRIBUIDOR	27/09/2023	OK	OK	OK	OK
00.066.670/0001-00	BEM - DTVM LTDA	ADMINISTRADOR	26/10/2023	OK	OK	OK	OK
68.622.174/0001-20	ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECURSOS LTDA.	GESTOR	26/10/2023	OK	OK	OK	OK
10.626.543/0001-72	CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	GESTOR	26/10/2023	OK	OK	OK	OK
17.203.539/0001-40	GRID AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTO LTDA	DISTRIBUIDOR	28/11/2023	OK	OK	OK	OK
07.078.144/0001-00	GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	GESTOR	26/03/2024	OK	OK	OK	OK
62.232.889/0001-90	BANCO DAYCOVAL	ADMINISTRADOR	26/03/2024	OK	OK	OK	OK
35.796.942/0001-02	EMPIRE CAPITAL AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS	DISTRIBUIDOR	26/03/2024	OK	OK	OK	OK
62.418.140/0001-31	INTRAG DTVM	ADMINISTRADOR	19/06/2024	OK	OK	OK	OK

3.2 Critérios Referentes aos Ativos Investidos

Nesse ponto, será demonstrada a diligência realizada pela Diretoria de Investimentos e do Comitê de Investimentos em relação aos ativos investidos, ou seja, dos ativos constantes da carteira de investimentos do FUNPREI. Serão analisados principalmente os seguintes pontos: Enquadramento da carteira à Resolução e Política de Investimentos, análise dos riscos, das Demonstrações Financeiras, principais movimentações na carteira, além dos ativos presentes em carteira.

3.2.1 Enquadramento das Alocações em Relação à Política de Investimentos

A Política de Investimentos é o documento que estabelece as diretrizes, fundamenta e norteia o processo de tomada de decisão de investimentos dos recursos previdenciários observando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência. Estes objetivos devem estar sempre alinhados em busca do equilíbrio financeiro e atuarial dos Regimes Próprios de Previdência Social ("**RPPS**").

A Política de Investimentos tem como objetivo central promover a maximização da rentabilidade dos seus ativos, buscando primeiramente a preservação e integridade de seu

patrimônio e, posteriormente, a constituição de reservas para o pagamento de benefícios aos segurados.

A estratégia de investimentos delimita os percentuais máximos e mínimos para cada um dos tipos de ativos que podem ser investidos, seguindo as limitações impostas pela Resolução CMN nº 4.963/2021. Mensalmente, a Diretoria de Investimentos e o Comitê de Investimentos emitem um Relatório de Acompanhamento da Política de Investimentos com as principais informações sobre a carteira de investimentos e as ações relativas à gestão dos recursos. Nesse relatório, também é mostrado o acompanhamento mensal do enquadramento da carteira com o que foi previsto anteriormente. A tabela 10 detalha o enquadramento, comparando com o previsto pela Política de Investimentos e a alocação do final do 1º semestre de 2024.

Tabela 10

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024		
	%	R\$	%	Inferior %	Alvo %	Máximo %
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100%	R\$ 100.718.379,88	19,92%	10,00%	20,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100%	R\$ 185.448.202,57	36,68%	20,00%	32,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70%	R\$ 62.185.828,59	12,30%	0,00%	10,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV	20%	R\$ 36.643.298,81	7,25%	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5%	R\$ 11.512,75	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5%	R\$ 23.735.124,61	4,69%	0,00%	5,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	100%	R\$ 408.742.347,21	80,84%	-	-	-
Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024		
	%	\$	%	Inferior %	Alvo %	Máximo %
Artigo 8º, Inciso I	30%	R\$ 48.066.686,51	9,51%	5,00%	12,00%	40,00%
Artigo 8º, Inciso II	30%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	30%	R\$ 48.066.686,51	9,51%	-	-	-

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024		
	%	\$	%	Inferior %	Alvo %	Máximo %
Artigo 9º, Inciso I	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%
Artigo 9º, Inciso II	10%	R\$ 12.543.253,71	2,48%	0,00%	1,00%	10,00%
Artigo 9º, Inciso III	10%	R\$ 27.090.778,99	5,36%	0,00%	4,00%	10,00%
Total Exterior	10%	R\$ 39.634.032,70	7,84%	-	-	-

Artigos - Estruturados	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024		
	%	\$	%	Inferior %	Alvo %	Máximo %
Artigo 10º, Inciso I	10%	R\$ 5.211.402,93	1,03%	0,00%	5,00%	10,00%
Artigo 10º, Inciso II	5%	R\$ 2.570.519,21	0,51%	0,00%	1,00%	5,00%
Artigo 10º, Inciso III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Estruturados	15%	R\$ 7.781.922,14	1,54%	-	-	-

Artigos - Imobiliários	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024		
	%	\$	%	Inferior %	Alvo %	Máximo %
Artigo 11º	5%	R\$ 1.415.579,59	0,28%	0,00%	1,00%	5,00%
Total Imobiliários	5%	R\$ 1.415.579,59	0,28%	-	-	-
Total Geral da Carteira	-	R\$ 505.640.568,15	100,00%	-	-	-

Percebemos uma aderência dos percentuais de alocação atual em relação à alocação alvo, estando todas as estratégias próximas ao previsto na Política de Investimentos para 2024. A maior diferença se dá em relação ao enquadramento Art. 10º inciso I, que é de Fundos Multimercado, exatamente por ser um ativo que vem sofrendo bastante no ano, devido ao cenário desafiador, inclusive com uma onda de resgates grande nesse tipo de ativo.

Já com relação à diversificação, são 36 fundos distribuídos em diferentes perfis e fatores de risco, além de títulos públicos comprados de forma direta (Artigo 7º, Inciso I, alínea "a"), e títulos privados (Artigo 7º, Inciso IV), conforme descrito na tabela 11:

Tabela 11

ÍNDICES	% TOTAL	VALOR
TÍTULOS PÚBLICOS	19.89%	R\$ 100.718.379,88
CDI	16.5%	R\$ 83.438.459,69
IRF-M	14.85%	R\$ 75.101.872,65
IRF-M 1	12.17%	R\$ 61.520.513,76
TÍTULOS PRIVADOS	7.25%	R\$ 36.643.298,81
IMA-B	5.64%	R\$ 28.513.948,66
GLOBAL BDRX	5.36%	R\$ 27.090.778,99

IBOVESPA	4.79%	R\$ 24.238.898,24
IMA-B 5	3.8%	R\$ 19.204.685,74
IPCA	3.46%	R\$ 17.498.796,09
SMLL	3.46%	R\$ 17.486.057,73
MSCI World	1.39%	R\$ 7.013.195,75
IDIV	1.25%	R\$ 6.341.730,54
IFIX	0.16%	R\$ 829.951,62
TOTAL	100,00%	R\$ 505.640.568,15

3.2.2 Análise dos Riscos

A seção V da Portaria MPT nº 1.467/2022 trata sobre o monitoramento dos riscos dos investimentos e sobre os procedimentos de controles internos formalizados para acompanhá-los:

Art. 125. A unidade gestora deverá identificar, analisar, avaliar, controlar e monitorar os riscos dos investimentos de recursos do RPPS, por meio de procedimentos e controles internos formalizados.

O IpojucaPrev tem os processos de investimentos mapeados e manualizados, sendo semestralmente analisado pela Controladoria Geral do Município, que verifica se os controles internos estão adequados, emitindo um relatório com as conclusões.

Nos próximos itens deste relatório, serão identificados os principais riscos incorridos pelas aplicações presentes em carteira. Esses riscos são acompanhados pelo Relatório Mensal de Acompanhamento da Política de Investimentos, sendo demonstradas as formas de monitoramento desses indicadores.

3.2.2.1 Risco de Mercado

É a oscilação no valor dos ativos financeiros que possa gerar perdas para instituição decorrentes da variação de parâmetros de mercado, como cotações de câmbio, ações, commodities, taxas de juros e indexadores como os de inflação, por exemplo.

A Política de Investimentos atual prevê a adoção da metodologia do VaR – Value-at-Risk – para controle de Risco de Mercado, utilizando os seguintes parâmetros para o cálculo:

- Modelo paramétrico;
- Intervalo de confiança de 95% (noventa e cinco por cento);
- Horizonte temporal de 21 dias úteis.

Como parâmetro de monitoramento para controle do risco de mercado dos ativos que compõe a carteira será observadas as referências abaixo estabelecidas e realizadas reavaliações destes ativos sempre que as referências pré-estabelecidas forem ultrapassadas.

- Segmento de Renda Fixa: 3,5% (três e meio por cento) do valor alocado neste segmento.
- Segmento de Renda Variável: 15% (quinze por cento) do valor alocado neste segmento.

O Relatório Mensal de Acompanhamento da Política de Investimentos acompanha os valores do VAR e ainda acompanha adicionalmente outras variáveis, tais como volatilidade e a rentabilidade dos fundos em janelas temporais (mês, ano, três meses, seis meses, doze meses e vinte e quatro meses), verificando o alinhamento com o “benchmark” estabelecido na política de investimentos do fundo.

Esses relatórios são apresentados mensalmente e podem ser acessados por quaisquer interessados no link poderá ser acessado por qualquer interessado no site do IpojucaPrev, pelo link: <https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/publicacoes-oficiais/investimentos/acompanhamento-da-politica-de-investimentos/>

3.2.2.2 Risco de Crédito dos ativos

É a possibilidade de perdas no retorno de investimentos ocasionadas pelo não cumprimento das obrigações financeiras por parte da instituição que emitiu determinado título, ou seja, o não atendimento ao prazo ou às condições negociadas e contratadas.

O § 5º do art. 7º Resolução CMN nº 4.963/2021, que trata das aplicações em renda fixa, regulamenta sobre o risco de crédito das aplicações desse tipo de ativo:

§ 5º Os responsáveis pela gestão de recursos do regime próprio de previdência social deverão certificar-se de que os direitos, títulos e valores mobiliários que compõem as carteiras dos fundos de investimento de que trata este artigo e os respectivos emissores são considerados de baixo risco de crédito.

Esse Relatório de diligência tem como objetivo atender ao item 3.2.6 do Manual 3.5 do Pró Gestão, que solicita que sejam analisados os seguintes pontos:

a) verificação dos ativos que compõem o patrimônio dos fundos de investimentos, incluindo os títulos e valores mobiliários aplicados pelo RPPS, excluídos os títulos públicos;

Serão identificados nessa parte do relatório

b) análise da situação patrimonial, fiscal e comercial das empresas investidas, por meio de Fundos de Investimentos em Participações - FIP; -

Serão identificados no item 4, uma vez que os únicos FIP's presentes na carteira do FUNPREI são ativos desenquadrados/estressados que estão em processo de liquidação dos ativos

c) análise do Relatório de Rating dos ativos no caso de Fundos de Renda Fixa (salvo aqueles que aplicam seus recursos exclusivamente em títulos públicos), Aplicações diretas em Ativos Financeiros de Renda Fixa, Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios (FIDC), Fundos de Renda Fixa – Crédito Privado e Fundos de Debêntures de Infraestrutura;

Serão identificados nessa parte do relatório

d) análise do Relatório de Avaliação de Imóveis no caso de Fundos de Investimentos possuí-los na Carteira

Serão identificados no item 4, uma vez que os únicos FII's presentes na carteira do FUNPREI são ativos desenquadrados/estressados que estão em processo de liquidação dos ativos

Para facilitar a análise dos ativos presentes e carteira e o rating de crédito dos ativos, dividimos os ativos a seguir de acordo com o enquadramento na resolução 4.963/2021, os dados foram tirados do sistema Quantum Axis, de acordo com a posição dos ativos em 30/06/2024

3.2.2.2.1 Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " - Títulos Tesouro Nacional

a) títulos de emissão do Tesouro Nacional, registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (Selic);

No enquadramento Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a ", temos os investimentos realizados diretamente na compra direta de títulos públicos federais. A seção II do Anexo VIII da Portaria MTP 1.467/2022 regulamenta os parâmetros para a precificação dos ativos, que podem ser classificados de duas formas: a) disponíveis para negociação futura ou para venda imediata, devendo ser marcados a mercado, buscando se beneficiar do fechamento da curva de juros futuros; b) mantidos até o vencimento, que podem ser marcados na curva, garantindo a rentabilidade contratada e diminuindo a volatilidade da carteira como um todo.

A tabela abaixo demonstra a posição dos investimentos com essa estratégia no fechamento do primeiro semestre de 2024:

Tabela 12

IPOJUCAPREV

Títulos - Junho/2024

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U.		MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
				COMPRA	ATUAL				
NTN-B 2026	15/08/26	24/09/21	307	3.900,48	4.511,13	CURVA 4,55%	R\$ 1.197.446,76	R\$ 1.384.916,05	R\$ 10.181,00 (0,74%)
NTN-B 2045	15/05/45	24/09/21	1300	4.296,32	4.955,18	CURVA 4,88%	R\$ 5.585.216,00	R\$ 6.441.731,60	R\$ 48.955,32 (0,77%)

NTN-B 2055	15/05/55	24/09/21	2000	4.372,99	5.066,08	CURVA 4,92%	R\$ 8.745.972,01	R\$ 10.132.162,70	R\$ 77.305,82 (0,77%)
NTN-B 2050	15/08/50	24/09/21	740	4.289,62	5.086,52	CURVA 4,90%	R\$ 3.174.319,33	R\$ 3.764.028,34	R\$ 28.661,24 (0,77%)
NTN-B 2040	15/08/40	24/09/21	1400	4.188,52	4.943,26	CURVA 4,84%	R\$ 5.863.923,39	R\$ 6.920.560,45	R\$ 52.381,45 (0,76%)
NTN-B 2035	15/05/35	24/09/21	1081	4.179,92	4.778,19	CURVA 4,75%	R\$ 4.518.492,43	R\$ 5.165.222,58	R\$ 38.747,76 (0,76%)
NTN-B 2030	15/08/30	24/09/21	951	4.016,33	4.687,80	CURVA 4,68%	R\$ 3.819.531,39	R\$ 4.458.100,20	R\$ 33.212,62 (0,75%)
NTN-B 2055	15/05/55	18/10/21	1169	4.275,37	4.900,17	CURVA 5,15%	R\$ 4.997.904,79	R\$ 5.728.300,09	R\$ 44.680,67 (0,79%)
NTN-B 2050	15/08/50	18/10/21	477	4.189,29	4.920,96	CURVA 5,15%	R\$ 1.998.291,40	R\$ 2.347.297,09	R\$ 18.306,36 (0,79%)
NTN-B 2045	15/05/45	20/12/21	387	4.137,39	4.709,13	CURVA 5,31%	R\$ 1.601.169,44	R\$ 1.822.431,99	R\$ 14.429,92 (0,80%)
NTN-B 2050	15/08/50	20/12/21	837	4.216,06	4.806,63	CURVA 5,33%	R\$ 3.528.844,70	R\$ 4.023.150,45	R\$ 31.916,24 (0,80%)
NTN-B 2040	15/08/40	20/12/21	382	4.198,69	4.766,02	CURVA 5,20%	R\$ 1.603.897,77	R\$ 1.820.621,06	R\$ 14.272,99 (0,79%)
NTN-B 2055	15/05/55	20/12/21	248	4.200,78	4.793,03	CURVA 5,30%	R\$ 1.041.792,34	R\$ 1.188.670,63	R\$ 9.406,57 (0,80%)
NTN-B 2035	15/05/35	06/01/22	356	4.056,13	4.570,34	CURVA 5,32%	R\$ 1.443.980,50	R\$ 1.627.039,41	R\$ 12.901,51 (0,80%)
NTN-B 2050	15/08/50	06/01/22	251	4.141,45	4.697,50	CURVA 5,50%	R\$ 1.039.504,98	R\$ 1.179.073,08	R\$ 9.508,85 (0,81%)
NTN-B 2026	15/08/26	06/01/22	100	3.976,86	4.449,81	CURVA 5,27%	R\$ 397.686,14	R\$ 444.980,98	R\$ 3.511,84 (0,80%)
NTN-B 2030	15/08/30	06/01/22	316	4.051,28	4.550,32	CURVA 5,29%	R\$ 1.280.204,51	R\$ 1.437.900,26	R\$ 11.369,47 (0,80%)
NTN-B 2055	15/05/55	06/01/22	859	4.109,38	4.664,31	CURVA 5,49%	R\$ 3.529.954,67	R\$ 4.006.641,52	R\$ 32.282,05 (0,81%)
NTN-B 2040	15/08/40	06/01/22	388	4.132,47	4.671,35	CURVA 5,40%	R\$ 1.603.397,32	R\$ 1.812.482,07	R\$ 14.480,65 (0,81%)
NTN-B 2045	15/05/45	06/01/22	395	4.061,65	4.601,51	CURVA 5,50%	R\$ 1.604.353,29	R\$ 1.817.594,61	R\$ 14.657,95 (0,81%)
NTN-B 2035	15/05/35	21/11/22	697	3.943,16	4.173,05	MERCADO	R\$ 2.748.382,52	R\$ 2.908.614,41	R\$ -47.915,02 (-1,62%)
NTN-B 2032	15/08/32	21/11/22	686	4.004,42	4.260,05	MERCADO	R\$ 2.747.031,03	R\$ 2.922.394,04	R\$ -36.772,61 (-1,24%)
NTN-B 2045	15/05/45	13/12/22	646	3.865,42	4.106,15	MERCADO	R\$ 2.497.059,65	R\$ 2.652.570,34	R\$ -76.202,43 (-2,79%)
NTN-B 2027	15/05/27	30/05/23	1898	4.214,06	4.270,23	MERCADO	R\$ 7.998.281,58	R\$ 8.104.889,40	R\$ -352,97 (-0,00%)
NTN-B 2029	15/05/29	24/05/24	1290	4.264,88	4.309,55	CURVA 6,14%	R\$ 5.501.689,74	R\$ 5.559.318,81	R\$ 47.450,94 (0,86%)
NTN-B 2040	15/08/40	11/06/24	1398	4.292,66	4.316,98	CURVA 6,20%	R\$ 6.001.133,37	R\$ 6.035.133,58	R\$ 34.000,21 (0,57%)
NTN-B 2040	15/08/40	18/06/24	1175	4.252,88	4.266,00	CURVA 6,33%	R\$ 4.997.135,41	R\$ 5.012.554,14	R\$ 15.418,73 (0,31%)
Total Públicos							R\$ 91.066.596,46	R\$ 100.718.379,88	R\$ 456.797,15 (0,46%)

3.2.2.2.2 Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " - FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN

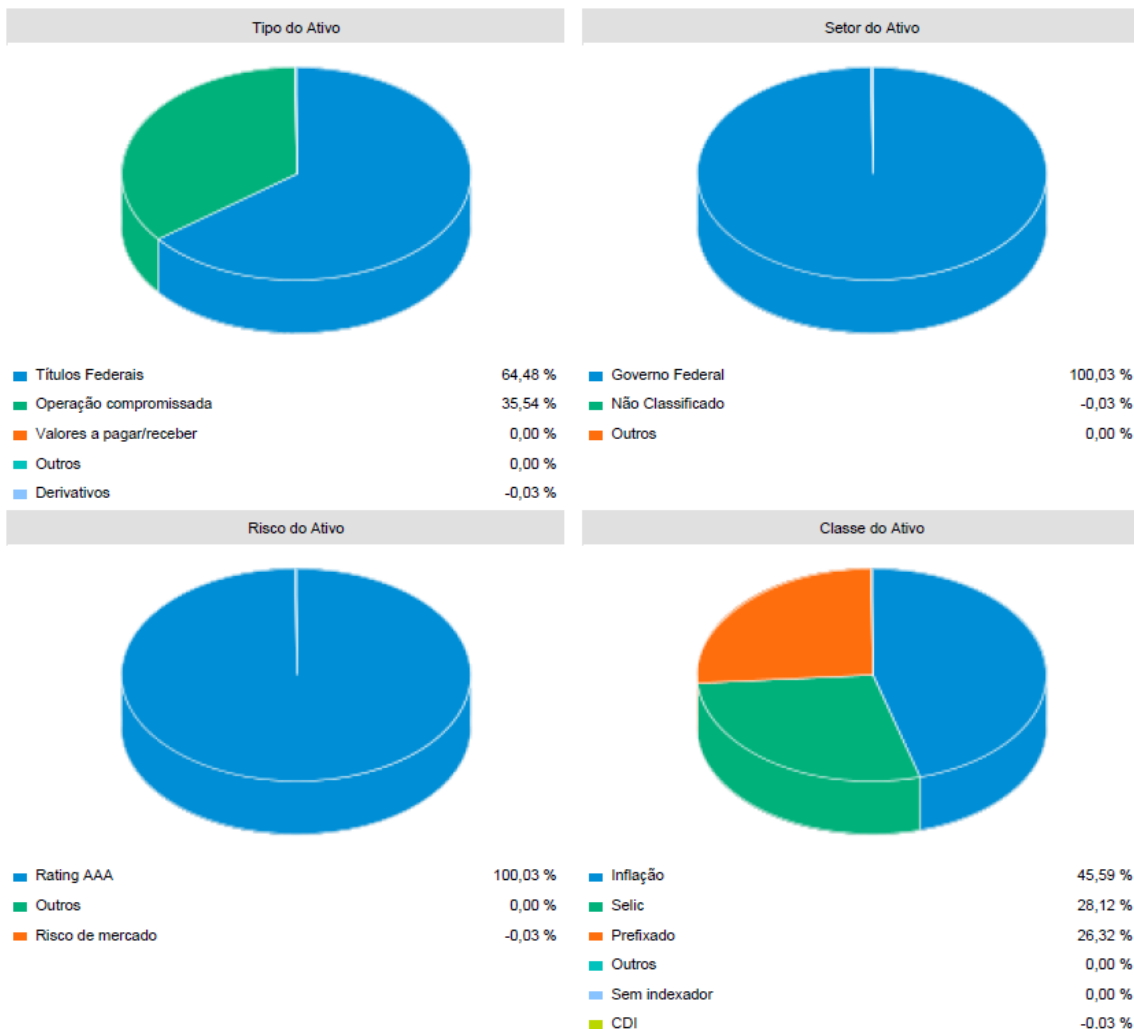
***b)** cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos determinem que seus recursos sejam aplicados exclusivamente em títulos definidos na alínea "a", ou compromissadas lastreadas nesses títulos;*

Tabela 13

:: Carteira Consolidada

28/06/2024

CNPJ: 07.442.078/0001-05 | Gestão: BB Asset Management



No enquadramento Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b", temos os fundos de renda fixa que investem 100% em Títulos Públicos Federais. A tabela 13 traz a posição consolidada dos investimentos dos fundos nesse enquadramento presentes na carteira do FUNPREI na data de 30/06/2024. Percebemos que 64,48% são Títulos Públicos Federais e 35,54% são Operações Compromissadas com Títulos Públicos Federais, totalizando a carteira.

Com relação ao risco dos ativos investidos, o rating de crédito dos ativos são 100,00% AAA, pois são formados por Títulos Públicos emitidos pelo Governo Federal, demonstrando um baixo risco de crédito, demonstrando o atendimento ao § 5º do art. 7º Resolução CMN nº 4.963/2021. Em relação à classe do ativo, 45,59% formado por Títulos públicos indexados à inflação, 28,12% em pós-fixados SELIC e 26,32% de pré-fixados.

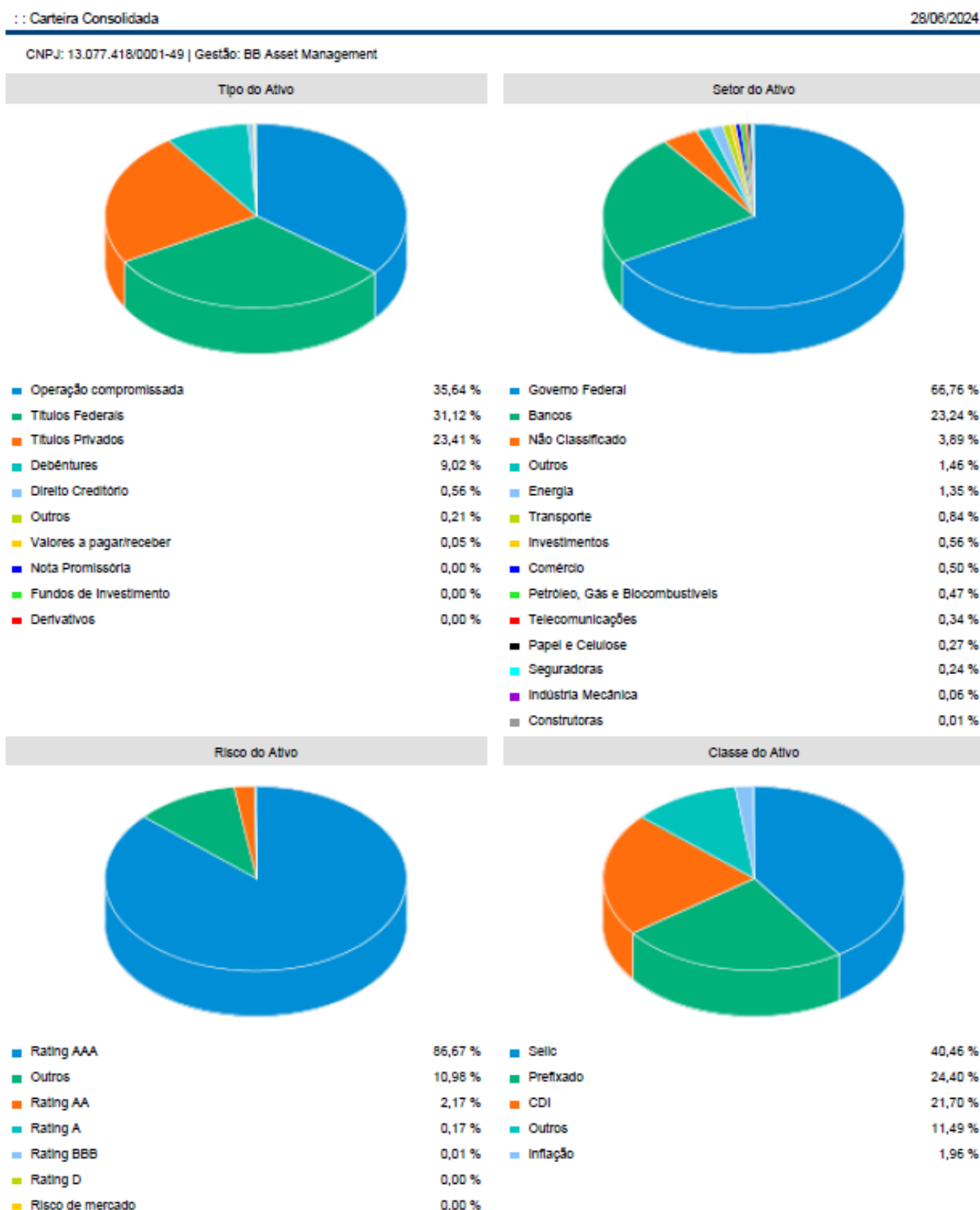
O anexo 01 apresenta a composição aberta de cada um dos fundos presentes na carteira na data de 30/06/2024. Os dados foram tirados do sistema Quantum Axis.

3.2.2.2.3 Artigo 7º, III, “a” - FI Renda Fixa

a) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, constituídos sob a forma de condomínio aberto (fundos de renda fixa);

No enquadramento Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a", temos os fundos de renda fixa que podem investir também em ativos privados. A tabela 14 traz a posição consolidada dos investimentos dos fundos nesse enquadramento presentes na carteira do FUNPREI na data de 30/06/2024.

Tabela 14



Percebemos que 35,64% são Títulos Públicos Federais e 31,12% são Operações Compromissadas com Títulos Públicos Federais, totalizando 66,76% de investimentos. Ainda temos participações relevantes em Títulos Privados 23,41% e debêntures 9,02%. Em comparação ao semestre anterior, percebemos um aumento da participação dos ativos de Crédito privado (títulos privados e debêntures) nas carteiras desse enquadramento. Isso ocorreu devido ao bom momento desse tipo de ativo no mercado.

Com relação ao risco dos ativos investidos, o rating de crédito dos ativos são 86,67% AAA, 2,17% AA e 0,17% A, demonstrando que são formados por ativos com baixo risco de crédito, atendendo ao § 5º do art. 7º Resolução CMN nº 4.963/2021.

Ainda consta um ativo de rating BBB, que é referente ao DPGE - BANCO FIBRA S.A. (58.616.418/0001-08) - Venc.: 06/01/2025, que equivale a 0,04% do fundo CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP, mas ainda é considerado um rating de baixo risco.

Temos um percentual próximo a 0,0% de Rating D, que é referente ao ativo Debênture Simples - OIBRA2, presente na carteira do fundo BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP. Pelo histórico da carteira do fundo, antes da remarcação da Debênture da OI, representava 0,06% da carteira, ocorrendo um rebaixamento do rating posteriormente, mas com impacto pequeno no desempenho do fundo.

