



FUNPREVI

Relatório Semestral de Diligência

1.º Semestre de 2024

SUMÁRIO

OBJETIVO	3
CREDENCIAMENTO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	3
ANÁLISE E APROVAÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS	4
APLICAÇÕES E RESGATES	5
PRODUTOS CAIXA PARA REGIMES PRÓPRIOS	5
CRITÉRIOS DE SELEÇÃO DOS FUNDOS	5
CARTEIRA DO FUNPREVI	5
META DE INVESTIMENTO	9
ENVIO DE INFORMAÇÕES AO MPS	9
BENS IMÓVEIS	9
CONCLUSÃO	10
ANEXOS	11

1. OBJETIVO

O presente relatório semestral de diligência tem por escopo evidenciar as ações realizadas pela Diretoria de Investimentos do Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro – PREVI-RIO, e pelo Comitê de Investimentos do Fundo Especial de Previdência do Município do Rio de Janeiro – FUNPREVI, atinentes ao acompanhamento dos ativos mobiliários e imobiliários pertencentes ao Regime Próprio de Previdência Social municipal, a fim de asseverar o atendimento por parte de sua unidade gestora dos princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e adequação à natureza de suas obrigações e transparência.

Importante destacar que a elaboração e a apresentação deste trabalho também visam a atender aos ditames previstos na Resolução CMN n.º 4.963, de 25 de novembro de 2021, e, em especial, ao item 3.2.6 do Manual do Pró-Gestão, versão 3.5, de 21 de dezembro de 2023, no qual, para atingir o nível II de certificação, é obrigatória a elaboração de relatórios semestrais de diligências que contenham, no mínimo:

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;

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

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; e

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

Importa esclarecer que os itens “b” e “d” não se aplicam ao FUNPREVI, uma vez que seus recursos não são empregados nesses segmentos.

2. CREDENCIAMENTO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

O Conselho de Administração do PREVI-RIO, órgão deliberativo do FUNPREVI, decidiu em sua 63.^a Reunião Ordinária, ocorrida em 07/06/2010, que os recursos do fundo de previdência somente poderiam ser aplicados nos fundos da Caixa Econômica Federal e do Banco do Brasil.

É importante destacar que, atualmente, a única instituição credenciada junto ao FUNPREVI é a Caixa Econômica Federal. O Banco do Brasil não conseguiu atender todos os requisitos exigidos até a presente data.

Os dados dos atuais administrador e gestor dos fundos de investimento são:

- Administrador: Caixa Econômica Federal, CNPJ 00.360.305/0001-04
- Gestor: CAIXA DTVM S.A., CNPJ 42.040.639/0001-40

Lembrando que o processo de credenciamento das instituições financeiras segue as etapas descritas no “Manual de Credenciamento”, disponível no site do PREVI-RIO (<http://https://previrio.prefeitura.rio/>).

3. ANÁLISE E APROVAÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

O processo de análise e aprovação dos fundos de investimento é composto por algumas fases. Na primeira, a equipe da Gerência de Ativos Mobiliários verifica junto à instituição financeira credenciada quais dos produtos por ela ofertados são dirigidos aos Regimes Próprios de Previdência Social.

A segunda fase, também desenvolvida na Gerência de Ativos Mobiliários, analisa quais dos fundos de investimento são compatíveis com a estratégia de alocação da Política Anual de Investimentos e com as obrigações e

necessidades de fluxo de caixa do FUNPREVI, assim como os que possuem a melhor relação rentabilidade-volatilidade.

No que tange à Política Anual de Investimentos para o ano de 2024, a estratégia prevista no plano de aplicações estipula que os recursos do FUNPREVI deverão ser aplicados nos seguintes seguimentos:

- 80% em cotas de fundos de investimento previstas no art. 7.º, I, “B”, da Resolução CMN n.º 4.963/21 (aplicação exclusivamente em títulos públicos e/ou compromissadas neles lastreadas); e
- 20% em cotas de fundos de investimento previstas no art. 7.º, III, “A”, da Resolução CMN n.º 4.963/21 (cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, , constituídos sob a forma de condomínio aberto).

Aqui é importante observar que a análise dos fundos de investimentos adequados à Política de Investimentos do FUNPREVI é uma atividade diária e de extrema importância. Tem o objetivo de identificar se, ao longo do tempo, os produtos escolhidos devem permanecer na carteira ou ser substituídos.

Na terceira fase, a Gerência de Ativos Mobiliários submete ao Diretor de Investimentos as opções de fundos mais adequados. Caso corrobore com as análises, submete ao Comitê de Investimentos a decisão quanto à

contratação ou não do produto e, somente após a deliberação positiva desse colegiado, é que as operações de aplicação e resgate passam a ser realizadas.

4. APLICAÇÕES E RESGATES

O processo de aplicações e resgates segue as etapas descritas no “Manual de Aplicações e Resgates”, disponível no site do PREVI-RIO (<http://https://previrio.prefeitura.rio/>).

5. PRODUTOS CAIXA PARA REGIMES PRÓPRIOS

A planilha do Anexo I deste relatório apresenta os fundos do seguimento renda fixa, disciplinados pelas regras do artigo 7.º da Resolução CMN n.º 4.963/2021, ofertados pela Caixa Econômica Federal, destinados ao RPPS.

6. CRITÉRIOS DE SELEÇÃO DOS FUNDOS

A escolha dos fundos que irão compor a carteira do FUNPREVI está intrinsecamente vinculada às necessidades de cobertura do fluxo de caixa, hoje dependente de aportes periódicos por parte do Tesouro Municipal. Em razão disso, a seleção deverá obedecer sempre os critérios

estabelecidos pela Diretoria de Investimentos, a saber:

- O fundo deve ser compatível com as necessidades do fluxo de caixa do FUNPREVI;
- A classificação do fundo deve estar em conformidade com o Plano de Aplicações da Política Anual de Investimentos;
- Deve possuir histórico de baixa volatilidade;
- Dentre os de baixa volatilidade, ter histórico de rentabilidade positiva; e
- Deve possuir pronta liquidez (D+0).

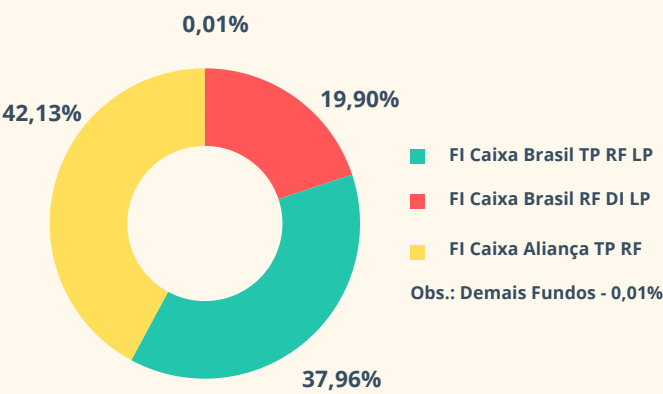
7. CARTEIRA DO FUNPREVI

O FUNPREVI encerrou o primeiro semestre de 2024 com um valor total de **R\$ 422.920.962,26** investidos no mercado financeiro, dos quais 100 % estão alocados no segmento de Renda Fixa.

