



R.I. Relatório de Investimentos

JUNHO/2024

JUSPREV 

Apresentação

A Lâmina de Rentabilidade consolida as informações enviadas pelas Gestoras de Ativos ICATU - Icatu Asset Management e Somma Investimentos S.A. e é disponibilizada mensalmente no site da JUSPREV para que os participantes possam acompanhar o desempenho dos fundos de investimentos. É destinado exclusivamente aos recursos aplicados pela JUSPREV e atende às exigências da Política de Investimentos e da Resolução CMN 4661.

Objetivo

O objetivo do plano é proporcionar valorização superior ao INPC + 4,35% a.a. que é a meta atuarial. A aplicação dos recursos é realizada por meio de fundos de investimento que investem diretamente em títulos e/ou em fundo de renda fixa, renda variável, multimercado e estruturados. A alocação dos recursos respeita os critérios de composição e diversificação definidos na legislação em vigor e estabelecidos no regulamento de cada fundo.

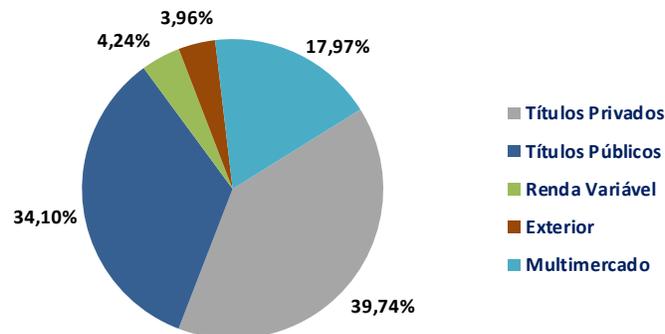
Performance dos Investimentos

Fundos de Investimentos	Patrimônio		Gestor	Rentabilidade					
				1M	12M	24M	36M	48M	60M
ICATU VANG FC FI MULT CRED PRIV JUSPREV ¹	250.600.758,15	43,37%	Icatu Asset Management	0,72%	11,48%	24,77%	25,63%	35,35%	37,51%
SOMMA JUSPREV ATIVO FI MULT CRED PRIV ²	250.739.189,85	43,39%	Somma Investimentos S.A.	0,93%	11,09%	21,75%	26,10%	33,63%	36,03%
SOMMA JUSPREV ALM FI MULT	76.474.168,34	13,24%	Somma Investimentos S.A.	0,81%	9,85%	20,38%	41,78%	62,16%	75,64%
TOTAL JUSPREV	577.814.116,34	100%		0,76%	10,24%	20,84%	27,43%	38,05%	41,64%

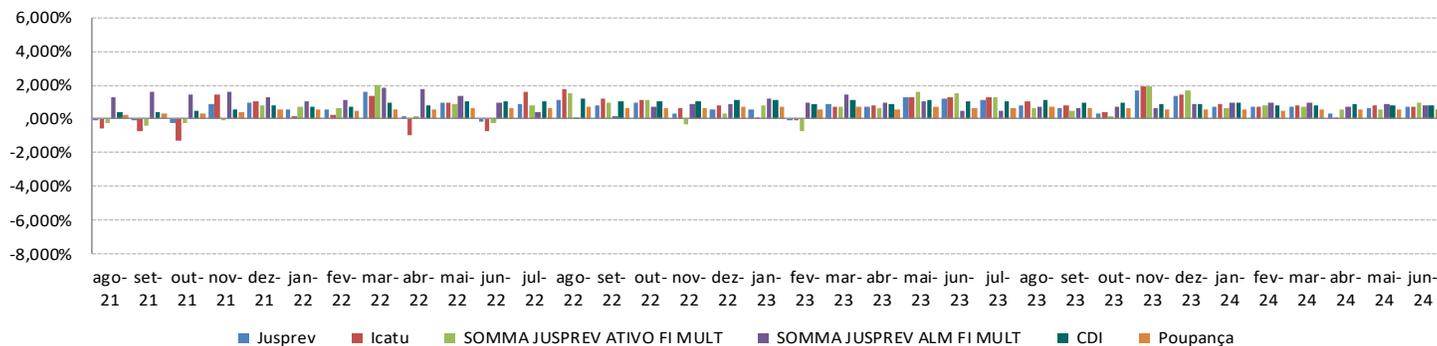
¹O Icatu Vanguarda assumiu a Gestão do Fundo a partir de 02/10/2017. Anterior a esta data, a Gestão do Fundo era de responsabilidade do Bradesco Asset Management.

²A Somma Investimentos S.A. assumiu a Gestão do Fundo a partir de 02/08/2021. Anterior a esta data, a Gestão do Fundo era de responsabilidade da Sul América Investimentos Gestora de Recursos S.A.

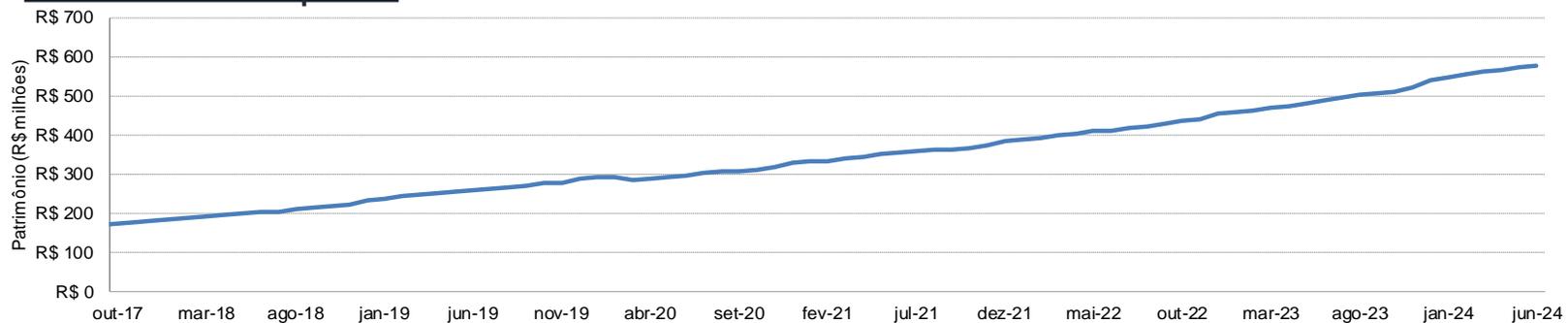
Composição



Rentabilidade Mensal



Patrimônio Líquido



Histórico de Desempenho

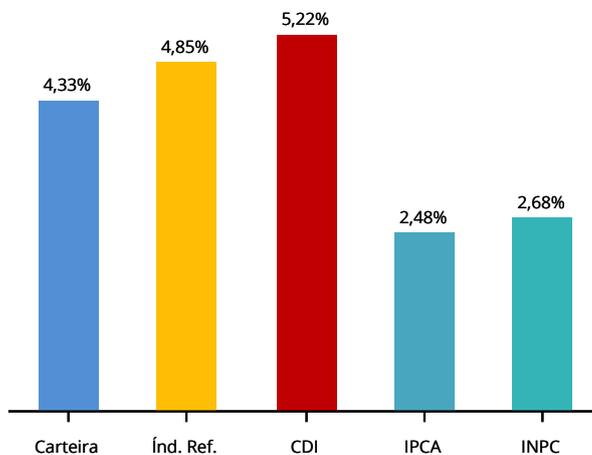
Início Período Considerado	6-ago-08	
	12 meses	Desde o início
Melhor Mês da JUSPREV	1,69%	2,10%
Melhor Mês do INPC + 4,35%	1,13%	2,09%
Melhor Mês do INPC + 6%	1,25%	2,23%
Pior Mês da JUSPREV	0,29%	-3,41%
Pior Mês do INPC + 4,35%	0,26%	-0,25%
Pior Mês do INPC + 6%	0,39%	-0,12%
% de meses acima de INPC + 4,35%	61,54%	40,00%
% de meses acima de INPC + 6%	61,54%	35,26%
% de meses acima de CDI	30,77%	37,89%
Volatilidade da JUSPREV (a.a.)	-0,11%	0,23%

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: Questões econômicas e políticas impactaram os mercados. Na economia, dados dos EUA ofereceram novas evidências de gradual desaceleração da atividade e do emprego. Ao mesmo tempo, a cena inflacionária trouxe notícias alvissareiras. Porém, as comunicações do Fed foram mais duras, a exemplo da projeção do BC dos EUA de apenas 1 corte da taxa de juros em neste ano. Do campo político, as eleições no país entraram de forma mais clara no radar, com as apostas de vitória de Trump ganhando mais espaço. Esse cenário começou a aparecer, timidamente, nos preços dos ativos, em meio à leitura de um eventual novo governo Trump ser mais inflacionista. Na Zona do Euro, o quadro político da França impôs cautela, em meio à dissolução da Assembleia Nacional e convocação de novas eleições.

Economia Brasileira: Junho mostrou que poucas informações detiveram a capacidade de retirar nossos mercados da recente espiral negativa. Dados favoráveis de inflação e uma bem-vinda decisão unânime do Copom apenas estancaram, momentaneamente, a sintonia negativa dos ativos. O sentimento desfavorável quanto ao rumo das contas públicas foi agravado, ao mesmo tempo em que os reiterados ataques de Lula à política de juros do BCB também não ofereceram alívio. Assim, a leitura é que somente o anúncio e posterior implementação de medidas críveis que aponte para o compromisso do governo federal com as contas públicas terá a capacidade de contribuir para algum retorno de melhora de nossos mercados.