Em relação à classe do ativo, a tabela 14 demonstra que 40,46% formado por ativos indexados à SELIC, 21,70% indexados ao CDI. Se somarmos os ativos SELIC e CDI, que são pós-fixados e têm desempenhos parecidos, temos 62,16% nesse tipo de estratégia. Ainda temos 11,49% classificado como "outros" e 1,96% indexados à inflação. O alto percentual de "outros" pode ser explicado pelo motivo do fundo BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ainda estar com a carteira omitida.

Quanto ao setor dos ativos investidos, temos 66,76% de ativos do Governo Federal, que são os Títulos Públicos Federais, além de 23,24% no setor de Bancos sólidos, que são instituições com baixo risco de crédito. Ainda temos pequenas participações do setor de Energia 1,35%, Transporte 0,84%, Investimentos 0,56%, Comércio 0,50%, dentre outros. Como dito anteriormente, percebemos um aumento dos ativos de crédito privado, por circunstâncias do bom momento no mercado para esses ativos.

O anexo 02 apresenta a composição aberta de cada um dos fundos presentes na carteira na data de 30/06/2024. Os dados foram tirados do sistema Quantum Axis.

3.2.2.2.4 Artigo 7º, IV - Ativos Bancários

IV - até 20% (vinte por cento) diretamente em ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras bancárias autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil, que atendam às condições previstas no inciso I do § 2º do art. 21;

No enquadramento Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a ", temos os investimentos diretos em Letras Financeiras de grandes bancos, desde que atendam às condições previstas no inciso I do § 2º do art. 21 e estejam na lista exaustiva divulgada pela Secretaria da Previdência. A seção II

do Anexo VIII da Portaria MTP 1.467/2022 regulamenta os parâmetros para a precificação dos ativos. E o § 4º do art. 7º da seção II do Anexo VIII da Portaria MTP 1.467/2022 possibilita a marcação na curva desses ativos, garantindo a rentabilidade contratada e diminuindo a volatilidade da carteira como um todo.

Tabela 15

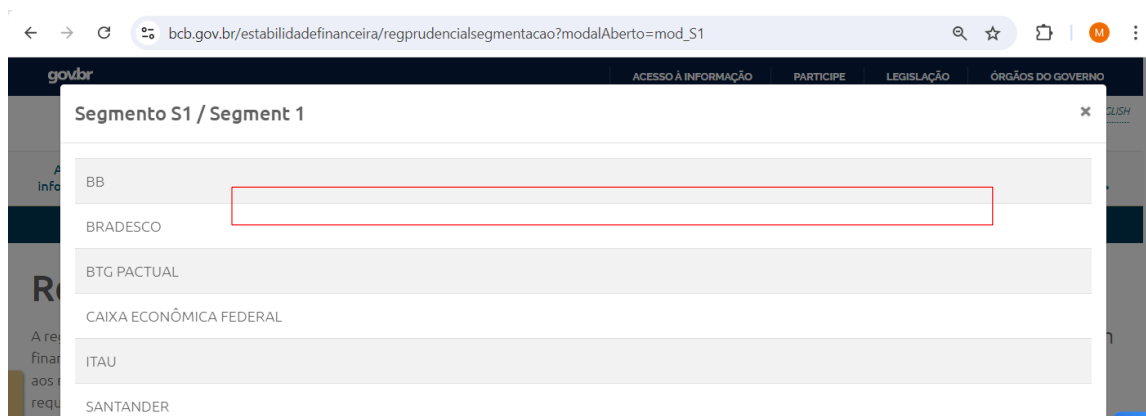
IPOJUCAPREV

Títulos - Junho/2024

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U.		MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
				COMPRA	ATUAL				
LF BTG PACTUAL IPCA	28/09/32	28/09/22	11	500.000,00	617.027,20	CURVA 7,75%	R\$ 5.500.000,00	R\$ 6.787.299,21	R\$ 68.670,65 (1,02%)
LF BTG PACTUAL IPCA	26/10/32	26/10/22	9	500.000,00	615.226,91	CURVA 7,71%	R\$ 4.500.000,00	R\$ 5.537.042,17	R\$ 57.066,70 (1,04%)
LF BTG PACTUAL IPCA	11/11/25	11/11/22	200	50.000,00	60.413,13	CURVA 6,90%	R\$ 10.000.000,00	R\$ 12.082.625,28	R\$ 123.692,99 (1,03%)
LF BTG PACTUAL IPCA	21/11/24	21/11/22	110	50.000,00	60.725,83	CURVA 7,50%	R\$ 5.500.000,00	R\$ 6.679.841,83	R\$ 67.891,06 (1,03%)
LF BTG PACTUAL IPCA	28/05/29	28/05/24	110	50.000,00	50.513,55	CURVA 6,66%	R\$ 5.500.000,00	R\$ 5.556.490,32	R\$ 51.627,97 (0,94%)
Total Privados							R\$ 31.000.000,00	R\$ 36.643.298,81	R\$ 368.949,37 (1,02%)

Como podemos ver, foram feitas compras de 5 Letras Financeiras do BTG Pactual, pagando boas taxas e diversificando os prazos de vencimento. Foram destacadas algumas informações das Demonstrações Contábeis do BTG Pactual e relatório de rating visando identificar que a empresa tem uma boa situação financeira e baixo risco de crédito.

As instituições supervisionadas no Sistema Financeiro Nacional (SFN) são classificadas em cinco segmentos, de acordo com seu porte, atividade internacional e perfil de risco. Quanto maior o banco, maiores são as regras prudenciais de complexidade adequada às atividades e ao perfil de risco da instituição, devido ao risco sistêmico. Os maiores bancos estão classificados como S1 e o Banco BTG faz parte dessa classificação, conforme pode ser consultado no site do Banco Central do Brasil.

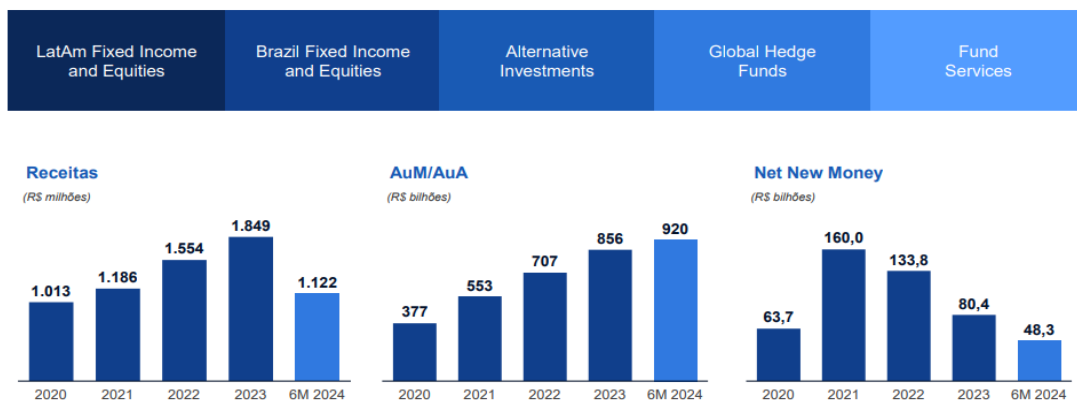


Fonte: site do Banco Central do Brasil https://www.bcb.gov.br/estabilidadefinanceira/regprudencialsegmentacao?modalAberto=mod_S1 acessado em 22/08/2024.

Em relação aos dados financeiros, foram utilizados os últimos dados disponíveis, que são referentes ao 2º Trimestre de 2024.

Uma das maiores gestoras de Asset Management e fund services da América Latina

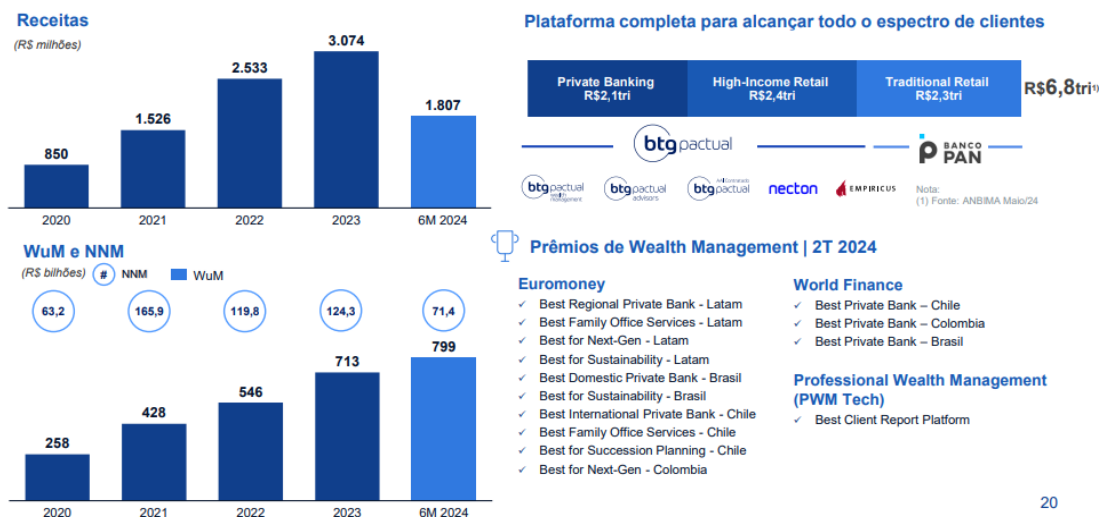
AuM/AuA de R\$920 bilhões e gama completa de produtos de investimentos tradicionais e estruturados



19

Fonte: site de RI Do Banco BTG Pactual <https://ri.btgpactual.com/principais-informacoes/informacoes-financeiras/> acessado em 22/08/2024.

Wealth Management & Personal Banking: forte captação líquida e geração de receita consistente



20

Fonte: site de RI Do Banco BTG Pactual <https://ri.btgpactual.com/principais-informacoes/informacoes-financeiras/> acessado em 22/08/2024.

Podemos perceber uma tendência de crescimento das Receitas e da captação do Banco BTG Pactual.

Índice de Basileia e VaR

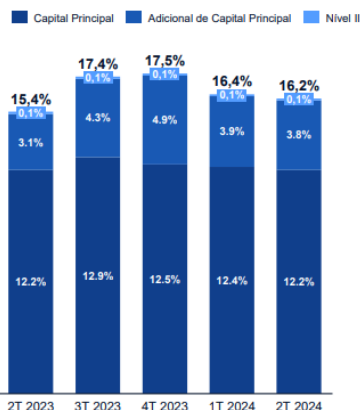
Resumo do 2T 2024

Índice de Basileia reduziu marginalmente para 16,2% no trimestre em linha com a distribuição de R\$1,55 bilhão em JCP

Como percentual do patrimônio líquido médio, nosso VaR médio diário total reduziu para 0,21%, à medida que mantivemos uma alocação de risco conservadora diante do cenário desafiador

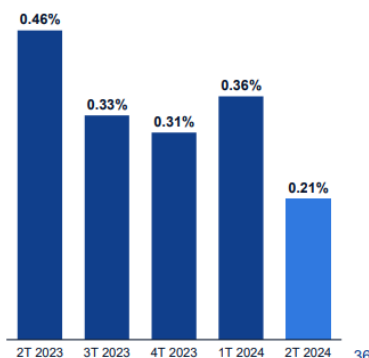
Índice de Basileia

(%)



VaR médio diário

(% do patrimônio líquido médio)



Fonte: site de RI Do Banco BTG Pactual <https://ri.btgpactual.com/principais-informacoes/informacoes-financeiras/> acessado em 22/08/2024.

a. Limites operacionais

	30/06/2024	31/12/2023
Patrimônio Líquido Consolidado	53.075.585	49.381.806
Nível I	49.965.658	46.334.527
Capital Principal	49.547.710	45.911.863
Capital complementar	417.948	422.663
Nível II	15.401.187	17.771.352
Patrimônio de Referência (PR) - (a)	65.366.845	64.105.878
Patrimônio de Referência Exigido (PRE)	32.368.106	29.272.568
Exposicao total ponderada pelo risco - (b)	404.601.320	365.907.099
Risco de Crédito	283.646.226	242.672.300
Risco Operacional	33.755.188	29.844.615
Risco de Mercado	87.199.906	93.390.184
Índice de Basileia - (a/b)	16,2%	17,5%
Capital de Nível I	12,3%	12,7%
Capital de Nível II	3,8%	4,9%
Índice de consumo de Imobilização	43,7%	57,6%
Limite para imobilização (LI)	32.683.423	32.052.939
Situação para o limite de imobilização	14.273.530	18.447.800
Valor da margem ou insuficiência	18.409.893	13.605.139

Fonte: Parecer do auditor independente (PWC) referente às Demonstrações Financeiras do 2ºT de 2024.

Em relação ao índice de basileia, percebe-se que o banco mantém uma margem bem maior do que exigido pelo Banco Central, demonstrando uma boa situação financeira e o atendimento aos limites operacionais atestados pelo parecer da auditoria independente que analisou as suas Demonstrações Financeiras no 2º Trimestre de 2024.

3.2.2.2.5 Artigo 7º, V, "a" FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior

a) cotas de classe sênior de fundos de investimento em direitos creditórios (FIDC);

O único FIDC presente na carteira do FUNPREI é o INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP, que é um fundo estressado, que está em processo de liquidação, que será mais bem detalhado no item 4.1 desse relatório.

3.2.2.2.6 Artigo 7º, V, "b" - FI Renda Fixa "Crédito Privado"

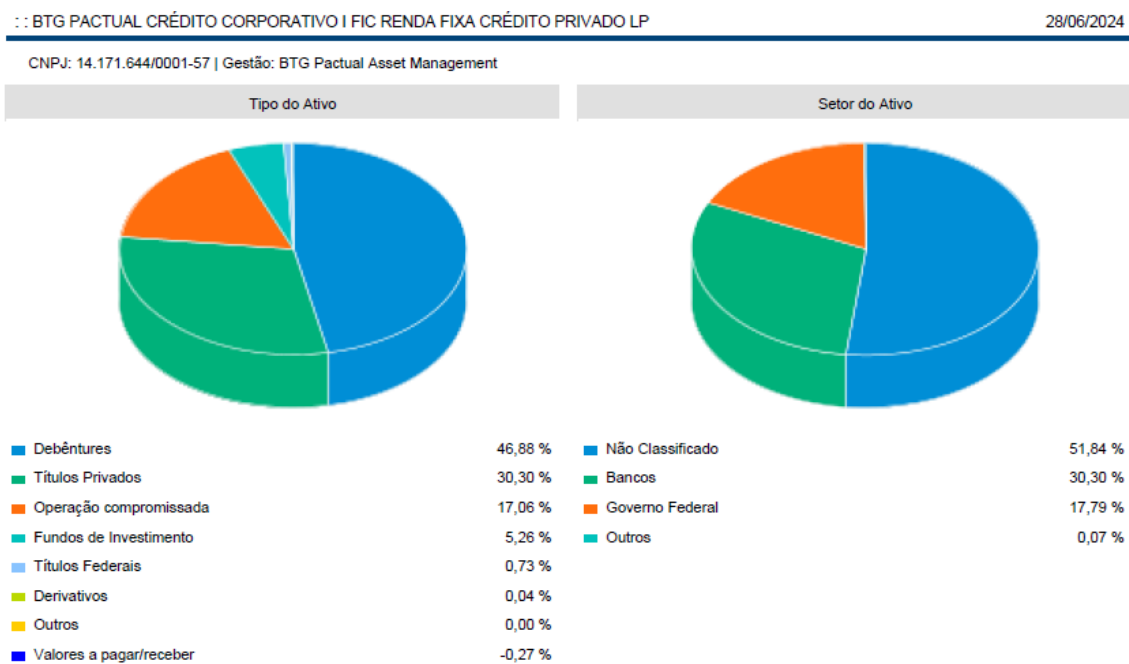
b) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa com sufixo “crédito privado” constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários (fundos de renda fixa);

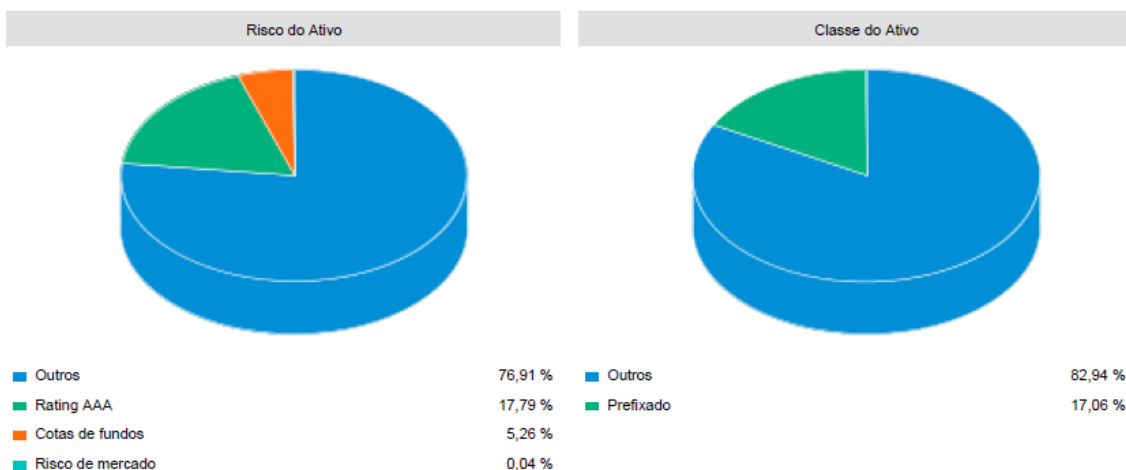
No enquadramento Artigo 7º, Inciso V, Alínea "b", temos os fundos de Crédito Privado, que investem em títulos de renda fixa de baixo risco de crédito emitidos por empresas privadas, tendo no mínimo 50% do seu Patrimônio Líquido em ativos de crédito, como por exemplo: debêntures, Letras Financeiras, dentre outros.

Por se tratar de um ativo que detém uma parcela maior de ativos de crédito na carteira, o acompanhamento do rating, solicitamos mensalmente aos gestores dos fundos desse enquadramento a carteira aberta e a distribuição do rating de qualidade de crédito dos papéis. Tal acompanhamento é feito a partir do Relatório de Acompanhamento da Política de Investimentos.

Para esse relatório, também abrimos a carteira no sistema quantum, com as informações da tabela 16. Boa parte dos ativos ainda estão omitidos nas informações públicas, situação permitida pelas Instruções da CVM para evitar que as estratégias dos gestores possam ser copiadas.

Tabela 16





A tabela 16 traz a posição consolidada dos investimentos do fundo BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP, único nesse enquadramento presentes na carteira do FUNPREI na data de 30/06/2024. Percebemos que 46,88% são Debêntures de grandes empresas, 30,30% de Títulos Privados, 17,06% de Operações compromissadas, 5,26% de Direitos Creditórios e 0,73% de Títulos Públicos Federais. Percebemos uma aderência do fundo à estratégia de manter grande parte dos seus ativos em créditos privados, com 77,18%. Porém, com uma redução dessa exposição, uma vez que no fechamento de 2023 o fundo tinha mais de 90% nesses tipos de ativos.

Com relação ao risco, setor e classe dos ativos investidos, as informações não são disponibilizadas no relatório do quantum, que utiliza dados constantes nos registros da CVM, e, como dito anteriormente, podem ser omitidas pelos gestores dos fundos. Portanto, para analisar os ativos em carteira, foram utilizadas as informações de carteira aberta enviada pelo BTG por solicitação nossa. O anexo 03 apresenta essa composição na data de 30/06/2024.

Daremos continuidade ao acompanhamento do rating de crédito dos ativos com classificação abaixo de A. Primeiro, vamos analisar o papel que representa um pequeno percentual carteira do fundo e tem rating BBB+, são Debêntures Simples - CASN12, da Companhia Catarinense de Águas e Saneamento, com vencimento em 14/09/2026. Identificamos que o rebaixamento do rating pela Fitch Rating de BBB + para BB+ havia acontecido em 10 de maio de 2023, porém em 24 de julho de 2024, a empresa teve um aumento do rating, retomando o BBB+, conforme figura abaixo. De acordo com a composição da carteira enviada pelo BTG com a posição de 28/06/2024, ainda está presente na carteira do fundo.

Rating de crédito CASAN:

NATIONAL LONG TERM RATING

DATE:	24-Jul-2024	15-Dec-2023	20-Oct-2023	10-May-2023	16-May-2022	20-May-2021
RATING:	BBB+(bra)●	BB+(bra)●	BB+(bra)◆	BB+(bra)◆	BBB+(bra)●	BBB+(bra)◆
ACTION:	Upgrade	Affirmed	Rating Watch Maintained	Downgrade	Affirmed	Upgrade

<https://www.fitchratings.com/entity/companhia-catarinense-de-aguas-e-saneamento-casan-92740312#ratings>

Posteriormente, vamos analisar o papel que representa um pequeno percentual da carteira do fundo e tem rating D, são Debêntures Simples – LAMEA7, das Lojas Americanas. Identificamos que o rebaixamento do rating pela Fitch Rating pra nota C aconteceu no dia 10 de janeiro de 2023, sendo sucedido de um novo rebaixamento para D em 19 de janeiro de 2023. A debênture tem vencimento original em 15/07/2033 e, de acordo com a composição da carteira enviada pelo BTG com a posição de 28/06/2024, ainda está presente na carteira do fundo. As Lojas Americanas atualmente estão em Recuperação Judicial e os Debenturistas titulares do ativo estão acompanhando a resolução do caso.

Desde que aconteceu o caso, a Diretoria de Investimentos do IpojucaPrev, junto com o Comitê de Investimentos e órgãos colegiados, acompanharam a situação, visando manter a diligência sobre o ativo.

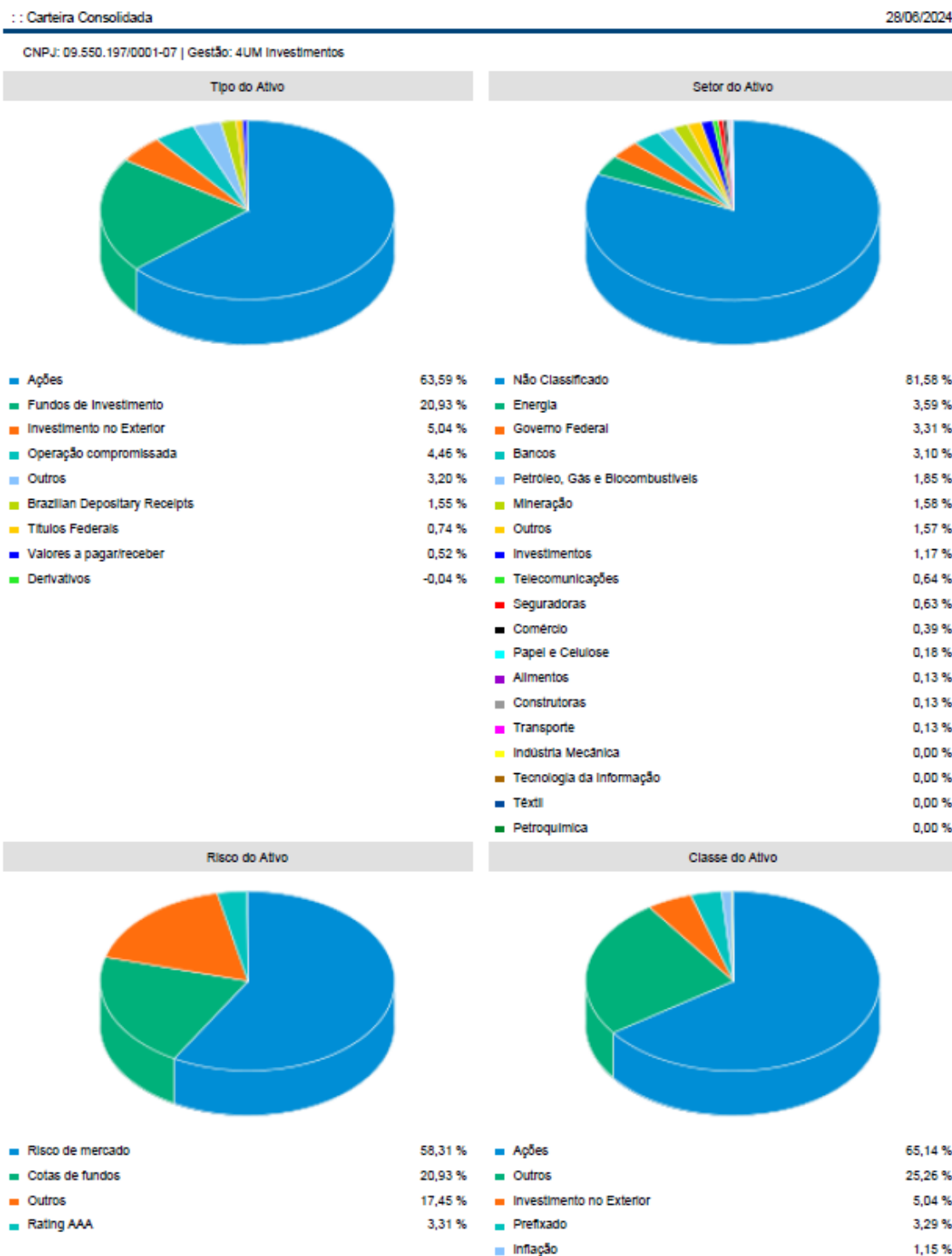
Durante o mês de julho de 2023, foi divulgado o Ofício Conjunto nº 06-2023 da CVM e Secretaria de Previdência, que tratou sobre *“Esclarecimentos sobre a aplicação das regras de desenquadramento passivo previstas na Resolução CMN nº 4.963, de 2021, relativas à classificação de risco de crédito dos ativos presentes nos fundos de investimento com recursos de RPPS e ao prazo para desinvestimentos que podem afetar as decisões de alocação de outros investidores.”* Conforme vinha sendo acompanhado, o mercado de crédito privado passou por um estresse a partir da divulgação do fato relevante das Lojas Americanas S/A em janeiro de 2023. Portanto, com a proximidade do fim do prazo de 180 dias para o reenquadramento da carteira nos casos de desenquadramento passivo, conforme artigo 27 da Resolução CMN nº 4.963, de 2021. Porém, considerando a peculiaridade do caso, o Ofício circular nº 6/2023/CVM/SIN/SRPC apresenta posicionamento *“12. É importante considerar que, **no caso específico relacionado aos RPPS que possuem fundos de investimentos com ativos de crédito da companhia Lojas Americanas S/A**, as possibilidades de perdas já estão devidamente precificadas pelos prestadores de serviço dos fundos, o que reserva pouca ou nenhuma vantagem na realização do desinvestimento em prazo certo, que, assim, apenas poderia acarretar consequências adversas aos cotistas.*

3.2.2.2.7 Artigo 8º, I - FI Ações

I - cotas de fundos de investimento classificados como ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários (fundos de renda variável);

No enquadramento Artigo 8º, Inciso I, temos os fundos de investimentos em ações, que, de acordo com a regulamentação da CVM, precisam manter pelo menos 67% de investimentos em ações.

Tabela 17



O anexo 04 apresenta a composição aberta de cada um dos fundos presentes na carteira na data de 30/06/2024. Os dados foram tirados do sistema Quantum Axis. Parte dos ativos estão omitidos, visando a manutenção da estratégia dos gestores dos fundos de investimentos. Tal medida é natural e atende à resolução da CVM, que permite a omissão por até 180 dias para os fundos de ação.

De acordo com a tabela 17, Percebemos que 63,59% são investimentos em ações e 20,93% em fundos de investimentos, predominantemente fundos de ações, 5,04% são de investimentos no exterior e 4,46% de operações compromissadas com Títulos Públicos Federais. Percebemos uma aderência clara dos investimentos ao enquadramento, sendo boa parte formada por investimentos em ações, seja diretamente ou por intermédio de fundos de investimentos.

Com relação ao risco, setor e classe dos ativos investidos, as informações não são disponibilizadas no relatório do quantum, que utiliza dados constantes nos registros da CVM, e, como dito anteriormente, podem ser omitidas pelos gestores dos fundos.

3.2.2.2.8 Artigo 9º, II - FI Investimento no Exterior

II - cotas de fundos de investimento constituídos no Brasil sob a forma de condomínio aberto com o sufixo "Investimento no Exterior", nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, que invistam, no mínimo, 67% (sessenta e sete por cento) do seu patrimônio líquido em cotas de fundos de investimento constituídos no exterior;

No artigo 9º, inciso II, temos os fundos de Investimento internacional investe em ativos de Renda Fixa e Variável de diferentes países, buscando diversificação e oportunidades de retorno.

Os fundos presentes em carteira são os fundos: AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY IE FIC AÇÕES e MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY IE FIC AÇÕES. A tabela 18 apresenta a composição das carteiras em 30/06/2024, demonstrando que os dois fundos são FIC's que investem quase que a totalidade dos seus recursos (99,63%) nas cotas de fundos de investimentos no exterior das casas AXA e MS Global, respectivamente. O resto do saldo é mantido em caixa para pagar as despesas do fundo e honrar resgates.