A carteira do FUNPREVI estava composta da seguinte forma em julho de 2024:

APLICAÇÕES POR FUNDO DE INVESTIMENTO	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$84.160.660,19
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.140,90
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$160.557.366,01
FI Caixa Aliança TP RF	R\$178.158.823,94
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 33.971,22
Total	R\$422.920.962,26

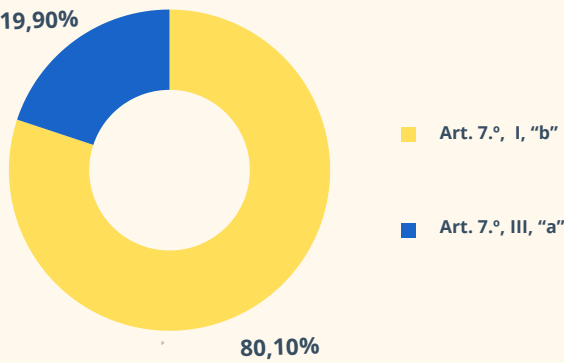
O gráfico abaixo informa o percentual de cada fundo na carteira do FUNPREVI.



Os dados a seguir apresentam os percentuais de alocação dos recursos em comparação com os limites definidos no plano de aplicações da Política Anual de Investimentos e os previstos na Resolução CMN n.º 4.963/2021.

APLICAÇÕES POR ENQUADRAMENTO LEGAL
RESOLUÇÃO CMN N.º 4.963/21

Art. 7.º, inciso I, alínea "b"	R\$338.750.161,17
Art. 7.º, inciso III, alínea "a"	R\$84.170.801,09
Total	R\$422.920.962,26



A composição de cada um dos fundos da carteira de investimentos do FUNPREVI pode ser consultada no Anexo II deste relatório.

7.1 - Fundos de investimento do art. 7.º, I, "B", da Resolução CMN n.º 4.963/21

O fundo "Caixa Brasil IRF-M 1 Títulos Públicos Renda Fixa" foi aprovado pelo Comitê de Investimentos na Reunião Ordinária n.º 111, de 17 de novembro de 2017, "visando a diversificação da carteira e o enquadramento à nova Resolução." Por muito tempo, foi o principal destino dos recursos do FUNPREVI. Contudo, por causa das oscilações de volatilidade apresentadas a partir do final de 2020, superado por fundos com melhor relação risco-retorno.

Os fundos de investimento "Caixa Aliança Títulos Públicos Renda Fixa" e "Caixa Brasil Títulos Públicos Renda Fixa LP" passaram a compor a carteira do FUNPREVI por decisão do Comitê de Investimentos adotada na 124.ª Reunião Ordinária, ocorrida em 25 de março de 2021. Além da necessidade de ampliação das opções de fundos de investimentos, os critérios observados pelo colegiado foram: atendimento às necessidades de fluxo de caixa, compatibilidade com a política de investimentos, baixa volatilidade e maior rentabilidade.

Quando comparados com os demais produtos ofertados pela Caixa Econômica Federal, os fundos da carteira do FUNPREVI, entre julho de 2023 e junho de 2024 (12 meses), foram os que apresentaram a melhor relação "volatilidade – rentabilidade".

PRODUTOS CEF - RPPS

art. 7.º, I, “B”

FUNDOS DE INVESTIMENTOS CAIXA	RENTABILIDADE	VOLATILIDADE MÉDIA	
		DIÁRIA	MENSAL
FI CAIXA ALIANÇA TP RF	11,44%	0,00%	0,02%
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	11,34%	0,01%	0,03%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	10,79%	0,02%	0,10%
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	8,08%	0,11%	0,49%
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	8,00%	0,11%	0,50%
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	7,94%	0,11%	0,50%
FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP	7,62%	0,16%	0,72%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	6,33%	0,22%	1,02%
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	2,87%	0,24%	1,11%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	-1,41%	0,38%	1,72%

7.1.1 Liquidez

Os regulamentos dos fundos “Caixa Brasil IRF-M 1 Títulos Públicos Renda Fixa”, “Caixa Aliança Títulos Públicos Renda Fixa” e “Caixa Brasil Títulos Públicos Renda Fixa LP” permitem a retirada dos recursos aplicados no mesmo dia em que a solicitação de resgate é feita (D+0).

7.1.2 Diversificação

Os fundos “Caixa Aliança Títulos Públicos Renda Fixa” e “Caixa Brasil Títulos Públicos Renda Fixa LP” diferem na composição. Enquanto o “Caixa Aliança Títulos Públicos Renda Fixa” possui como maior parte de seus ativos operações compromissadas lastreadas em título públicos, o “Caixa Aliança Títulos Públicos Renda Fixa” opera mais com títulos públicos. A depender do cenário econômico, é possível que um deles tenha um desempenho melhor o que fornece

mais agilidade para a salvaguarda do patrimônio do FUNPREVI.

No primeiro semestre, em virtude do desempenho muito próximo de ambos, foi mantido o percentual, aproximado, de 40% dos recursos do FUNPREVI em cada um deles.

Já o fundo “Caixa Brasil IRF-M 1 Títulos Públicos Renda Fixa” ainda se mantém na carteira por conta de sua rentabilidade. Mas, por conta de sua volatilidade, não tem recebido aplicações significativas.

7.2 - Fundos de investimento previstos no art. 7.º, III, “A”, da Resolução CMN n.º 4.963/21

Os fundos de investimento “FI Caixa Brasil Referenciado DI LP” e “FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples” são os únicos da carteira do FUNPREVI que possuem títulos privados em suas composições. A relação dos ativos de cada um dos fundos está no Anexo II deste Relatório.

O fundo “Caixa Brasil Referenciado DI LP” foi incluído na carteira do FUNPREVI a partir da decisão do Comitê de Investimentos ocorrida na 98ª Reunião Ordinária, de 27 de janeiro de 2015. Possui como referência o CDI e tem se mostrado, ao longo do tempo, uma excelente opção de investimento e diversificação.

No que tange ao “FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples”, é o único fundo da Caixa Econômica Federal de aplicação automática. Sua manutenção na carteira é a garantia de rentabilidade para os recursos que ingressem após às 17 horas.

Quando comparados com os demais produtos ofertados pela Caixa Econômica Federal, os fundos acima mencionados, entre julho de 2023 e junho de 2024 (12 meses), foram os que apresentaram a melhor relação “volatilidade - rentabilidade”.