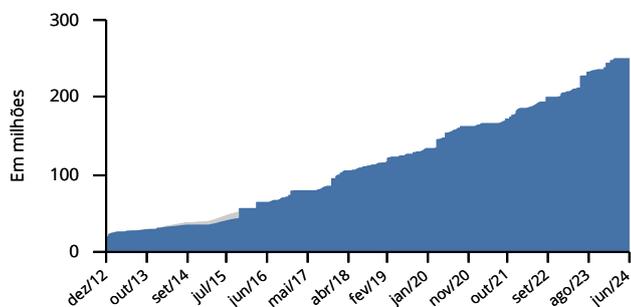
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	Mai-24	Jun-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev Ativo	1,25	0,67	0,52	0,18	1,97	1,72	0,67	0,82	0,71	0,54	0,58	0,93	4,33	11,09	21,75
Índ. Ref.	0,27	0,59	0,45	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,53	0,74	0,82	0,59	4,85	8,15	16,11
CDI	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	5,22	11,69	26,82
IPCA	0,12	0,23	0,26	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	0,38	0,46	0,21	2,48	4,23	7,52

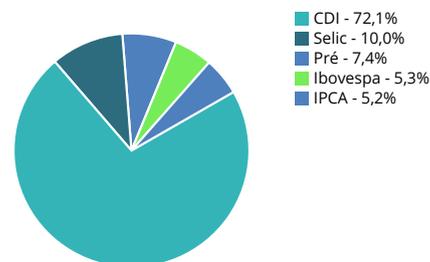
Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

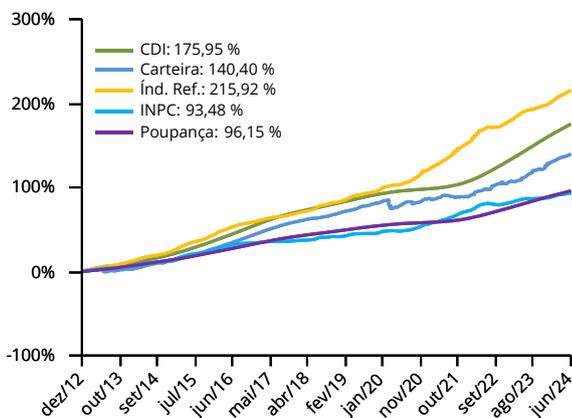


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

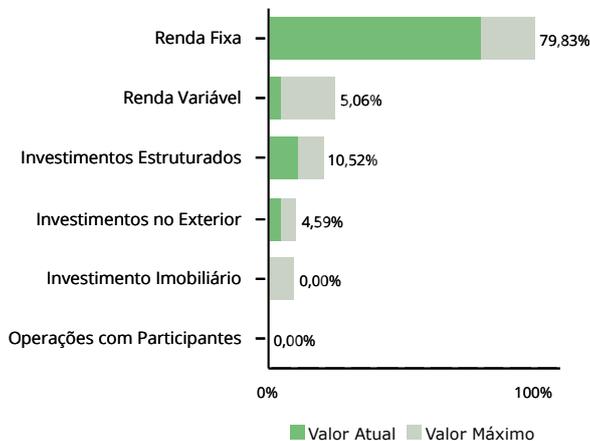
Patrimônio Líquido R\$ 250.739.189,85



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





SOMMA JUSPREV ATIVO FIM CRED PRIV
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
JUNHO DE 2024



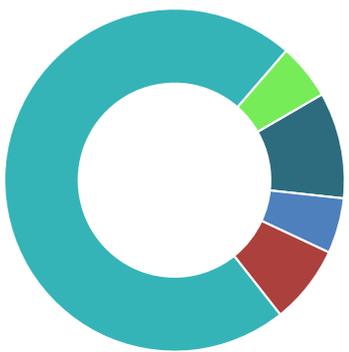
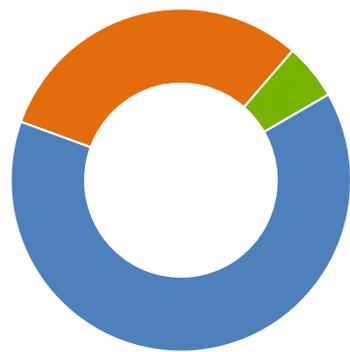
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	5
Política de Investimento	7
Análise de Rentabilidade	8
Retorno da Carteira (R\$)	9
Rentabilidade da Carteira (%)	11
Relatório de Movimentações	12



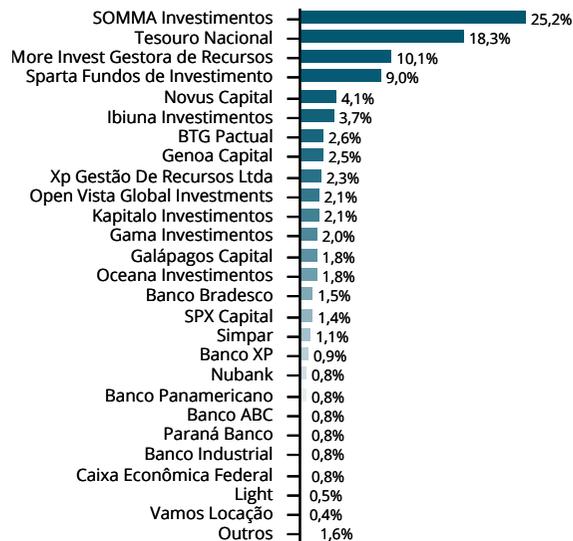
ATIVOS	JUNHO-24	%	MAIO-24	%
RENDA FIXA	79.884.422,54	31,9%	96.831.345,79	39,0%
CDB - Banco BR Partners	1.036.351,56	0,4%	1.026.948,30	0,4%
Compromissada - Titulos Públicos	18.589.958,76	7,4%	30.458.669,58	12,3%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	-	0,0%	1.657.204,86	0,7%
Debênture - Cosan (CSAN33)	-	0,0%	0,00	0,0%
Debênture - JSL (JSMLB5)	2.794.561,45	1,1%	2.797.468,17	1,1%
Debênture - Light (LIGHD7)	1.248.363,00	0,5%	1.281.074,13	0,5%
Debênture - Localiza (LORTA7)	-	0,0%	2.269.722,17	0,9%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	-	0,0%	1.616.389,80	0,7%
Debênture - Vamos (VAMO34)	1.059.977,56	0,4%	1.070.429,55	0,4%
Letra Financeira - Banco ABC	2.087.690,98	0,8%	2.070.068,42	0,8%
Letra Financeira - Banco Bradesco	3.818.415,41	1,5%	3.785.094,85	1,5%
Letra Financeira - Banco CNH	487.927,65	0,2%	483.860,88	0,2%
Letra Financeira - Banco Industrial	1.949.652,66	0,8%	1.932.522,07	0,8%
Letra Financeira - Banco NBC	1.038.395,59	0,4%	1.028.580,96	0,4%
Letra Financeira - Banco Panamericano	2.088.265,19	0,8%	2.065.119,61	0,8%
Letra Financeira - Banco Rodobens	502.705,97	0,2%	498.267,11	0,2%
Letra Financeira - Banco Sicredi	1.028.435,71	0,4%	1.019.575,81	0,4%
Letra Financeira - Banco XP	2.329.693,35	0,9%	2.299.140,65	0,9%
Letra Financeira - BTG Pactual	6.509.202,73	2,6%	6.459.986,78	2,6%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1.912.756,85	0,8%	1.893.498,91	0,8%
Letra Financeira - Nubank	2.099.602,01	0,8%	2.067.535,73	0,8%
Letra Financeira - Paraná Banco	2.058.211,11	0,8%	2.040.348,27	0,8%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	21.685.403,44	8,6%	21.515.700,07	8,7%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	5.558.851,56	2,2%	5.494.139,11	2,2%
FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555	170.818.200,01	68,1%	149.398.659,28	60,1%
Galápagos Albatroz FI RF LP	2.277.105,32	0,9%	2.263.990,52	0,9%
Galápagos Dragon FIC FIM CP	2.278.384,78	0,9%	2.256.561,59	0,9%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	6.175.055,38	2,5%	6.126.073,11	2,5%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	4.731.788,18	1,9%	4.743.116,87	1,9%
IBIUNA LS FP FICM	4.491.489,13	1,8%	4.517.823,73	1,8%
Kapitalo K10 FIC FIM	5.371.023,24	2,1%	5.287.693,10	2,1%
MCA Institucional FIC FIM CP	25.334.150,70	10,1%	25.094.467,09	10,1%
Novus Institucional FI RF LP	10.203.617,84	4,1%	10.117.473,16	4,1%
OAKTREE Global Credit IE FIM	5.106.919,68	2,0%	5.035.573,21	2,0%
Oceana Valor 30 FIC FIA	4.435.738,30	1,8%	4.365.042,87	1,8%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	5.380.647,64	2,1%	4.952.714,59	2,0%
SOMMA Firenze RF CP	22.613.177,83	9,0%	25.028.319,62	10,1%
SOMMA Fundamental FIA	3.023.359,93	1,2%	3.061.740,95	1,2%
SOMMA Institucional FIM	7.430.322,68	3,0%	7.448.253,69	3,0%
SOMMA Positano FIC FIM CP	2.068.133,35	0,8%	2.048.007,04	0,8%
SOMMA Real Estate FIC FIM	5.486.025,49	2,2%	5.517.702,50	2,2%
SOMMA Torino RF CP	22.590.990,43	9,0%	22.371.998,05	9,0%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



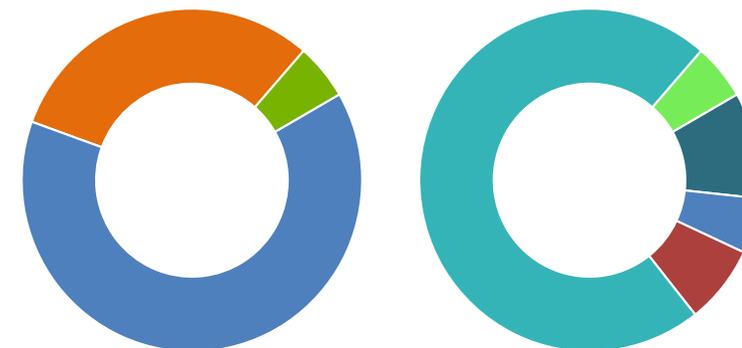
■ Renda Fixa - 63,9%
 ■ Multimercados - 30,9%
 ■ Selic - 10,0%
 ■ Inflação - 5,2%
■ Renda Variável - 5,3%
■ Pré-fixada - 7,4%
■ CDI - 72,1%
■ Ibovespa - 5,3%

INSTITUIÇÃO²

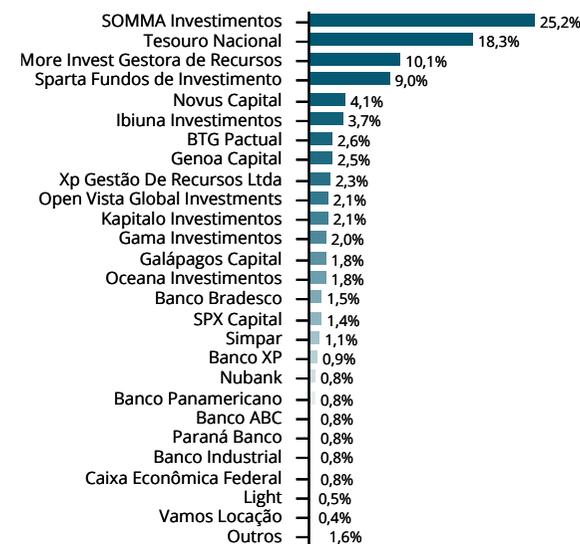


ATIVOS	JUNHO-24	%	MAIO-24	%
Sparta Top Renda Fixa FICFI	22.527.355,08	9,0%	-	0,0%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	3.544.624,71	1,4%	3.486.730,57	1,4%
XP Investor FIA	5.748.290,32	2,3%	5.675.377,02	2,3%
DERIVATIVOS	(20.791.187,39)	-8,3%	(26.610.564,81)	-10,7%
Futuros DAP ¹	(7.049.900,10)	-2,8%	(13.440.425,01)	-5,4%
Futuros WDO ¹	(1.681.565,40)	-0,7%	-	0,0%
Futuros WIN ¹	(13.217.265,40)	-5,3%	(13.170.139,80)	-5,3%
Futuros WSP ¹	1.157.543,51	0,5%	-	0,0%
TESOURARIA	36.567,31	0,0%	2.198.022,78	0,9%
Caixa	1.000,00	0,0%	999,90	0,0%
Valores a Pagar/Receber	35.567,31	0,0%	2.197.022,88	0,9%
TOTAL DA CARTEIRA	250.739.189,86	100%	248.428.027,85	100%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



INSTITUIÇÃO²



¹O saldo deste item não é considerado no somatório do PL.