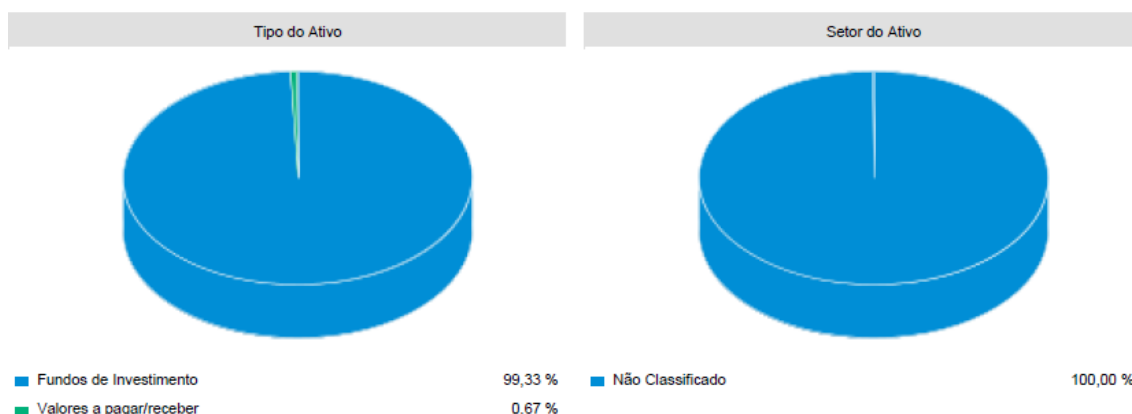
Essa composição completa pode ser verificada no anexo 05, que apresenta a composição aberta de cada um dos fundos presentes na carteira na data de 30/06/2024.

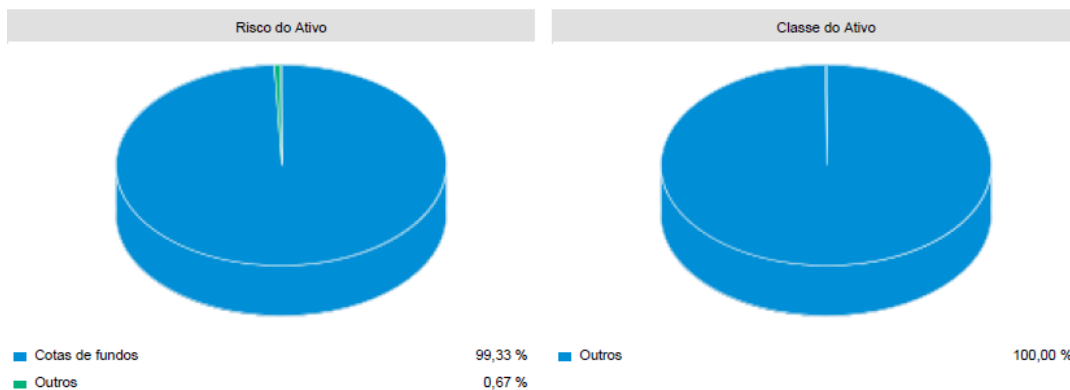
Tabela 18

:: Carteira Consolidada

28/06/2024

CNPJ: 35.002.482/0001-01 | Gestão: XP Asset Management



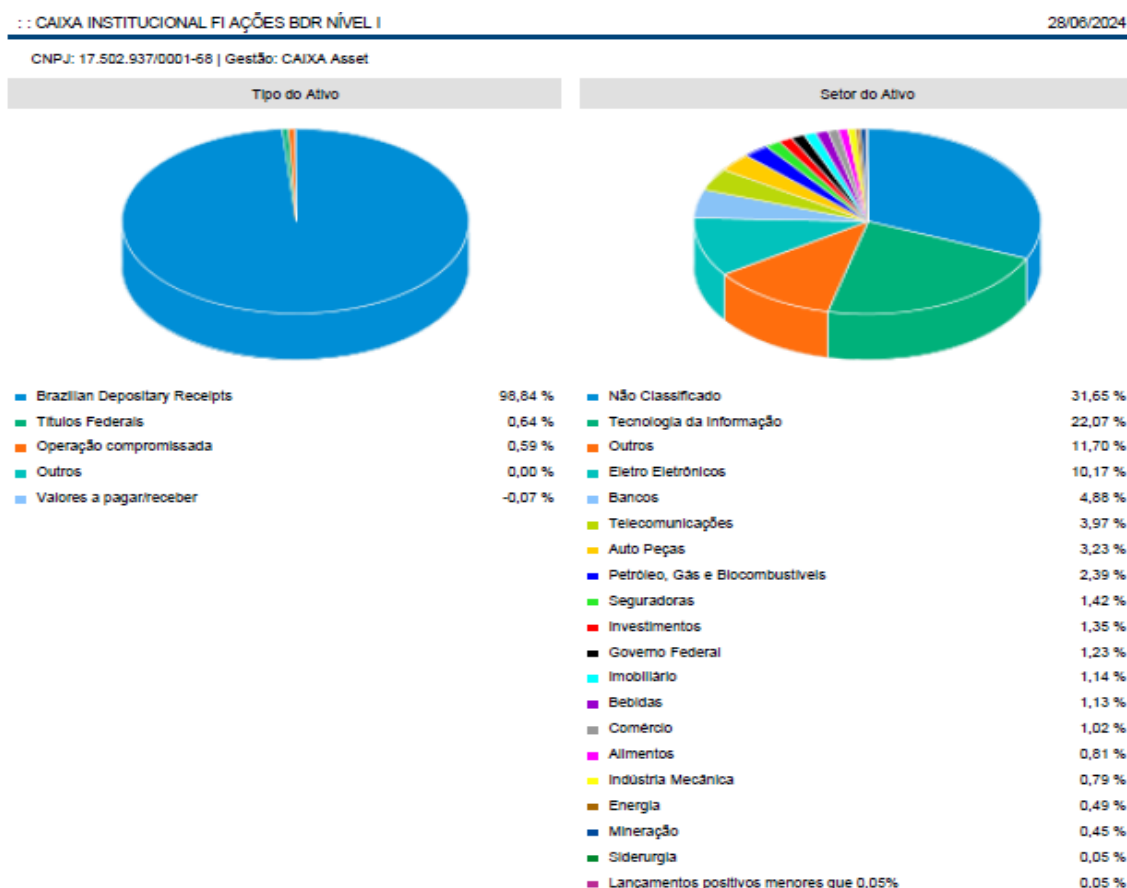


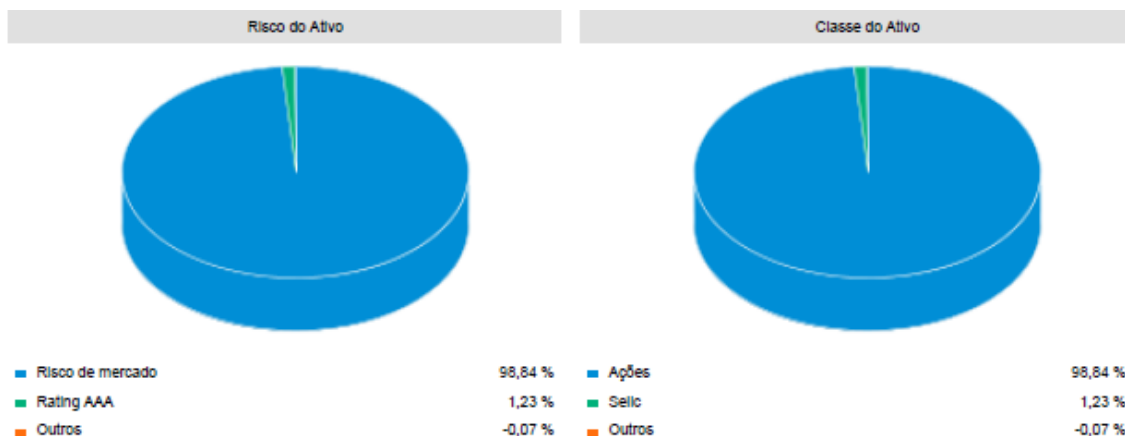
3.2.2.2.9 Artigo 9º, III FI Ações - BDR Nível I

III - cotas dos fundos da classe “Ações – BDR Nível I”, nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários.

No enquadramento Artigo 9º, Inciso III, temos os fundos de investimentos que investem em BDR, que, de acordo com a classificação da B3 são “*Brazilian Depositary Receipts Não Patrocinados Nível I (BDR NP) são valores mobiliários, emitidos no Brasil por instituições depositárias, que possuem como lastro valores mobiliários emitidos no Exterior tais como ações de companhias estrangeiras.*”

Tabela 19





O único fundo presente em carteira no fim do primeiro semestre de 2024 era o CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I. A tabela 19 detalha a carteira do fundo, que é formada quase que totalmente por BDR's, que totalizam 98,84% do fundo. O restante é aplicado em Títulos Públicos Federais 0,64% e Operações Compromissadas com Títulos Públicos Federais 0,59%.

Com relação ao risco do ativo, 98,84% correm risco de mercado, que é o risco incorrido nos investimentos em ações. Nesse caso, o risco incorrido é de flutuações nos preços das ações de empresas de fora do Brasil. Não se falando em risco de crédito para esses casos. 1,23% são rating AAA, que boa parte são Títulos Públicos Federais ou operações compromissadas.

A classificação de setores dos ativos tem 31,65% como "Não classificado" e 11,70% em "outros" por se tratar de empresas estrangeiras com classificações diferentes das que o Quantum classifica. Ao abrir os dados, podemos perceber que boa parte desses ativos "não classificados" são ligados a empresas de tecnologia, como por exemplo: Microsoft, Apple, Alphabet, Meta.

Essa característica de setores ligados à tecnologia está ligada à composição do S&P 500, benchmark do fundo. O que se percebe também nas demais classificações, como 22,07% Tecnologia da Informação, 10,17% em Eletro-eletrônicos. Depois aparecem outras classificações com posições menores, como Bancos 4,88%, Telecomunicações 3,97%, autopeças 3,23%, Petróleo Gás e Biocombustíveis 2,39%, e assim por diante.

O anexo 06 apresenta a composição aberta do fundo presente na carteira na data de 30/06/2024.

3.2.2.2.10 Artigo 10, I - FI Multimercado – aberto

I - até 10% (dez por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como multimercado (FIM) e em cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento classificados como multimercado (FICFIM);

No enquadramento Artigo 10º, Inciso I, temos os Fundos de Investimentos Multimercado, que, de acordo com a classificação da B3 são *fundos que investem em diversos mercados sem*

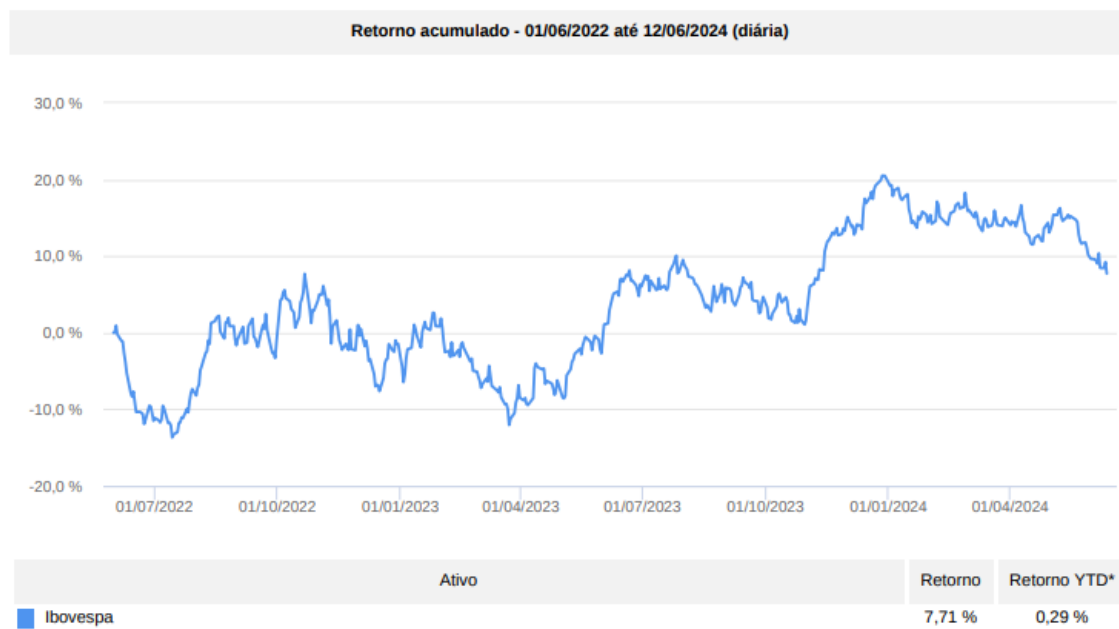
a concentração de investimento em um único segmento e/ou setor. São uma alternativa para quem busca diversificar a carteira de forma prática, pois reúnem em um só produto vários tipos de ativos.”

Durante o primeiro semestre de 2024, houve o vencimento da operação do RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO, fundo de capital protegido, que é um fundo fechado que faz uma operação estruturada, buscando uma rentabilidade que acompanhe a variação do Ibovespa, com a proteção do capital investido, durante a vigência da estratégia de investimento

Conforme Fato relevante divulgado pelo administrador do fundo no dia 13/06/2024, os parâmetros do fundo são:

- Período da Estratégia: de 01 de junho de 2022 a 12 de junho de 2024
- Barreira de Alta: 50%
- Pontuação IBOVESPA de Referência (31 MAI 2022): 111.350,51 pontos
- Prêmio de Rompimento de Barreira: 25,50 % a.p.
- Retorno Mínimo: 9,00% a.p.
- Pontuação IBOVESPA ao final da Estratégia (12 JUNHO 2024): 119.936,02 pontos

Tabela 20



Considerando o início da estratégia em 01/06/2022 até o dia 31/05/2024, fechamento do relatório, podemos perceber que o retorno do Ibovespa não atingiu a barreira de alta de 50% e teve variação positiva no período de 7,71%.

No fim do primeiro semestre de 2024, havia apenas um fundo multimercado presente na carteira, RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO é uma

operação estruturada que permite que o cotista fique exposto ao mesmo tempo aos 3 (três) índices que compõem as carteiras dos RPPS, quais sejam: índice de preços por meio do IMA-B5, bolsa local por meio do IBOVESPA e bolsa internacional por meio do S&P. Essa exposição, entretanto, é dinâmica de forma que o investidor possa capturar da melhor forma os movimentos do mercado e seus impactos nos referidos benchmarks, uma vez que a ponderação entre os três índices ocorrerá somente no final do prazo do investimento e será definida com base em suas respectivas rentabilidades, sendo que 50% do resultado será daquele índice com a melhor performance no período, 30% no índice com a segunda melhor performance e 20% no índice com a terceira melhor performance.

Conforme Fato relevante divulgado pelo administrador do fundo no dia 18/07/2024, os parâmetros do fundo são:

- Período da Estratégia: de **27 de junho de 2024 a 27 de julho de 2026**.
- Pontuação de Referência S&P500 (26 JUN 2024): 5.477,9000
- Pontuação de Referência IBOVESPA (26 JUN 2024): 122.641,3000
- Pontuação de Referência B5P211 (26 JUN 2024): 89,0021
- Retorno Mínimo: 0%

A tabela 21 abaixo demonstra a composição da carteira na data de 30/06/2024 com a operação estruturada montada. Percebemos que 77,69% são Títulos Públicos Federais e 19,31% são derivativos de swap e 3,03% de operação compromissada, que fazem a estruturação da operação para a formação dos cenários de utilização de 50% do melhor índice, 30% do segundo melhor e 20% no pior índice, no período de 27 de junho de 2024 a 27 de julho de 2026, conforme estratégia do fundo.

Com relação ao risco dos ativos e setores investidos, o rating de crédito dos ativos são 80,72% AAA, pois são formados por Títulos Públicos emitidos pelo Governo Federal, demonstrando um baixo risco de crédito, demonstrando o atendimento ao § 5º do art. 7º Resolução CMN nº 4.963/2021, 19,31 são referentes ao derivativo registrado na B3.

Em relação à classe do ativo, 77,69% formado por Títulos Públicos Pré-fixados, 19,28% é o derivativo e 3,03% de Títulos Públicos atrelados à inflação.

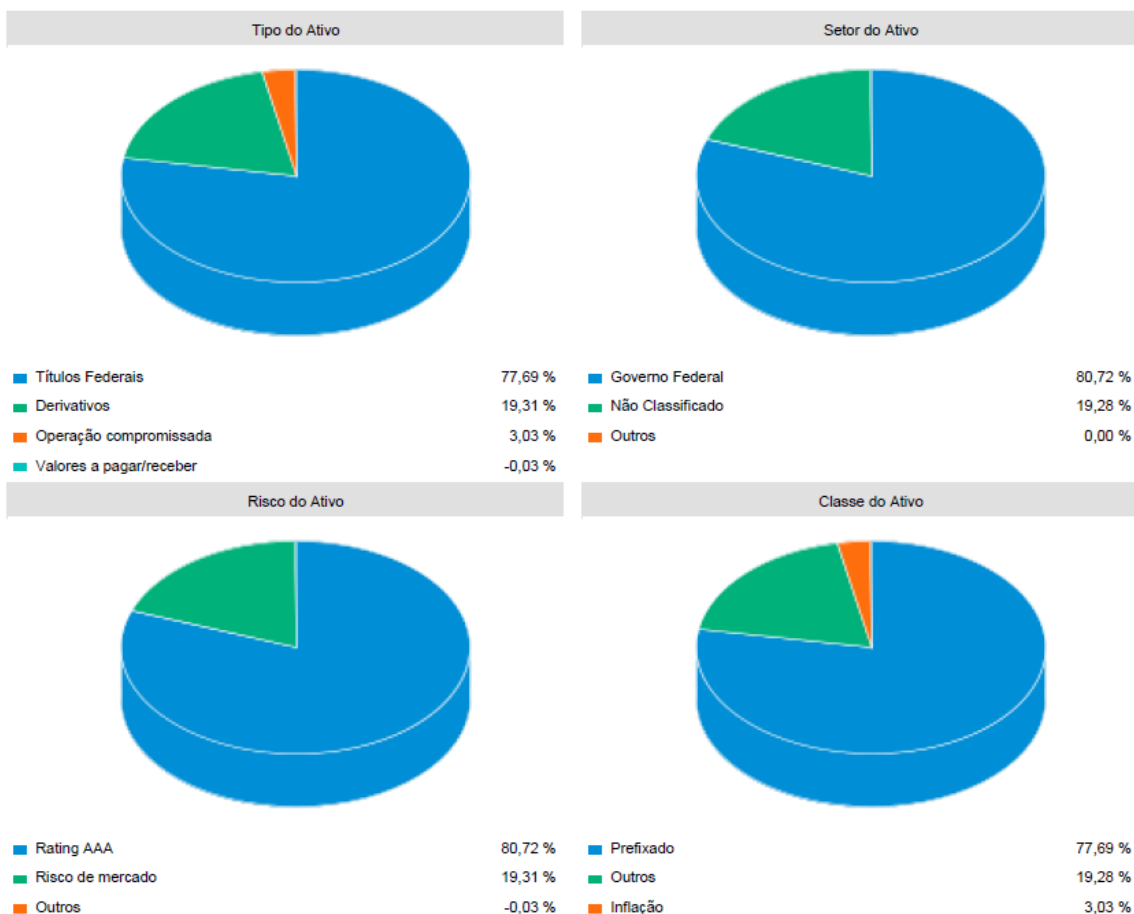
O anexo 07 apresenta a composição aberta do fundo presente na carteira na data de 30/06/2024, demonstrando como a operação estruturada é montada a partir da composição de títulos públicos e derivativos.

Tabela 21

:: RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO

28/06/2024

CNPJ: 55.274.339/0001-78 | Gestão: Rio Bravo Investimentos



3.2.2.2.11 Artigo 10, II - FI em Participações

II - até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento em participações (FIP), constituídos sob a forma de condomínio fechado, vedada a subscrição em distribuições de cotas subsequentes, salvo se para manter a mesma proporção já investida nesses

Os únicos FIPS presentes na carteira do FUNPREI são: GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP e BRASIL FLORESTAL FIP MULTIESTRATÉGIA, que são fundos estressados, que estão em processo de liquidação, que serão mais bem detalhados nos itens 4.3 e 4.4 desse relatório.

Além desses, o fundo CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA FIP foi liquidado com a entrega dos ativos, e será detalhado no item 4.2 desse relatório.

3.2.2.2.12 Artigo 11 - FI Imobiliário

Art. 11. No segmento de fundos imobiliários, as aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social sujeitam-se ao limite de até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento imobiliários (FII) negociadas nos pregões de bolsa de valores

O único FII's presentes na carteira do FUNPREI são: SINGULARE FII - REIT11 e VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - CLASSE BIOR LP, que são fundos estressados, que estão em processo de liquidação, que serão mais bem detalhados nos itens 4.5 e 4.6 desse relatório.

3.2.2.3 Risco de Liquidez

É possibilidade de perda de capital ocasionada pela incapacidade de liquidar determinado ativo em tempo razoável sem perda de valor. Este risco surge da dificuldade de encontrar potenciais compradores do ativo em um prazo hábil ou da falta de recursos disponíveis para honrar pagamentos ou resgates solicitados.

O art. 115 da Portaria MPT nº 1.467/2022 apresenta como esse risco de liquidez pode ser acompanhado e mitigado pelos gestores de recursos.

Art. 115. A aplicação dos recursos do RPPS deverá observar as necessidades de liquidez do plano de benefícios e a compatibilidade dos fluxos de pagamentos dos ativos com os prazos e o montante das obrigações financeiras e atuariais do regime, presentes e futuras.

§ 1º As aplicações que apresentem prazos para desinvestimento, inclusive para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento, deverão ser precedidas de atestado elaborado pela unidade gestora, evidenciando a compatibilidade prevista no caput.

§ 2º As rentabilidades e os fluxos projetados deverão estar em consonância com a política de investimentos do RPPS e considerar eventuais descasamentos de fluxos de ativos e passivos que acarretem risco de reinvestimento dos recursos a taxas de retorno inferiores às da carteira corrente.

De acordo com a Política de Investimentos, o prazo definindo para a necessidade da elaboração desse atestado é no caso de prazo de desinvestimento a partir de 1 ano. A compatibilidade do prazo do passivo com os valores investidos é realizada através do estudo de ALM, que é atualizado pelo menos uma vez por ano.

Segue abaixo a tabela com a disponibilidade de liquidez dos ativos em relação ao Patrimônio Líquido do FUNPREI na data do fim do 1º semestre de 2024.

Tabela 22

Liquidez	Valor (em Milhões)	%
0 a 30 dias	319,8	63,26%
31 a 365 dias	32,9	6,52%
acima de 365 dias	11,4	2,26%
Ilíquidos/estressados	2,6	0,52%
Títulos Públicos e Privados	138,7	27,44%
Total	505,6	100,00%

Fonte: Elaboração própria

3.2.2.4 Risco de Solvência

É o que decorre das obrigações do RPPS para com seus segurados e seu funcionamento. O monitoramento desse risco se dá através de avaliações atuariais e realização de estudos para embasamento dos limites financeiros no direcionamento dos recursos.

Além desse estudo, também é utilizado o Relatório de Gestão Atuarial, no qual são analisados os resultados das avaliações atuarias anuais relativas aos três últimos exercícios, com comparativo entre a evolução das receitas e despesas estimadas e as efetivamente executadas. Esses estudos podem ser acessados por qualquer interessado no site do IpojucaPrev, através do link: <https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/publicacoes-oficiais/atuariais/relatorios-atuariais/>

3.2.3 Desempenho dos ativos e aderência ao benchmark

O desempenho dos ativos é realizado mensalmente a partir do Relatório de Acompanhamento da Política de Investimentos, no qual os fundos são separados por estratégia de investimento e são analisadas diversas janelas temporais de risco e retorno, fazendo a comparação dos desempenhos dos fundos entre si e em relação ao benchmark definido para estratégia. Esses relatórios são apresentados mensalmente e podem ser acessados por quaisquer interessados no link poderá ser acessado por qualquer interessado no site do IpojucaPrev, pelo link: <https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/publicacoes-oficiais/investimentos/acompanhamento-da-politica-de-investimentos/>

3.2.4 Análise das Demonstrações Contábeis dos Fundos

o inciso III do art. 135 da portaria MPT nº 1.467/2022 diz que, no monitoramento dos fundos de investimentos, a unidade gestora deverá:

III - avaliar as demonstrações financeiras anuais do fundo investido e o parecer dos auditores independentes.

De acordo com a Instrução CVM nº 555/2014, o exercício do Fundo de investimentos deve ser encerrado a cada 12 (doze) meses, quando devem ser levantadas as demonstrações contábeis do fundo relativas ao período findo. E, anualmente, deverá ser disponibilizado no site da CVM, no prazo de 90 (noventa) dias contado a partir do encerramento do exercício a que se referirem, as demonstrações contábeis acompanhadas do parecer do auditor independente.

O processo de auditoria deve ser conduzido de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria. Com uma empresa independente em relação ao Fundo, de acordo com os princípios éticos relevantes previstos no Código de Ética Profissional do Contador e nas normas profissionais emitidas pelo Conselho Federal de Contabilidade.

Salientamos que todos os fundos com liquidez já tiveram as suas últimas Demonstrações Financeiras aprovadas pelos auditores independentes contratados para esse fim. Todas tiveram parecer informando que as informações "Apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Fundo" e que as evidências de auditoria obtida são suficientes e apropriadas para fundamentar a opinião dos auditores.

Tabela 23

Ativo	Tipo de Ativo	Saldo do ativo em 30/06/2024	2024.1		
			DF	Auditoria	Opinião
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	FI	R\$ 7.538.376,49	31/12/2023	PWC	ok
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY IE FIC AÇÕES	FIC	R\$ 3.917.637,62	31/03/2024	PWC	ok
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	FIC	R\$ 9.947.681,24	30/09/2023	KPMG	ok
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	FIC	R\$ 21.527.533,85	31/12/2023	PWC	ok
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	FIC	R\$ 3.225.042,46	30/09/2023	PWC	ok
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	FIC	R\$ 19.209.638,05	31/03/2024	PWC	ok
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	FI	R\$ 1.107.181,76	31/12/2023	PWC	ok
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	FI	R\$ 23.004.187,20	31/12/2023	PWC	ok
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	FIC	R\$ 1.625.513,23	31/03/2024	PWC	ok
BNB RPPS IMA-B FI RF	FI	R\$ 2.087.703,51	31/03/2024	PWC	ok
BRDESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI LP	FI	R\$ 20.871.348,30	31/01/2024	KPMG	ok
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	FI	R\$ 874.860,12	31/12/2023	KPMG	ok
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	FIC	R\$ 2.874.534,10	31/12/2023	EY	ok
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF	FIC	R\$ 23.735.124,61	30/09/2023	EY	ok
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	FI	R\$ 3.839.169,96	31/12/2023	Deloitte	ok
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	FI	R\$ 2.480.005,40	31/12/2023	Deloitte	ok
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	FI	R\$ 3.422.057,95	31/12/2023	Deloitte	ok
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	FI	R\$ 1.332.290,96	31/12/2023	Deloitte	ok
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	FI	R\$ 11.122.973,83	31/12/2023	Deloitte	ok
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	FI	R\$ 39.992.979,91	31/12/2023	Deloitte	ok
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	FI	R\$ 75.101.872,65	31/12/2023	Deloitte	ok
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	FI	R\$ 27.090.778,99	30/09/2023	Deloitte	ok
CAIXA EXPERT PIMCO INCOME IE FIC MULTIMERCADO LP *	FIC	R\$ 5.530.057,96	N/A	N/A	N/A
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	FIC	R\$ 6.341.730,54	30/09/2023	Deloitte	ok

CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	FI	R\$ 8.630.539,88	30/09/2023	Deloitte	ok
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	FI	R\$ 12.010.650,26	31/03/2024	KPMG	ok
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	FIC	R\$ 4.915.868,73	31/03/2024	Deloitte	ok
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY IE FIC AÇÕES	FIC	R\$ 3.095.558,13	31/03/2024	PWC	ok
PLURAL DIVIDENDOS FIA	FI	R\$ 4.592.913,07	31/12/2023	PWC	ok
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	FI	R\$ 8.024.064,22	30/04/2024	KPMG	N/A
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LIMITADA FIF	FIF	R\$ 5.211.402,93	N/A	N/A	N/A
MULTIMERCADO **					

* Fundo com data de início em 21/08/2023, ainda sem Demonstração Financeira completa.

** Fundo com data de início em 18/06/2024, ainda sem Demonstração Financeira completa.

Alguns fundos ilíquidos presentes em carteira e que estão em processo de tentativa de recuperação dos valores investidos, conforme melhor detalhado no item “4 – Fundos Estressados apresentam: Demonstrações Financeiras atrasadas; ou Demonstrações Financeiras que não apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes a posição financeira do fundo; e ainda ressalvas para base de opinião por parte dos auditores, conforme tabela a seguir.