PRODUTOS CEF - RPPS
art. 7.º, III, “A”

FUNDOS DE INVESTIMENTOS CAIXA	RENTABILIDADE	VOLATILIDADE MÉDIA	
		DIÁRIA	MENSAL
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	10,59%	0,00%	0,02%
FI CAIXA BRASIL RF REF. DI LP	12,19%	0,01%	0,02%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	12,03%	0,01%	0,03%
FICFI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	8,65%	0,06%	0,29%
FICFI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	7,39%	0,09%	0,42%
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CP	8,28%	0,12%	0,55%
FICFI CAIXA NOVO BRASIL RF REF. IMA-B LP	2,86%	0,25%	1,14%

7.2.1 Liquidez

Os regulamentos dos fundos “FI Caixa Brasil Referenciado DI LP” e “FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples” permitem a retirada dos recursos aplicados no mesmo dia em que a solicitação de resgate é feita (D+0).

7.2.2 Rating dos Ativos dos Fundos de Investimento

No que tange ao fundo “Caixa Brasil Referenciado DI LP”, a Diretoria de Investimentos levantou o rating de 71 empresas cujos ativos estão presentes na relação disponibilizada no Anexo II. Todas foram classificadas como de “baixo risco de crédito” pelas empresas de rating, em consonância com o que preceitua o artigo 6.º, parágrafo segundo, do Regulamento do fundo: “O FUNDO deverá manter, direta ou indiretamente, 100% de seu patrimônio líquido aplicado em ativos financeiros que sejam considerados de baixo risco de crédito pela GESTORA, e classificados por agência de risco registrada na CVM.”

Em relação ao “FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples”, os títulos privados de sua carteira são todos emitidos pela Caixa Econômica Federal, instituição financeira com rating indicando baixo risco de crédito (<https://ri.caixa.gov.br/informacoes-financeiras/rating/>).

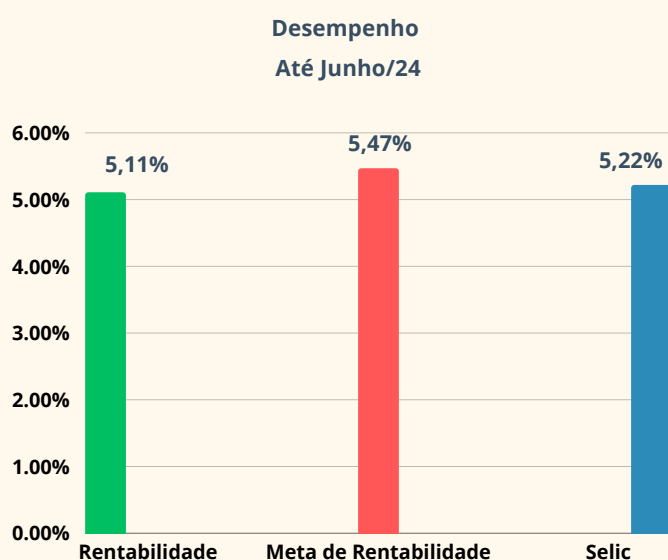
7.2.3 Diversificação

No caso dos fundos “Caixa Brasil Referenciado DI LP” e FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples”, não existe uma diversificação propriamente. Cada um possui uma razão específica para estar na carteira do FUNPREVI. O primeiro persegue maior rentabilidade. O segundo, rentabilidade para recursos que ingressarem após às 17 horas.

8. META DE INVESTIMENTO

A meta de investimentos prevista na Política Anual de Investimentos do exercício de 2024 é de 6% mais IPCA-E.

No primeiro semestre de 2024, o desempenho acumulado da carteira foi de 5,11%. Já a meta de investimentos prevista na Política de Investimentos para o exercício de 2024 (6% ao ano mais IPCA-E), no mesmo período, alcançou 5,47%, valor superior, inclusive, ao da Taxa Selic.



Portanto, os dados demonstram que a carteira de investimentos obteve rentabilidade levemente inferior à meta atuarial no acumulado do primeiro semestre.

9. ENVIO DE INFORMAÇÕES AO MPS

No primeiro semestre de 2024, o PREVI-RIO cumpriu todos os prazos de encaminhamento ao Ministério da Previdência Social, via sistema CADPREV, do Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos Recursos (DAIR). Essa informação pode ser consultada seguindo o passo a passo descrito no site do PREVI-RIO (<https://previrio.prefeitura.rio/dpin-2/>).

10. BENS IMÓVEIS

A carteira imobiliária do FUNPREVI conta com 38 (trinta e oito) imóveis, os quais, somados, representam o montante de R\$ 699.179.830,00. Ressalte-se que as avaliações são todas realizadas periodicamente pela Comissão Especial de Avaliação (CEA), vinculada à Secretaria Municipal de Fazenda e Planejamento.

No primeiro semestre de 2024, a exploração econômica desses bens por terceiros rendeu aos cofres do fundo R\$ 31.372.066,95, o que representa uma rentabilidade anual de 8,88%+IPCA-E.

A relação total dos imóveis pode ser consultada no Relatório e Bens Imóveis do FUNPREVI, referente ao primeiro semestre de 2024 (<https://previrio.prefeitura.rio/imoveis-funprevi/>).

11. CONCLUSÃO

Diante de todo o exposto, verifica-se que:

1. Os investimentos em fundos de renda fixa da Caixa Econômica Federal realizados pelo FUNPREVI no primeiro semestre de 2024:
 - Estão em consonância com os limites mínimos e máximos, tanto em relação à Política Anual de Investimentos quanto aos limites da Resolução CMN n.º 4.963/2021;
 - São aderentes às necessidades de caixa do FUNPREVI, uma vez que são de baixo risco e alta liquidez; e
 - Apresentam desempenho levemente inferior à meta de investimentos informada na Política de Investimentos.
2. O rendimento obtido pelos imóveis foram superiores à meta de investimentos no primeiro semestre de 2024.