²Não estão incluídas ações e opções

RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
CDB - Banco BR Partners	Mercado	01/03/2024	05/03/2025	CDI + 1,02%	1.000.000,00	1.036.351,56	-	1.036.351,56	0,41%
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	28/06/2024	01/07/2024	10,39% a.a.	18.589.958,76	18.589.958,76	-	18.589.958,76	7,42%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,42%	-	247.895,39	-	247.895,39	0,10%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,62%	-	1.646.897,61	-	1.646.897,61	0,66%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,42%	-	899.768,45	-	899.768,45	0,36%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	468.734,00	-	468.734,00	0,19%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	16/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,99%	-	435.253,00	-	435.253,00	0,17%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	38.264,00	-	38.264,00	0,02%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	306.112,00	-	306.112,00	0,12%
Debênture - Vamos (VAMO34)	Mercado	12/11/2021	15/10/2031	IPCA + 7,71%	-	1.059.977,56	-	1.059.977,56	0,42%
Letra Financeira - Banco ABC	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,80%	2.000.000,00	2.087.690,98	-	2.087.690,98	0,83%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	20/07/2023	23/12/2026	CDI + 1,09%	1.989.726,90	2.265.909,39	-	2.265.909,39	0,90%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	14/11/2018	15/03/2025	100% Selic	1.500.000,00	1.552.506,02	-	1.552.506,02	0,62%
Letra Financeira - Banco CNH	Mercado	29/02/2024	05/11/2025	CDI + 0,74%	469.656,91	487.927,65	-	487.927,65	0,19%
Letra Financeira - Banco Industrial	Mercado	23/02/2024	10/11/2025	CDI + 1,29%	989.707,11	1.031.646,81	-	1.031.646,81	0,41%
Letra Financeira - Banco Industrial	Mercado	10/04/2024	24/11/2025	CDI + 1,16%	895.719,66	918.005,85	-	918.005,85	0,37%
Letra Financeira - Banco NBC	Mercado	07/03/2024	09/03/2026	CDI + 1,90%	1.000.000,00	1.038.395,59	-	1.038.395,59	0,41%
Letra Financeira - Banco Panamericano	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,95%	2.000.000,00	2.088.265,19	-	2.088.265,19	0,83%
Letra Financeira - Banco Rodobens	Mercado	01/03/2024	18/08/2025	CDI + 0,94%	485.534,64	502.705,97	-	502.705,97	0,20%
Letra Financeira - Banco Sicredi	Mercado	27/03/2024	27/03/2026	CDI + 0,80%	1.000.000,00	1.028.435,71	-	1.028.435,71	0,41%
Letra Financeira - Banco XP	Mercado	21/02/2024	11/05/2026	CDI + 0,89%	2.223.980,09	2.329.693,35	-	2.329.693,35	0,93%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,80%	2.000.000,00	2.088.416,88	-	2.088.416,88	0,83%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	12/07/2022	19/08/2024	IPCA + 7,69%	273.654,04	339.807,00	-	339.807,00	0,14%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	22/07/2022	01/09/2027	CDI + 2,21%	1.500.000,00	1.991.133,54	-	1.991.133,54	0,79%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	29/10/2021	29/10/2026	IPCA + 7,50%	1.500.000,00	2.089.845,31	-	2.089.845,31	0,83%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	Mercado	12/09/2019	30/11/2024	100% Selic	1.800.000,00	1.912.756,85	-	1.912.756,85	0,76%
Letra Financeira - Nubank	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 1,18%	2.000.000,00	2.099.602,01	-	2.099.602,01	0,84%
Letra Financeira - Paraná Banco	Mercado	28/03/2024	07/04/2026	CDI + 0,90%	2.000.000,00	2.058.211,11	-	2.058.211,11	0,82%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	17.593.464,95	18.412.416,98	-	18.412.416,98	7,35%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	17.593.464,95	18.412.416,98	-	18.412.416,98	7,35%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	17.593.464,95	18.412.416,98	-	18.412.416,98	7,35%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	17.593.464,95	18.412.416,98	-	18.412.416,98	7,35%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	18/04/2024	15/08/2024	IPCA + 7,60%	5.433.027,78	5.558.851,56	-	5.558.851,56	2,22%
TOTAL						79.884.422,54	-	79.884.422,54	31,87 %

FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555									
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL		
Galápagos Albatroz FI RF LP	Galápagos Capital	D+1	1.857.375,9784660	1,2259797	-	2.277.105,32	0,91%		
Galápagos Dragon FIC FIM CP	Galápagos Capital	D+91	1.443.962,9321070	1,5778693	-	2.278.384,78	0,91%		
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	Genoa Capital	D+31	3.888.478,5895897	1,5880389	-	6.175.055,38	2,46%		
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	Ibiuna	D+31	35.831,2085761	132,0577330	-	4.731.788,18	1,89%		
IBIUNA LS FP FICM	Ibiuna	D+31	42.956,1041367	104,5599739	-	4.491.489,13	1,79%		
Kapitalo K10 FIC FIM	Kapitalo Investimentos	D+30	2.609.841,1044542	2,0579886	-	5.371.023,24	2,14%		
MCA Institucional FIC FIM CP	More Invest Gestora de Recursos	D+90	22.229.565,1846160	1,1396602	-	25.334.150,70	10,11%		
Novus Institucional FI RF LP	Novus Capital	D+4	7.047.867,9917500	1,4477595	-	10.203.617,84	4,07%		
OAKTREE Global Credit IE FIM	Gama Investimentos	D+12	3.117.553,9475597	1,6381175	-	5.106.919,68	2,04%		
Oceana Valor 30 FIC FIA	Oceana Investimentos	D+30	724.021,6332701	6,1265273	-	4.435.738,30	1,77%		

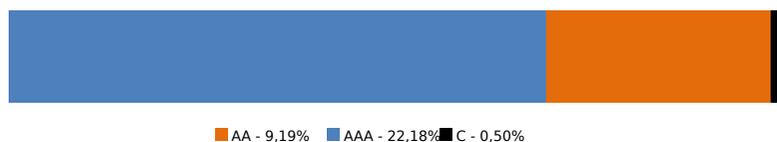
FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555							
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	SOMMA Investimentos	D+6	29.043,4841458	185,2617825	-	5.380.647,64	2,15%
SOMMA Firenze RF CP	SOMMA Investimentos	D+32	18.290.061,9672660	1,2363642	-	22.613.177,83	9,02%
SOMMA Fundamental FIA	SOMMA Investimentos	D+5	21.784,5419010	138,7846458	-	3.023.359,93	1,21%
SOMMA Institucional FIM	SOMMA Investimentos	D+5	2.224.635,1217532	3,3400186	-	7.430.322,68	2,96%
SOMMA Positano FIC FIM CP	SOMMA Investimentos	D+360	1.332,3973746	1.552,1896040	-	2.068.133,35	0,83%
SOMMA Real Estate FIC FIM	SOMMA Investimentos	D+60	4.166,9687837	1.316,5506567	-	5.486.025,49	2,19%
SOMMA Torino RF CP	SOMMA Investimentos	D+1	14.316.970,0474360	1,5779170	-	22.590.990,43	9,01%
Sparta Top Renda Fixa FICFI	Sparta Fundos de Investimento	D+32	6.942.833,5257248	3,2446918	-	22.527.355,08	8,99%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	SPX Capital	D+60	1.463.725,1378000	2,4216464	-	3.544.624,71	1,41%
XP Investor FIA	Xp Gestão De Recursos Ltda	D+3	450.411,0523329	12,7623208	-	5.748.290,32	2,29%
TOTAL					-	170.818.200,01	68,14 %

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano			
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	79,83%	20,17%
Títulos Públicos Federais	100,00%	32,90%	67,10%
CDI/CDBs	80,00%	0,69%	79,31%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	15,05%	64,95%
Debêntures	80,00%	11,49%	68,51%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	10,80%	9,20%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,06%	19,94%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	5,06%	19,94%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	5,06%	19,94%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	10,52%	9,48%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	10,52%	4,48%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	4,59%	5,41%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	4,59%	5,41%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	0,00%	10,00%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

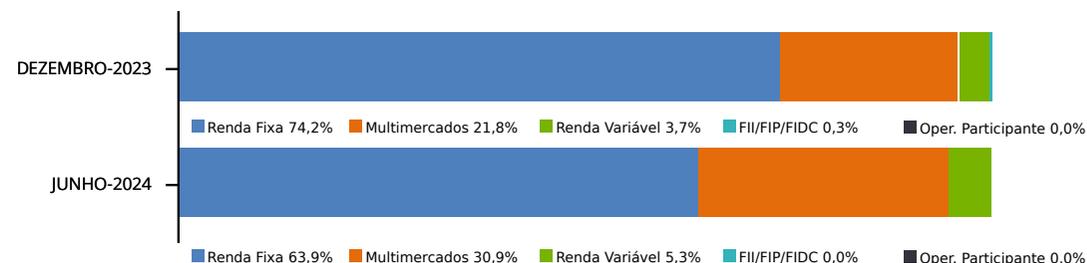
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹							
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO				
			FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN	
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	22,18%					
Banco Bradesco	25,00%	1,52%	AAA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Banco CNH	25,00%	0,19%	AAA(bra)	-	-	-	
Banco NBC	25,00%	0,41%	AAA(bra)	-	-	-	
Banco XP	25,00%	0,93%	AAA(bra)	-	brAAA	-	
Nubank	25,00%	0,84%	-	AAA.br	brAAA	-	
Tesouro Nacional	100,00%	18,28%	-	-	brAAA	-	
Alta Segurança (AA)	100,00%	9,19%					
Banco ABC	25,00%	0,83%	AAA(bra)	AA+.br	brAAA	-	
Banco BR Partners	25,00%	0,41%	AA(bra)	AA-.br	-	-	
Banco Industrial	25,00%	0,78%	-	AA-.br	-	-	
Banco Panamericano	25,00%	0,83%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Banco Rodobens	25,00%	0,20%	AA+(bra)	-	-	-	
Banco Sicredi	25,00%	0,41%	AA+(bra)	AAA.br	brAAA	-	
BTG Pactual	25,00%	2,60%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Caixa Econômica Federal	25,00%	0,76%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Debênture - JSL (JSMLB5)	25,00%	1,11%	AAA(bra)	-	brAA	-	
Debênture - Vamos (VAMO34)	25,00%	0,42%	AAA(bra)	-	brAA+	-	
Paraná Banco	25,00%	0,82%	AA-(bra)	-	brAA+	-	
Risco Substancial (C)	0,00%	0,50%					
Debênture - Light (LIGHD7)	25,00%	0,50%	D(bra)	-	brD	-	