Tabela 24

Nome do fundo	CNPJ	Período	Auditor Independente	Opiniões	Base para Opiniões
---------------	------	---------	----------------------	----------	--------------------

INVEST DUNAS FIDC
MULTISSETORIAL
SÊNIOR LP

13.633.964/0001-19

31/12/2016

ERNST &
YOUNG

"Apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Fundo, **porém, houveram ressalvas para a base de opinião.**"

a) Verificação de lastro Conforme requerido pela Instrução CVM Nº 356 de 17 de dezembro de 2001 e pelo regulamento do Fundo, o custodiante das operações do fundo deve efetuar verificação amostral do lastro dos direitos creditórios trimestralmente. Durante o exercício findo em 31 de dezembro de 2016, em amostras selecionadas nos trimestres findos em 15 de agosto de 2016 e 14 de novembro de 2016, não foram identificados 7 e 11 documentos, respectivamente, que evidenciariam o lastro das operações. As documentações não identificadas representavam 5,83% e 9,17%, respectivamente, do total das operações selecionadas para os trimestres. Como não tivemos acesso à documentação de suporte dos lastros das operações supramencionadas por parte do custodiante, não foi possível concluir sobre os eventuais impactos caso tais operações não fossem reconhecidas nas demonstrações financeiras do Fundo.

b) Valores a receber e a pagar e resultado com direitos creditórios Conforme notas explicativas nº 6 e 7, em 31 de dezembro de 2016, o Fundo possuía registrado o montante a receber de R\$ 6.111 mil e o montante a pagar de R\$ 2.090 mil, nas rubricas de "Recebíveis - títulos descontados" e "Outras obrigações", bem como o montante de R\$ 6.269 mil registrado na rubrica de "Rendas de títulos descontados – outros", para os quais não foi apresentada evidência de auditoria apropriada e suficiente por parte do administrador. Consequentemente, não foi possível concluir sobre a necessidade de ajuste sobre esses valores.

BRASIL FLORESTAL
MULTIESTRATÉGIA FIP

12.312.767/0001-35 30/06/2020

ERNST &
YOUNG

"Não expressaram uma
opinião sobre as
demonstrações financeiras do
Fundo, pois, não foi possível
obter evidência de auditoria
apropriada e suficiente para
fundamentar a opinião de
auditoria sobre essas
demonstrações financeiras."

Em 30 de junho de 2020, o Fundo possuía investimento em ações da companhia de capital fechado Tree Florestal Empreendimentos e Participações S.A. ("Tree Florestal"), no montante de R\$144.994 mil, representando 104,26% do total do patrimônio líquido do Fundo, conforme descrito na demonstração da posição financeira. As demonstrações financeiras da Tree Florestal referentes aos exercícios findos em 31 de dezembro de 2018 e 31 de dezembro de 2019 não foram emitidas até a data de emissão desse relatório, tendo sido as demonstrações financeiras mais recentes disponibilizadas para nossos exames aquelas relativas ao exercício findo em 31 de dezembro de 2017, representando, portanto, significativa defasagem de tempo em relação às demonstrações financeiras do Fundo. Adicionalmente, durante nossos trabalhos, não nos foi disponibilizado laudo econômico-financeiro da Tree Florestal, e/ou análise de recuperação do valor do investimento. Consequentemente, não foi possível determinar o valor e a recuperabilidade deste investimento, em 30 de junho de 2020, e se existem passivos e/ou obrigações futuras que possam gerar desembolso de recursos por parte do Fundo e que não foram reconhecidos e os respectivos impactos no patrimônio líquido do Fundo.

CAIS MAUÁ DO BRASIL
FIP

17.213.821/0001-09 31/12/2020

BENDORAYTES
& CIA

"Não nos foi possível obter
evidência de auditoria
apropriada e suficiente para
fundamentar nossa opinião de
auditoria sobre essas
demonstrações financeiras."

Até a conclusão dos nossos procedimentos, não nos foram apresentadas as demonstrações financeiras auditada da companhia investida em 31 de dezembro de 2020. Devido ao assunto apresentado, pela limitação aos nossos procedimentos de auditoria, não obtivemos evidências de auditoria suficientes e apropriadas para concluirmos sobre a razoabilidade do saldo apresentado ou concluir sobre a recuperabilidade dos investimentos do Fundo.

GERAÇÃO DE ENERGIA
MULTIESTRATÉGIA FIP

11.490.580/0001-69

30/06/2023

AUDIPEC

"Em nossa opinião, exceto pelos efeitos do assunto descrito na seção a seguir intitulada "Base para Opinião com Ressalva", as demonstrações financeiras acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Geração Energia Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia de junho de 2023 e o desempenho de suas operações para o exercício findo nessa data, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de investimento em participações."

"Em 30 de junho de 2023, o Fundo possuía investimento em ações da companhia de capital fechado, Green Oil Participações Ltda. ("Companhia Investida"), avaliadas pelo montante de R\$ 12.797 mil, representando 91,42% do total do Ativo do Fundo, conforme Demonstração da Posição Financeira. No entanto, o Laudo de Avaliação Econômico-financeira emitido em 17 de outubro de 2023, registra o valor de R\$ 8.531 mil de valor justo para essa companhia investida na data-base de 30 de junho de 2023. O ajuste negativo de R\$ 4.266 mil, decorrente da perda na avaliação do valor justo da companhia investida foi registrado na carteira do Fundo em 23 de outubro de 2023, data subsequente ao exercício examinado.

Como consequência, o valor do Passivo a Descoberto (Patrimônio Líquido Negativo), o resultado do exercício e a rentabilidade do Geração Energia Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia deixaram de registrar o impacto negativo da perda na avaliação a valor justo de investimento de R\$ 4.266 mil.

O Geração Energia Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia apresentava, em 30 de junho de 2023, patrimônio líquido negativo (passivo a descoberto) e iliquidez para a quitação de suas obrigações circulantes. Desta forma, o plano de encerramento organizado e a quitação das obrigações do Fundo dependem de:

i) possíveis novos aportes de recursos pelos seus cotistas; ii) da realização dos investimentos nas Companhias Investidas em valores superiores aos estimados para a data-base de 30 de junho de 2023; ou iii) da resolução dos passivos em valores inferiores aos valores pedidos nas respectivas ações ou provisionados em balanço das investidas, quando aplicável. Esses eventos indicam a existência de incerteza relevante quanto à capacidade de continuidade operacional do Fundo. Essa situação é agravada pelo fato de que os cotistas, entidades participantes do Regime Próprio de Previdência Social estão impossibilitadas de realizar aportes de recursos adicionais, dada a vedação prevista na regulamentação vigente. As demonstrações financeiras não divulgam adequadamente esse assunto."

SINGULARE FII -
REIT11

16.841.067/0001-99

31/12/2023

BDO

"Apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo."

"Acreditamos que a evidência de auditoria obtida é suficiente e apropriada para fundamentar nossa opinião"

VECTOR QUELUZ
LAJES CORPORATIVAS
FII - VLJS11

13.842.683/0001-76

31/12/2023

CONFIANCE

"Apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Fundo"

"Acreditamos que a evidência de auditoria obtida é suficiente e apropriada para fundamentar nossa opinião"

3.2.5 Relatório de Avaliação e Monitoramento dos riscos

O art. 129 da Portaria MPT n 1.467/2022 traz algumas exigências sobre os controles internos dos RPPS visando a mitigação dos riscos

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

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

Esse relatório de diligência procurou demonstrar informações sobre a carteira de investimentos, demonstrando o atendimento a esse item I

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

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

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

Conforme exigido pelo nível II do Pró-Gestão, a Controladoria Geral do Município emite relatório semestral dos processos de gestão dos investimentos, nos quais esses itens são analisados e podem ser emitidas recomendações para melhoria, quando necessário. Além disso, as auditorias de órgãos de controle externo, como TCE-PE, Ministério da Previdência, dentre outros, também podem apontar recomendações nesse sentido.

Nos relatórios de controle interno e nas auditorias externas realizadas, não foram apresentadas recomendações de melhoria por nenhum dos órgãos de controle. Portanto, não há nenhum ponto a ser mencionado em relação aos itens II e III do art. 129.

4. Fundos Estressados

O IpojucaPrev detém cotas de 6 fundos estressados que são fechados para resgate e que não têm liquidez para devolver os valores investidos pelos cotistas. Na maioria dos casos, os fundos adquiriram títulos de crédito que não foram honrados por seus devedores e coobrigados. Todos tiveram a troca de parte dos seus prestadores de serviço, tais como: administradores e gestores. Essas novas instituições estão trabalhando na tentativa de venda dos ativos para devolução do valor investido pelos cotistas inclusive, de ações judiciais.

Tabela 25

CNPJ	FUNDO	ENQUADRAMENTO
17.213.821/0001-09	CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA FIP	FI em Participações - Art. 10º, I
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	FI em Participações - Art. 10º, I
12.312.767/0001-35	BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	FI em Participações - Art. 10º, I
13.633.964/0001-19	INVEST DUNAS FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR LP	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, V, a
16.841.067/0001-99	SINGULARE FII - REIT11	FI Imobiliários - Art. 11º
13.842.683/0001-76	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	FI Imobiliários - Art. 11º

Esses fundos demandam um acompanhamento mais próximo da gestão, uma vez que as decisões a serem tomadas impactam diretamente no resultado desse processo de desinvestimento. Para tal, é primordial a conversa constante com os atuais gestores/administradores desses fundos, a participação em Assembleias e acompanhamento das deliberações, dos fatos relevantes e demais documentos oficiais. Por isso, todas essas atualizações estão presentes no Relatório Mensal de Acompanhamento da Política de Investimentos, sendo discutidas com os Conselheiros e membros do Comitê de Investimentos, que tiveram ciência de todo esse processo, com total transparência sobre a situação de cada um dos fundos. Todos tiveram acesso a esses documentos e foram inseridos no processo decisório sobre o desinvestimento.

A evolução da regulamentação dos RPPS já vem tentando diminuir esses casos de ocorrências de fundos estressados. A Resolução CMN nº 4.695/2018, alterou a Resolução CMN nº 3.922/2010, e introduziu, entre outros pontos, critérios relacionados aos prestadores de serviço autorizados a administrar ou gerir fundos de investimentos nos quais os Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS podem aplicar seus recursos, conforme disposto na nova redação conferida ao art. 15 da referida Resolução. A resolução CMN nº 4.963/2021 manteve esses critérios.

Em sua seção X do capítulo VI, a Portaria MPT nº 1.467/2022 trouxe a consolidação sobre as medidas a serem tomadas em caso de desenquadramento dos investimentos realizados, mantendo expressamente a vedação de novas aplicações nesses fundos, conforme § 3º do art. 152.

§ 3º Em qualquer hipótese, a unidade gestora não poderá efetuar novas aplicações que onerem os excessos verificados, relativamente aos limites excedidos, salvo em caso de ter sido comprovadamente celebrados, anteriormente às situações de que trata o § 1º, compromissos de subscrição de cotas do fundo de investimento ou cumprimento de ordem judicial.

Nos próximos itens, serão apresentadas as situações de cada um dos fundos:

4.1 INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP

a) Apresentação do Fundo:

O **FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP** ("Fundo"), inscrito no CNPJ/MF sob o nº 13.633.964/0001-19, é um fundo de investimento em direitos creditórios, constituído sob a forma de condomínio fechado, regido por seu regulamento e pelas disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis, especialmente a Instrução nº 356, de 17 de dezembro de 2001, da Comissão de Valores Mobiliários ("CVM"), suas alterações posteriores, e demais disposições legais e regulamentares aplicáveis a espécie.

Os serviços de Administração e Custódia são atualmente exercidos pela **SINGULARE CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A** (antiga **SOCOPA - SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.**), instituição financeira autorizada a funcionar pelo BACEN, e devidamente autorizada pela CVM a administrar carteiras de valores mobiliários, com sede na cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, na Av. Brigadeiro Faria Lima, nº 1.355, 3º andar, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 62.285.390/0001-40.

Conforme aprovação em Assembleia Geral de Cotistas ocorrida em 22/12/2022, a Queluz Gestão de Recursos Financeiros Ltda substituiu a Singulare na Gestão do Fundo, fato que foi concluído em 15/02/2023, após processo de due dilligence da Queluz.

Porém, a época dos rebaixamentos do rating do Fundo, a Administração do Fundo era feita pela **SINGULARE CTVM S.A.** (antiga **SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.**), a sua carteira de ativos financeiros era gerida pela **RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA.**, inscrita no CNPJ/MF sob nº 07.611.259/0001-18, e as atividades de custódia e controladora dos ativos integrantes da carteira do fundo eram realizadas pelo **BANCO PAULISTA S/A**, inscrito no CNPJ/MF sob nº 61.820.817/0001-09.

b) Histórico de aplicações e Resgates:

CNPJ	Tipo Movimentação	Movimentação			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Movimentação
13.633.964/0001-19	Aplicação	14/07/2016	875,623809	1.427,55	R\$ 1.250.000,00
13.633.964/0001-19	Aplicação	12/08/2016	414,552995	1.447,34	R\$ 600.000,00
13.633.964/0001-19	Aplicação	10/10/2016	336,520131	1.485,80	R\$ 500.000,00
13.633.964/0001-19	Aplicação	14/12/2016	147,202103	1.528,51	R\$ 225.000,00
13.633.964/0001-19	Aplicação	21/02/2017	126,962031	1.575,27	R\$ 200.000,00
13.633.964/0001-19	Aplicação	25/04/2017	124,065039	1.612,06	R\$ 200.000,00
13.633.964/0001-19	Aplicação	23/08/2017	714,819717	1.678,74	R\$ 1.200.000,00
13.633.964/0001-19	Aplicação (Resgate do Brasil Plus)*	30/04/2018	5210,549152	244,69602	R\$ 1.275.000,65
13.633.964/0001-19	Amortização	31/01/2018	7,950.294955	-	R\$ 384.998,76
13.633.964/0001-19	Amortização	28/02/2018	7,950.294955	-	R\$ 256.665,84
13.633.964/0001-19	Amortização	29/03/2018	7,950.294955	-	R\$ 91.873,27

13.633.964/0001-19	Amortização	30/04/2018	7,950.294955	-	R\$ 48.053,50
13.633.964/0001-19	Amortização	30/05/2018	7,950.294955	-	R\$ 50.218,19
13.633.964/0001-19	Amortização	03/07/2018	7,950.294955	-	R\$ 101.289,77
13.633.964/0001-19	Amortização	02/08/2018	7,950.294955	-	R\$ 99.927,63
13.633.964/0001-19	Amortização	04/09/2018	7,950.294955	-	R\$ 52.598,84
13.633.964/0001-19	Amortização	08/10/2018	7,950.294955	-	R\$ 64.797,82
13.633.964/0001-19	Amortização	08/11/2018	7,950.294955	-	R\$ 76.686,07
13.633.964/0001-19	Amortização	05/12/2018	7,950.294955	-	R\$ 34.974,68
13.633.964/0001-19	Amortização	09/01/2019	7,950.294955	-	R\$ 44.708,42
13.633.964/0001-19	Amortização	07/02/2019	7,950.294955	-	R\$ 64.763,66
13.633.964/0001-19	Amortização	11/03/2019	7,950.294955	-	R\$ 56.876,46
13.633.964/0001-19	Amortização	05/04/2019	7,950.294955	-	R\$ 8.747,32
13.633.964/0001-19	Amortização	08/05/2019	7,950.294955	-	R\$ 52.801,48
13.633.964/0001-19	Amortização	10/06/2019	7,950.294955	-	R\$ 32.998,88
13.633.964/0001-19	Amortização	05/07/2019	7,950.294955	-	R\$ 10.800,98
13.633.964/0001-19	Amortização	05/08/2019	7,950.294955	-	R\$ 14.969,34
13.633.964/0001-19	Amortização	06/09/2019	7,950.294955	-	R\$ 16.076,21
13.633.964/0001-19	Amortização	07/10/2019	7,950.294955	-	R\$ 18.178,83
13.633.964/0001-19	Amortização	07/11/2019	7,950.294955	-	R\$ 14.878,45
13.633.964/0001-19	Amortização	04/02/2021	7,950.294955	-	R\$ 10.722,47
13.633.964/0001-19	Amortização	04/03/2022	7,950.294955	-	R\$ 29.047,29
13.633.964/0001-19	Amortização	02/10/2023	7,950.294955	-	R\$ 55.711,22

* Aplicação realizada a partir da liquidação do Fundo FIDC Brazil Plus

c) Cotação atualizada:

CNPJ	Fundo	Cotação atualizada			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Valor atual
13.633.964/0001-19	FIDC MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP	30/06/2024	7,950.294955	1,448093	11.512,75

d) Resumo de Assembleias e Fatos Relevantes:

No relatório do 1º semestre de 2021, foi apresentado um histórico com as Assembleias e Fatos Relevantes ocorridas nos anos anteriores até o período de referência do relatório. Não houve atualização nesse ponto no 1º semestre de 2022.

O relatório anterior foi publicado no site do IpojucaPrev e pode ser acessado a partir do link: <https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/publicacoes-oficiais/investimentos/diligencia-e-verificacao-de-lastro/>

e) Situação da liquidação do Fundo:

O Fundo está com um plano de liquidação que foi instituído na Assembleia Geral dos Cotistas- AGC realizada no dia 28 de junho de 2018 a ser realizado de formas mensais e em

regime de caixa, descontadas as despesas incorridas. O plano foi renovado no a AGC ocorrida no dia 29 de Agosto de 2019.

Desde então, a situação de liquidação do fundo continua sendo acompanhada pela Diretoria de Investimentos, dando ciência para os conselheiros e membros do Comitê de Investimentos sobre as atualizações mais importantes do fundo. Durante o ano de 2023 não houve avanço relevante na continuidade da liquidação do fundo.

Conforme aprovação em Assembleia Geral de Cotistas ocorrida em 22/12/2022, a Queluz Gestão de Recursos Financeiros Ltda substituiu a Singulare na Gestão do Fundo, fato que foi concluído em 15/02/2023, após processo de due dilligence da Queluz.

De acordo com o último relatório de atividades emitido pelo escritório de advocacia Hirtácides Advogados Associados (datado de outubro-2023), que é o escritório contratado pelo FIDC Dunas para representar os cotistas e acompanhar o caso, após a modificação do gestor do fundo, tem sido tratado com a CVM a possibilidade da Queluz acumular também o cargo de administrador. Tal alteração seria visando a responsabilização da Singulare por ter deixado de agir com os seus deveres previstos na legislação.

Visando detalhar os direitos creditórios do fundo, analisamos o relatório de rating do FIDC Dunas, divulgado em 26/06/24 pela Austing Rating,

Ratings

Classe / Série	1T24 (atual)	4T23	3T23	Jul/22 (Inicial)
Cotas Seniores (1ª Série)	brD(sf)	brD(sf)	brC(sf) Estável	brC(sf) Estável
Sub. Mezanino (1ª Emissão)	brD(sf)	brD(sf)	brD(sf)	brD(sf)
Subordinadas Júnior	brD(sf)	brD(sf)	brD(sf)	brD(sf)

Validade dos Ratings: 11/out/2024

fonte: Relatório de Rating Austing Ratings 26/06/2024

“Destaque-se que, embora o Fundo possa adquirir diversos recebíveis comerciais, conforme descrito em seu Regulamento, sua carteira compõe-se, atualmente, apenas por Direitos Creditórios vencidos. De acordo com a Administradora e a Gestora do veículo, não serão adquiridos novos créditos e nem devem ser emitidas novas emissões de Cotas.

Os ativos do FIDC Invest Dunas são passíveis de medidas judiciais objetivando a restituição dos valores por diversas empresas que cederam créditos no Fundo. De acordo com o andamento do plano de cobrança e recuperação dos créditos, informado pela Credescon Consultoria e Soluções Financeira Ltda. (Credescon / Agente de Cobrança) e apresentado em Assembleia Geral Extraordinária de Cotistas de 10 de maio de 2022, a carteira do Fundo em abr/22, tinha valor de R\$ 96,6 milhões, dos quais R\$

11,3 milhões eram créditos recuperados. Na mesma data, havia uma provisão de R\$ 96,3 milhões, e R\$ 1,3 milhão eram confissões de dívidas já assinadas. Ademais, foi determinada uma perda efetiva no valor de R\$ 44,6 milhões. Destaca-se que, em dez/17, os Direitos Creditórios do FIDC Invest Dunas (período em funcionamento normal) perfaziam R\$ 106,3 milhões.

Ainda de acordo com a Agente de Cobrança, estão em andamento mais de 200 ações em execução (já protocoladas), as quais montam R\$ 41,8 milhões. Para essas ações, a Credescon estimou uma probabilidade de recebimento de R\$ 4,5 milhões e informou que R\$ 3,5 milhões pertencem a Cedentes em Recuperação Judicial, R\$ 1,5 milhão referem-se a imóveis dados em dação e pagamento, que, porém, estão no nome da Consultora, e outros R\$ 596,1 mil dizem respeito a um imóvel recuperado e em execução de posse”

fonte: Relatório de Rating Austing Ratings 03/04/2024

4.2 CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA FIP

a) Apresentação do Fundo:

Fundo de Investimentos em Participações que conta com 97,03% da empresa investida na Cais Mauá do Brasil S.A. O Fundo foi liquidado, conforme histórico constante no item “e) Situação da Liquidação do Fundo”, fazendo com que o FUNPREI passasse a receber 640.603 ações da Cais Mauá do Brasil S.A., o que por sua vez representa 1,372% da empresa, uma vez que o FIP possuía 97,03% da CMB S.A.

b) Histórico de aplicações e resgates:

CNPJ	Tipo Movimentação	Movimentação			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Movimentação
17.213.821/0001-09	Aplicação	27/11/2013	256.39471961	9.749,83115710	R\$ 2.500.000,00
17.213.821/0001-09	Liquidação do Fundo	31/03/2021	256.39471961	(193,41088832)	R\$ (49,589.53)

c) Cotação atualizada:

CNPJ	Fundo	Cotação atualizada			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Valor atual
17.213.821/0001-09	CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA FIP	30/06/2024	0,00	0,00	R\$ 0,00

*Fundo liquidado, conforme descrito no item “e) Situação da liquidação do Fundo”

d) Resumo de Assembleias e Fatos Relevantes:

No relatório do 1º semestre de 2021, foi apresentado um histórico com as Assembleias e Fatos Relevantes ocorridas nos anos anteriores até o período de referência do relatório. Durante o ano de 2024 não houve avanço relevante na continuidade da liquidação do fundo

O relatório anterior foi publicado no site do IpojucaPrev e pode ser acessado a partir do link: <https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/publicacoes-oficiais/investimentos/diligencia-e-verificacao-de-lastro/>

e) Situação da liquidação do Fundo:

O Fundo vem passando pelo processo de liquidação das suas cotas e está sendo acompanhado de perto pela Diretoria de Investimentos, que vem participando das Assembleias entre cotistas e repassando todas as informações sobre o andamento da situação do FIP para os membros do Comitê de Investimentos e dos Conselhos Fiscal e Deliberativo. O relatório do 1º semestre de 2021 fez um resumo detalhado de todo o processo de liquidação do fundo e dos seus desdobramentos. Segue abaixo um resumo das principais informações e atualização sobre a situação do fundo

Conforme ata da Assembleia Geral de Cotistas ocorrida no dia 24 de Agosto de 2020 do FIP Cais Mauá *“Na hipótese de não substituição da Administradora e Gestora, informar sobre a liquidação do Fundo com entrega de ativos, uma vez que no dia 15 de agosto de 2020 transcorreu o período de 180 (cento e oitenta) dias da renúncia da LAD Capital, nos termos do artigo 42, §1º da Instrução CVM 578/16. Considerando que não foram eleitos prestadores de serviço no prazo de considerado nos termos do art. 42, § 1º instrução CVM 578/16, aptos a substituir a LAD Capital enquanto prestadoras de serviços de: (i) Administração Fiduciária; e (ii) Gestão de Recursos; esta prosseguirá com a liquidação do Fundo com entrega de ativos, e provisões constantes na carteira do Fundo, em especial a totalidade das ações da Companhia Cais Mauá do Brasil S.A., sociedade anônima de capital fechado, inscrita no CNPJ/ME sob o número 13.072.557/001-80”*

Esse assunto foi pauta da reunião do dia 27 de Agosto de 2020 com os membros do Comitê de Investimentos e dos Conselhos Deliberativo. Nessa reunião também foi informado que foi solicitado o acompanhamento jurídico e contábil sobre os reflexos da liquidação do fundo através da entrega das ações da empresa investida.

No dia 28 de Outubro de 2020, ocorreu uma Assembleia Geral Extraordinária da Companhia Cais Mauá do Brasil S.A., sociedade anônima de capital fechado, inscrita no CNPJ/ME sob o número 13.072.557/001-80. Conforme ata da reunião, foram *“discutidas a seguinte ordem do dia: 1. relatar a liquidação do acionista Fundo de Investimento em Participações Cais Mauá do Brasil Infraestrutura, nos termos da ICVM 578 2. Informar que os atuais cotistas do fundo irão suceder o Fundo, na proporção de suas cotas, como acionistas da empresa, assumindo seus direitos e obrigações; 3. destituição dos atuais membros do Conselho de Administração; 4. eleição de novos membros do Conselho de Administração da Companhia, incluindo a indicação do Presidente do Conselho de Administração; 5. Outros assuntos de interesse da Companhia.”*

No dia 03 de Março de 2021, a LAD Capital divulgou um comunicado aos cotistas que trazia um breve histórico sobre o fundo e o seu processo de liquidação, sendo destacado

principalmente o *“item 5: Frente ao exposto, a LAD Capital, esclarece que, até o momento, passados mais de 06 (seis) meses nenhum cotista a procurou para efetivar a transferência das ações em livro próprio. Diante disso, a LAD Capital, solicita que os Cotistas compareçam à sua sede, ou entrem em contato através do e-mail contato@ladcapital.com.br, até o dia 31 de março de 2021, para que seja operacionalizada a entrega das ações da Companhia. Frisa-se que a respectiva data corresponderá, inclusive a data de encerramento e liquidação definitiva do Fundo. Cabendo destacar que o silêncio e/ou não comparecimento ensejará medidas judiciais para entrega das ações, para perfectibilizar a entrega dos ativos, a conclusão da liquidação e encerramento do Fundo.”*

Esse assunto foi pauta da reunião do dia 25 de Novembro de 2020 com os membros do Comitê de Investimentos e dos Conselhos Deliberativo. No qual foi evidenciado que já tinham sido enviados diversos e-mails pedindo à LAD Capital mais informações sobre o processo de liquidação dos fundos e diversos documentos que tinham sido prometidos pela Administradora/gestora do FIP. Logo após a divulgação do comunicado acima publicado, foi enviado mais uma vez um e-mail à LAD Capital, ratificando a solicitação dos documentos.

No dia 31 de Março de 2021, a LAD Capital mandou parte da documentação solicitada e divulgou o procedimento para a continuidade do processo de liquidação. O que fez com que a Lema Consultoria organizasse uma reunião no dia 16 de Abril de 2021 entre diversos cotistas do FIP Cais Mauá, inclusive, com a participação da Sra. Raquel Gouveia, Procuradora Jurídica do IpojucaPrev, do Sr Marcelo Marinheiro, Diretor de Investimentos do IpojucaPrev e do Sr Alexandre Melo, Diretor Jurídico do IpojucaPrev. Além dos cotistas, a reunião também contou com a presença de alguns representantes de outras instituições, de acordo com a seguinte programação: CVM (Sr Daniel Maeda), que falou um pouco sobre a situação do FIP Cais Mauá, tirando dúvidas sobre a legalidade do processo de liquidação do fundo com a entrega dos ativos e sobre as ações que podem ser tomadas pelos cotistas para resolver esse problema; LAD Capital (Sr Luiz Favieri e André Fernandes), que repassaram o histórico do fundo a partir da assunção da LAD às funções de administrador e gestor do FIP; Sr. Alexandre Pasqualini (Advogado contratado pela companhia investida), que fez a atualização sobre o processo da companhia investida contra a rescisão unilateral do Contrato de Arrendamento promovida pela SUPRG e pelo Estado do Rio Grande do Sul, Processo sob o nº 5043843-54.2019.4.04.7100.

Durante o período de 2024, não houve atualização relevante na situação do fundo e nem nenhuma notificação oficial do FUNPREI como cotista da Cais Mauá do Brasil S.A., sociedade anônima de capital fechado, inscrita no CNPJ/ME sob o número 13.072.557/001-80.

4.3 GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP

a) Apresentação do Fundo:

Fundo de Investimentos em Participações que tem como objetivo investir em sociedades anônimas, abertas ou fechadas, emissoras de títulos e valores mobiliários, que atuem, direta ou indiretamente, no setor de geração de energia e que possam ser objeto de Propostas de Investimento pelo Fundo. Ademais, em sendo de capital aberto, deverão estar listadas em um dos segmentos do Novo Mercado, da Bovespa ou permitir a participação efetiva do Fundo em sua gestão.