ANEXO I

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

FUNDOS DE RENDA FIXA PARA RPPS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS CAIXA	RENTABILIDADE MENSAL												RENT.	VOLATILIDADE	
	jul/23	ago/23	set/23	out/23	nov/23	dez/23	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	ACUM.	DIÁRIA	MENSAL
FI CAIXA ALIANÇA TP RF	1,05%	1,12%	0,96%	0,98%	0,90%	0,88%	0,95%	0,78%	0,82%	0,87%	0,81%	0,77%	11,44%	0,00%	0,02%
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,99%	1,05%	0,90%	0,91%	0,84%	0,81%	0,88%	0,73%	0,75%	0,80%	0,75%	0,71%	10,59%	0,00%	0,02%
FI CAIXA BRASIL RF REF. DI LP	1,14%	1,24%	1,03%	1,02%	0,97%	0,92%	1,00%	0,82%	0,87%	0,89%	0,84%	0,82%	12,19%	0,01%	0,02%
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	1,05%	1,13%	0,95%	0,96%	0,91%	0,90%	0,95%	0,79%	0,79%	0,80%	0,79%	0,78%	11,34%	0,01%	0,03%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	1,15%	1,22%	1,02%	0,99%	0,99%	0,93%	1,01%	0,82%	0,85%	0,83%	0,83%	0,79%	12,03%	0,01%	0,03%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	1,07%	1,11%	0,91%	0,94%	0,97%	0,89%	0,91%	0,74%	0,80%	0,58%	0,76%	0,61%	10,79%	0,02%	0,10%
FICFI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,00%	0,62%	0,45%	0,35%	1,19%	0,98%	0,88%	0,65%	0,62%	0,33%	0,66%	0,60%	8,65%	0,06%	0,29%
FICFI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,89%	0,63%	0,40%	0,26%	1,43%	1,21%	0,66%	0,55%	0,58%	-0,32%	0,70%	0,17%	7,39%	0,09%	0,42%
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,92%	0,77%	0,36%	-0,29%	1,73%	1,40%	0,73%	0,44%	0,90%	-0,36%	1,03%	0,20%	8,08%	0,11%	0,49%
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	0,95%	0,60%	0,11%	-0,32%	1,79%	1,44%	0,66%	0,58%	0,75%	-0,22%	1,03%	0,37%	8,00%	0,11%	0,50%
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	0,93%	0,59%	0,15%	0,28%	1,85%	1,60%	0,45%	0,63%	0,51%	-0,22%	0,92%	0,00%	7,94%	0,11%	0,50%
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CP	1,14%	0,93%	0,07%	-0,31%	1,90%	1,43%	0,67%	0,56%	0,77%	-0,49%	1,05%	0,28%	8,28%	0,12%	0,55%
FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP	0,88%	0,73%	0,15%	0,35%	2,47%	1,46%	0,67%	0,43%	0,50%	-0,55%	0,63%	-0,32%	7,62%	0,16%	0,72%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	0,80%	0,55%	-0,18%	0,09%	3,14%	1,71%	0,59%	0,31%	0,39%	-1,03%	0,58%	-0,75%	6,33%	0,22%	1,02%
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	0,80%	-0,37%	-0,96%	-0,66%	2,61%	2,73%	-0,47%	0,54%	0,06%	-1,64%	1,30%	-1,00%	2,87%	0,24%	1,11%
FICFI CAIXA NOVO BRASIL RF REF. IMA-B LP	0,82%	-0,34%	-1,00%	-0,71%	2,67%	2,77%	-0,49%	0,59%	0,10%	-1,70%	1,30%	-1,08%	2,86%	0,25%	1,14%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	0,74%	-1,26%	-1,86%	-0,96%	3,37%	3,93%	-1,46%	0,50%	-0,56%	-2,91%	1,56%	-2,25%	-1,41%	0,38%	1,72%

ANEXO II

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

**COMPOSIÇÃO DOS FUNDOS DE
INVESTIMENTO DA CARTEIRA
DO FUNPREVI**

06/2024

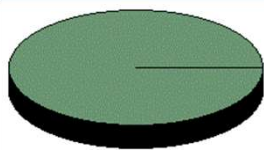
Nome do Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CURTO PRAZO

CNPJ: 05.164.358/0001-73

Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL

CNPJ: 00.360.305/0001-04

Versão: 4.0



4.838.578.238,20	Operações Compromissadas
3.858.151,94	Disponibilidades
250.099,36	Valores a pagar
29.577,94	Valores a receber

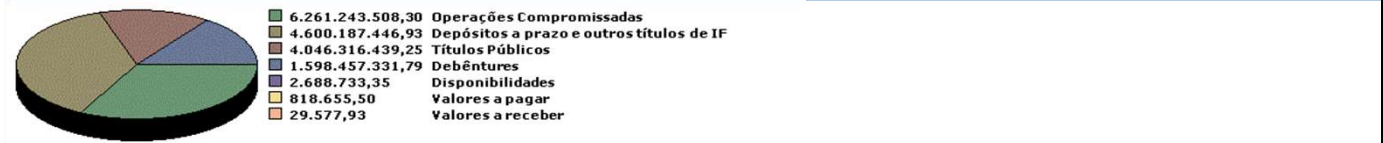
Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 4.842.215.868,72

Data de Recebimento das Informações: 08/07/2024 10:22:18

Lista de Aplicações

Clique sobre o ativo para mais informações.

Ativo	Classificaçã o	Empresa Ligada	Negócios Realizados no Mês				Posição Final			
			Vendas		Aquisições		Quant.	Valores		% Patr. Líq.
			Quant.	Valor	Quant.	Valor		Custo	Mercado	
Disponibilidades Descrição: Disponibilidades	Para negociação								3.858.151,94	0,08
Operações Compromissadas Cod. SELIC: 210100 Venc.: 01/09/2029	Para negociação	Não					326.327		4.838.578.238,20	99,925
Valores a pagar Descrição: VALORES A PAGAR	Para negociação								250.099,36	-0,005
Valores a receber Descrição: VALORES A RECEBER	Para negociação								29.577,94	0,001



Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 16.508.104.382,05					Data de Recebimento das Informações: 08/07/2024 10:30:04					
Lista de Aplicações										
Clique sobre o ativo para mais informações.										
Ativo	Classificação	Empresa Ligada	Negócios Realizados no Mês				Posição Final			
			Vendas		Aquisições		Quant.	Valores		% Patr. Liq.
			Quant.	Valor	Quant.	Valor		Custo	Mercado	
Debêntures CNPJ do emissor: 33.000.167/0001-01 Denominação Social do emissor: PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS Venc.: 25/02/2030	Para negociação	Não	0	0	0	0	109.040		115.871.578,33	0,702
Debêntures CNPJ do emissor: 16.670.085/0001-55 Denominação Social do emissor: LOCALIZA RENT A CAR S.A. Venc.: 27/02/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	103.000		107.629.123,54	0,652
Debêntures CNPJ do emissor: 02.600.854/0001-34 Denominação Social do emissor: TIM BRASIL SERVICOS E PARTICIPACOES S.A Venc.: 25/07/2028	Para negociação	Não	0	0	0	0	74.500		77.761.031,13	0,471
Debêntures CNPJ do emissor: 08.807.432/0001-10 Denominação Social do emissor: ESTACIO PARTICIPACOES S.A. Venc.: 10/04/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	62.000		63.639.804,33	0,386
Debêntures CNPJ do emissor: 34.274.233/0001-02 Denominação Social do emissor: VIBRA ENERGIA S.A. Venc.: 03/10/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	55.300		57.824.688,15	0,35
Debêntures CNPJ do emissor: 01.027.058/0001-91 Denominação Social do emissor: CIELO S.A. Venc.: 20/09/2025	Para negociação	Não	0	0	0	0	55.000		57.162.612,87	0,346
Debêntures CNPJ do emissor: 02.846.056/0001-97 Denominação Social do emissor: CCR S.A. Venc.: 15/01/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	51.735		55.510.142,93	0,336
Debêntures CNPJ do emissor: 02.451.848/0001-62 Denominação Social do emissor: CONC SIST ANHANG-BANDEIRANT S.A. AUTOBAN Venc.: 14/06/2028	Para negociação	Não	0	0	0	0	51.000		52.701.930,33	0,319
Debêntures CNPJ do emissor: 08.324.196/0001-81 Denominação Social do emissor: CIA ENERGETICA DO RIO GDE NORTE - COSERN Venc.: 15/07/2027	Para negociação	Não	0	0	0	0	49.119		52.103.375,73	0,316
Debêntures CNPJ do emissor: 06.057.223/0001-71 Denominação Social do emissor: SENDAS DISTRIBUIDORA S.A. Venc.: 26/11/2027	Para negociação	Não	0	0	0	0	47.130		48.346.917,37	0,293
Debêntures CNPJ do emissor: 02.558.157/0001-62 Denominação Social do emissor: TELEFÔNICA BRASIL S.A Venc.: 12/07/2027	Para negociação	Não	0	0	0	0	44.848		48.045.546,41	0,291
Debêntures CNPJ do emissor: 04.992.714/0001-84 Denominação Social do emissor: NOVA TRANSPORTADORA DO SUDESTE S.A. ζ NT Venc.: 13/09/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	39.845		41.970.277,87	0,254
Debêntures CNPJ do emissor: 60.840.055/0001-31 Denominação Social do emissor: FLEURY S.A. Venc.: 17/05/2031	Para negociação	Não	0	0	0	0	39.700		39.946.932,17	0,242
Debêntures CNPJ do emissor: 04.370.282/0001-70 Denominação Social do emissor: COPEL GERACAO E TRANSMISSAO S.A. Venc.: 15/10/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	38.160		39.503.109,01	0,239
Debêntures CNPJ do emissor: 05.197.443/0001-38 Denominação Social do emissor: HAPVIDA PARTICIPAÇÕES E INVESTIMENTOS S.A. Venc.: 30/04/2027	Para negociação	Não	0	0	0	0	37.180		38.070.873,73	0,231
Debêntures CNPJ do emissor: 33.042.730/0001-04 Denominação Social do emissor: CIA SIDERURGICA NACIONAL Venc.: 20/12/2027	Para negociação	Não	0	0	0	0	33.600		32.724.168,38	0,198
Debêntures CNPJ do emissor: 09.346.601/0001-25 Denominação Social do emissor: B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO Venc.: 28/05/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	32.380		32.699.066,04	0,198
Debêntures CNPJ do emissor: 71.208.516/0001-74	Para negociação	Não	0	0	0	0	30.000		31.910.545,82	0,190

Denominação Social do emissor: ALGAR TELECOM S/A Venc.: 15/01/2029										
Debêntures CNPJ do emissor: 16.404.287/0001-55 Denominação Social do emissor: SUZANO PAPEL E CELULOSE S.A. Venc.: 15/05/2032	Para negociação	Não	0	0	0	0	30.000		30.268.614,84	0,183
Debêntures CNPJ do emissor: 50.746.577/0001-15 Denominação Social do emissor: COSAN S.A. INDUSTRIA E COMERCIO Venc.: 15/08/2028	Para negociação	Não	0	0	0	0	27.000		28.679.034,15	0,174
Debêntures CNPJ do emissor: 33.050.196/0001-88 Denominação Social do emissor: CIA PAULISTA DE FORÇA E LUZ Venc.: 12/12/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	27.800		28.290.857,48	0,171
Debêntures CNPJ do emissor: 61.486.650/0001-83 Denominação Social do emissor: DIAGNOSTICOS DA AMERICA S.A. Venc.: 30/10/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	28.651		27.721.781,42	0,168
Debêntures CNPJ do emissor: 02.328.280/0001-97 Denominação Social do emissor: ELEKTRO REDES S.A. Venc.: 15/04/2031	Para negociação	Não	0	0	0	0	27.000		27.407.973,61	0,166
Debêntures CNPJ do emissor: 05.197.443/0001-38 Denominação Social do emissor: HAPVIDA PARTICIPAÇÕES E INVESTIMENTOS S.A. Venc.: 10/05/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	24.920		25.472.311,30	0,154
Debêntures CNPJ do emissor: 61.585.865/0001-51 Denominação Social do emissor: RAIA DROGASIL S.A. Venc.: 22/04/2031	Para negociação	Não	0	0	0	0	24.000		24.365.138,30	0,148
Debêntures CNPJ do emissor: 84.683.374/0003-00 Denominação Social do emissor: TUPY S.A. Venc.: 06/09/2027	Para negociação	Não	0	0	0	0	23.070		24.226.282,14	0,147
Debêntures CNPJ do emissor: 33.000.167/0001-01 Denominação Social do emissor: PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS Venc.: 15/01/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	23.044		24.217.180,84	0,147
Debêntures CNPJ do emissor: 76.483.817/0001-20 Denominação Social do emissor: CIA PARANAENSE DE ENERGIA - COPEL Venc.: 15/05/2027	Para negociação	Não	0	0	0	0	22.725		23.365.214,29	0,142
Debêntures CNPJ do emissor: 16.670.085/0001-55 Denominação Social do emissor: LOCALIZA RENT A CAR S.A. Venc.: 05/12/2024	Para negociação	Não	0	0	0	0	22.666		22.788.258,90	0,138
Debêntures CNPJ do emissor: 50.746.577/0001-15 Denominação Social do emissor: COSAN S.A. INDUSTRIA E COMERCIO Venc.: 05/05/2028	Para negociação	Não	0	0	0	0	21.672		22.365.166,41	0,135
Debêntures CNPJ do emissor: 04.992.714/0001-84 Denominação Social do emissor: NOVA TRANSPORTADORA DO SUDESTE S.A. � NT Venc.: 15/02/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	20.000		21.146.030,52	0,128
Debêntures CNPJ do emissor: 43.776.517/0001-80 Denominação Social do emissor: CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO Venc.: 20/02/2031	Para negociação	Não	0	0	0	0	20.000		20.977.092,34	0,127
Debêntures CNPJ do emissor: 04.370.282/0001-70 Denominação Social do emissor: COPEL GERACAO E TRANSMISSAO S.A. Venc.: 10/09/2025	Para negociação	Não	0	0	0	0	18.646		19.383.203,84	0,117
Debêntures CNPJ do emissor: 43.776.517/0001-80 Denominação Social do emissor: CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO Venc.: 15/07/2024	Para negociação	Não	0	0	0	0	17.264		18.186.023,43	0,11
Debêntures CNPJ do emissor: 21.314.559/0001-66 Denominação Social do emissor: MOVIDA PARTICIPACOES SA Venc.: 15/09/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	16.200		16.791.732,86	0,102
Debêntures CNPJ do emissor: 23.373.000/0001-32 Denominação Social do emissor: VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHÕES, MÁQUINAS E E Venc.: 15/06/2029	Para negociação	Não	0	0	0	0	16.117		16.120.149,90	0,098
Debêntures CNPJ do emissor: 02.302.100/0001-06 Denominação Social do emissor: EDP SÃO PAULO DISTRIBUIÇÃO DE ENERGIA S. Venc.: 20/06/2028	Para negociação	Não	0	0	16.000	15.967.396,33	16.000		16.006.713,56	0,097
Debêntures CNPJ do emissor: 02.286.479/0001-08 Denominação Social do emissor: TOTAL FLEET S/A Venc.: 05/04/2028	Para negociação	Não	0	0	0	0	14.877		15.303.729,62	0,093
Debêntures CNPJ do emissor: 10.835.932/0001-08 Denominação Social do emissor: CIA ENERGETICA DE PERNAMBUCO - CELPE Venc.: 15/11/2028	Para negociação	Não	0	0	0	0	14.850		15.187.617,00	0,092
Debêntures CNPJ do emissor: 02.846.056/0001-97 Denominação Social do emissor: CCR S.A.	Para negociação	Não	0	0	0	0	14.659		14.923.868,44	0,09