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



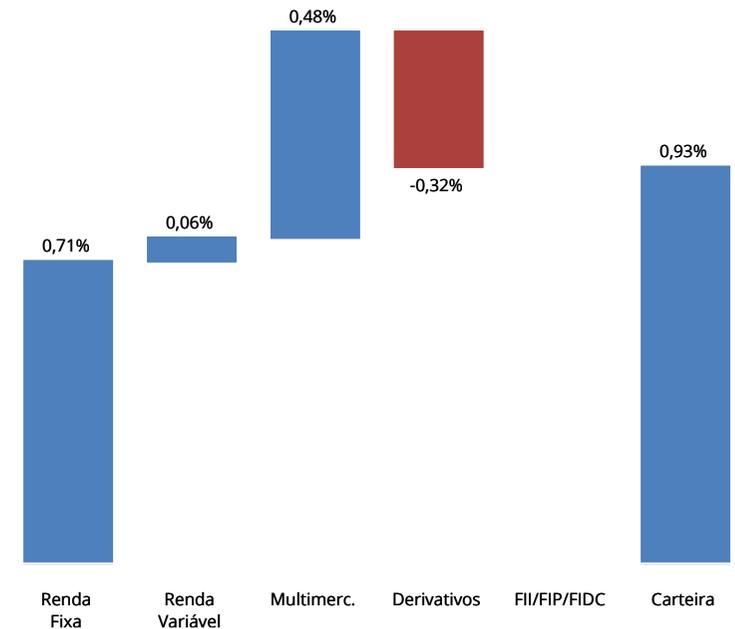
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
CDB - Banco BR Partners	0,92	155,4%	-	-	-	-
Compromissada - Títulos Públicos	0,79	133,6%	5,22	107,6%	-	-
Debênture - JSL (JSM LB5)	-0,10	-	2,11	43,5%	7,57	92,9%
Debênture - Light (LIGHD7)	-2,55	-	-21,80	-	-0,39	-
Debênture - Vamos (VAMO34)	-0,98	-	-0,26	-	5,30	65,0%
Galápagos Albatroz FI RF LP	0,58	98,3%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco ABC	0,85	144,4%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Bradesco	0,88	149,4%	6,58	135,7%	15,53	190,6%
Letra Financeira - Banco CNH	0,84	142,6%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Industrial	0,89	150,4%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco NBC	0,95	161,9%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Panamericano	1,12	190,2%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Rodobens	0,89	151,2%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Sicredi	0,87	147,4%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco XP	1,33	225,5%	-	-	-	-
Letra Financeira - BTG Pactual	0,76	129,3%	5,63	116,1%	12,31	151,0%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1,02	172,6%	6,80	140,2%	15,45	189,6%
Letra Financeira - Nubank	1,55	263,1%	-	-	-	-
Letra Financeira - Paraná Banco	0,88	148,5%	-	-	-	-
Letra Financeira do Tesouro Nacional	0,79	133,8%	-	-	-	-
Notas do Tesouro Nacional - Série B	1,18	199,8%	3,06	63,1%	7,30	89,6%
Novus Institucional FI RF LP	0,85	144,5%	-	-	-	-
SOMMA Firenze RF CP	0,94	160,2%	6,29	129,7%	14,56	178,7%
SOMMA Torino RF CP	0,98	166,1%	6,10	125,8%	14,19	174,1%
Multimercados	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Galápagos Dragon FIC FIM CP	0,97	128,6%	6,61	111,8%	14,44	139,4%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	0,80	106,3%	-	-	-	-
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	-0,24	-	-3,09	-	1,38	13,3%
IBIUNA LS FP FIC FIM	-0,58	-	-3,80	-	-	-
Kapitalo K10 FIC FIM	1,58	209,5%	1,53	25,9%	9,76	94,2%
MCA Institucional FIC FIM CP	0,96	127,0%	-	-	-	-
OAKTREE Global Credit IE FIM	1,42	188,3%	6,11	103,4%	16,41	158,4%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	8,64	1.466,0%	21,52	443,7%	25,67	315,0%
SOMMA Institucional FIM	-0,24	-	0,09	1,5%	4,94	47,7%
SOMMA Positano FIC FIM CP	0,98	130,6%	6,55	110,8%	14,28	137,8%
SOMMA Real Estate FIC FIM	-0,57	-	3,68	75,9%	9,93	121,8%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	1,66	220,7%	2,52	42,6%	3,58	34,6%
Renda Variável	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench
Oceana Valor 30 FIC FIA	1,62	1,0	-8,27	-13,1	6,78	-1,4
SOMMA Fundamental FIA	-1,25	-1,8	-14,24	-19,1	-4,09	-12,2
XP Investor FIA	1,28	0,7	-	-	-	-

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,59	4,85	8,15
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,59	4,85	8,15
Renda Variável (INPC + 4.35% a.a.)	0,59	4,85	8,15
Estruturados (INPC + 6.50% a.a.)	0,75	5,91	10,36
Op. com Participante (CDI)	0,79	5,22	11,69
CDI	0,79	5,22	11,69
IPCA	0,21	2,48	4,23
INPC	0,25	2,68	3,70
Ibovespa	1,48	-7,66	4,93
Dólar	6,05	14,82	15,35

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,77	4,70	11,34
Renda Variável	0,79	-12,53	-4,95
Investimentos Estruturados	0,73	2,59	8,88
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA

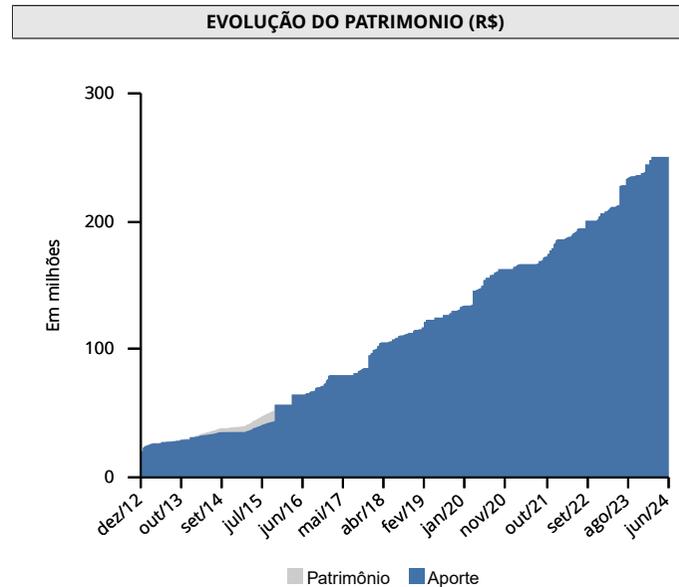
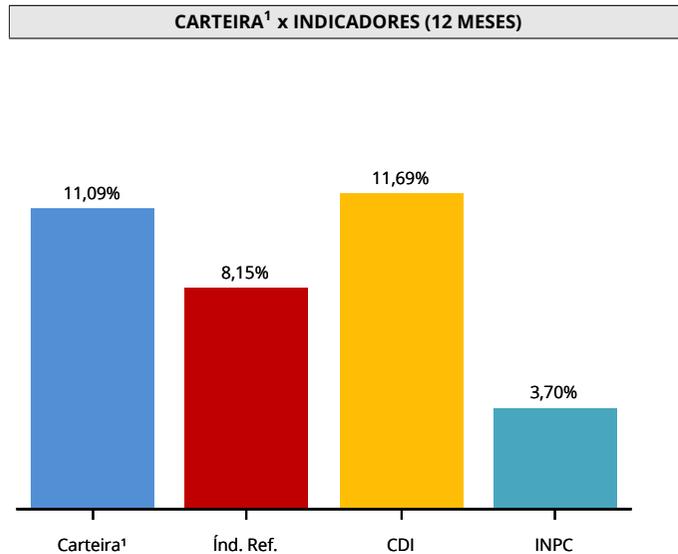
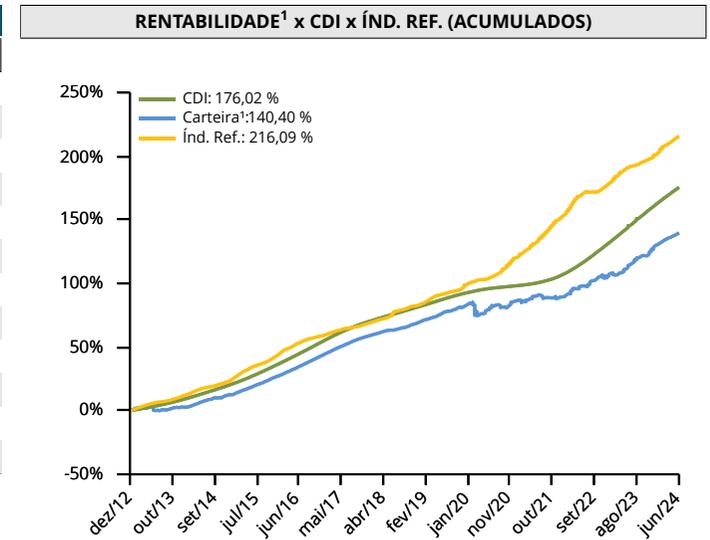


RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	NO ANO
RENDA FIXA	1.673.487,55	1.650.479,14	1.438.282,13	644.772,26	1.143.258,66	1.301.521,57	7.851.801,31
Augme Institucional FI RF CP	50.508,71	47.214,29	50.953,26	(1.950,83)	-	-	146.725,43
CDB - Banco BR Partners	-	-	6.478,29	10.541,11	9.928,90	9.403,26	36.351,56
Compromissada - Títulos Públicos	477.082,93	208.601,86	75.197,36	85.409,10	227.237,14	268.047,97	1.341.576,36
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	18.779,80	13.309,92	23.934,24	9.424,50	20.112,56	3.725,88	89.286,90
Debênture - Aegea Saneamento (AEGPA3)	5.347,05	-	-	-	-	-	5.347,05
Debênture - Assaf (ASAI14)	3.539,40	-	-	-	-	-	3.539,40
Debênture - CIA Siderúrgica (CSNAA1)	10.733,99	13.403,63	-	-	-	-	24.137,62
Debênture - CM Hospitalar (VVEO15)	2.468,99	-	-	-	-	-	2.468,99
Debênture - Cosan (CSAN33)	13.166,91	44.142,63	(9.008,09)	(25.421,99)	33.458,26	(0,00)	56.337,72
Debênture - JSL (JSMLB5)	1.228,56	40.953,22	14.204,07	(35.120,41)	41.292,88	(2.906,72)	59.651,60
Debênture - Light (LIGHD7)	67.535,97	59.000,31	71.137,11	(169.797,09)	(343.275,91)	(32.711,13)	(348.110,74)
Debênture - Localiza (LORTA7)	(14.175,11)	28.029,32	22.459,22	(21.239,34)	46.928,73	(10.555,68)	51.447,14
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	7.994,90	26.196,66	15.671,54	(14.206,75)	30.476,80	(5.266,15)	60.867,00
Debênture - Qualicorp Saúde (QUAL16)	11.576,26	13.324,71	(887,83)	-	-	-	24.013,14
Debênture - Rede DOr (RDORD9)	8.161,87	-	-	-	-	-	8.161,87
Debênture - Stone (MNL11)	2.161,28	-	-	-	-	-	2.161,28
Debênture - TIM Telefonia (TBSP11)	7.736,22	-	-	-	-	-	7.736,22
Debênture - Vamos (VAMO24)	15.507,86	5.737,17	-	-	-	-	21.245,03
Debênture - Vamos (VAMO34)	(8.388,56)	15.843,54	(9.117,13)	(10.138,18)	19.371,73	(10.451,99)	(2.880,59)
Debênture - Vix Logística (VIXL35)	6.136,89	-	-	-	-	-	6.136,89
Galápagos Albatroz FI RF LP	-	-	-	-	13.990,52	13.114,80	27.105,32
Letra Financeira - Banco ABC	-	4.340,00	18.467,31	25.877,96	21.383,15	17.622,56	87.690,98
Letra Financeira - Banco Bradesco	44.147,08	47.778,55	36.815,21	36.584,23	43.610,65	33.320,56	242.256,28
Letra Financeira - Banco CNH	-	(1.065,16)	4.272,83	6.696,77	4.299,54	4.066,77	18.270,75
Letra Financeira - Banco Industrial	-	(2.686,61)	13.786,39	17.894,13	18.101,40	17.130,59	64.225,90
Letra Financeira - Banco NBC	-	-	7.397,61	10.809,95	10.373,40	9.814,63	38.395,59
Letra Financeira - Banco Panamericano	-	3.600,82	21.881,17	20.226,05	19.411,57	23.145,58	88.265,19
Letra Financeira - Banco Rodobens	-	-	3.157,96	4.916,29	4.658,22	4.438,86	17.171,33
Letra Financeira - Banco Sicredi	-	-	903,69	9.770,24	8.901,88	8.859,90	28.435,71
Letra Financeira - Banco XP	-	11.050,82	20.781,06	22.335,96	20.992,72	30.552,70	105.713,26
Letra Financeira - BTG Pactual	61.191,56	33.231,50	66.890,67	34.644,58	65.276,42	49.215,95	310.450,68
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	22.553,29	18.869,08	19.924,59	20.774,52	20.325,85	19.257,94	121.705,27
Letra Financeira - Nubank	-	6.535,17	24.549,62	19.467,57	16.983,37	32.066,28	99.602,01
Letra Financeira - Paraná Banco	-	-	-	19.667,08	20.681,19	17.862,84	58.211,11
Letra Financeira do Tesouro Nacional	120.825,08	287.907,19	312.685,83	273.536,33	177.089,76	169.703,37	1.341.747,56
Notas do Tesouro Nacional - Série B	98.102,99	225.728,55	105.765,37	(73.978,33)	69.670,77	64.712,45	490.001,80
Novus Institucional FI RF LP	-	-	-	-	117.473,16	86.144,68	203.617,84
SOMMA Firenze RF CP	405.603,79	314.746,91	330.487,89	230.843,39	214.557,02	234.858,21	1.731.097,21
SOMMA Torino RF CP	212.128,01	163.057,02	186.935,59	137.205,42	189.946,98	218.992,38	1.108.265,40
Sparta Top Renda Fixa FICFI	-	-	-	-	-	27.355,08	27.355,08
Valora Horizon HY FIM CP	21.831,83	21.628,04	2.557,30	-	-	-	46.017,17
RENDA VARIÁVEL	(381.365,80)	110.352,09	(74.265,30)	(286.276,61)	(594.096,94)	105.227,71	(1.120.424,85)
Ibiúna Equities 30 FIC FIA	(85.324,77)	15.314,86	-	-	-	-	(70.009,91)
Oceana Valor 30 FIC FIA	(54.814,43)	37.651,88	(49.879,09)	(142.381,53)	(158.116,12)	70.695,43	(296.843,86)
SOMMA Fundamental FIA	(241.226,60)	57.385,35	(24.386,21)	(143.895,08)	(111.357,84)	(38.381,02)	(501.861,40)

RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	NO ANO
XP Investor FIA	-	-	-	-	(324.622,98)	72.913,30	(251.709,68)
MULTIMERCADOS	263.711,34	232.824,61	476.071,27	100.952,22	409.514,83	883.847,87	2.366.922,14
Galápagos Dragon FIC FIM CP	29.047,62	23.294,88	22.919,59	24.776,53	19.368,88	21.823,19	141.230,69
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	-	(9.947,43)	39.916,09	116.285,07	(20.180,62)	48.982,27	175.055,38
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	(79.853,75)	37.078,79	37.651,08	(184.384,85)	50.180,25	(11.328,69)	(150.657,17)
IBIUNA LS FP FICM	65.482,44	(24.103,76)	(109.144,87)	84.529,06	(167.905,60)	(26.334,60)	(177.477,33)
Kapitalo K10 FIC FIM	73.820,14	815,58	76.594,66	(179.144,98)	25.729,38	83.330,14	81.144,92
KP Crédito Privado FIC FIM	12.446,00	10.505,31	11.042,83	11.960,94	7.072,99	-	53.028,07
MCA Institucional FIC FIM CP	-	16.638,46	99.446,98	233.260,92	251.120,73	239.683,61	840.150,70
OAKTREE Global Credit IE FIM	54.531,35	30.490,42	61.218,97	8.349,37	68.031,61	71.346,47	293.968,19
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	15.970,85	12.689,79	55.205,58	63.915,95	138.734,39	427.933,05	714.449,61
SOMMA Institucional FIM	(6.134,38)	26.389,06	20.366,14	(46.185,99)	31.203,92	(17.931,01)	7.707,74
SOMMA Positano FIC FIM CP	22.730,01	19.746,81	22.036,53	22.150,18	20.368,37	20.126,31	127.158,21
SOMMA Real Estate FIC FIM	86.763,01	70.777,51	91.481,12	(20.198,89)	(2.381,25)	(31.677,01)	194.764,49
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	16.943,12	18.449,19	47.336,57	(34.361,09)	(11.828,22)	57.894,14	94.433,71
Vista Hedge Institucional FIC FIM	(28.035,07)	-	-	-	-	-	(28.035,07)
FII/FIP/FIDC	54.349,57	9.887,65	53.008,35	7.901,48	887,27	-	126.034,32
FIDC Credz Sênior 8	54.349,57	9.887,65	53.008,35	7.901,48	887,27	-	126.034,32
DERIVATIVOS	-	-	(106.927,96)	909.488,22	509.627,03	66.935,13	1.379.122,42
Futuros DAP	-	-	(74.472,99)	709.490,62	(67.223,17)	163.135,23	730.929,69
Futuros WDO	-	-	-	-	-	(5.765,40)	(5.765,40)
Futuros WIN	-	-	(32.454,97)	199.997,60	576.850,20	(83.598,60)	660.794,23
Futuros WSP	-	-	-	-	-	(6.836,10)	(6.836,10)
TOTAL	1.610.182,66	2.003.543,49	1.786.168,49	1.376.837,57	1.469.190,85	2.357.532,28	10.603.455,34

RESULTADOS DE 2024			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	0,67	0,94	70,73%
Fevereiro	0,82	1,13	72,42%
Março	0,71	0,53	134,89%
Abril	0,54	0,74	72,87%
Mai	0,58	0,82	70,67%
Junho	0,93	0,59	157,85%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	4,33	4,85	89,21%

INDICADORES DE MERCADO				
CDI	IPCA	INPC	Ibovespa	Dólar
0,97	0,42	0,57	(4,79)	2,32
0,80	0,83	0,81	0,99	0,60
0,83	0,16	0,19	(0,71)	0,26
0,89	0,38	0,37	(1,70)	3,51
0,83	0,46	0,46	(3,04)	1,35
0,79	0,21	0,25	1,48	6,05
5,22	2,48	2,68	(7,66)	14,82



RESULTADOS DE 2023			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	0,84	0,83	100,94%
Fevereiro	(0,69)	1,08	-
Março	0,74	1,03	72,06%
Abril	0,66	0,84	79,01%
Mai	1,60	0,73	217,76%
Junho	1,54	0,26	603,32%
Julho	1,25	0,27	472,62%
Agosto	0,67	0,59	113,39%
Setembro	0,52	0,45	116,51%
Outubro	0,18	0,48	38,12%
Novembro	1,97	0,44	449,26%
Dezembro	1,72	0,89	193,49%
Total	11,56	8,16	141,57%

¹A rentabilidade da carteira é baseado na cota Bruta

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
06/06/2024	-1.660.930,74	Venda	Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)
07/06/2024	-2.259.166,49	Venda	Debênture - Localiza (LORTA7)
07/06/2024	-1.611.123,65	Venda	Debênture - Locamérica (LCAMD1)
24/06/2024	12.500.000,00	Aplicação	Sparta Top Renda Fixa FICFI
27/06/2024	10.000.000,00	Aplicação	Sparta Top Renda Fixa FICFI
28/06/2024	-2.650.000,00	Resgate	SOMMA Firenze RF CP

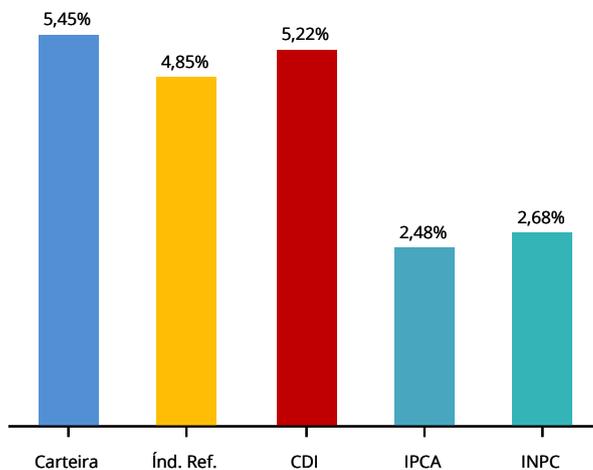
RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: Questões econômicas e políticas impactaram os mercados. Na economia, dados dos EUA ofereceram novas evidências de gradual desaceleração da atividade e do emprego. Ao mesmo tempo, a cena inflacionária trouxe notícias alvissareiras. Porém, as comunicações do Fed foram mais duras, a exemplo da projeção do BC dos EUA de apenas 1 corte da taxa de juros em neste ano. Do campo político, as eleições no país entraram de forma mais clara no radar, com as apostas de vitória de Trump ganhando mais espaço. Esse cenário começou a aparecer, timidamente, nos preços dos ativos, em meio à leitura de um eventual novo governo Trump ser mais inflacionista. Na Zona do Euro, o quadro político da França impôs cautela, em meio à dissolução da Assembleia Nacional e convocação de novas eleições.