O Fundo está em processo de liquidação, conforme histórico constante no item “e) Situação da Liquidação do Fundo”.

b) Histórico de aplicações e resgates:

CNPJ	Tipo movimentação	Movimentação			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Movimentação
11.490.580/0001-69	Aplicação	25/11/2015			R\$ 1.500.000,00

c) Cotação atualizada:

CNPJ	Fundo	Cotação atualizada			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Valor atual
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	30/06/2024	793,349.72372707	(0,07166439)	R\$ (56.854,92)

d) Resumo de Assembleias e Fatos Relevantes:

CNPJ	Nome do Fundo	Assuntos Principais	Resultado Final
25/01/2024 11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	1) Aprovação das Demonstrações Financeiras do período findo em 30 Junho de 2023	Reprovado

Data	CNPJ	Fundo	Fato Relevante
			RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA., inscrita no CNPJ sob o nº 42.066.258/0001-30, com sede na Cidade e Estado do Rio de Janeiro, na Avenida Rio Branco, nº 138, sala 402 - parte, Centro, CEP: 20040-909 (“RJI” e “Administradora”), na qualidade de administradora do GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA, inscrito no CNPJ sob o nº

12/07/2024

11.490.580/0001-69

GERAÇÃO DE
ENERGIA
MULTIESTRATÉGIA
FIP

11.490.580/0001-69 ("Fundo"), vem informar à V.Sas. que houve reajuste na carteira do Fundo, na data do dia 28 de junho de 2024, onde foi observada a variação na precificação das cotas no importe de -64,21% (menos sessenta e quatro vírgula vinte e um por cento), especificamente por conta das demonstrações financeiras auditadas da Empresa "GREEN OIL PARTICIPAÇÕES S.A.", investida do Fundo. (Rerratificação da empresa investida divulgada em 23/07/2024

Assim, onde lê -se: "especificamente por conta das demonstrações financeiras auditadas da Empresa "STIG ENERGIA E PROJETOS S.A.", investida do Fundo.", leia-se: "especificamente por conta das demonstrações financeiras auditadas da Empresa "GREEN OIL PARTICIPAÇÕES S.A.", investida do Fundo.

e) Situação da liquidação do Fundo:

O plano de liquidação do fundo foi aprovado na Assembleia Geral de Cotistas do dia 24 de Junho de 2019, com o prazo de 2 anos, prorrogáveis por mais 2 anos. Com o fim dos 2 primeiros anos em Junho de 2021, a Brasil Plural - BRPP, nova gestora do fundo, apresentou em seu call mensal de acompanhamento da liquidação de Maio de 2021, um resumo das ações realizadas durante o período, prorrogando o período por mais 2 anos para viabilizar a finalização da venda dos ativos investidos.

Com o fim do prazo pro plano original de liquidação, houve uma consulta formal para uma Assembleia Geral de Cotistas, que só ocorreu no dia 21 de Setembro de 2023 por conta de algumas prorrogações de prazo. Porém, os cotistas aprovaram a prorrogação do prazo do fundo para a data de 29 de Junho de 2025 podendo ser prorrogado por mais dois anos, ou seja, até a data de 29 de junho de 2027, conforme Plano de Encerramento proposto pelo Gestor e aprovado pelos cotistas.

O gestor do FIP tem procurado empresas interessadas no financiamento da ação de responsabilização dos antigos gestores e administradores, uma vez que o fundo não tem capital para isso e os cotistas não podem ser chamados a aportar, pois muitos são RPPS. Conforme pauta 2 da Assembleia Geral de Cotistas, ocorrida no dia 21 de Setembro de 2023, foram aprovados "condições mínimas elencadas pela Gestora no anexo à esta convocação, para celebração de um Contrato Definitivo com um terceiro investidor, compreendendo a adoção de todas as medidas necessárias ao cumprimento do seu Objeto, bem como a celebração de todos os contratos acessórios ao Contrato Definitivo"

Até o fechamento desse relatório, o contrato definitivo ainda não foi finalizado, de acordo com a última conference call mensal de acompanhamento da liquidação dos ativos realizada no dia 20 de agosto de 2024.

A tabela 27 traz a composição da carteira do fundo, demonstrando que o Patrimônio Líquido está negativo, além disso, as ações das empresas GREEN OIL PARTICIPAÇÕES S.A. e STIG ENERGIA E PROJETOS S.A. estão marcadas a 0,00 no fundo.

Tabela 27

Nome do Ativo	Valor do Ativo (mil)	Quantidade Total	Tipo de Aplicação
Ação Companhia Fechada - GREEN OIL PARTICIPAÇÕES S.A. (18.606.899/0001-56)	R\$ 0,00	114.550.244	Ações
Ação Companhia Fechada - STIG ENERGIA E PROJETOS S.A. (26.775.178/0001-06)	R\$ 0,00	172.515.602	Ações
Outras Disponibilidades	R\$ 0,00	0	Disponibilidades
Outros Valores a pagar	R\$ 23.570,33	0	Valores a pagar
Outros Valores a receber	-R\$ 1.747,18	0	Valores a receber

4.4 BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP

a) Apresentação do Fundo:

O Brasil Florestal - Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia ("Fundo"), foi constituído sob a forma de condomínio fechado e iniciou suas operações em 21 de março de 2012. O Fundo possuía prazo determinado de duração de seis anos, contados da data da primeira integralização de cotas, podendo ser prorrogado mediante deliberação em Assembleia Geral de Cotistas.

A gestão da carteira do Fundo compete à Queluz Gestão de Recursos Financeiros Ltda. ("Gestora") e a administração à BNY Mellon Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. ("Administradora"). Até 13 de março de 2019, a gestão competia à Ático Administração de Recursos Ltda.

O objetivo do Fundo era buscar a valorização do capital investido, a médio ou longo prazo, por meio de investimentos na aquisição direta de ações ou títulos e valores mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações de emissão da Tree Florestal Empreendimentos e Participações S.A. ("Tree Florestal ou Companhia"), de forma que o Fundo venha a participar de seu processo decisório e com efetiva influência na definição de sua política estratégica e na sua gestão.

b) Histórico de aplicações e resgates:

CNPJ	Tipo Movimentação	Movimentação			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Movimentação
12.312.767/0001-35	Aplicação	07/11/2014	-	-	R\$ 1.000.000,00
12.312.767/0001-35	Aplicação	03/06/2016	-	-	R\$ 1.000.000,00
12.312.767/0001-35	Aplicação	15/07/2016	-	-	R\$ 500.000,00
12.312.767/0001-35	Aplicação	10/10/2016	-	-	R\$ 500.000,00

c) Cotação atualizada:

CNPJ	Fundo	Cotação atualizada			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Valor atual
12.312.767/0001-35	BRASIL FLORESTAL				
	MULTIESTRATÉGIA	30/06/2024	3.59716189	740.802,4800114	R\$
	FIP				2.664.786,44

d) Resumo de Assembleias e Fatos Relevantes:

Não houve atualização de Assembleias e Fatos Relevantes durante o ano de 2024.

e) Situação da liquidação do Fundo:

Conforme ata da reunião, ocorrida em 03 de setembro de 2021, foi deliberada em Assembleia Geral de Cotistas a alienação das ações detidas pela Tree Florestal Empreendimentos e Participações S.A. ("Tree Florestal") na Remasa Reflorestadora S.A. ("Remasa"), prorrogando o prazo de duração do Plano de Liquidação para o dia 15 de Janeiro de 2031, considerando o fluxo de pagamento e amortização constante na proposta de venda da Remasa.

Fluxo de pagamento saldo final dos credores

Data	Pgto Remasa	Minoritários Bolt	Green Oil	Villemor Amaral	Administração Vencida	Fundo	Saldo Minoritários Bolt	Saldo Green Oil
15/04/2022	1.012.392,32	350.000,00	150.000,00	500.000,00	12.392,32		2.359.015,28	24.205.672,91
15/07/2022	8.159.210,48	2.359.015,28	5.100.195,20		700.000,00		-	19.105.477,71
15/10/2022	1.027.465,99		1.027.465,99		-			18.078.011,72
15/01/2023	7.245.607,46		6.545.607,46		700.000,00			11.532.404,26
15/04/2023	1.042.641,79		1.042.641,79		-			10.489.762,47
15/07/2023	7.351.763,57		6.651.763,57		700.000,00			3.837.998,90
15/10/2023	1.058.041,73		1.058.041,73		-			2.779.957,17
15/01/2024	7.460.350,00		2.779.957,17			4.680.392,83		-
15/04/2024	1.073.543,21					1.073.543,21		
15/07/2024	7.570.540,27					7.570.540,27		
15/10/2024	1.089.910,82					1.089.910,82		
15/01/2025	7.685.963,37					7.685.963,37		
15/04/2025	1.106.008,93					1.106.008,93		
15/07/2025	6.683.705,55					6.683.705,55		
15/10/2025	1.122.608,14					1.122.608,14		
15/01/2026	6.786.403,64					6.786.403,64		
15/04/2026	1.139.189,20					1.139.189,20		
15/07/2026	6.885.024,26					6.885.024,26		
15/10/2026	1.156.150,77					1.156.150,77		
15/01/2027	6.988.356,13					6.988.356,13		
15/04/2027	1.173.089,65					1.173.089,65		
15/07/2027	7.090.743,22					7.090.743,22		
15/10/2027	1.190.695,62					1.190.695,62		
15/01/2028	5.997.635,47					5.997.635,47		
15/04/2028	1.208.282,34					1.208.282,34		
15/07/2028	6.085.507,41					6.085.507,41		
15/10/2028	1.226.128,81					1.226.128,81		
15/01/2029	6.175.391,09					6.175.391,09		
15/04/2029	1.243.947,02					1.243.947,02		
15/07/2029	6.265.867,34					6.265.867,34		
15/10/2029	1.262.616,44					1.262.616,44		
15/01/2030	6.359.160,82					6.359.160,82		
15/04/2030	1.281.115,16					1.281.115,16		
15/07/2030	5.161.863,61					5.161.863,61		
15/10/2030	1.300.494,93					1.300.494,93		
15/01/2031	5.240.563,18					5.240.563,18		
	166.907.979,74				Valor devolvido aos cotistas -->	112.230.899,22		

Fonte: Fluxo de Pagamento da Proposta de compra da Remasa

Foi convocada uma Reunião Extraordinária do Comitê de Investimentos para o dia 01 de Setembro de 2021, contando com a participação de representantes da Queluz, gestora do Fundo, de representantes da Lema, Consultoria de Investimentos Contratada pelo IpojucaPrev, e de representantes dos Conselhos Deliberativo e Fiscal. Nessa reunião, foram discutidos todos os principais pontos da proposta, visando definir qual seria a orientação de voto para a Assembleia em questão. No final, os membros do Comitê de Investimentos votaram pela aprovação da proposta, considerando as discussões e o parecer da Lema Consultoria.

Os cotistas são atualizados do processo de venda dos ativos, sendo emitido um relatório trimestral da situação pela nova gestora do Fundo, Queluz Gestão de Recursos. Os destaques do Relatório do 1º Trimestre de 2024 são os seguintes:

"TREE FLORESTAL - Com a aprovação e conclusão do processo de alienação da Remasa, no que diz respeito ao Fundo, as atenções passaram a ficar voltadas para três principais frentes: (i) o cumprimento dos acordos formatados no âmbito das renegociações implementadas; (ii) redução de custos fixos do Fundo; (iii) responsabilização dos envolvidos nos eventos irregulares identificados anteriormente. Nesse sentido, foram iniciadas a adoção das medidas cabíveis, preparatórias à instrução do processo judicial, com a propositura de medidas disciplinares junto à OAB em face dos escritórios que receberam recursos da Tree Florestal, requerendo a comprovação da efetiva prestação de serviços e a respectiva prestação de contas, procedimento que está em andamento, sem grandes evoluções até a presente data, estando ainda na fase de citação das partes envolvidas. Além disso, o refazimento das DFs foi concluído e está em fase final de revisão, com previsão de contratação da auditoria para refazimento das DFs do Fundo até abril/24, quando o Fundo provavelmente voltará a ter caixa para fazer frente às despesas. "

"REMASA - No que se refere à Remasa, até o momento, além da parcela de entrada, foi recebida a parcela vencida no mês de abril, cujos valores foram integralmente destinados ao pagamento dos credores da Tree Florestal, na forma em que apresentado aos cotistas anteriormente."

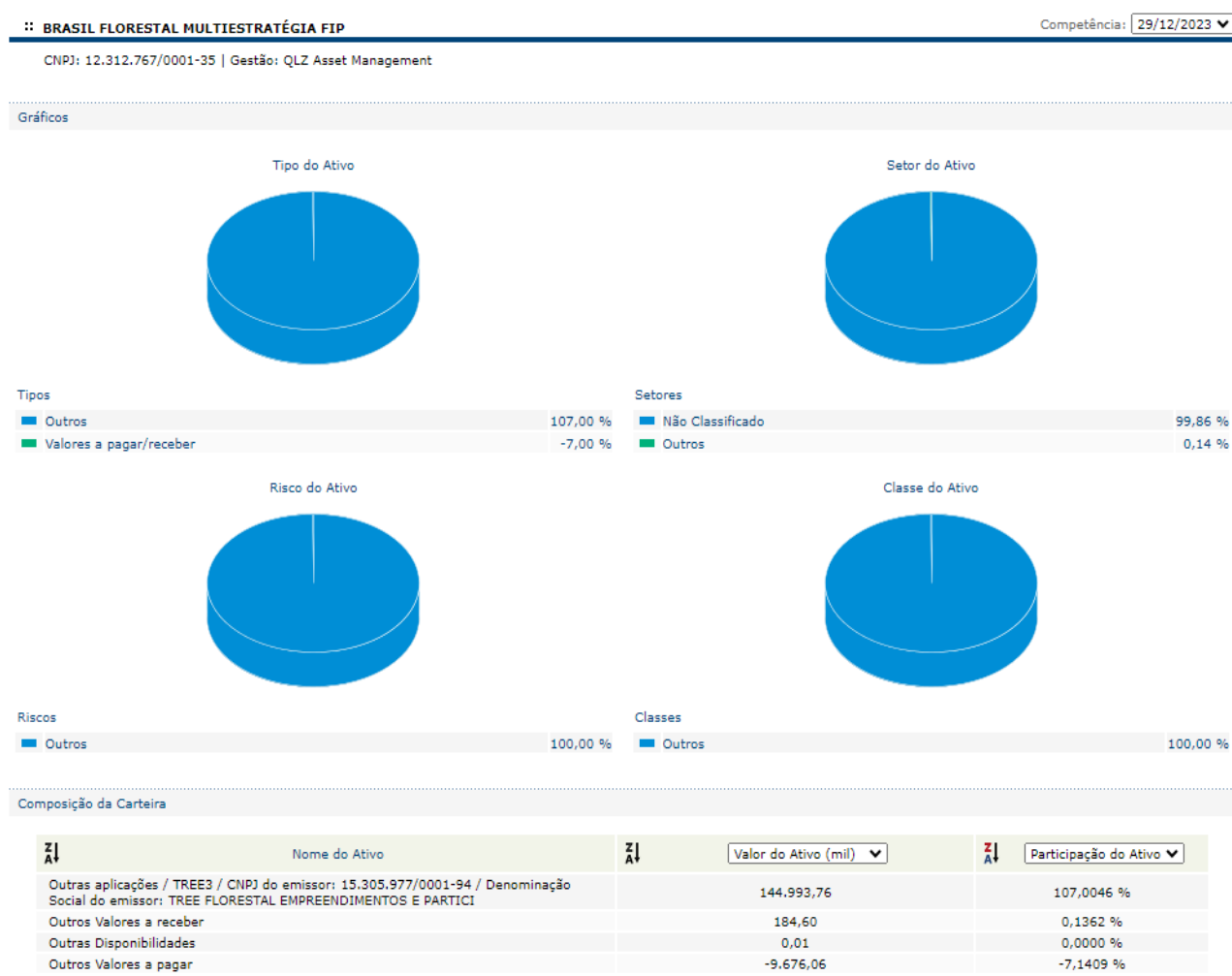
"TREE SERVIÇOS - Com a manutenção do cenário de incerteza global, o quarto trimestre novamente registrou maior oscilação no volume de produtos exportados, sendo certo que o mês de dezembro apresentou um volume de vendas bastante pequeno, contribuindo para a deterioração da já complicada gestão do fluxo de caixa da empresa. Soma-se a isso as dificuldades operacionais enfrentadas pela empresa nesse último trimestre em razão do fechamento dos portos de Itajaí e Navegantes em consequência de eventos climáticos de chuvas extremas, impactando negativamente a operação. No mais, todas as obrigações relativas ao dia a dia da empresa e, também, à repactuação das dívidas estão em dia, em linha com o cenário de manutenção das atividades da Sociedade, em busca da restituição de valor de mercado para a empresa, mesmo diante de uma previsão muito mais desafiadora do que aquela inicialmente esperada."

Fonte: Relatório do 1º Trimestre de 2024 emitido pela Queluz

Considerando que o fluxo esperado de pagamentos na venda da REMASA geraria amortizações aos cotistas a partir de Janeiro de 2024, foi solicitado que o Sr Rafael Cordeiro, representante da Queluz Asset, pudesse comparecer na 4ª Reunião Ordinária, ocorrida, no dia 30 de Abril de 2024, para esclarecer a atual situação do fundo para os membros do Comitê de Investimentos e Conselheiros. A ata da referida reunião tem os principais pontos abordados e as justificativas apresentadas pelo Representante da Queluz. Foi ressaltado também que as Demonstrações Financeiras do fundo estão atrasadas e devem ser atualizadas e refeitas a dos últimos cinco anos, devendo ser publicadas a convocação de AGE ainda no primeiro semestre de 2024.

A tabela 27, retirada do quantum, demonstra a composição da carteira em 29/12/2023, relacionando os ativos presentes em carteira. Após essa data, não tem atualização de carteira no sistema quantum.

Tabela 27



4.5 SINGULARE FII - REIT11 (Antigo SOCOPA FII)

a) Apresentação do Fundo:

O Socopa Fundo de Investimento Imobiliário ("Fundo"), CNPJ nº16.841.067/0001-99, administrado pela SOCOPA Sociedade Corretora Paulista S.A. – CNPJ nº 62.285.390/0001-40, foi constituído em 10 de outubro de 2012 sob a forma de condomínio fechado e com prazo de duração indeterminado, nos termos da Instrução CVM nº 472 de 31 de outubro de 2008 e pelas disposições legais que lhe forem aplicáveis, tendo sido concedido o seu registro de funcionamento pela Comissão de Valores Mobiliários ("CVM") em 10 de março de 2014 após o encerramento da primeira oferta de cotas.

A primeira emissão de cotas teve sua distribuição durante o período de 10 de outubro de 2012 a 10 de março de 2014 quando foi encerrada a oferta e obtido o registro de funcionamento pela CVM. O Fundo recebeu a aplicação inicial de cotistas em 05 de março de 2013. O CNPJ do Fundo foi obtido em 28 de agosto de 2012.

As cotas de emissão do Fundo são destinadas exclusivamente a Investidores, residentes no Brasil ou no exterior, considerados como Investidores Qualificados, conforme definido na legislação em vigor, desde que tais Investidores realizem um investimento mínimo individual de R\$ 1.000 (um milhão de reais) em cotas do Fundo e que estejam dispostos a correr os riscos inerentes ao mercado imobiliário.

O Fundo tem por objetivo obter retornos superiores ao Índice de Performance, por meio da realização de investimentos em empreendimentos imobiliários, por meio da destinação de parcela preponderante de seu Patrimônio Líquido na aquisição de: (i) CRIs, observando a Política de Investimento descrita no seu Regulamento; (ii) participação direta em SPEs; e (iii) demais ativos com lastro em empreendimentos imobiliários e direitos a estes inerentes ou relacionados e demais valores mobiliários, de acordo com a Política de Investimentos do Fundo, conforme seu Regulamento. A parcela do Patrimônio Líquido do Fundo que não esteja aplicada em Ativos Alvo poderá, ainda, vir a ser investida em Ativos Financeiros, sempre visando proporcionar aos cotistas do Fundo uma distribuição de resultados constante e o aumento do valor patrimonial de suas cotas.

b) Histórico de aplicações e resgate:

CNPJ	Tipo Movimentação	Movimentação			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Movimentação
16.841.067/0001-99	Aplicação	28/05/2015	1.411	1.063,32037208	R\$ 1.500.345,05
16.841.067/0001-99	Aplicação	21/12/2015	880	1.135,72942427	R\$ 1.000.000,00
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	07/03/2019	1	1.310,934880	R\$ 1.310,93
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	08/03/2019	16	1.311,496188	R\$ 20.983,94
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	11/03/2019	16	1.312,394763	R\$ 20.998,32
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	11/12/2019	83	1.322,579891	R\$ 109.774,13
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	12/12/2019	1	1.322,622049	R\$ 1.322,62

16.841.067/0001-99	Venda de cotas	19/12/2019	4	1.325,977445	R\$ 5.303,91
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	26/12/2019	6	1.329,671511	R\$ 7.978,03
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	27/12/2019	1	1.342,156442	R\$ 1.342,16
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	30/12/2019	88	1.271,649834	R\$ 111.905,19
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	13/01/2021	7	1.298,000000	R\$ 9.086,00
16.841.067/0001-99	Venda de cotas	03/03/2021	1	1.298,000000	R\$ 1.298,00

O fundo vem sendo liquidado e pagando dividendos. Segue o relatório desses pagamentos a partir de Janeiro de 2019 até o final de 2023

	Descrição	Valor	Ativo
Data Exercício			
15/01/2019	Dividendo	R\$ 82.192,37	SINGULARE FII - REIT11
01/04/2019	Dividendo	R\$ 40.518,35	SINGULARE FII - REIT11
01/07/2019	Dividendo	R\$ 65.527,60	SINGULARE FII - REIT11
30/09/2019	Amortização	R\$ 97.532,67	SINGULARE FII - REIT11
01/10/2019	Dividendo	R\$ 51.034,29	SINGULARE FII - REIT11
01/10/2019	Amortização	R\$ 97.532,67	SINGULARE FII - REIT11
30/12/2019	Amortização	R\$ 99.472,52	SINGULARE FII - REIT11
31/12/2019	Dividendo	R\$ 53.531,44	SINGULARE FII - REIT11
31/03/2020	Amortização	R\$ 107.484,28	SINGULARE FII - REIT11
01/04/2020	Dividendo	R\$ 46.071,10	SINGULARE FII - REIT11
30/06/2020	Amortização	R\$ 81.436,92	SINGULARE FII - REIT11
01/07/2020	Dividendo	R\$ 34.446,07	SINGULARE FII - REIT11
30/09/2020	Amortização	R\$ 83.932,53	SINGULARE FII - REIT11
01/10/2020	Dividendo	R\$ 30.093,71	SINGULARE FII - REIT11
30/12/2020	Amortização	R\$ 160.870,95	SINGULARE FII - REIT11
31/12/2020	Dividendo	R\$ 40.421,51	SINGULARE FII - REIT11
31/03/2021	Amortização	R\$ 164.445,89	SINGULARE FII - REIT11
01/04/2021	Dividendo	R\$ 50.289,77	SINGULARE FII - REIT11
30/06/2021	Amortização	R\$ 704.970,68	SINGULARE FII - REIT11
01/07/2021	Dividendo	R\$ 36.578,72	SINGULARE FII - REIT11
30/09/2021	Amortização	R\$ 905.361,48	SINGULARE FII - REIT11
01/10/2021	Dividendo	R\$ 44.241,34	SINGULARE FII - REIT11
30/12/2021	Amortização	R\$ 98.771,27	SINGULARE FII - REIT11
31/12/2021	Dividendo	R\$ 19.134,54	SINGULARE FII - REIT11
31/03/2022	Amortização	R\$ 16.856,09	SINGULARE FII - REIT11
01/04/2022	Dividendo	R\$ 4.581,82	SINGULARE FII - REIT11
30/06/2022	Amortização	R\$ 16.742,32	SINGULARE FII - REIT11
01/07/2022	Dividendo	R\$ 4.230,44	SINGULARE FII - REIT11
30/09/2022	Amortização	R\$ 17.536,23	SINGULARE FII - REIT11
03/10/2022	Dividendo	R\$ 5.637,50	SINGULARE FII - REIT11
20/12/2022	Dividendo	R\$ 46.784,07	SINGULARE FII - REIT11
20/12/2022	Amortização	R\$ 350.880,53	SINGULARE FII - REIT11
30/12/2022	Amortização	R\$ 18.055,25	SINGULARE FII - REIT11

30/12/2022	Dividendo	R\$	5.699,00	SINGULARE FII - REIT11
17/04/2023	Amortização	R\$	8.771,85	SINGULARE FII - REIT11
17/04/2023	Dividendo	R\$	2.911,00	SINGULARE FII - REIT11
14/07/2023	Dividendo	R\$	3.813,00	SINGULARE FII - REIT11
16/10/2023	Amortização	R\$	7.790,00	SINGULARE FII - REIT11
16/10/2023	Dividendo	R\$	4.366,50	SINGULARE FII - REIT11
15/01/2024	Amortização	R\$	8.835,50	SINGULARE FII - REIT11
15/01/2024	Dividendo	R\$	5.145,50	SINGULARE FII - REIT11
12/04/2024	Dividendo	R\$	2.829,00	SINGULARE FII - REIT11
12/07/2024	Dividendo	R\$	5.391,50	SINGULARE FII - REIT11
Total	Amortização + Dividendo	R\$	3.742.749,80	

c) Cotação atualizada:

CNPJ	Fundo	Cotação atualizada			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Valor atual
16.841.067/0001-99	SINGULARE FII - REIT11	30/06/2024	2050	285,67218173	585.627,97

d) Resumo de Assembleias e Fatos Relevantes:

No relatório do 1º semestre de 2021, foi apresentado um histórico com as Assembleias e Fatos Relevantes ocorridas nos anos anteriores até o período de referência do relatório.

O relatório anterior foi publicado no site do IpojucaPrev e pode ser acessado a partir do link: <https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/publicacoes-oficiais/investimentos/diligencia-e-verificacao-de-lastro/>

Segue planilha com os resumos das Assembleias convocadas no ano de 2024:

	CNPJ	Nome do Fundo	Assuntos Principais	Resultado Final
29/04/2024	16.841.067/0001-99	SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	A aprovação das demonstrações financeiras do Fundo referentes ao exercício social encerrado em 31 de Junho de 2024.	Aprovado

e) Situação da liquidação do Fundo:

O Fundo tem prazo de duração até 30/11/2028, conforme aprovado na Assembleia Geral de Cotistas ocorrida no dia 03/07/2019, e passou a constar em seu regulamento. Tem cotas negociadas na B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão, porém com baixa liquidez. Mensalmente é enviada uma ordem de venda para que seja efetuada a venda do papel na quantidade em que haja compradores no preço de mercado do ativo.

Esse vencimento do fundo está compatível com o vencimento do CRI que está presente na carteira do ativo, conforme Demonstração Financeira na data de 30/06/2024.

b) Certificados de Recebíveis Imobiliários

Emissores	31/12/2023	31/12/2022
Pro Lotes Participações S.A.	7.025	7.151
Total	7.025	7.151

Corresponde à CRI emitido pela REIT Securitizadora que está atualizado pela variação dos respectivos indexadores e possui vencimento final em 20 de setembro de 2028.

Resumo sobre as características dos CRI's do Fundo:

CRI	Securitizadora	Data de Vencimento	Prazo	Taxa	Lastro
PRO LOTES	REIT Securitizadora de recebíveis imobiliários S.A.	20/09/2028	120 meses	IGPM+10,50%a.a.	(i)

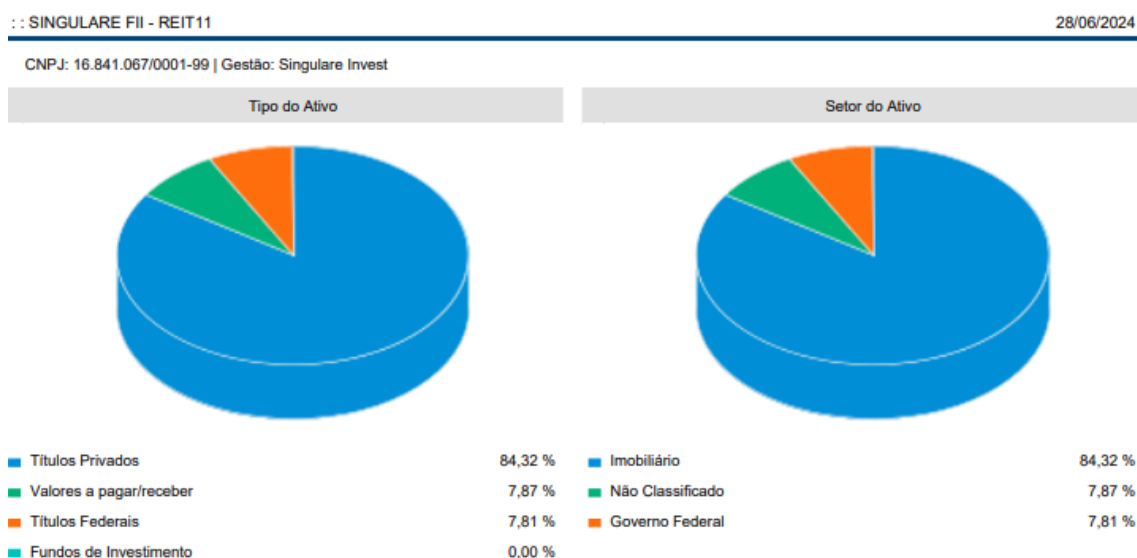
(i) CCLs das 16ª e 17ª séries da 2ª emissão, originadas dos créditos imobiliários provenientes de Contratos de venda dos empreendimentos denominados "Condomínio Holiday Park Land I (Itaboraí/RJ)", "Condomínio Solaris Residencial Clube (Maricá/RJ)", "Riviera Classic Resort Condominium (Aldeia/RJ)" e "Condomínio Holiday Park Land II (Itaboraí/RJ)", empreendimentos desenvolvidos pelas empresas SPE Riviera Francesa Empreendimentos Imobiliários Ltda., SPE Itaboraí 2 Empreendimentos Imobiliários Ltda. e SPE Maricá 1 Empreendimentos Imobiliários e SPE Maricá 1 Empreendimentos Imobiliários Ltda.