Venc.: 15/12/2026										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	13.535		14.145.266,09	0,086
CNPJ do emissor: 04.992.714/0001-84										
Denomina��o Social do emissor: NOVA TRANSPORTADORA DO SUDESTE S.A. � NT										
Venc.: 13/09/2027										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	11.924		12.434.680,91	0,075
CNPJ do emissor: 16.670.085/0001-55										
Denomina��o Social do emissor: LOCALIZA RENT A CAR S.A.										
Venc.: 25/02/2027										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	23.233		12.194.433,65	0,074
CNPJ do emissor: 92.754.738/0001-62										
Denomina��o Social do emissor: LOJAS RENNER S.A.										
Venc.: 18/02/2025										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	10.282		10.572.649,56	0,064
CNPJ do emissor: 33.050.196/0001-88										
Denomina��o Social do emissor: CIA PAULISTA DE FORCA E LUZ										
Venc.: 15/12/2028										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	9.400		9.806.462,18	0,059
CNPJ do emissor: 00.864.214/0001-06										
Denomina��o Social do emissor: ENERGISA S.A.										
Venc.: 20/10/2027										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	9.600		9.652.452,31	0,058
CNPJ do emissor: 60.894.730/0001-05										
Denomina��o Social do emissor: USINAS SID DE MINAS GERAIS S.A.-USIMINAS										
Venc.: 23/05/2027										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	8.050		8.578.300,02	0,052
CNPJ do emissor: 75.315.333/0001-09										
Denomina��o Social do emissor: ATACAD�O S.A.										
Venc.: 11/01/2027										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	7.976		8.080.490,81	0,049
CNPJ do emissor: 43.776.517/0001-80										
Denomina��o Social do emissor: CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO										
Venc.: 15/12/2025										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	7.539		8.063.246,37	0,049
CNPJ do emissor: 43.776.517/0001-80										
Denomina��o Social do emissor: CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO										
Venc.: 15/07/2026										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	10.000		6.991.605,00	0,042
CNPJ do emissor: 50.746.577/0001-15										
Denomina��o Social do emissor: COSAN S.A. INDUSTRIA E COMERCIO										
Venc.: 25/08/2025										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	5.500		5.632.954,71	0,034
CNPJ do emissor: 06.977.745/0001-91										
Denomina��o Social do emissor: BR MALLS PARTICIPACOES S.A.										
Venc.: 14/11/2027										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	500		5.274.721,36	0,032
CNPJ do emissor: 01.417.222/0001-77										
Denomina��o Social do emissor: MRS LOGISTICA S.A.										
Venc.: 15/08/2026										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	3.302.573		3.383.449,71	0,02
CNPJ do emissor: 04.895.728/0001-80										
Denomina��o Social do emissor: CENTRAIS ELET DO PARA S.A. - CELPA										
Venc.: 15/05/2028										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	2.371		2.448.453,33	0,015
CNPJ do emissor: 02.451.848/0001-62										
Denomina��o Social do emissor: CONC SIST ANHANG-BANDEIRANT S.A. AUTOBAN										
Venc.: 04/11/2026										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	2.673		2.092.028,63	0,013
CNPJ do emissor: 43.776.517/0001-80										
Denomina��o Social do emissor: CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO										
Venc.: 15/03/2027										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	1.308		1.386.504,61	0,008
CNPJ do emissor: 43.776.517/0001-80										
Denomina��o Social do emissor: CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO										
Venc.: 15/03/2029										
Deb�ntures	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	2.364		1.103.933,21	0,007
CNPJ do emissor: 17.281.106/0001-03										
Denomina��o Social do emissor: CIA SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA MG										
Venc.: 16/12/2025										
Dep�sitos a prazo e outros t�tulos de IF	Para negocia��o	Sim	0	0	0	0	400.000		430.080.612,00	2,605
Tipo de Ativo: CDB/ RDB										
CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04										
Denomina��o Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Venc.: 23/10/2024										
Dep�sitos a prazo e outros t�tulos de IF	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	6.500		340.416.924,23	2,062
Tipo de Ativo: Letra Financeira										
CNPJ do emissor: 60.746.948/0001-12										
Denomina��o Social do emissor: BCO BRADESCO S.A.										
Venc.: 01/02/2027										
Dep�sitos a prazo e outros t�tulos de IF	Para negocia��o	N�o	0	0	0	0	2.100		265.329.609,16	1,607
Tipo de Ativo: Letra Financeira										
CNPJ do emissor: 60.701.190/0001-04										
Denomina��o Social do emissor: BANCO ITAU S.A.										
Venc.: 01/09/2025										
Dep�sitos a prazo e outros t�tulos de IF	Para negocia��o	Sim	0	0	0	0	200.000		207.628.424,00	1,258
Tipo de Ativo: CDB/ RDB										
CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04										
Denomina��o Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Venc.: 17/02/2025										

Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 59.588.111/0001-03 Denominação Social do emissor: BANCO VOTORANTIM S.A. Venc.: 01/04/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	4.000		205.574.757,91	1,245
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 90.400.888/0001-42 Denominação Social do emissor: BCO SANTANDER (BRASIL) S.A. Venc.: 31/03/2025	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.500		199.368.488,82	1,208
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 60.701.190/0001-04 Denominação Social do emissor: BANCO ITAU S.A. Venc.: 01/09/2025	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.500		196.231.585,44	1,189
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 90.400.888/0001-42 Denominação Social do emissor: BCO SANTANDER (BRASIL) S.A. Venc.: 29/07/2024	Para negociação	Não	0	0	0	0	2.000		140.609.099,50	0,852
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 60.746.948/0001-12 Denominação Social do emissor: BCO BRADESCO S.A. Venc.: 23/12/2024	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.000		120.844.121,88	0,732
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 60.746.948/0001-12 Denominação Social do emissor: BCO BRADESCO S.A. Venc.: 27/12/2024	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.000		120.588.075,41	0,73
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 58.160.789/0001-28 Denominação Social do emissor: BANCO SAFRA S.A. Venc.: 02/02/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	2.200		115.041.525,45	0,697
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 60.746.948/0001-12 Denominação Social do emissor: BCO BRADESCO S.A. Venc.: 23/12/2025	Para negociação	Não	0	0	223	15.046.176,75	1.691		114.148.231,90	0,691
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 26/05/2025	Para negociação	Sim	0	0	0	0	112.000		113.071.010,08	0,685
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 58.160.789/0001-28 Denominação Social do emissor: BANCO SAFRA S.A. Venc.: 20/04/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.940		100.016.179,92	0,606
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 59.109.165/0001-49 Denominação Social do emissor: BANCO VOLKSWAGEN S.A. Venc.: 10/03/2025	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.220		72.140.385,71	0,437
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 33.479.023/0001-80 Denominação Social do emissor: BANCO CITIBANK S.A. Venc.: 27/09/2024	Para negociação	Não	0	0	0	0	509		71.325.489,66	0,432
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 60.746.948/0001-12 Denominação Social do emissor: BCO BRADESCO S.A. Venc.: 01/08/2025	Para negociação	Não	0	0	0	0	80		64.782.871,38	0,392
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 60.701.190/0001-04 Denominação Social do emissor: BANCO ITAU S.A. Venc.: 15/10/2024	Para negociação	Não	0	0	0	0	500		61.881.442,74	0,375
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 62.307.848/0001-15 Denominação Social do emissor: BANCO RCI BRASIL SA Venc.: 04/11/2024	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.000		61.622.888,83	0,373
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 01.181.521/0001-55 Denominação Social do emissor: BANCO COOPERATIVO SICREDI S/A Venc.: 23/03/2026	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.140		58.733.672,33	0,356
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 60.770.336/0001-65 Denominação Social do emissor: BCO ALFA DE INVESTIMENTO S.A. Venc.: 22/04/2025	Para negociação	Não	0	0	0	0	56.600		57.764.033,42	0,35
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: Letra Financeira CNPJ do emissor: 58.160.789/0001-28 Denominação Social do emissor: BANCO SAFRA S.A.	Para negociação	Não	0	0	0	0	1.100		57.337.148,26	0,347

Venc.: 09/02/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 33.479.023/0001-80		Não	0	0	0	0	808		57.231.881,33	0,347	
Denominação Social do emissor: BANCO CITIBANK S.A.											
Venc.: 23/08/2024											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 59.588.111/0001-03		Não	0	0	0	0	1.000		52.783.363,13	0,32	
Denominação Social do emissor: BANCO VOTORANTIM S.A.											
Venc.: 15/01/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 59.588.111/0001-03		Não	0	0	0	0	1.000		52.508.154,45	0,318	
Denominação Social do emissor: BANCO VOTORANTIM S.A.											
Venc.: 30/01/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: CDB/ RDB											
CNPJ do emissor: 59.109.165/0001-49		Não	0	0	0	0	50.000		52.492.765,86	0,318	
Denominação Social do emissor: BANCO VOLKSWAGEN S.A.											
Venc.: 17/01/2025											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 28.195.667/0001-06		Não	0	0	0	0	400		50.777.172,67	0,308	
Denominação Social do emissor: BCO ABC BRASIL S.A.											
Venc.: 22/08/2024											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 62.232.889/0001-90		Não	0	0	0	0	1.000		50.593.988,07	0,306	
Denominação Social do emissor: BCO DAYCOVAL S.A.											
Venc.: 13/05/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 58.160.789/0001-28		Não	0	0	0	0	1.000		50.587.865,64	0,306	
Denominação Social do emissor: BANCO SAFRA S.A.											
Venc.: 18/05/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 33.479.023/0001-80		Não	0	0	0	0	800		47.044.681,01	0,285	
Denominação Social do emissor: BANCO CITIBANK S.A.											
Venc.: 02/04/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 28.195.667/0001-06		Não	0	0	0	0	400		46.031.964,13	0,279	
Denominação Social do emissor: BCO ABC BRASIL S.A.											
Venc.: 02/06/2025											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 02.992.446/0001-75		Não	0	0	0	0	886		44.986.074,99	0,273	
Denominação Social do emissor: BANCO CNH INDUSTRIAL CAPITAL S/A											
Venc.: 09/05/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 62.232.889/0001-90		Não	0	0	0	0	820		41.903.177,58	0,254	
Denominação Social do emissor: BCO DAYCOVAL S.A.											
Venc.: 09/04/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 33.479.023/0001-80		Não	0	0	0	0	300		41.048.876,91	0,249	
Denominação Social do emissor: BANCO CITIBANK S.A.											
Venc.: 13/01/2025											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 60.872.504/0001-23		Não	0	0	0	0	52		38.816.214,32	0,235	
Denominação Social do emissor: ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.											
Venc.: 19/11/2029											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 60.746.948/0001-12		Não	0	0	0	0	600		38.490.616,87	0,233	
Denominação Social do emissor: BCO BRADESCO S.A.											
Venc.: 25/07/2025											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: CDB/ RDB											
CNPJ do emissor: 60.814.191/0001-57		Não	0	0	0	0	30.000		38.332.545,73	0,232	
Denominação Social do emissor: BANCO MERCEDES BENZ DO BRASIL SA											
Venc.: 02/08/2024											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 03.215.790/0001-10		Não	0	0	0	0	302		38.191.579,44	0,231	
Denominação Social do emissor: BANCO TOYOTA DO BRASIL S.A											
Venc.: 01/09/2024											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 33.264.668/0001-03		Não	0	0	730	36.500.000,00	730		36.637.031,36	0,222	
Denominação Social do emissor: BANCO XP S A											
Venc.: 17/06/2026											
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Para negociação										
Tipo de Ativo: Letra Financeira											
CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04		Sim	0	0	0	0	99		31.884.180,29	0,193	

[illegible]

06/2024 ▼

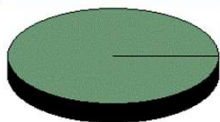
Nome do Fundo: FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES

CNPJ: 14.508.643/0001-55

Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL

CNPJ: 00.360.305/0001-04

Versão: 4.0



977.053.696,84	Cotas de Fundos
197.040,59	Valores a pagar
26.352,95	Valores a receber

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 976.883.009,20

Data de Recebimento das Informações: 08/07/2024 10:22:51

[illegible]

06/2024

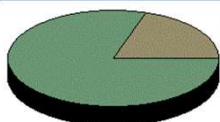
Nome do Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER RENDA FIXA SIMPLES

CNPJ: 41.739.605/0001-86

Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL

CNPJ: 00.360.305/0001-04

Versão: 4.0



8.447.940.456,35	Operações Compromissadas
1.589.303.959,82	Depósitos a prazo e outros títulos de IF
97.213,96	Valores a pagar
29.577,89	Valores a receber
953,02	Disponibilidades