Economia Brasileira: Junho mostrou que poucas informações detiveram a capacidade de retirar nossos mercados da recente espiral negativa. Dados favoráveis de inflação e uma bem-vinda decisão unânime do Copom apenas estancaram, momentaneamente, a sintonia negativa dos ativos. O sentimento desfavorável quanto ao rumo das contas públicas foi agravado, ao mesmo tempo em que os reiterados ataques de Lula à política de juros do BCB também não ofereceram alívio. Assim, a leitura é que somente o anúncio e posterior implementação de medidas críveis que aponte para o compromisso do governo federal com as contas públicas terá a capacidade de contribuir para algum retorno de melhora de nossos mercados.

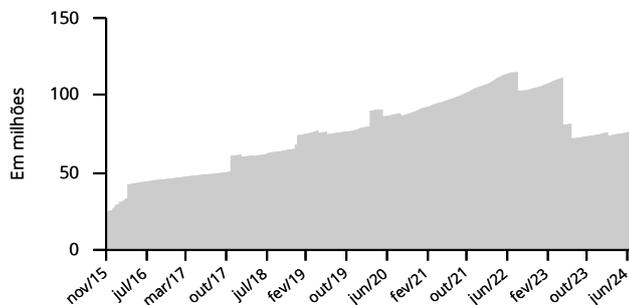
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	Mai-24	Jun-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev ALM CP	0,48	0,72	0,68	0,69	0,67	0,86	1,01	0,98	0,98	0,70	0,85	0,81	5,45	9,85	20,38
Índ. Ref.	0,27	0,59	0,45	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,53	0,74	0,82	0,59	4,85	8,15	16,22
CDI	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	5,22	11,69	26,82
IPCA	0,12	0,23	0,26	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	0,38	0,46	0,21	2,48	4,23	7,52

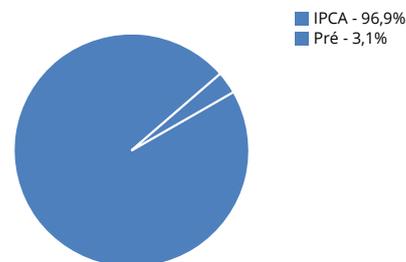
Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

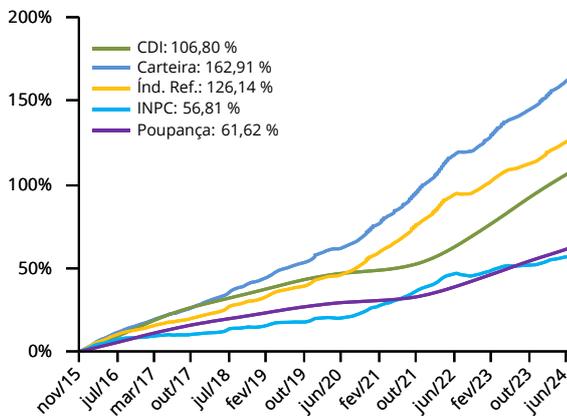


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

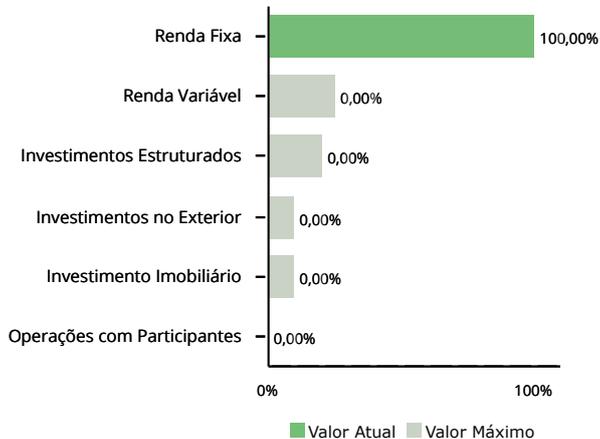
Patrimônio Líquido R\$ 76.474.168,34



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





SOMMA JUSPREV ALM CP
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
JUNHO DE 2024

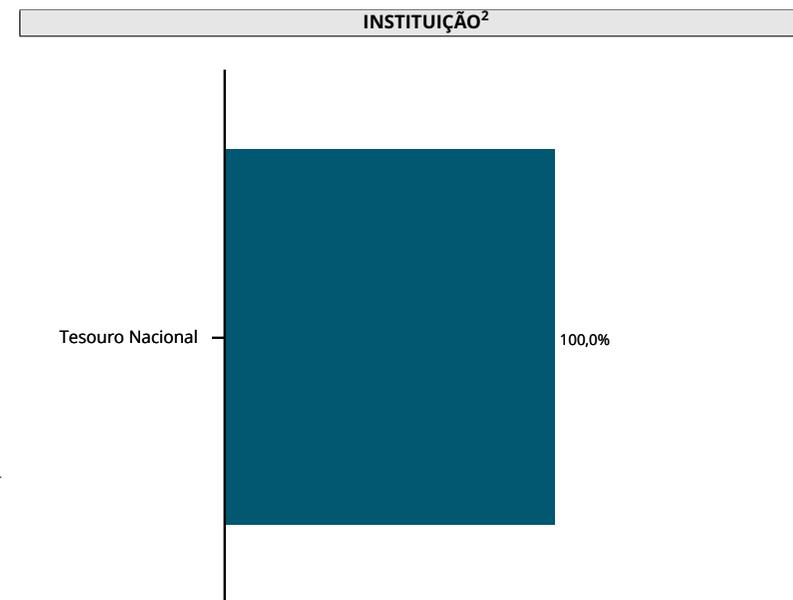
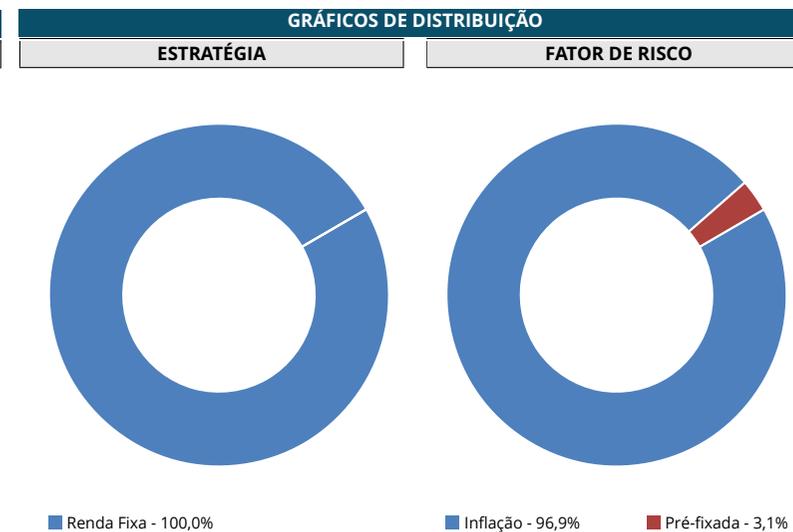


RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	4
Política de Investimento	5
Análise de Rentabilidade.....	6
Retorno da Carteira (R\$)	7
Rentabilidade da Carteira (%).....	8
Relatório de Movimentações	9



ATIVOS	JUNHO-24	%	MAIO-24	%
RENDA FIXA	76.479.046,69	100,0%	75.864.246,66	100,0%
Compromissada - Títulos Públicos	2.344.607,50	3,1%	2.334.717,71	3,1%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	74.134.439,19	96,9%	73.529.528,95	96,9%
TESOURARIA	(4.878,34)	0,0%	(3.585,69)	0,0%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(5.878,34)	0,0%	(4.585,69)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	76.474.168,35	100%	75.860.660,97	100%



¹O saldo deste item não é considerado no somatório do PL.

²Não estão inclusas ações e opções

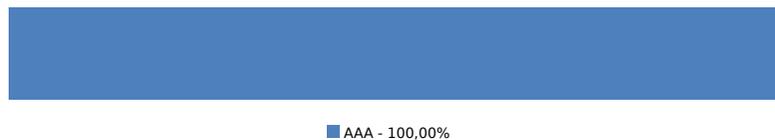
RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	28/06/2024	01/07/2024	10,39% a.a.	2.344.607,50	2.344.607,50	-	2.344.607,50	3,07%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	31/05/2017	15/08/2026	IPCA + 5,65%	1.493.159,87	2.111.789,67	-	2.111.789,67	2,76%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2035	IPCA + 7,01%	5.062.404,62	8.041.411,41	-	8.041.411,41	10,52%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,35%	121.192,13	196.053,37	-	196.053,37	0,26%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	13/01/2016	15/05/2035	IPCA + 7,35%	549.253,50	882.077,32	-	882.077,32	1,15%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2016	15/08/2050	IPCA + 6,83%	1.153.894,05	1.792.902,16	-	1.792.902,16	2,34%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,45%	860.308,17	1.401.031,92	-	1.401.031,92	1,83%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.554.779,21	-	2.554.779,21	3,34%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	02/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,99%	2.093.975,28	2.806.089,83	-	2.806.089,83	3,67%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/05/2045	IPCA + 5,03%	1.340.943,59	1.800.531,29	-	1.800.531,29	2,35%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	73.843,71	113.013,01	-	113.013,01	0,15%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/08/2024	IPCA + 4,47%	1.348.172,69	1.714.716,87	-	1.714.716,87	2,24%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	22/08/2018	15/08/2030	IPCA + 5,65%	2.048.893,74	2.830.028,83	-	2.830.028,83	3,70%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,55%	474.768,52	772.568,22	-	772.568,22	1,01%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/02/2016	15/05/2035	IPCA + 7,41%	1.703.916,03	2.693.282,07	-	2.693.282,07	3,52%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2020	15/08/2050	IPCA + 4,46%	10.007.893,59	12.968.009,22	-	12.968.009,22	16,96%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	172.302,01	263.697,06	-	263.697,06	0,34%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/11/2017	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	13.740.389,66	-	13.740.389,66	17,97%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,32%	241.312,77	392.934,11	-	392.934,11	0,51%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2055	IPCA + 6,39%	4.095.944,22	6.107.207,96	-	6.107.207,96	7,99%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	28/08/2020	15/08/2050	IPCA + 4,01%	1.114.803,90	1.439.405,43	-	1.439.405,43	1,88%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/08/2020	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.460.152,02	-	1.460.152,02	1,91%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/08/2050	IPCA + 4,61%	2.378.295,32	3.175.569,49	-	3.175.569,49	4,15%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	1.058.426,68	1.619.853,44	-	1.619.853,44	2,12%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	30/12/2015	15/05/2045	IPCA + 7,33%	947.095,85	1.500.098,50	-	1.500.098,50	1,96%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	19/06/2018	15/05/2055	IPCA + 5,92%	1.261.769,06	1.756.847,12	-	1.756.847,12	2,30%
TOTAL						76.479.046,69	-	76.479.046,69	100,01 %