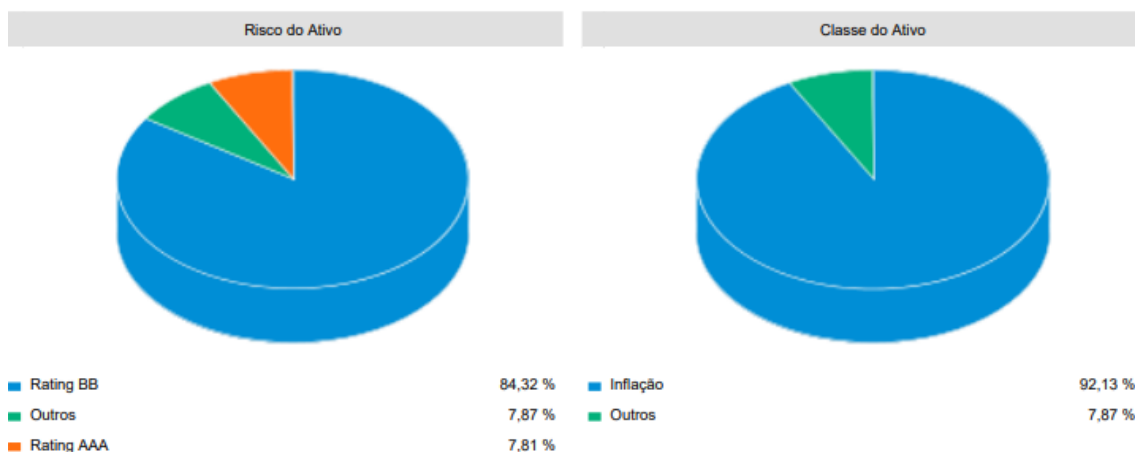
No exercício findo em 31 de dezembro de 2023, o Fundo recebeu a título de amortizações e pagamento de juros no montante de R\$ 1.451 (R\$ 1.651 em 2022), referente aos rendimentos com CRIs (juros e atualizações monetárias apropriados).

Fonte: Demonstração Financeira do fundo na data de 30/06/2024.

A tabela 28 retirada do sistema quantum detalha toda a carteira do fundo na data de 30/06/2024, demonstrando que 84,32% da carteira é formada pelo CRI da REIT Securitizadora de Recebíveis Imobiliários, investimento indexado à inflação e com rating BB. Também traz a carteira detalhada para acompanhamento dos ativos.

Tabela 28





Nome do Ativo	Valor do Ativo (mil)	Participação do Ativo
Certificado de Recebível Imobiliário - REIT SECURITIZADORA S.A. (13349677000181) / 20/09/2028 - Código Cetip: 1810295355	6.977,62565	84,3152 %
NTN	646,40944	7,8110 %
Disponibilidades - Títulos Públicos	646,40944	7,8110 %
Outras Disponibilidades	5,19764	0,0628 %
Cotas FI RENDA FIXA	0,00000	0,0000 %

4.6 VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11

a) Apresentação do Fundo:

O Fundo de Investimento Imobiliário Vector Queluz Lajes Corporativas Fundo de Investimento Imobiliário ("Fundo"), administrado pela Planner Corretora de Valores S.A., foi constituído em 16 de junho de 2011, sob forma de condomínio fechado, com prazo de setenta e nove meses, nos termos da Instrução CVM nº 472 de 13 de janeiro de 2010. Iniciou as atividades em 14 de novembro de 2012 e destina-se exclusivamente a investidores qualificados.

O objetivo do Fundo é a realização de investimentos imobiliários, preferencialmente, por meio da aquisição de empreendimentos imobiliários prontos, inclusive bens e direitos a eles relacionados, predominantemente lajes corporativas e escritórios comerciais de alto padrão, visando gerar ganhos por meio de locação e/ou arrendamento e alienação, e se beneficiar de potencial valorização imobiliária.

b) Histórico de aplicações:

CNPJ	Fundo	Aplicação			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Movimentação
13.842.683/0001-76	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	07/02/2014	2.485,89680145	1.005,67328400	R\$ 2.500.000,00
	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	14/07/2016	1.019,96817360	980,42274840	R\$ 1.000.000,00

VECTOR QUELUZ LAJES					
13.842.683/0001-76	CORPORATIVAS FII - VLJS11	25/04/2017	951,56614120	1.050,10151220	R\$ 1.000.000,00

c) Cotação atualizada:

CNPJ	Fundo	Cotação atualizada			
		Data	QTD de cotas	Valor cota	Valor atual
13.842.683/0001-76	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	28/06/2024	951,56614120	872,19541150	R\$ 829.951,62

d) Resumo de Assembleias e Fatos Relevantes:

No relatório do 1º semestre de 2021, foi apresentado um histórico com as Assembleias e Fatos Relevantes ocorridas nos anos anteriores até o período de referência do relatório.

O relatório anterior foi publicado no site do IpojucaPrev e pode ser acessado a partir do link: <https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/publicacoes-oficiais/investimentos/diligencia-e-verificacao-de-lastro/>

Data da reunião	Fundos		Ordens do Dia	
	CNPJ	Nome do Fundo	Assuntos Principais	Resultado Final
05/05/2022	13.842.683/0001-76	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS	I- aprovação para o Plano de Liquidação, conforme material entregue	Aprovado
06/06/2023	13.842.683/0001-76	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS	Deliberar sobre aprovação das demonstrações Financeiras referentes ao exercício social findo em 31 de dezembro de 2022.	Aprovado

e) Situação da liquidação do Fundo:

O Fundo tem cotas do tipo A e do tipo B, que contam com prazos para amortização diferentes.

Na Assembleia Geral de Cotistas do dia 18/11/2019 foi determinado um prazo para amortização das "cotas tipo A" até 31/12/2020. Devido aos impactos da pandemia do novo coronavírus, em nova Assembleia Geral de Cotistas ocorrida no dia 15/01/2021, foi aprovada a extensão do prazo para o dia 31/03/2021. A amortização dessas cotas foi finalizada no dia 12/11/2021, conforme demonstrativo abaixo:

Data	Valor	Histórico
29/11/2019	1.551.927,82	Amortização "Cota Tipo A"
31/03/2020	946.480,88	Amortização "Cota Tipo A"

30/11/2020	517.309,27	Amortização "Cota Tipo A"
11/03/2021	279.595,45	Amortização "Cota Tipo A"
30/03/2021	137.949,14	Amortização "Cota Tipo A"
05/05/2021	241.410,99	Amortização "Cota Tipo A"
23/07/2021	141.328,54	Amortização "Cota Tipo A"
09/09/2021	206.923,70	Amortização "Cota Tipo A"
01/10/2021	149.444,90	Amortização "Cota Tipo A"
12/11/2021	504.791,79	Amortização "Cota Tipo A"
TOTAL	4.677.162,48	Amortização "Cota Tipo A"

O prazo final para amortização das cotas "Tipo B" era até o dia 30/04/2022, conforme Regulamento. Por conta disso, a Planner Corretora de Valores S.A, na qualidade de administradora do Vector Queluz Lajes Corporativas FII, convocou uma Assembleia Extraordinária de Cotista para aprovar um plano de liquidação das cotas B do fundo, com prazo estimado até agosto de 2023. Visando identificar a melhor decisão, foi solicitado um "parecer de orientação de voto" à LEMA Consultoria.

A AGE também foi pauta da reunião do Comitê de Investimentos e dos Conselhos Deliberativo e Fiscal, contando com a participação de representantes da Queluz, gestora do Fundo, e de representantes da Lema, Consultoria de Investimentos Contratada pelo IpojucaPrev. Nessa reunião, foram discutidos todos os principais pontos do plano de liquidação, visando definir qual seria a orientação de voto para a Assembleia em questão. No final, os membros do Comitê de Investimentos votaram pela aprovação do parecer de orientação de voto da LEMA, que acabou sendo pela aprovação da ordem do dia.

Data	Valor	Histórico
18/05/2022	R\$ 419.776,75	Amortização "Cota Tipo B"
03/06/2022	R\$ 32.341,06	Amortização "Cota Tipo B"
09/09/2022	R\$ 26.930,65	Amortização "Cota Tipo B"
21/11/2022	R\$ 22.826,94	Amortização "Cota Tipo B"
26/04/2023	R\$ 26.691,04	Amortização "Cota Tipo B"
20/03/2024	R\$ 27.376,74	Amortização "Cota Tipo B"
TOTAL	R\$ 136.168,90	Amortização "Cota Tipo B"

Considerando o final do prazo estimado pelo plano de liquidação aprovado em 2022, foi solicitado que o Sr Rafael Cordeiro, representante da Queluz Asset, pudesse comparecer na 4ª Reunião Ordinária, ocorrida, no dia 30 de Abril de 2024, para esclarecer a atual situação do fundo para os membros do Comitê de Investimentos e Conselheiros. A ata da referida reunião tem os principais pontos abordados e as justificativas apresentadas pelo Representante da Queluz.

No dia 30 de Julho de 2024, houve uma Assembleia Geral Extraordinária de Cotistas que aprovou o "Prolongamento do prazo para liquidação do Fundo em 12 meses, contados da

data da assembleia, com redução da Taxa de gestão em 50%", fazendo com que o fundo tenha prazo até o dia 30 de Julho de 2025.

As Demonstrações Financeiras com a data de 31/12/2023 detalham os ativos presentes na carteira de investimentos.

b) Certificados Recebíveis Imobiliários (CRI)

Em 31 de dezembro de 2023 e 2022, o Fundo possui a seguinte composição de Certificados Recebíveis Imobiliários:

Emissor	Código CETIP	Emissão	Vencimento	Indexador	Spread (a.a.)	Quant.	2023	2022
I Habitasec Securizadora S.A (iii)		08/01/2020	20/11/2028	IPCA		4.998	5.738	5.897
I Habitasec Securizadora S.A (iv)		08/01/2020	20/11/2028	IPCA		4.998	5.650	5.806
I Habitasec Securizadora S.A (v)		08/01/2020	20/11/2028	IPCA		4.998	5.261	5.613
I Habitasec Securizadora S.A(vi)		12/11/2021	07/01/2034	IPCA		8.000	7.998	8.441
(-) PDD Certificado de Recebível Imobiliário						-	(231)	(231)
						22.994	24.416	25.526

(iii) CRI Habitasec Securizadora S.A.: 125 série/1ª Emissão da Habitasec Securizadora S.A. Os CRI's possuem carência até 20 de novembro de 2028 e são lastreados por Créditos Imobiliários representados por Cédulas de Crédito Imobiliário da FS Participações S.A. SPE São José dos Campos S.A. As garantias da operação são: (i) alienação fiduciária de 100% das ações de emissão da devedora, (ii) cessão fiduciária de 55% dos recebíveis decorrentes das vendas dos lotes do empreendimento imobiliário, (iii) cessão fiduciária de conta centralizadora que receberá os recursos correspondentes aos 55% dos recebíveis decorrentes das vendas dos lotes do empreendimento imobiliário e (iv) regime fiduciário com consequente instituição do patrimônio separado, nos termos da Lei nº 9.514 de 20 de novembro de 1997. Esse CRI não teve avaliação realizada por empresa de rating;

(iv) CRI Habitasec Securizadora S.A.: 126 série/1ª Emissão da Habitasec Securizadora S.A. Os CRI's possuem carência até 20 de novembro de 2028 e são lastreados por Créditos Imobiliários representados por Debêntures conversíveis em ações da Castanheira Loteamento SPE. As garantias da operação são: (i) alienação fiduciária de 100% das ações de emissão da devedora, (ii) cessão fiduciária de 55%

dos recebíveis decorrentes das vendas dos lotes do empreendimento imobiliário, (iii) cessão fiduciária de conta centralizadora que receberá os recursos correspondentes aos 55% dos recebíveis decorrentes das vendas dos lotes do empreendimento imobiliário e (iv) regime fiduciário com consequente instituição do patrimônio separado, nos termos da Lei nº 9.514 de 20 de novembro de 1997. Esse CRI não teve avaliação realizada por empresa de rating.

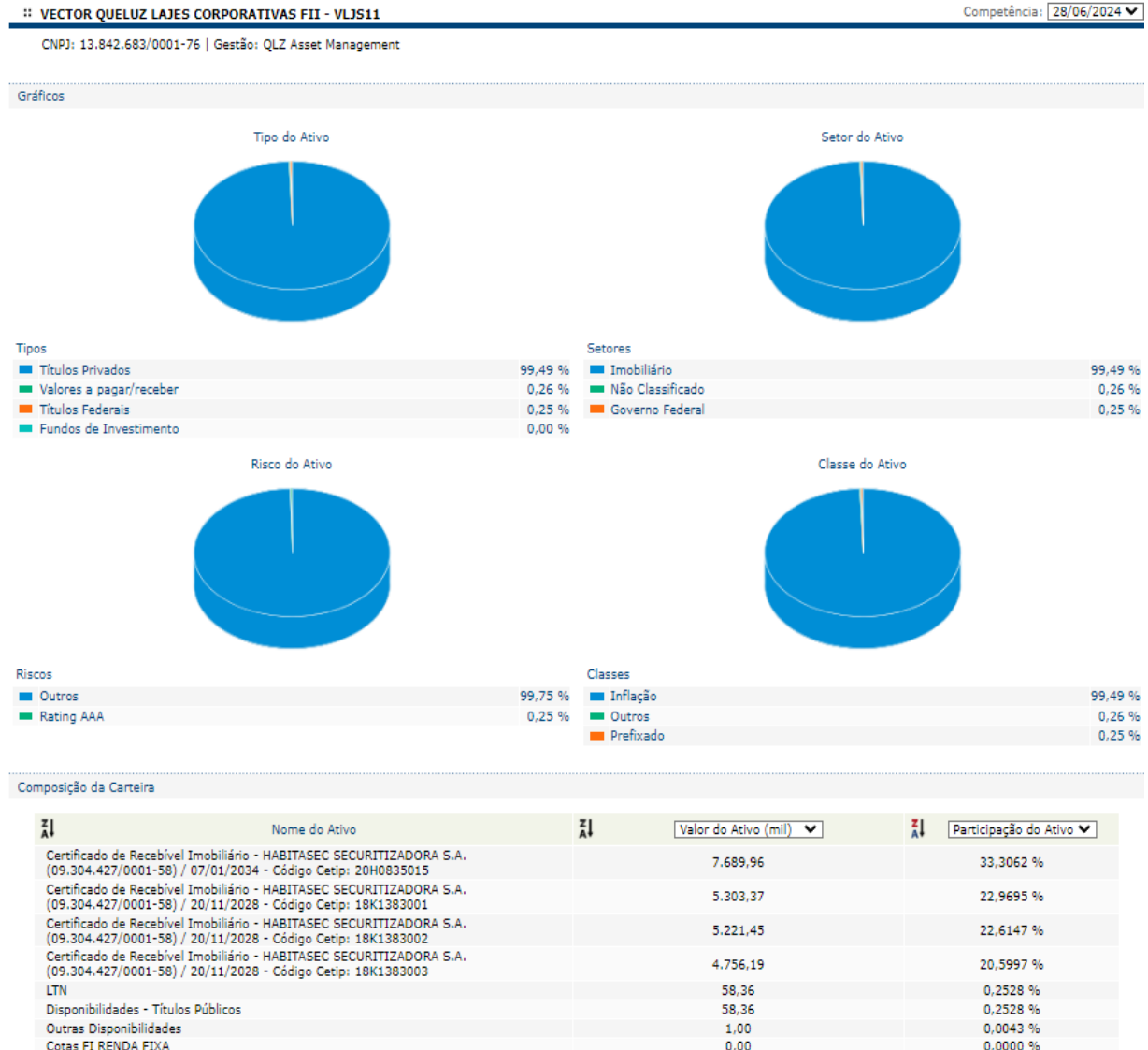
(v) CRI Habitasec Securizadora S.A.: 127 série/1ª Emissão da Habitasec Securizadora S.A. Os CRI's possuem carência até 20 de novembro de 2028 e são lastreados por Créditos Imobiliários representados por Cédulas de Crédito Imobiliário da FS Participações S.A. SPE São José dos Campos S.A. As garantias da operação são: (i) alienação fiduciária de 100% das ações de emissão da devedora, (ii) cessão fiduciária de 55% dos recebíveis decorrentes das vendas dos lotes do empreendimento imobiliário, (iii) cessão fiduciária de conta centralizadora que receberá os recursos correspondentes aos 55% dos recebíveis decorrentes das vendas dos lotes do empreendimento imobiliário e (iv) regime fiduciário com consequente instituição do patrimônio separado, nos termos da Lei nº 9.514 de 20 de novembro de 1997. Esse CRI não teve avaliação realizada por empresa de rating.

(vi) CRI Habitasec Securizadora S.A.: 199 série/1ª Emissão da Habitasec Securizadora S.A. Os CRIS's possuem data de emissão dos CRIS's 25 de agosto de 2020, data de vencimento final dos CRI's 07 de janeiro de 2034. Devedora Nabileque Incorporadora Ltda. Escritura de emissão: o Instrumento Particular de Emissão de Cédulas de Crédito Imobiliário Integrais, sem Garantia Real Imobiliária, sob a Forma Escritural, celebrado, nesta data, pela Emissora e nomeando a Instituição Custodiante. Escriturador: Itaú corretora de valores S.A. A Emissora declara que foram vinculados, pelo presente Termo de Securitização, os Créditos Imobiliários representados pelas CCI, decorrentes dos Contratos de Compra e Venda, com valor nominal total de R\$ 8.000.000,00 (oito milhões de reais), na Data de Emissão dos CRI, cuja titularidade foi obtida pela Emissora por meio da celebração do Contrato de Dação em Pagamento. Segundo aditamento ao termo de securitização: A Emissora poderá, a partir de 04 de março de 2021 (inclusive), realizar mensalmente amortização extraordinária (parcial) dos CRI, até sua total liquidação, com os recursos excedentes verificados na Conta do Patrimônio Separado, se houver, após o pagamento das despesas, remuneração do CRI, dentre outras incorridas pelo Patrimônio Separado.

Fonte: Demonstração Financeira do fundo na data de 30/06/2024

A tabela 29 retirada do sistema quantum detalha toda a carteira do fundo na data de 28/06/2024, demonstrando que 99,49% da carteira é formada pelos CRI's, acima detalhados, da Habitasec Securitizadora S.A, investimento indexado à inflação e sem avaliação de rating realizada. Também traz a carteira detalhada para acompanhamento dos ativos.

Tabela 29



5. Considerações Finais

Este Relatório de Diligência teve como objetivo principal detalhar a carteira de ativos dos fundos de investimentos na data-base do final do 1º semestre de 2024. Foram explanadas as análises internas que são executadas pela Diretoria de Investimentos com o viés de analisar minuciosamente os papéis incluídos nas carteiras de ativos dos fundos de investimentos que recebem aplicações do FUNPREI. Além de detalhar as diligências em relação aos prestadores de serviços essenciais credenciados, como administradores, gestores, custodiantes e emissores de Letras Financeiras. Em relação aos investimentos estruturados, foram analisados a situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das empresas investidas e dos ativos, dando ênfase importante na análise de risco de crédito dos ativos que compõem as carteiras dos fundos de investimentos.

Em relação aos fundos estressados presentes em carteira, foram feitas análises detalhadas em relação às aplicações realizadas em anos anteriores, amortizações realizadas, atualizações sobre as Assembleias e fatos relevantes e um resumo geral sobre a situação atual do plano de liquidação dos ativos, conforme acompanhamento que é feito em conjunto com o Comitê de Investimentos e Conselhos Deliberativo e Fiscal.

Desta forma, a Diretoria de Investimentos do IpojucaPrev, neste relatório, visou avançar com seu amplo processo de efetivação de boas práticas institucionais priorizando sempre a transparência, eficiência e eficácia das ações realizadas para aprimorar a Gestão dos Recursos.



(081) 3551-0981 | 3551-2523



@ipojucaprev



www.ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br



ouvidoria@ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br



Acesse pelo Site do IpojucaPREV ou Aplicativo

ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br

FONES: (81) 3551-2523 | 3551-2984

Relatório Semestral de Diligência – 2024.1

ANEXO 01

Composição da Carteira dos Fundos

Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b" - FI Renda Fixa
Referenciado 100% títulos TN

Resolução CMN 4.963/2021

Nome	Data da Competência	Nome do Ativo	Participação do Ativo	Risco do Ativo	Classe do Ativo
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	12,03%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	11,70%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	10,16%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	9,96%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	8,22%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	7,55%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	6,68%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	6,29%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	6,15%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	5,44%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	3,86%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	3,25%	Rating AAA	Selic
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	2,79%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	2,57%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	2,45%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2029 (BRSTNCNTB716)	0,91%	Rating AAA	Inflação
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	0,00%	Risco de mercado	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Selic	0,00%	Outros	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Auditoria	0,00%	Outros	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Outros Valores a pagar	0,00%	Outros	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK29	0,00%	Risco de mercado	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	0,00%	Risco de mercado	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	0,00%	Risco de mercado	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00%	Outros	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00%	Outros	Sem indexador
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00%	Outros	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ26	0,00%	Risco de mercado	Outros
BB IMA-B TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK27	-0,01%	Risco de mercado	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2055	35,26%	Rating AAA	Inflação
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/07/2024 (BRSTNCLTN7W3)	20,77%	Rating AAA	Prefixado
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCLTN7N2)	16,78%	Rating AAA	Prefixado
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/04/2025 (BRSTNCLTN830)	9,66%	Rating AAA	Prefixado
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/10/2024 (BRSTNCLTN822)	7,14%	Rating AAA	Prefixado
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	2,17%	Rating AAA	Selic
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1,84%	Rating AAA	Selic
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	1,83%	Rating AAA	Selic
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	1,65%	Rating AAA	Selic
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	1,65%	Rating AAA	Selic
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	1,28%	Rating AAA	Prefixado
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,01%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	0,00%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Selic	0,00%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN24	0,00%	Risco de mercado	CDI
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Auditoria	0,00%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Outros Valores a pagar	0,00%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00%	Outros	CDI
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / SALDO A REG LARIZAR	0,00%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV24	0,00%	Risco de mercado	CDI
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00%	Outros	Sem indexador
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00%	Outros	Outros
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	-0,01%	Risco de mercado	CDI
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ25	-0,02%	Risco de mercado	CDI
BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	99,88%	Rating AAA	Inflação
BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	0,07%	Rating AAA	Selic
BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,05%	Outros	Outros
BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,01%	Outros	Outros

BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Selic	0,00%	Outros	Outros
BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00%	Outros	Outros
BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00%	Outros	Sem indexador
BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Auditoria	0,00%	Outros	Outros
BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00%	Outros	Outros
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	12,84%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	11,45%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	9,67%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	9,40%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	9,14%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	8,88%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	6,08%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	5,90%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	5,67%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	5,31%	Rating AAA	Selic
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	5,04%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	4,32%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	3,36%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	2,13%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	0,70%	Rating AAA	Inflação
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	0,15%	Rating AAA	Selic
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,01%	Outros	Outros
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,06%	Outros	Outros
BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	99,71%	Rating AAA	Inflação
BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/06/2030	0,22%	Rating AAA	Selic
BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,08%	Outros	Outros
BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,01%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	99,76%	Rating AAA	Inflação
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2025	0,25%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,01%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	99,76%	Rating AAA	Inflação
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2030	0,25%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,01%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2030 III TP FI RF	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	99,73%	Rating AAA	Inflação
CAIXA BRASIL 2030 III TP FI RF	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2027	0,27%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL 2030 III TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,01%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2030 III TP FI RF	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL 2030 III TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,01%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2029	81,14%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	12,27%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	2,86%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCLTN7N2)	1,88%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/04/2025 (BRSTNCLTN830)	1,67%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/10/2024 (BRSTNCLTN822)	0,21%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,06%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV24	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	-0,01%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ25	-0,03%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,05%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	24,01%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	12,63%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/07/2026 (BRSTNCLTN848)	10,80%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/01/2026 (BRSTNCLTN7U7)	9,03%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	NTN-F - Venc.: 01/01/2027 (BRSTNCNTF1P8)	6,98%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	NTN-F - Venc.: 01/01/2029 (BRSTNCNTF1Q6)	6,81%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/07/2025 (BRSTNCLTN7Z6)	6,60%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/10/2025 (BRSTNCLTN863)	4,83%	Rating AAA	Prefixado

CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	NTN-F - Venc.: 01/01/2031 (BRSTNCNTF204)	3,66%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	3,31%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/07/2027 (BRSTNCLTN871)	2,73%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/04/2026 (BRSTNCLTN8B5)	2,52%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	NTN-F - Venc.: 01/01/2033 (BRSTNCNTF212)	1,95%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/01/2028 (BRSTNCLTN897)	1,69%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/01/2030 (BRSTNCLTN8A7)	1,33%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	NTN-F - Venc.: 01/01/2035 (BRSTNCNTF238)	0,95%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2029 (BRSTNCLF1RM3)	0,22%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCLTN7N2)	0,08%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,01%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN24	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF31	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF35	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN25	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV24	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV25	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF27	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN26	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF30	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ26	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF26	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF28	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF29	0,00%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	-0,01%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ25	-0,01%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF33	-0,01%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN27	-0,01%	Risco de mercado	CDI
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,07%	Outros	Outros
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	24,99%	Rating AAA	Inflação
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	24,30%	Rating AAA	Inflação
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	20,02%	Rating AAA	Inflação
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	16,11%	Rating AAA	Inflação
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	10,67%	Rating AAA	Inflação
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	1,98%	Rating AAA	Inflação
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/05/2029 (BRSTNCNTB716)	1,86%	Rating AAA	Inflação
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,05%	Outros	Outros
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições vendidas (omitidas)	0,01%	Risco de mercado	Outros
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,01%	Outros	Outros
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros

Relatório Semestral de Diligência – 2024.1

ANEXO 02

Composição da Carteira dos Fundos

Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a" - FI Renda Fixa

Resolução CMN 4.963/2021

Nome	Data da Competência	Nome do Ativo	Participação do Ativo	Risco do Ativo	Classe do Ativo
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2029	21,83%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	9,48%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	7,30%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	7,19%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	7,04%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	6,48%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	5,99%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	3,04%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	2,75%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	2,50%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 12/08/2025 - Indexador: CDI BRBBDCLFC4Y6	2,40%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 27/08/2024 - Indexador: CDI BRBBDCLTRS8	1,87%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 21/10/2025 - Indexador: CDI BRBBDCLFC654	1,09%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-91) - Venc.: 09/02/2026 - Indexador: CDI	1,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 16/11/2026 - Indexador: CDI	1,01%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-91) - Venc.: 07/03/2025 - Indexador: CDI BRBBASLFIBV2	0,99%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2024	0,83%	Rating AAA	Inflação
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - ITAU UNIBANCO S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc.: 01/02/2027 - Indexador: CDI BRBITALFN391	0,80%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (90.400.888/0001-42) - Venc.: 21/03/2025 - Indexador: CDI BRSANBLFN138	0,76%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - Venc.: 24/02/2025 - Indexador: CDI BRBEVELFNFI0	0,70%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - CAIXA ECONOMICA FEDERAL (00.360.305/0001-04) - Venc.: 08/11/2024 - Indexador: CDI BRBCEFLFIZH7	0,53%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Depósitos a prazo e outros títulos de IF / Tipo de Ativo: Letra Financeira / CNPJ do emissor: 53.505.601/0001-12 / Denominação Social do emissor: STONE SOCIEDADE DE CRÉDITO, FIN E INVEST / Venc.: 29/06/2026	0,49%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - SUZBB1	0,47%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - PALFA4	0,47%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2029 (BRSTNCLF1RM3)	0,47%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CIEL16	0,46%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001-45) - Venc.: 05/03/2027 - Indexador: CDI BRBPACLFNRM1	0,45%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-91) - Venc.: 08/02/2074 - Indexador: CDI	0,42%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	0,42%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - HYPEA8	0,41%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - BSA312	0,35%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO PAN S.A. (59.285.411/0001-13) - Venc.: 05/03/2027 - Indexador: CDI BRBPANLFICX7	0,35%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - PASS13	0,34%	Rating AAA	CDI

BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 03/11/2025 - Indexador: CDI	0,31%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - NTSD17	0,30%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	0,30%	Rating AAA	Selic
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-91) - Venc.: 28/03/2025 - Indexador: CDI	0,29%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 05/04/2027 - Indexador: CDI	0,29%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CGOS15	0,26%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - BSA318	0,25%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc.: 02/02/2026 - Indexador: CDI	0,24%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Venc.: 03/06/2025 - Indexador: CDI	0,24%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - EBENA7	0,23%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 10/05/2027 - Indexador: CDI	0,22%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CELG12	0,21%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - NTSD15	0,21%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CGASA0	0,21%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - MNLT11	0,20%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 28/08/2026 - Indexador: CDI BRBBDCLFC555	0,20%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 28/08/2025 - Indexador: CDI BRBBDCLFC530	0,20%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - GGBRA7	0,19%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CSANA0	0,19%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - NTSD16	0,17%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - TRPLA5	0,17%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - IOCHA3	0,17%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - ASIAI0	0,17%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOLKSWAGEN S.A. (59.109.165/0001-49) - Venc.: 14/06/2027 - Indexador: CDI BRBVKWLFIB82	0,17%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debêntures - MULTI PCH SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FINANCEIROS S.A. (38.042.694/0001-00) - Venc.: 07/10/2030	0,16%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - EKTRA3	0,15%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CPLD19	0,15%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO CITIBANK S.A. (33.479.023/0001-80) - Venc.: 23/08/2024 - Indexador: CDI	0,13%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - FLRY19	0,13%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CPFPA6	0,13%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 17/09/2027 - Indexador: CDI	0,12%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CPGT17	0,12%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - SUZB18	0,12%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CEEBA8	0,12%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - VBBR16	0,12%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debêntures - UNIÃO QUÍMICA FARMACÊUTICA NACIONAL S.A. (60.665.981/0001-18) - Venc.: 13/06/2031	0,11%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	DPGE - BANCO C6 S.A. (31.872.495/0001-72) - Venc.: 22/08/2024	0,11%	Rating A	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - ANHBA2	0,11%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - LORTA5	0,10%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - VTBE21	0,10%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - FENS12	0,10%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CRFB33	0,10%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - RDORB9	0,10%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - ANHB10	0,08%	Rating AAA	CDI

BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública / NCCPGT CDI+% - 10/09/2025 / CNPJ do emissor: 04.370.282/0001-70 / Denominação Social do emissor: COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	0,08%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - ONCOA1	0,08%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - NU FINANCEIRA S.A. - SOCIEDADE DE CREDITO FINANCIAMENTO E INVESTIMENTO (30.680.829/0001-43) - Venc.: 06/07/2027 - Indexador: CDI BRNUFNLF3T0	0,08%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - LORTA8	0,07%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - IGTA1	0,07%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - TIET19	0,07%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - ENEVC0	0,07%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	CDB/ RDB - DRESNER BANK BRASIL S.A. BANCO MULTIPLO (29.030.467/0001-66) - Venc.: 29/05/2025 - Indexador: CDI	0,07%	Outros	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - FLRY29	0,06%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - TAE16	0,06%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - ESCEA1	0,06%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - SBSPE8	0,06%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - TBSP11	0,05%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 20/05/2025 - Indexador: CDI BRBBDCLTRYF7	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - PETR36	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCOSEGURO S.A. (10.264.663/0001-77) - Venc.: 10/05/2026 - Indexador: CDI BRCCDBLFI097	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CPLD17	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Venc.: 07/10/2024 - Indexador: CDI	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 17/01/2025 - Indexador: CDI BRBBDCLTRL3	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CELP16	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - EKTRA0	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - MULP17	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - TAE1	0,04%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - IGTA0	0,03%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - RIGEA4	0,03%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - HAPV11	0,03%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CCROA4	0,03%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	DPGE - BANCO BMG S.A. (61.186.680/0001-74) - Venc.: 26/02/2027	0,02%	Rating A	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CCROA6	0,02%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - CSRNA2	0,02%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - IGTA37	0,02%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - DASAA1	0,01%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - DASAA5	0,01%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Selic	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00%	Outros	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / Auditoria	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / IOF_a_recolher	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / IR_a_recolher	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 24/06/2024 - Indexador: CDI	0,00%	Rating AAA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Debênture Simples - OIBRA2	0,00%	Rating D	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - Venc.: 03/06/2024 - Indexador: CDI BRBEVELFN0Y4	0,00%	Rating AA	CDI
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	0,00%	Outros	Outros
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI PREV LP	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00%	Outros	Outros

BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	12,76%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	12,39%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	11,55%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	6,23%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	5,41%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	4,07%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	4,04%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 01/08/2025 - Indexador: CDI	4,02%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001-45) - Venc.: 04/08/2025 - Indexador: CDI BRBPACLFNMS9	3,61%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	3,58%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	3,54%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001-45) - Venc.: 18/12/2025 - Indexador: CDI BRBPACLFNPT0	2,49%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO PAN S.A. (59.285.411/0001-13) - Venc.: 15/05/2025 - Indexador: CDI	2,33%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 23/12/2025 - Indexador: CDI	2,31%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	2,28%	Rating AAA	Selic
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 29/09/2026 - Indexador: CDI BRBBDCLTRT33	1,88%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001-45) - Venc.: 07/11/2025 - Indexador: CDI BRBPACLFNOO4	1,66%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 31/01/2025 - Indexador: CDI	1,41%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 28/02/2025 - Indexador: CDI	1,31%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	1,23%	Rating AAA	Inflação
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 02/03/2026 - Indexador: CDI	1,19%	Rating AA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 14/01/2025 - Indexador: CDI	1,15%	Rating AA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/0001-23) - Venc.: 19/11/2024 - Indexador: CDI	1,13%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 06/01/2025 - Indexador: CDI	1,11%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001-45) - Venc.: 27/04/2026 - Indexador: CDI	1,07%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO PAN S.A. (59.285.411/0001-13) - Venc.: 30/01/2026 - Indexador: CDI BRBPANLFICC1	1,00%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO PAN S.A. (59.285.411/0001-13) - Venc.: 30/01/2026 - Indexador: CDI BRBPANLFICD9	1,00%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 18/07/2024 - Indexador: CDI	0,94%	Rating AA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 04/10/2024 - Indexador: CDI	0,93%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 15/06/2026 - Indexador: CDI BRDAYCLTF2H0	0,78%	Rating AA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 16/06/2025 - Indexador: CDI	0,78%	Rating AA	CDI

BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO DESENVOLVIMENTO MINAS GERAIS S.A. BDMG (38.486.817/0001-94) - Venc.: 16/05/2025 - Indexador: CDI	0,75%	Rating A	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	0,11%	Rating AAA	Inflação
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO PAN S.A. (59.285.411/0001-13) - Venc.: 17/06/2025 - Indexador: CDI	0,09%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/0001-23) - Venc.: 08/11/2024 - Indexador: CDI	0,04%	Rating AAA	CDI
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,02%	Outros	Outros
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,18%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	33,71%	Rating AAA	Prefixado
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Depósitos a prazo e outros títulos de IF (omitidos)	28,46%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Debêntures (omitidas)	10,75%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2025	10,62%	Rating AAA	Prefixado
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2024	6,45%	Rating AAA	Inflação
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	3,41%	Rating AAA	Selic
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Direitos Creditórios	2,22%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	1,75%	Rating AAA	Selic
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	0,83%	Rating AAA	Selic
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	0,72%	Rating AAA	Selic
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Títulos de Crédito Privado (omitidos)	0,67%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	0,28%	Rating AAA	Selic
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Títulos Públicos Federais	0,06%	Rating AAA	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	0,03%	Rating AAA	Selic
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,02%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,00%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Diferencial de SWAP a Receber	0,00%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Operações Compromissadas	0,00%	Outros	Prefixado
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Mercado a Termo - Posições Vendidas	0,00%	Risco de mercado	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Notas Promissórias Comerciais	0,00%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Outros Valores Mobiliários	0,00%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Cotas de Fundos / Demais Fundos de Investimento em FIDC	0,00%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Certificado de Recebível Imobiliário	0,00%	Outros	Outros
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Letras Financeiras	0,00%	Outros	CDI
BRABESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	28/06/2024	Diferencial de SWAP a Pagar	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2029	84,18%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 06/09/2024 - Indexador: CDI	3,56%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 06/06/2025 - Indexador: CDI	3,11%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 20/06/2025 - Indexador: CDI	2,84%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 18/06/2025 - Indexador: CDI	2,73%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 26/06/2025 - Indexador: CDI	2,51%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 05/06/2025 - Indexador: CDI	1,10%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 02/06/2025 - Indexador: CDI	0,00%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 05/06/2024 - Indexador: CDI	0,00%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 09/05/2025 - Indexador: CDI	0,00%	Rating AAA	CDI

CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 27/05/2025 - Indexador: CDI	0,00%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 21/05/2025 - Indexador: CDI	0,00%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 15/05/2025 - Indexador: CDI	0,00%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 13/06/2024 - Indexador: CDI	0,00%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF SIMPLES	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,02%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2027	37,93%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	9,17%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	5,76%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	3,45%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 23/10/2024 - Indexador: CDI	2,61%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	2,17%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 01/02/2027 - Indexador: CDI BRBBDCLFC787	2,06%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc.: 01/09/2025 - Indexador: CDI	1,61%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	1,47%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 17/02/2025 - Indexador: CDI	1,26%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Venc.: 01/04/2026 - Indexador: CDI	1,25%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (90.400.888/0001-42) - Venc.: 31/03/2025 - Indexador: CDI BRSANBLFN1A0	1,21%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - ITAU UNIBANCO S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc.: 01/09/2025 - Indexador: CDI BRBITALFN1G3	1,19%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888/0001-42) - Venc.: 29/07/2024 - Indexador: CDI	0,85%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 23/12/2024 - Indexador: CDI	0,73%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 27/12/2024 - Indexador: CDI BRBBDCLFC290	0,73%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debêntures - PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS (33.000.167/0001- 01) - Venc.: 25/02/2030	0,70%	Rating AA	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc.: 02/02/2026 - Indexador: CDI	0,70%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 23/12/2025 - Indexador: CDI BRBBDCLFC373	0,69%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 26/05/2025 - Indexador: CDI	0,68%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - RENTC8	0,65%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	0,62%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc.: 20/04/2026 - Indexador: CDI BRBSAFLNNCE1	0,61%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	0,59%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	0,53%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	0,52%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - TBSP11	0,47%	Rating AAA	CDI

CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOLKSWAGEN S.A. (59.109.165/0001-49) - Venc.: 10/03/2025 - Indexador: CDI BRBVKWLF19X4	0,44%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO CITIBANK S.A. (33.479.023/0001-80) - Venc.: 27/09/2024 - Indexador: CDI BRCITILFI3W4	0,43%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 01/08/2025 - Indexador: CDI	0,39%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - YDUQA0	0,39%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - ITAU UNIBANCO S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc.: 15/10/2024 - Indexador: CDI BRBITALFN2X6	0,37%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO RCI BRASIL S.A. (62.307.848/0001-15) - Venc.: 04/11/2024 - Indexador: CDI BRCAMRLF1288	0,37%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A. (01.181.521/0001-55) - Venc.: 23/03/2026 - Indexador: CDI BRSCDILFI7J8	0,36%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - VBBR15	0,35%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO ALFA S.A. (60.770.336/0001-65) - Venc.: 22/04/2025 - Indexador: CDI	0,35%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc.: 09/02/2026 - Indexador: CDI BRBSAFLNNC66	0,35%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO CITIBANK S.A. (33.479.023/0001-80) - Venc.: 23/08/2024 - Indexador: CDI	0,35%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CIEL16	0,35%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CCROA6	0,34%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - Venc.: 15/01/2026 - Indexador: CDI BRBEVELFNJZ6	0,32%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - ANHBA4	0,32%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - Venc.: 30/01/2026 - Indexador: CDI BRBEVELFNLC1	0,32%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO VOLKSWAGEN S.A. (59.109.165/0001-49) - Venc.: 17/01/2025 - Indexador: CDI	0,32%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CSRNA0	0,32%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 22/08/2024 - Indexador: CDI BRABCLFIEX6	0,31%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 13/05/2026 - Indexador: CDI BRDAYCLTF1L4	0,31%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc.: 18/05/2026 - Indexador: CDI BRBSAFLNNCY9	0,31%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - ASAI14	0,29%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - TLPP27	0,29%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO CITIBANK S.A. (33.479.023/0001-80) - Venc.: 02/04/2026 - Indexador: CDI BRCITILFI3Y0	0,29%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 02/06/2025 - Indexador: CDI	0,28%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO CNH INDUSTRIAL CAPITAL S.A. (02.992.446/0001-75) - Venc.: 09/05/2026 - Indexador: CDI BRCNHCLFI3J4	0,27%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - NTSD25	0,25%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 09/04/2026 - Indexador: CDI BRDAYCLTF1C3	0,25%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO CITIBANK S.A. (33.479.023/0001-80) - Venc.: 13/01/2025 - Indexador: CDI BRCITILFI3X2	0,25%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - FLRY29	0,24%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CPGT17	0,24%	Rating AAA	CDI

CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - ITAU UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/0001-23) - Venc.: 19/11/2029 - Indexador: CDI BRITUBLFI175	0,24%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 25/07/2025 - Indexador: CDI BRBBDCLFC035	0,23%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO MERCEDES BENZ BRASIL S.A. (60.814.191/0001-57) - Venc.: 02/08/2024 - Indexador: CDI	0,23%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO TOYOTA DO BRASIL S.A. (03.215.790/0001-10) - Venc.: 01/09/2024 - Indexador: CDI BRBTOYLF2J6	0,23%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - HAPV12	0,23%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLFI1R11)	0,23%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO XP S.A. (33.264.668/0001-03) - Venc.: 17/06/2026 - Indexador: CDI	0,22%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CSNAA2	0,20%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - BSA318	0,20%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - ALGAA2	0,19%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Venc.: 31/12/2060 - Indexador: Selic	0,19%	Rating AAA	Selic
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - CHEVROLET SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. (59.274.605/0001-13) - Venc.: 16/06/2026 - Indexador: CDI	0,19%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 23/03/2026 - Indexador: CDI	0,19%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - SUZBA1	0,18%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO RABOBANK INTERNATIONAL BRASIL S.A. (01.023.570/0001-60) - Venc.: 16/03/2026 - Indexador: CDI BRBBKLF11B8	0,18%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 18/03/2026 - Indexador: CDI	0,18%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CSAN13	0,17%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO CNH INDUSTRIAL CAPITAL S.A. (02.992.446/0001-75) - Venc.: 08/10/2024 - Indexador: CDI BRCNHCLFI382	0,17%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - PALFA2	0,17%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - DASAA5	0,17%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - EKTRA3	0,17%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001-45) - Venc.: 01/07/2024 - Indexador: CDI BRBPACLFNCN1	0,16%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - CHEVROLET SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. (59.274.605/0001-13) - Venc.: 08/07/2024 - Indexador: CDI	0,16%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - HAPV13	0,15%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 26/08/2024 - Indexador: CDI BRBBDCLFC0W8	0,15%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 11/10/2024 - Indexador: CDI BRBBDCLFC175	0,15%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - RADL19	0,15%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - TUPY14	0,15%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - PETR36	0,15%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001-45) - Venc.: 06/01/2025 - Indexador: CDI	0,15%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debêntures - COPEL - COMPANHIA PARANAENSE ENERGIA (76.483.817/0001-20) - Venc.: 15/05/2027	0,14%	Rating AAA	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debêntures - LOCALIZA RENT A CAR S.A. (16.670.085/0001-55) - Venc.: 05/12/2024	0,14%	Rating AAA	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CSAN14	0,14%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 06/04/2026 - Indexador: CDI	0,13%	Rating AA	CDI

CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - NTSD16	0,13%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - SBSPB1	0,13%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 11/05/2026 - Indexador: CDI	0,12%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debêntures - COPEL GERAÇÃO E TRANSMISSÃO S.A. (04.370.282/0001-70) - Venc.: 10/09/2025	0,12%	Rating AAA	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - SBSPD8	0,11%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - CHEVROLET SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. (59.274.605/0001-13) - Venc.: 05/03/2025 - Indexador: CDI	0,11%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - MOVI17	0,10%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOLKSWAGEN S.A. (59.109.165/0001-49) - Venc.: 09/07/2024 - Indexador: CDI	0,10%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - VAMO13	0,10%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - EBENA7	0,10%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - CHEVROLET SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. (59.274.605/0001-13) - Venc.: 07/10/2024 - Indexador: CDI	0,09%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - TFLEB0	0,09%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CEPEA3	0,09%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CCROA4	0,09%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - CHEVROLET SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. (59.274.605/0001-13) - Venc.: 27/06/2025 - Indexador: CDI	0,09%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - CHEVROLET SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. (59.274.605/0001-13) - Venc.: 26/06/2025 - Indexador: CDI	0,09%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - NTSD15	0,09%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 05/03/2025 - Indexador: CDI	0,08%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 17/02/2025 - Indexador: CDI	0,08%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - Venc.: 20/05/2026 - Indexador: CDI BRBEVELFNOG6	0,08%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	DPGE - BANCO MERCANTIL BRASIL S.A. (17.184.037/0001-10) - Venc.: 12/09/2024	0,08%	Rating A	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc.: 14/10/2024 - Indexador: CDI	0,08%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc.: 01/07/2024 - Indexador: CDI	0,08%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - LORTA9	0,08%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 21/10/2024 - Indexador: CDI BRBBDCLFC1H7	0,07%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	DPGE - BANCO MERCANTIL BRASIL S.A. (17.184.037/0001-10) - Venc.: 05/12/2024	0,07%	Rating A	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - LRENB1	0,07%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	DPGE - BANCO AGIBANK S.A. (10.664.513/0001-50) - Venc.: 02/09/2025	0,07%	Rating A	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO MERCEDES BENZ BRASIL S.A. (60.814.191/0001-57) - Venc.: 17/04/2025 - Indexador: CDI	0,07%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	DPGE - BANCO MERCANTIL BRASIL S.A. (17.184.037/0001-10) - Venc.: 12/05/2025	0,07%	Rating A	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	CDB/ RDB - BANCO MERCEDES BENZ BRASIL S.A. (60.814.191/0001-57) - Venc.: 06/06/2025 - Indexador: CDI	0,07%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO CNH INDUSTRIAL CAPITAL S.A. (02.992.446/0001-75) - Venc.: 20/05/2025 - Indexador: CDI BRCNHCLFI3E5	0,07%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Venc.: 21/10/2024 - Indexador: CDI	0,07%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - PALFA1	0,06%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - ENGIA7	0,06%	Rating AAA	CDI

CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - USIM18	0,06%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CRFB26	0,05%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - SBSPB7	0,05%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - SBSPE8	0,05%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO JOHN DEERE S.A. (91.884.981/0001-32) - Venc.: 24/04/2025 - Indexador: CDI	0,05%	Outros	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - Venc.: 19/02/2026 - Indexador: CDI	0,04%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	DPGE - BANCO FIBRA S.A. (58.616.418/0001-08) - Venc.: 06/01/2025	0,04%	Rating BBB	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - RLOG11	0,04%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOLKSWAGEN S.A. (59.109.165/0001-49) - Venc.: 25/06/2026 - Indexador: CDI BRBVKWLFIBA5	0,04%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BOCOM BBM S.A. (15.114.366/0001-69) - Venc.: 24/10/2024 - Indexador: CDI BRBBHILFIEQ2	0,04%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - BRMLA0	0,03%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - MRS1A	0,03%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO VOLKSWAGEN S.A. (59.109.165/0001-49) - Venc.: 15/06/2026 - Indexador: CDI BRBVKWLFIB74	0,03%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO PACCAR S.A. (28.517.628/0001-88) - Venc.: 17/05/2026 - Indexador: CDI BRBPASLFI000	0,02%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CELP16	0,02%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,02%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - ANHBA2	0,01%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - SBSPG0	0,01%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Venc.: 16/12/2024 - Indexador: CDI BRBBDCLFC258	0,01%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - SBSPH0	0,01%	Rating AAA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Debênture Simples - CSMGA5	0,01%	Rating AA	CDI
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%	Outros	Outros
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,01%	Outros	Outros
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/07/2025 (BRSTNCLTN7Z6)	90,08%	Rating AAA	Prefixado
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER (omitidos)	9,66%	Outros	Outros
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	1,18%	Rating AAA	Selic
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	0,31%	Rating AAA	Selic
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2032	0,21%	Rating AAA	Inflação
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	0,18%	Rating AAA	Selic
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,08%	Outros	Outros
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,01%	Outros	Outros
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	28/06/2024	DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR (omitidos)	-1,71%	Outros	Outros

Relatório Semestral de Diligência – 2024.1

ANEXO 03

Composição da Carteira dos Fundos

Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b " - FI Renda Fixa
Crédito Privado

Resolução CMN 4.963/2021

Código	Nome	Risco do Ativo	Classe do Ativo	Data da Competência	Nome do Ativo	Participação do Ativo
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Risco de mercado	Outros	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições vendidas (omitidas)	0,04%
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Rating AAA	Prefixado	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	17,06%
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Rating AAA	Outros	28/06/2024	Títulos Públicos (omitidos)	0,73%
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Outros	Outros	28/06/2024	Debêntures (omitidas)	46,88%
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Outros	Outros	28/06/2024	Depósitos a prazo e outros títulos de IF (omitidos)	30,30%
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Outros	Outros	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,07%
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Outros	Outros	28/06/2024	Valores a pagar / A Pagar Premio Cotista	0,00%
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Outros	Outros	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,33%
293075	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RF CP LP	Cotas de fundos	Outros	28/06/2024	Cotas de Fundos (omitidas)	5,26%

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL).

Fonte: Quantum Axis.

Emissor	Setor	Rating
NORTE ENERGIA S/A	Energy	A(bra)
ORIGEM ENERGIA S.A	Energy	A(bra)
3R PETROLEUM OLEO E GAS S.A.	Oil & Gas	A(bra)
BANCO BMG S.A	Financials	A(bra)
AGASUS S.A.	Technology	A(bra)
3R POTIGUAR SNR FIDC	Oil & Gas	A(bra)
CLOUDWALK IV FIDC SR	Financials	A(bra)
BANCO C6 S.A.	Financials	A-(bra)
BANCO ORIGINAL S/A	Financials	A-(bra)
BANCO C6 CONSIGNADO S.A	Financials	A-(bra)
VIX LOGISTICA S/A	Transportation	A+(bra)
VIA BRASIL BR 163 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S.A.	Toll Roads	A+(bra)
TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPACOES S.A.	Telecom	A+(bra)
ARMAC LOCACAO LOGISTICA E SERVICOS S.A.	Transportation	A+(bra)
SANEAMENTO DE GOIAS S/A	Water & Sanitation	A+(bra)
VERO S.A.	Telecom	A+(bra)
IGUA RIO DE JANEIRO S.A	Water & Sanitation	A+(bra)
MOBILEPAY FIDC SR5	Financials	A+(bra)
SERENA GERACAO S.A	Energy	AA(bra)
AGUAS GUARIROBA SA	Water & Sanitation	AA(bra)
AURA ALMAS MINERACAO S/A	Metals, Mining & Siderurgy	AA(bra)
ASA BRANCA HOLDING S.A.	Energy	AA(bra)
AEGEA SANEAMENTO E PARTICIPACOES S.A.	Water & Sanitation	AA(bra)
ZAMP S.A.	Food & Beverages	AA(bra)
UNIDAS LOCADORA S.A.	Transportation	AA(bra)
ONCOCLINICAS DO BRASIL SERVICOS MEDICOS SA	Healthcare	AA(bra)
PORTOSEG S/A - CREDITO FINANCIAMENTO E INVESTIMEN	Financials	AA(bra)
PROLAGOS S/A - CONCESSIONARIA DE SERVICOS PUBLICOS	Water & Sanitation	AA(bra)
VITRU BRASIL EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES E COME	Education	AA(bra)
COMPANHIA RIOGRANDENSE DE SANEAMENTO - CORSAN	Water & Sanitation	AA(bra)
PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	Oil & Gas	AA(bra)
CLOUDWALK III FIDC S	Financials	AA(bra)
FS FORTALECE FIDC SR	Agro	AA(bra)
RED FIDC CP SR5	Financials	AA(bra)
KORA SAUDE PARTICIPACOES S.A	Healthcare	AA-(bra)
BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	Water & Sanitation Metals, Mining &	AA-(bra)
LIVETECH DA BAHIA INDUSTRIA E COMERCIO S.A	Telecom	AA-(bra)
HIDROVIAS DO BRASIL S.A.	Transportation	AA-(bra)
CM HOSPITALAR S.A.	Healthcare	AA-(bra)
HOSPITAL ANCHIETA S.A	Healthcare	AA-(bra)
BRK AMBIENTAL - REGIAO METROPOLITANA DE MACEIO S.A	Water & Sanitation	AA-(bra)
BR PARTNERS BANCO DE INVESTIMENTO S.A.	Financials	AA-(bra)
AGUAS DO SERTAO S/A	Water & Sanitation	AA-(bra)
ESSENTIA PCHS S.A	Retail	AA+(bra)
ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	Energy	AA+(bra)
BANCO DAYCOVAL S.A.	Financials	AA+(bra)
V.TAL - REDE NEUTRA DE TELECOMUNICACOES S.A.	Telecom	AA+(bra)
LOG COMMERCIAL PROPERTIES E PARTICIPACOES S.A	Real Estate & Malls	AA+(bra)
PARANA BANCO S/A	Financials	AA+(bra)
AGUAS DO RIO 1 SPE S.A	Water & Sanitation	AA+(bra)
AGUAS DO RIO 4 SPE S.A	Water & Sanitation	AA+(bra)
SMARTFIT ESCOLA DE GINASTICA E DANCA SA	Healthcare	AA+(bra)
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S/A	Healthcare	AAA(bra)
CONCESSIONARIA ROTA DAS BANDEIRAS S.A.	Toll Roads	AAA(bra)
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	Financials	AAA(bra)
LOCALIZA RENT A CAR SA	Transportation	AAA(bra)
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S/A	Real Estate & Malls	AAA(bra)
COMPANHIA CATARINENSE DE AGUAS E SANEAMENTO CASAN	Water & Sanitation	AAA(bra)
IGUATEMI EMPRESA DE SHOPPING CENTERS S/A	Real Estate & Malls	AAA(bra)
BANCO BRADESCO S.A.	Financials	AAA(bra)
AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT S/A	Toll Roads	AAA(bra)
BANCO VOTORANTIM S.A.	Financials	AAA(bra)
COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	Retail	AAA(bra)
SENDAS DISTRIBUIDORA S/A	Retail	AAA(bra)
COMPANHIA DE LOCACAO DAS AMERICAS	Transportation	AAA(bra)
VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS MAQUINAS E EQUIPAMENTO	Transportation	AAA(bra)