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 10.037.177.733,12

Data de Recebimento das Informações: 08/07/2024 10:22:56

Lista de Aplicações										
Clique sobre o ativo para mais informações.										
Ativo	Classificação	Empresa Ligada	Negócios Realizados no Mês				Posição Final			
			Vendas		Aquisições		Quant.	Valores		% Patr. Liq.
			Quant.	Valor	Quant.	Valor		Custo	Mercado	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 06/09/2024	Para negociação	Sim	0	0	0	0	330.132		357.056.024,20	3,557
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 06/06/2025	Para negociação	Sim	0	0	310.000	310.000.000,00	310.000		311.757.665,90	3,106
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 20/06/2025	Para negociação	Sim	0	0	284.000	284.000.000,00	284.000		284.502.225,60	2,834
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 18/06/2025	Para negociação	Sim	0	0	273.000	273.000.000,00	273.000		273.772.846,62	2,728
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 26/06/2025	Para negociação	Sim	0	0	252.000	252.000.000,00	252.000		252.178.158,96	2,512
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 05/06/2025	Para negociação	Sim	219.622	220.881.686,13	329.000	329.000.000,00	109.378		110.037.038,54	1,096
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 05/06/2024	Para negociação	Sim	0	0	157.531	157.531.000,00	0		0	0
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 13/06/2024	Para negociação	Sim	0	0	33.790	33.790.000,00	0		0	0
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 09/05/2025	Para negociação	Sim	290.014	291.658.347,47	0	0	0		0	0
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04 Denominação Social do emissor: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Venc.: 15/05/2025	Para negociação	Sim	200.000	200.940.462,01	0	0	0		0	0
Depósitos a prazo e outros títulos de IF Tipo de Ativo: CDB/ RDB CNPJ do emissor: 00.360.305/0001-04	Para negociação	Sim	350.000	351.474.587,38	0	0	0		0	0

06/2024

Nome do Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA

CNPJ: 10.740.670/0001-06

Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL

CNPJ: 00.360.305/0001-04

Versão: 4.0

Data de Recebimento das Informações: 08/07/2024 10:31:17

Lista de Aplicações

Clique sobre o ativo para mais informações.

[illegible]

06/2024										
Nome do Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO						CNPJ: 05.164.356/0001-84				
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL						CNPJ: 00.360.305/0001-04				
Versão: 4.0										
Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 11.312.134.510,29						Data de Recebimento das Informações: 08/07/2024 10:32:26				
Lista de Aplicações										
Clique sobre o ativo para mais informações.										
Ativo	Classificaçã o	Empresa Ligada	Negócios Realizados no Mês				Quant.	Posição Final		% Patr. Liq.
			Vendas		Aquisições			Valores		
			Quant.	Valor	Quant.	Valor		Custo	Mercado	
Disponibilidades	Para negociação								1.740.364,95	0,015
Descrição: Disponibilidades										
Mercado Futuro - Posições compradas	Para negociação		0	0	4.415	386.147.930,92	0		0	0
Descrição: Bolsa Mercadoria Futuros - FUT-DI1-V25										
CNPJ do emissor: 54.641.030/0001-06										
Denominação Social do emissor: BMF										
Mercado Futuro - Posições compradas	Para negociação		0	0	14.910	1.406.906.869,58	8.277		-396.385,53	-0,004
Cod. Ativo: DI1FUTF25										
Dt. Ini. Vigen.: 01/01/2021										
Mercado Futuro - Posições compradas	Para negociação		2.372	213.377.126,83	0	0	4.745		-837.065,45	-0,007
Descrição: Bolsa Mercadoria Futuros - FUT-DI1-N25										
CNPJ do emissor: 54.641.030/0001-06										
Denominação Social do emissor: BMF										
Mercado Futuro - Posições vendidas	Para negociação		0	0	282	14.918.101,74	6.939		3.111.143,07	0,028
Cod. Ativo: DI1FUTF30										
Dt. Ini. Vigen.: 02/03/2015										
Mercado Futuro - Posições vendidas	Para negociação		2.937	249.448.957,69	5.580	472.964.906,19	5.679		2.941.951,47	0,026
Cod. Ativo: DI1FUTF26										
Dt. Ini. Vigen.: 13/11/2013										
Mercado Futuro - Posições vendidas	Para negociação		0	0	249	19.955.109,00	7.503		2.565.004,65	0,023
Descrição: Bolsa Mercadoria Futuros - FUT-DI1-N26										
CNPJ do emissor: 54.641.030/0001-06										
Denominação Social do emissor: BMF										
Mercado Futuro - Posições vendidas	Para negociação		290	21.869.389,30	0	0	1.876		582.761,56	0,005
Cod. Ativo: DI1FUTF27										
Dt. Ini. Vigen.: 02/03/2015										
Operações Compromissadas	Para negociação	Não					1.095.746		896.640.764,49	7,926
Cod. SELIC: 100000										
Venc.: 01/04/2026										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	95.790		1.435.235.517,48	12,688
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/03/2027										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	90.687		1.356.626.513,07	11,993
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/09/2027										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	67.054		996.108.043,22	8,806
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/06/2030										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	1.125.900		954.048.164,49	8,434
Cod. SELIC: 100000										
Venc.: 01/01/2026										
Títulos Públicos	Para negociação		30.000	450.256.715,61	54.760	817.972.403,85	62.997		945.862.535,05	8,361
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/09/2024										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	61.462		922.181.439,40	8,152
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/09/2026										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	42.363		633.121.120,35	5,597
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/03/2028										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	775.200		620.033.537,72	5,481
Cod. SELIC: 100000										
Venc.: 01/07/2026										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	39.500		589.719.932,80	5,213
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/09/2028										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	600	8.904.506,69	38.972		580.268.894,74	5,13
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/09/2029										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	37.129		552.004.374,78	4,88
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/03/2030										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	722.100		378.767.826,82	3,348
Cod. SELIC: 100000										
Venc.: 01/01/2030										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	55.172	240.284.746,35	55.172		241.490.518,47	2,135
Cod. SELIC: 760199										
Venc.: 15/08/2024										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	25.630		109.445.898,38	0,968
Cod. SELIC: 760199										
Venc.: 15/05/2027										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	5.211		78.244.294,70	0,692
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/09/2025										
Títulos Públicos	Para negociação		0	0	0	0	878		13.178.192,67	0,116
Cod. SELIC: 210100										
Venc.: 01/03/2026										
Títulos Públicos	Para negociação		13.000	56.112.138,82	13.000	56.087.904,08	0		0	0
Cod. SELIC: 760199										
Venc.: 15/08/2030										
Títulos Públicos	Para negociação		441.500	386.310.112,56	0	0	0		0	0
Cod. SELIC: 100000										
Venc.: 01/10/2025										
Valores a pagar	Para negociação								565.694,98	-0,005
Descrição: VALORES A PAGAR										
Valores a receber	Para negociação								7.982.271,69	0,071
Descrição: VALORES A RECEBER										



PREVI-RIO