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano			
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	100,00%	0,00%
Títulos Públicos Federais	100,00%	100,00%	0,00%
CDI/CDBs	80,00%	0,00%	80,00%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	0,00%	80,00%
Debêntures	20,00%	0,00%	20,00%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	0,00%	20,00%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,00%	20,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	0,00%	25,00%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	0,00%	25,00%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	0,00%	20,00%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	0,00%	15,00%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	0,00%	10,00%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	0,00%	10,00%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	0,00%	10,00%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

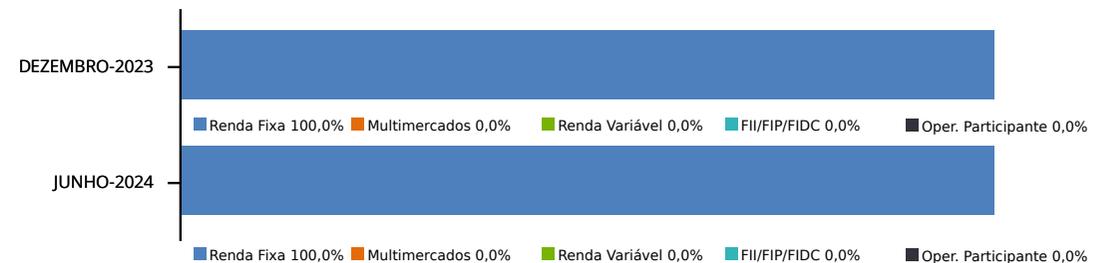
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹			
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	100,00%	FITCH MOODY'S S&P AUSTIN
Tesouro Nacional	100,00%	100,00%	- - brAAA -

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



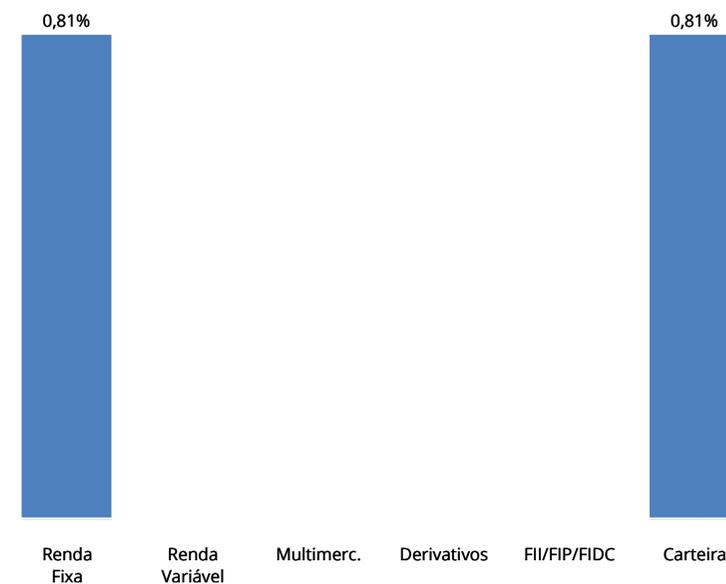
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Compromissada - Títulos Públicos	0,79	133,6%	5,22	107,6%	11,68	143,3%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	0,82	139,6%	5,54	114,2%	9,99	122,6%

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,59	4,85	8,15
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,59	4,85	8,15
Op. com Participante (0% CDI)	0,00	0,00	0,00
CDI	0,79	5,22	11,69
IPCA	0,21	2,48	4,23
INPC	0,25	2,68	3,70
Ibovespa	1,48	-7,66	4,93
Dólar	6,05	14,82	15,35

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,81	5,46	9,89
Renda Variável	0,00	0,00	0,00
Investimentos Estruturados	0,00	0,00	0,00
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

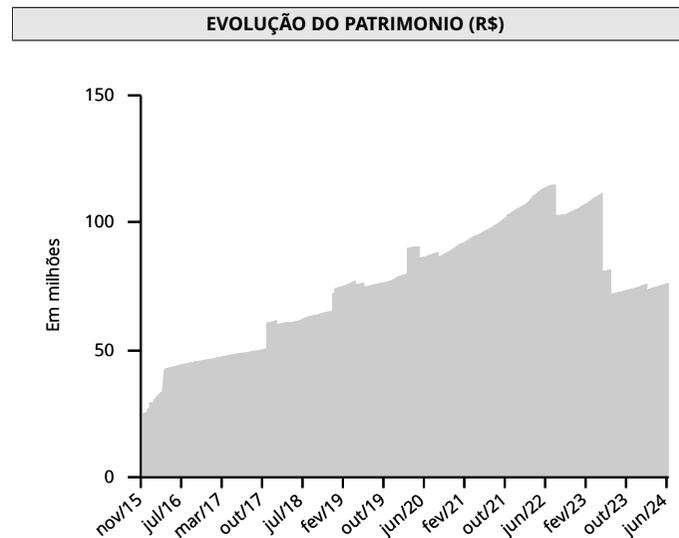
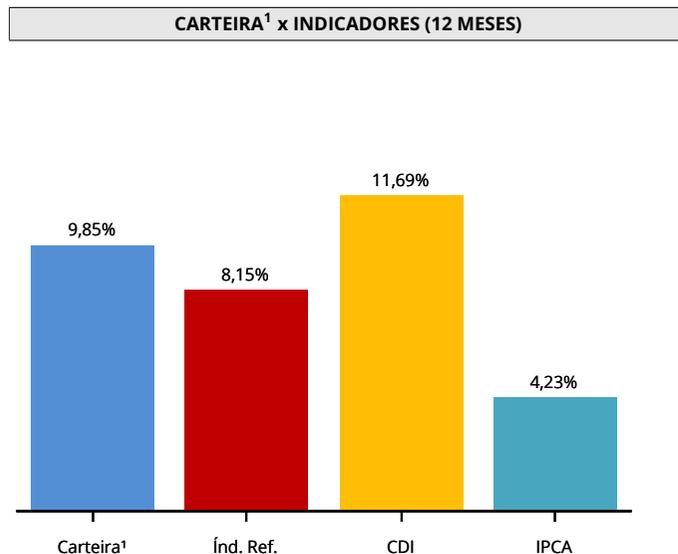
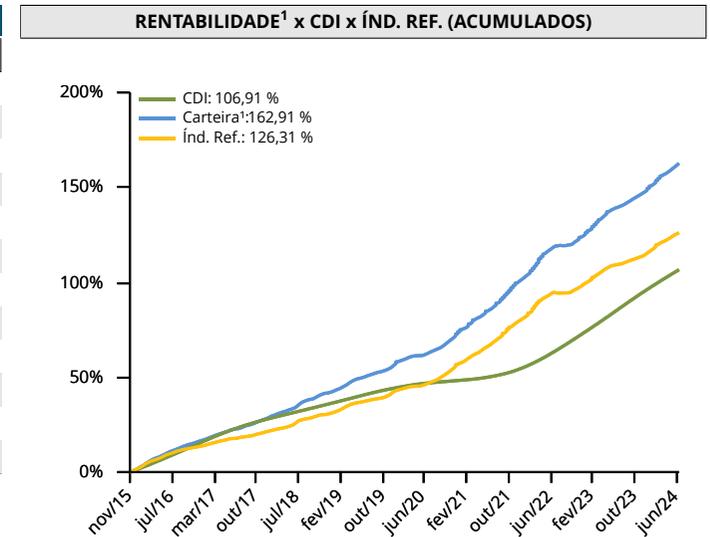
COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA



RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	NO ANO
RENDA FIXA	764.914,68	745.454,28	731.279,11	536.195,15	651.239,02	623.258,35	4.052.340,59
Compromissada - Títulos Públicos	26.655,58	19.867,96	8.046,61	8.537,47	13.887,03	18.348,11	95.342,76
Notas do Tesouro Nacional - Série B	738.259,10	725.586,32	723.232,50	527.657,68	637.351,99	604.910,24	3.956.997,83
TOTAL	764.914,68	745.454,28	731.279,11	536.195,15	651.239,02	623.258,35	4.052.340,59

RESULTADOS DE 2024			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	1,01	0,94	106,57%
Fevereiro	0,98	1,13	86,76%
Março	0,98	0,53	184,39%
Abril	0,70	0,74	94,68%
Mai	0,85	0,82	104,36%
Junho	0,81	0,59	137,22%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	5,45	4,85	112,35%

INDICADORES DE MERCADO				
CDI	IPCA	INPC	Ibovespa	Dólar
0,97	0,42	0,57	(4,79)	2,32
0,80	0,83	0,81	0,99	0,60
0,83	0,16	0,19	(0,71)	0,26
0,89	0,38	0,37	(1,70)	3,51
0,83	0,46	0,46	(3,04)	1,35
0,79	0,21	0,25	1,48	6,05
5,22	2,48	2,68	(7,66)	14,82



RESULTADOS DE 2023			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	1,20	0,83	144,42%
Fevereiro	1,00	1,08	92,83%
Março	1,46	1,03	141,72%
Abril	0,93	0,84	110,81%
Mai	1,03	0,73	140,24%
Junho	0,50	0,26	195,38%
Julho	0,48	0,27	180,58%
Agosto	0,72	0,59	121,37%
Setembro	0,68	0,45	150,75%
Outubro	0,69	0,48	145,45%
Novembro	0,67	0,44	152,79%
Dezembro	0,86	0,89	96,92%
Total	10,71	8,16	131,14%

¹A rentabilidade da carteira é baseado na cota Bruta

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
Rent. Líquida	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%
Índice Ref.	0,73%	0,88%	1,09%	0,96%	0,52%	0,33%	0,49%	0,49%	0,31%	0,43%	0,88%	1,58%	9,04%