COSAN S.A.	Energy	AAA(bra)
REDE DOR SAO LUIZ S.A.	Healthcare	AAA(bra)
SIMPAR S.A.	Transportation	AAA(bra)
RUMO MALHA PAULISTA S.A.	Railroads	AAA(bra)
COMPANHIA ENERGETICA DE PERNAMBUCO	Energy	AAA(bra)
AUTOPISTA LITORAL SUL S.A.	Toll Roads	AAA(bra)
CAMIL ALIMENTOS S.A.	Food & Beverages	AAA(bra)
EQUATORIAL ENERGIA S/A	Energy	AAA(bra)
BANCO BOCOM BBM S.A.	Financials	AAA(bra)
DIAGNOSTICOS DA AMERICA S.A .	Healthcare	AAA(bra)
LOCALIZA FLEET S.A.	Transportation	AAA(bra)
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS S/A. USIMINAS	Siderurgy	AAA(bra)
BRASKEM S.A	Industrials	AAA(bra)
UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	Transportation	AAA(bra)
COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL	Metals, Mining & Siderurgy	AAA(bra)
CLI SUL S/A	Ports	AAA(bra)
BANCO SAFRA S A	Financials	AAA(bra)
MOVIDA LOCACAO DE VEICULOS S.A.	Transportation	AAA(bra)
TIM BRASIL SERVICOS E PARTICIPACOES S.A	Telecom	AAA(bra)
NU FINANCEIRA S.A. - SOCIEDADE DE CREDITO FINANCI	Financials	AAA(bra)
BANCO XP S.A	Financials	AAA(bra)
BANCO CITIBANK S A	Financials	AAA(bra)
BANCO GMAC S.A.	Financials	AAA(bra)
BANCO MERCEDES-BENZ DO BRASIL S/A	Financials	AAA(bra)
EQUATORIAL GOIAS DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S/A	Energy	AAA(bra)
MNLT S.A	Financials	AAA(bra)
BANCO TOYOTA DO BRASIL S.A.	Financials	AAA(bra)
BANCO ABC BRASIL S.A.	Financials	AAA(bra)
BANCO STELLANTIS S.A.	Financials	AAA(bra)
RIO SANEAMENTO BL3 S.A	Water & Sanitation	AAA(bra)
HYPERA S.A.	Healthcare	AAA(bra)
EDP ESPIRITO SANTO DISTRIBUICAO DE ENERGIA S.A.	Energy	AAA(bra)
ENERGISA MATO GROSSO DO SUL - DISTRIBUIDORA DE ENE	Energy	AAA(bra)
BANCO CSF S/A	Financials	AAA(bra)
HAITONG BANCO DE INVESTIMENTO DO BRASIL SA	Financials	AAA(bra)
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	Financials	AAA(bra)
ENERGISA SUL-SUDESTE - DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.	Energy	AAA(bra)
BANCO AGIBANK S.A	Financials	AAA(bra)
BANCOSEGURO S.A	Financials	AAA(bra)
BANCO PACCAR S.A.	Financials	AAA(bra)
COMPASS GAS E ENERGIA S.A	Oil & Gas	AAA(bra)
STONE SOCIEDADE DE CREDITO FINANCIAMENTO E INVEST	Financials	AAA(bra)
CLOUDWALK II FIDC SR	Financials	AAA(bra)
FIDC ACR FAST SR	Financials	AAA(bra)
FIDC BRF II SNR	Financials	AAA(bra)
FIDC CR AUTO IX SR1	Financials	AAA(bra)
FIDC CRE AUTO VII SR	Financials	AAA(bra)
FIDC CRED UNIV SR29	Education	AAA(bra)
FIDC CRED UNIV SR33	Education	AAA(bra)
FIDC CREDITAS AUTOVI	Financials	AAA(bra)
FIDC CREDITAS IV SR	Financials	AAA(bra)
FIDC FORNECEDOR CRB	Transportation	AAA(bra)
FIDC SOMACRED CON S2	Financials	AAA(bra)
BANCO RCI BRASIL SA	Financials	Bonds Offshore
AMERICANAS S.A - EM RECUPERACAO JUDICIAL	Retail	D(bra)
OCEANICA ENGENHARIA E CONSULTORIA S.A.	Oil & Gas	Sem Rating

Relatório Semestral de Diligência – 2024.1

ANEXO 04

Composição da Carteira dos Fundos

Artigo 8º, Inciso I - FI Ações

Resolução CMN 4.963/2021

Nome	Data da Competência	Nome do Ativo	Participação do Ativo	Risco do Ativo	Classe do Ativo
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	28/06/2024	Ações (omitidas)	72,32%	Risco de mercado	Ações
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo (omitidas)	14,73%	Outros	Ações
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2026	12,39%	Rating AAA	Prefixado
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,38%	Outros	Outros
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,18%	Outros	Outros
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações (omitidas)	83,33%	Risco de mercado	Ações
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas	13,57%	Outros	Prefixado
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários	6,26%	Outros	Outros
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Títulos Públicos (omitidos)	1,17%	Rating AAA	Outros
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,63%	Outros	Outros
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2045	0,08%	Rating AAA	Inflação
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,01%	Outros	Outros
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,92%	Outros	Outros
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	-4,13%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Cotas de Fundos (omitidas)	42,34%	Cotas de fundos	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações (omitidas)	37,74%	Risco de mercado	Ações
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Brazilian Depository Receipt - BDR (omitidas)	9,44%	Outros	Ações
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	4,17%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Títulos Públicos (omitidos)	3,35%	Rating AAA	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas	2,90%	Outros	Prefixado
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Outras Aplicações (omitidas)	2,43%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Disponibilidades	2,00%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Valores a receber	1,22%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00%	Outros	CDI
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar / IR_a_recolher	0,00%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	0,00%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-0,01%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas (omitidas)	-0,02%	Risco de mercado	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar / Cotas_Resgatadas	-0,07%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições vendidas (omitidas)	-0,14%	Risco de mercado	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar / Cotas_a_Emitir_Passi	-1,14%	Outros	Outros
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	-4,22%	Outros	Outros
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST. FIC AÇÕES	28/06/2024	Cotas de Fundos (omitidas)	99,51%	Cotas de fundos	Outros
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST. FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,25%	Outros	Outros
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST. FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas	0,20%	Outros	Prefixado
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST. FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,04%	Outros	Outros
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST. FIC AÇÕES	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	PETROBRAS PN - PETR4	9,64%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	8,16%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	CEMIG PN N1 - CMIG4	6,91%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações (omitidas)	5,84%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	VALE ON N1 - VALE3	5,45%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	GERDAU MET PN N1 - GOAU4	5,16%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	BRASIL ON NM - BBAS3	4,30%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	TELEF BRASIL ON - VIVT3	4,18%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	COPEL PNB N1 - CPLE6	3,62%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários	2,95%	Outros	Outros
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	2,76%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	2,60%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CPLE6	2,59%	Risco de mercado	Ações

CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EGIE3	2,41%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBSE3	2,28%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	2,17%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Valores a receber	2,11%	Outros	Outros
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo (omitidas)	1,97%	Outros	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	EQUATORIAL ON NM - EQTL3	1,56%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	PETRORIO ON NM - PRIO3	1,31%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	1,28%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	ELETRORAS PNB N1 - ELET6	1,23%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	1,23%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	ELETRORAS ON N1 - ELET3	1,21%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	SABESP ON NM - SBSP3	1,21%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	VIBRA ON NM - VBBR3	1,16%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	BTGP BANCO UNT - BPAC11	1,12%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	IGUATEMI S.AUNT N1 - IGTI11	1,03%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	USIMINAS PNA N1 - USIM5	1,00%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	REDE D OR ON NM - RDOR3	0,98%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	0,97%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	MARFRIG ON NM - MRFG3	0,93%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	0,92%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	CYRELA REALT ON NM - CYRE3	0,92%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CPFE3	0,86%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	GRUPO NATURAON NM - NTCO3	0,83%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	0,83%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LOCALIZA ON NM - RENT3	0,82%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - NTCO3	0,74%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - USIM5	0,54%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RDOR3	0,50%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	B3 ON NM - B3SA3	0,50%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	BRADESCO PN N1 - BBDC4	0,47%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LOJAS RENNER ON NM - LREN3	0,47%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2030	0,47%	Rating AAA	Prefixado
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	HAPVIDA ON NM - HAPV3	0,45%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VIVT3	0,31%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - HAPV3	0,19%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFI - Venc.: 01/09/2026 (RRSTNCF1RF7)	0,14%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFI - Venc.: 01/09/2027 (RRSTNCF1RH3)	0,13%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VBBR3	0,11%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFI - Venc.: 01/03/2029 (RRSTNCF1RI5)	0,09%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RENT3	0,08%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SBSP3	0,07%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BPAC11	0,06%	Risco de mercado	Ações
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFI - Venc.: 01/03/2027 (RRSTNCF1RG5)	0,05%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (RRSTNCF1RF0)	0,03%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2029 (RRSTNCF1RM3)	0,03%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFI - Venc.: 01/03/2030 (RRSTNCF1RQ9)	0,02%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outras Aplicações (omitidas)	0,02%	Outros	Outros
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFI - Venc.: 01/09/2025 (RRSTNCF1RD7)	0,02%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,01%	Outros	Outros
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2028 (RRSTNCF1RK7)	0,01%	Rating AAA	Selic
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFI - Venc.: 01/03/2025 (RRSTNCF1RC4)	0,00%	Rating AAA	Selic

CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública (omitidas)	0,00%	Outros	Outros
CAIXA EXPERT VINCI VAL DIVID RPPS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-1,99%	Outros	Outros
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Ações (omitidas)	56,82%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo (omitidas)	21,79%	Outros	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Outros Certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários	5,78%	Outros	Outros
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	4,78%	Rating AAA	Inflação
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	2,79%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	ITAUSA PN N1 - ITSA4	2,72%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	VALE ON N1 - VALE3	1,35%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,96%	Outros	Outros
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ABEV3	0,51%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	0,49%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Disponibilidades	0,47%	Outros	Outros
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Brazilian Depository Receipt - BDR (omitidas)	0,45%	Outros	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	PETROBRAS PN - PETR4	0,40%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	0,24%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,17%	Outros	Outros
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITSA4	0,13%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	LFI - Venc.: 01/03/2025 (RSTNCFIR4)	0,11%	Rating AAA	Selic
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	0,07%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	AMBEV S.A. ON - ABEV3	0,03%	Risco de mercado	Ações
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Opções - Posições lançadas (omitidas)	-0,02%	Risco de mercado	Outros
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas (omitidas)	-0,03%	Risco de mercado	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações (omitidas)	63,16%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,595139 - Investimento no Exterior - ITAUSA -	8,22%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 3,75% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	3,75%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,595139 - Venc.: 26/11/2050 - Investimento no Exterior - ITAUSA -	3,43%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	1,76%	Rating AAA	Prefixado
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Valores a receber	1,70%	Outros	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários	1,56%	Outros	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 1,52% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	1,52%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 1,16% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	1,16%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 1,16% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	1,16%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 1,05% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	1,05%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,98% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	0,98%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,92% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	0,92%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,83% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	0,83%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,82% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	0,82%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,82% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	0,82%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,81% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	0,81%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAUSA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,81% - Investimento no Exterior - ITAUSA -	0,81%	Outros	Investimento no Exterior

ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,79%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 2767,39771 -	0,79%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,78%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,71%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 987,931225 -	0,54%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,53%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,46%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,42%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,31%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 238,055717 -	0,23%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,21%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,20%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU -	0,19%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2026	0,16%	Rating AAA	Prefixado
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 654,653222 -	0,15%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	0,14%	Rating AAA	Selic
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,12%	Outros	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Opções - Posições titulares (omitidas)	0,08%	Risco de mercado	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0 - Venc.:	0,08%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 368,986361 -	0,06%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 291,618253 -	0,05%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BOVV11 LFT - Venc.: 01/09/2025	0,03%	Risco de mercado	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	(RRSTNCLF1RD2)	0,03%	Rating AAA	Selic
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,595139 -	0,02%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (RRSTNCLF1RF0)	0,02%	Rating AAA	Selic
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	0,02%	Rating AAA	Prefixado
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	VALE ON N1 - VALE3	0,02%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,595139 -	0,01%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	0,01%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 2,380557 -	0,01%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	PETROBRAS PN - PETR4	0,01%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2025 (RRSTNCLF1RF4)	0,01%	Rating AAA	Selic
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	PETROBRAS ON - PETR3	0,01%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	BRADESCO PN N1 - BBDC4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - SITPASSGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,595139 -	0,00%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	WEG ON NM - WEGE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	B3 ON NM - B3SA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	0,00%	Risco de mercado	Ações

ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ITAUSA PN N1 - ITSA4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	BRASIL ON NM - BBAS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - 3ITAASGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 178,541788 - Venc.: 16/11/2050	0,00%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	AMBEV S.A. ON - ABEV3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	EQUATORIAL ON NM - EQTL3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LOCALIZA ON NM - RENT3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	BTGP BANCO UNT - BPAC11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	JBS ON NM - JBSS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBAS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	REDE D OR ON NM - RDOR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	EMBRAR ON NM - EMBR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	VIBRA ON NM - VBBR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - 3ITAASGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 357,083575 - Venc.: 16/11/2050	0,00%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	GERDAU PN N1 - GGBR4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PRIO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	PETROBRAS ON NM - PRIO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	SABESP ON NM - SBSP3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ELET3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	RUMO S.A. ON NM - RAIL3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	TELEF BRASIL ON - VIVT3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	HAPVIDA ON NM - HAPV3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	RAIADROGASIL ON NM - RADL3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - 3ITAASGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 5948030,148005 - Venc.: 22/11/2050	0,00%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	BRABESCO ON N1 - BBDC3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	KLABIN S.A. UNT N2 - KLBN11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ULTRAPAR ON NM - UGPA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ENEVA ON NM - ENEV3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ENERGISA UNT N2 - ENGI11	0,00%	Rating AAA	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - 3ITAASGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 5960773,061848 - Venc.: 30/11/2050	0,00%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBSE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	COSAN ON NM - CSAN3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - UGPA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	TOTVS ON NM - TOTS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	TIM ON NM - TIMS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CMIG4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	BRF SA ON NM - BRFS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BRFS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LOJAS RENNER ON NM - LREN3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	CEMIG PN N1 - CMIG4	0,00%	Risco de mercado	Ações

ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - WEGE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RAIL3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SBSP3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CPLE6	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ABEV3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ENEV3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ASAI3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	COPEL PNB N1 - CPLE6	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - NTCO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ELETROBRAS PNB N1 - ELET6	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ASSAI ON NM - ASAI3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - 3ITAASGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 5952984,700986 - Venc.: 15/12/2050	0,00%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - HYPE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CCRO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	GRUPO NATURAON NM - NTCO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	GERDAU MET PN N1 - GOAU4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EGIE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ALOS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ALLOS ON NM - ALOS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - JBSS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	CCR SA ON NM - CCRO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TRPL4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CSAN3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TOTS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - 3ITAASGA - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0 - Venc.: 05/12/2050	0,00%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RDOR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ELET6	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CSNA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - GGBR4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	TAESA UNT N2 - TAEE11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TAEE11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	SID NACIONAL ON - CSNA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - KLBN11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	CYRELA REALT ON NM - CYRE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RRRP3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	MULTIPLAN ON N2 - MULT3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	FLEURY ON NM - FLRY3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CIEL3	0,00%	Risco de mercado	Ações

ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CPFE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	PETRORECSA ON NM - RECV3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	3R PETROLEUMON NM - RRRP3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CMIN3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	SAO MARTINHO ON NM - SMT03	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	CARREFOUR BR ON NM - CRFB3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	CIELO ON NM - CIEL3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	BRADSPAR PN N1 - BRAP4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ENGI11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MULT3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	CSNMINERACAOON N2 - CMIN3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - LREN3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BRKM5	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TIMS3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	IGUATEMI S.AUNT N1 - IGTI11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	BRASKEM PNA N1 - BRKM5	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MGLU3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - USIM5	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/08/2030	0,00%	Rating AAA	Inflação
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Investimento no Exterior - ITAÚ ASGAR - IU ASGARD FUND SEGR - KYG4976W2941 - ITAU - 0,595139 - Venc: 14/12/2050	0,00%	Outros	Investimento no Exterior
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - IGTI11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MRFG3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	MARFRIG ON NM - MRFG3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	VAMOS ON NM - VAMO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	YDUQS PART ON NM - YDUQ3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RAIZ4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CRFB3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RECV3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	USIMINAS PNA N1 - USIM5	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VIVT3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VAMO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SLCE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BRAP4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ARZZ3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - COGN3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	RAIZEN PN N2 - RAIZ4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CYRE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SOMA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	SLC AGRICOLA ON NM - SLCE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EMBR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SMT03	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	COGNA ON ON NM - COGN3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SUZB3	0,00%	Risco de mercado	Ações

ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	AREZZO CO ON NM - ARZZ3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RENT3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BPAC11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LOCAWEB ON NM - LWSA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MRVE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	MINERVA ON NM - BEEF3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	IRBBRASIL RE ON NM - IRBR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - IRBR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - AZUL4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	AZUL PN N2 - AZUL4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - GOAU4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	MRV ON NM - MRVE3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - YDUQ3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	DEXCO ON NM - DXCO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SANB11	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - DXCO3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITSA4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ALPA4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	ALPARGATAS PN N1 - ALPA4	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EQTL3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETZ3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	EZTEC ON NM - EZTC3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VBBR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EZTC3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PCAR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	PETZ ON NM - PETZ3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CVCB3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	CVC BRASIL ON NM - CVCB3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	P.ACUCAR-CBD ON N1 - PCAR3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BEEF3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - LWSA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - FLRY3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - HAPV3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Direito de Subscrição - RENT1	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VIVA3	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Mercado Futuro - WINFUT	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2027	0,00%	Rating AAA	Selic
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2025	0,00%	Rating AAA	Selic
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026	0,00%	Rating AAA	Selic
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2025	0,00%	Rating AAA	Selic
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública - OPFITA	0,00%	Outros	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RENT1	0,00%	Outros	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas - WIN	0,00%	Risco de mercado	Ações
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas (omitidas)	-0,02%	Risco de mercado	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições vendidas (omitidas)	-0,07%	Risco de mercado	Outros
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-1,68%	Outros	Outros
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	Ações (omitidas)	56,33%	Risco de mercado	Ações
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	Outros Certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários	10,29%	Outros	Outros

PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	9,07%	Risco de mercado	Ações
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	VALE ON N1 - VALE3	7,01%	Risco de mercado	Ações
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	ITAUSA PN N1 - ITSA4	5,57%	Risco de mercado	Ações
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	B3 ON NM - B3SA3	4,29%	Risco de mercado	Ações
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2055	3,89%	Rating AAA	Inflação
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	PETROBRAS PN - PETR4	2,18%	Risco de mercado	Ações
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	1,12%	Outros	Outros
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,19%	Outros	Outros
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública (omitidos)	0,05%	Outros	Outros
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	28/06/2024	Mercado Futuro - Posições compradas (omitidas)	0,00%	Risco de mercado	Outros

Relatório Semestral de Diligência – 2024.1

ANEXO 05

Composição da Carteira dos Fundos

Artigo 9º, Inciso II - FI Investimento no Exterior

Resolução CMN 4.963/2021

Nome	Data da Competência	Nome do Ativo	Participação do Ativo	Risco do Ativo	Classe do Ativo
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY IE FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,13%	Outros	Outros
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY IE FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,08%	Outros	Outros
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY IE FIC AÇÕES	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY IE FIC AÇÕES	28/06/2024	Cotas de Fundos (omitidas)	99,79%	Cotas de fundos	Outros
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY IE FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a pagar (omitidos)	0,41%	Outros	Outros
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY IE FIC AÇÕES	28/06/2024	Valores a receber (omitidos)	0,39%	Outros	Outros
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY IE FIC AÇÕES	28/06/2024	Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY IE FIC AÇÕES	28/06/2024	Cotas de Fundos (omitidas)	99,20%	Cotas de fundos	Outros

Relatório Semestral de Diligência – 2024.1

ANEXO 06

Composição da Carteira dos Fundos

Artigo 9º, Inciso III – FI Ações - BDR Nível I

Resolução CMN 4.963/2021

Nome	Data da Competência	Nome do Ativo	Participação do Ativo	Risco do Ativo	Classe do Ativo
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MICROSOFT CORPORATION - MSFT34	9,90%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	APPLE INC - AAPL34	9,87%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	NVIDIA CORP - NVDC34	9,75%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	AMAZONCOM, INC - AMZO34	5,74%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	META PLATFORMS, INC - M1TA34	3,19%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ALPHABET INC - GOGL34	3,12%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ALPHABET INC - GOGL35	3,02%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD - TSMC34	2,72%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ELI LILLY AND COMPANY - LILY34	2,56%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BROADCOM INC - AVGO34	2,49%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TESLA, INC - TSLA34	2,00%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	JPMORGAN CHASE & CO - JPMC34	1,67%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	WALMART INC - WALM34	1,58%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	NOVO NORDISKDRN - N1VO34	1,43%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	UNITEDHEALTH GROUP INC - UNHH34	1,33%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	EXXON MOBIL CORPORATION - EXXO34	1,30%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ORACLE CORPORATION - ORCL34	1,28%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ASML HOLDING NV - ASML34	1,17%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MASTERCARD INCORPORATED - MSCD34	1,17%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PROCTER & GAMBLE COMPANY - PGCO34	1,13%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	COSTCO WHOLESALE CORPORATION - COWC34	1,09%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	THE HOME DEPOT, INC - HOME34	1,03%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TOYOTA MOTOR CORP - TMC034	0,93%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MERCK & CO, INC - MRCK34	0,93%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BANK OF AMERICA CORPORATION - BOAC34	0,91%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ABBVIE INC - ABBV34	0,88%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	NETFLIX, INC - NFLX34	0,87%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CHEVRON CORPORATION - CHVX34	0,83%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	THE COCA-COLA COMPANY - COCA34	0,78%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ADVANCED MICRO DEVICES INC - A1MD34	0,76%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ADOBE INC - ADBE34	0,72%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ASTRAZENECA PLC - A1ZN34	0,70%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SALESFORCE, INC - SSFO34	0,69%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	QUALCOMM INC - QCOM34	0,67%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	WELLS FARGO & COMPANY - WFCO34	0,60%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	APPLIED MATERIALS INC - A1MT34	0,59%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CISCO SYSTEMS, INC - CSCO34	0,56%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MCDONALDS CORP - MCD34	0,53%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	DANAHER CORPORATION - DHER34	0,52%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PDD HOLDINGS INC - P1DD34	0,52%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ALIBABA GROUP HOLDING LTD - BABA34	0,51%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	VERIZON COMMUNICATIONS INC - VERZ34	0,50%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	GE AEROSPACE - GEOO34	0,49%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CATERPILLAR INC - CATP34	0,48%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SERVICENOW INC - N1OW34	0,47%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PFIZER INC - PFIZ34	0,45%	Risco de mercado	Ações

CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MICRON TECHNOLOGY INC - MUTC34	0,45%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	UBER TECHNOLOGIES INC - U1BE34	0,44%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	COMCAST CORPORATION - CMCS34	0,44%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	GOLDMAN SACHS GROUP INC - GSGI34	0,43%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	NEXTERA ENERGY INC - NEXT34	0,42%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	UNILEVER PLC - ULEV34	0,41%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BOOKING HOLDINGS INC - BKNG34	0,40%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CONOCOPHILLIPS - CPH34	0,38%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	THE CHARLES SCHWAB CORPORATION - SCHW34	0,38%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	INTEL DRN - ITLC34	0,37%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CITIGROUP INC - CTGP34	0,36%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BLACKROCK, INC - BLAK34	0,35%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PALO ALTO NETWORKS INC - P2AN34	0,33%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PROLOGIS INC - P1LD34	0,32%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	DEERE & CO - DEEC34	0,31%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SONY GROUP CORPORATION - SNEC34	0,30%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BP PLC - B1PP34	0,29%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	AMERICAN TOWER CORP - T1OW34	0,26%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	NIKE INC - NIKE34	0,26%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	STARBUCKS CORPORATION - SBUB34	0,25%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MERCADOLIBRE INC - MELI34	0,24%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	EQUINOR ASA - E1QN34	0,24%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SHOPIFY INC - S2HO34	0,24%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	RIO TINTO PLC - RIOT34	0,24%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	COLGATE-PALMOLIVE COMPANY - COLG34	0,23%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - C2RW34	0,23%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ZOETIS INC - Z1TS34	0,22%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	EQUINIX INC - EQIX34	0,21%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	DIAGEO PLC - DEOP34	0,20%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC - B1TI34	0,20%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BANCO SANTANDER SA - BCSA34	0,20%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	AIRBNB INC - AIRB34	0,19%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SPOTIFY TECHNOLOGY SA - S1PO34	0,18%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PAYPAL HOLDINGS INC - PYPL34	0,17%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP - OXYP34	0,16%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	GENERAL MOTORS COMPANY - GMCO34	0,15%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PALANTIR TECHNOLOGIES INC - P2LT34	0,15%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SIMON PROPERTY GROUP INC - SIMN34	0,14%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MONSTER BEVERAGE CORP - M1NS34	0,14%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	FORD MOTORS COMPANY - FDMO34	0,14%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	NEWMONT CORP - N1EM34	0,14%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	REALTY INCOME CORP - R1IN34	0,13%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	AT&T INC - ATTB34	0,13%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	THE TRADE DESK INC - T2TD34	0,13%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	COINBASE GLOBAL INC - C2OI34	0,13%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MODERNA INC - M1RN34	0,13%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LLOYDS BANKING GROUP PLC - L1YG34	0,13%	Risco de mercado	Ações

CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CHARTER COMMUNICATIONS INC - CHCM34	0,12%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SEA LTD - S2EA34	0,11%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	JDCOM INC - JDCO34	0,10%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	NASDAQ INC - N1DA34	0,10%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BLOCK, INC - S2QU34	0,10%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	HEWLETT-PACKARD COMPANY - HPQB34	0,10%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MORGAN STANLEY - MSBR34	0,09%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO - A1DM34	0,09%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	VISA INC - VISA34	0,09%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BERKSHIRE HATHAWAY INC - BERK34	0,08%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	DOLLAR GENERAL CORP - DGCO34	0,08%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC - T1TW34	0,08%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BAIDU INC - BIDU34	0,07%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	FIRST SOLAR, INC - FSLR34	0,07%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TELEFONICA SA - TLNC34	0,07%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	VODAFONE GROUP PUBLIC LTD COMPANY - V1OD34	0,07%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	JOHNSON & JOHNSON - JNJB34	0,07%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ECOPETROL SA - E1CO34	0,07%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	FRANCO-NEVADA CORP - F2NV34	0,07%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ROBLOX CORPORATION - R2BL34	0,06%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CARNIVAL CORP - C1CL34	0,06%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MICROSTRATEGY INC - M2ST34	0,06%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ARCELORMITTAL - ARMT34	0,05%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BIONTECH SE - B1NT34	0,05%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	AMERICAN EXPRESS COMPANY - AXPB34	0,05%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SUN COMMUNITIES INC - S2UI34	0,04%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PEPSICO, INC - PEPB34	0,04%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC - Z1OM34	0,04%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC - E1DU34	0,04%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	THE WALT DISNEY COMPANY - DISB34	0,03%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TEXAS INSTRUMENTS INC - TEXA34	0,03%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	ALBEMARLE CORP - A1LB34	0,03%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	THE KRAFT HEINZ COMPANY - KHCB34	0,03%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BANCO SANTANDER CHILE - B1SA34	0,03%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	AMERICAN AIRLINES GROUP INC - AALL34	0,02%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	STAG INDUSTRIAL INC - S2TA34	0,02%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	UNITY SOFTWARE INC - U2ST34	0,02%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BILIBILI INC - B1IL34	0,02%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TAL EDUCATION GROUP - T1AL34	0,02%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BILL HOLDINGS, INC - B2HI34	0,02%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TRANSOCEAN LTD - RIGG34	0,01%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SL GREEN REALTY CORP - S1LG34	0,01%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	SIBANYE STILLWATER LTD - S1BS34	0,01%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC - M2PW34	0,01%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	PAGSEGURO DIGITAL LTD - PAGS34	0,01%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	UPSTART HOLDINGS INC - U2PS34	0,01%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	TELADOC HEALTH INC - T2DH34	0,00%	Risco de mercado	Ações

CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LUMEN TECHNOLOGIES, INC - L1MN34	0,00%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD - K2CG34	0,00%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	BEYOND MEAT INC - B2YN34	0,00%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	CVS HEALTH CORPORATION - CVSH34	0,00%	Risco de mercado	Ações
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2028	0,59%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	0,21%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	0,13%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	0,12%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	0,08%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2029 (BRSTNCLF1RM3)	0,03%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	0,02%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	0,02%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	0,01%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	0,01%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	0,00%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/06/2030 (BRSTNCLF1RQ4)	0,00%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	0,00%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	0,00%	Rating AAA	Selic
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,07%	Outros	Outros
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%	Outros	Outros
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	Outras aplicações / Recibo - BMYB11 / CNPJ do emissor: 09.346.601/0001-25 / Denominação Social do emissor: BRISTOL-MYERS SQUIBB COMPANY	0,00%	Outros	Outros
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,14%	Outros	Outros

Relatório Semestral de Diligência – 2024.1

ANEXO 07

Composição da Carteira dos Fundos

Artigo 10º, Inciso I - FI Multimercado - aberto

Resolução CMN 4.963/2021

Código	Nome	Risco do Ativo	Classe do Ativo	Data da Competência	Nome do Ativo	Participação do Ativo
640571218	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LTDA FIF MULTIMERCADO	Risco de mercado	Outros	28/06/2024	DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER - 999 X 999	19,31%
640571218	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LTDA FIF MULTIMERCADO	Rating AAA	Prefixado	28/06/2024	LTN - Venc.: 01/07/2026 (BRSTNCLTN848)	77,69%
640571218	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LTDA FIF MULTIMERCADO	Rating AAA	Inflação	28/06/2024	Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	3,03%
640571218	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LTDA FIF MULTIMERCADO	Outros	Outros	28/06/2024	Outras Disponibilidades	0,00%
640571218	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LTDA FIF MULTIMERCADO	Outros	Outros	28/06/2024	Outros Valores a receber	0,00%
640571218	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO RESP LTDA FIF MULTIMERCADO	Outros	Outros	28/06/2024	Outros Valores a pagar	-0,03%

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL).

Fonte: Quantum Axis.