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,53%	0,76%	0,37%	0,04%	0,47%	0,86%	0,75%	0,87%	1,29%	1,25%	1,64%	10,61%
Rent. Líquida	1,30%	0,53%	0,76%	0,37%	0,04%	0,47%	0,86%	0,75%	0,87%	1,29%	1,25%	1,64%	10,61%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,77%
Índice Ref.	0,56%	0,48%	0,55%	0,11%	0,09%	0,66%	0,83%	0,72%	1,23%	1,25%	1,29%	1,84%	10,02%

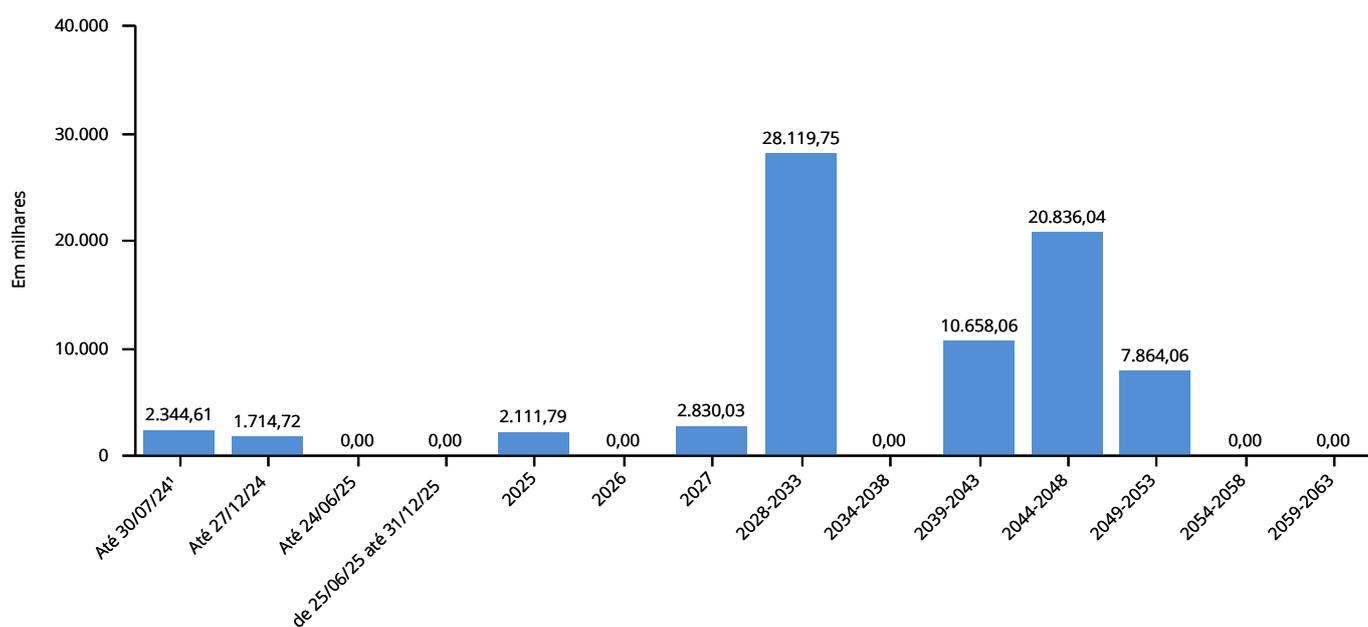
2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
Rent. Líquida	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,39%
Índice Ref.	0,61%	1,13%	1,25%	0,72%	1,32%	0,96%	1,40%	1,26%	1,56%	1,50%	1,18%	1,12%	14,93%

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%	0,00%	0,16%	0,69%	0,92%	0,89%	11,75%
Rent. Líquida	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%	0,00%	0,16%	0,69%	0,92%	0,89%	11,75%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,37%
Índice Ref.	1,03%	1,32%	2,09%	1,36%	0,82%	0,98%	-0,25%	0,08%	0,03%	0,81%	0,72%	1,06%	10,52%

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,20%	1,00%	1,46%	0,93%	1,03%	0,50%	0,48%	0,72%	0,68%	0,69%	0,67%	0,86%	10,71%
Rent. Líquida	1,20%	1,00%	1,46%	0,93%	1,03%	0,50%	0,48%	0,72%	0,68%	0,69%	0,67%	0,86%	10,71%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%
Índice Ref.	0,83%	1,08%	1,03%	0,84%	0,73%	0,26%	0,27%	0,59%	0,45%	0,48%	0,44%	0,89%	8,16%

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,01%	0,98%	0,98%	0,70%	0,85%	0,81%							5,45%
Rent. Líquida	1,01%	0,98%	0,98%	0,70%	0,85%	0,81%							5,45%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%							5,22%
Índice Ref.	0,94%	1,13%	0,53%	0,74%	0,82%	0,59%							4,85%

MAPA DE VENCIMENTOS DOS ATIVOS DA CARTEIRA



¹ São considerados títulos e fundos categorizados como a negociação

² Dados de referência calculados com mês anterior

Relatório mensal

Icatu Vanguarda Jusprev FIC FIM CP

Junho 2024

Cenário

Os desdobramentos políticos produziram efeitos inesperados sobre os preços dos ativos em algumas regiões do globo ao longo do último mês. Coincidência ou não, os movimentos de estresse ocorreram ao fim de um semestre de reprecificação das curvas de juros por conta do adiamento do início do processo de corte de juros nos EUA. Se até o momento as dúvidas eram concentradas nos próximos passos do Fed, agora, questiona-se também que vetor deve ser preponderante sobre o comportamento dos mercados no segundo semestre: o político ou o relacionado ao ciclo econômico.

Nos EUA, o debate realizado no final de junho antecipou as discussões sobre quem será o próximo presidente. Apesar das divergências de pautas e impactos econômicos, o grande foco do embate entre Biden e Trump foi a capacidade mental e física do incumbente de 81 anos de continuar governando o país por mais 4 anos. A instabilidade nas respostas, com difícil compreensão em algumas delas, implicou em uma redução da probabilidade de vitória do representante democrata.

No que tange ao cenário econômico, o último mês mostrou uma dinâmica favorável à tese de desinflação nos EUA, com leituras abaixo das expectativas tanto no CPI quanto no PCE. Além disso, houve mais evidências de redução do desequilíbrio observado no mercado de trabalho após a pandemia – apontado como uma das principais causas do nível e da resiliência da inflação de serviços. A razão entre vagas abertas e o número de desempregados nos EUA voltou para nível similar ao observado antes da pandemia.

Mesmo diante de dados melhores de inflação, a última reunião do FOMC foi mais dura do que o esperado pelo mercado. A mediana das projeções para o juro no final de 2024 que antes indicava três cortes passou a indicar apenas um. O que ainda permite maior paciência do Fed para começar o processo de cortes é o ritmo forte de criação de empregos. No entanto, as recentes comunicações indicam uma reação rápida a sinais de deterioração no mercado de trabalho.

No Brasil, a dinâmica interna tem sido de deterioração significativa das expectativas para inflação e dos prêmios de risco nos ativos de forma geral. A instabilidade, que teve início com a piora no ambiente externo, e que se misturou a questionamentos às políticas fiscal e monetária teve um de seus capítulos parcialmente encerrados. O Banco Central decidiu de forma unânime interromper o ciclo de queda nos juros. A composição dos votos foi importante como uma tentativa de sinalizar ao mercado que as decisões do Comitê serão tomadas de forma técnica, independente da origem da indicação dos diretores.

O foco no mês de junho foi o risco fiscal. O ajuste pelo lado da receita aparenta ser cada vez mais difícil de ocorrer e o governo não tem demonstrado vontade para tomar as medidas necessárias para manter o arcabouço fiscal de pé. O resultado tem sido uma forte depreciação do câmbio e, por consequência, a precificação de alta nos juros ainda este ano. Durante o mês de julho será importante acompanhar possíveis desdobramentos da política fiscal. Sem uma mudança de rota e continuidade de deterioração dos prêmios de risco, o Banco Central poderá agir com aumento da taxa básica.

Rentabilidade

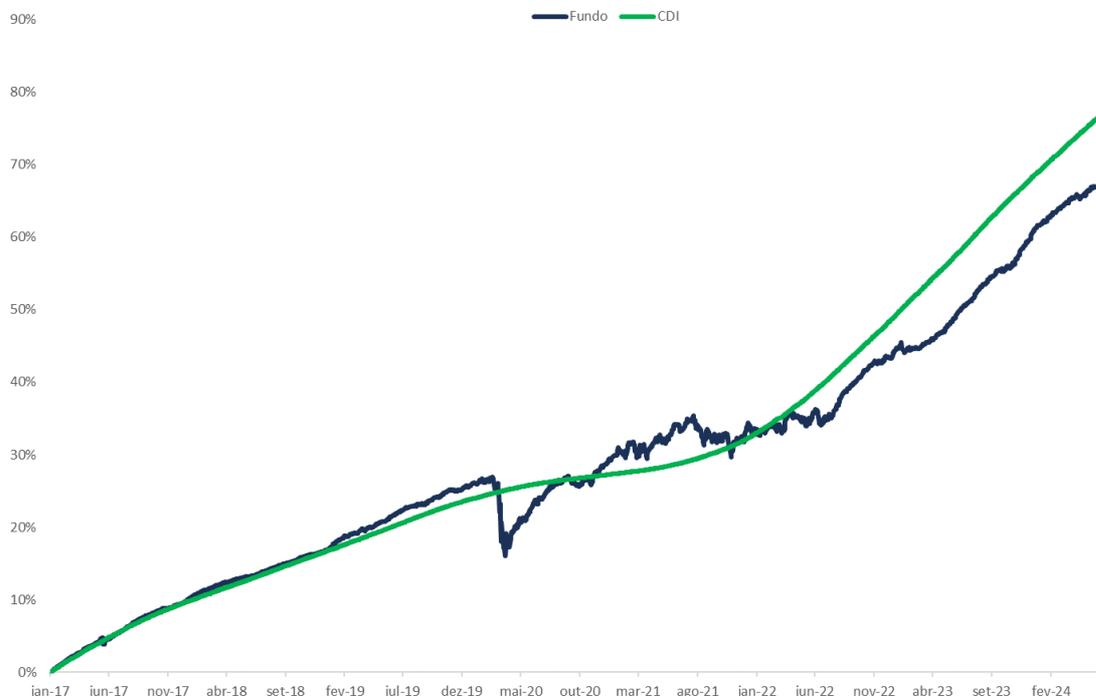
CDI	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2023
Fundo	0,03%	-0,04%	0,74%	0,79%	1,32%	1,29%	1,32%	1,03%	0,82%	0,39%	1,90%	1,45%	11,61%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%
INPC + 4,35%*	0,83%	1,08%	1,03%	0,84%	0,73%	0,26%	0,27%	0,59%	0,45%	0,48%	0,44%	0,89%	8,16%
Bench 2023	1,32%	0,51%	0,97%	0,97%	1,25%	1,43%	1,23%	0,90%	0,89%	0,73%	1,61%	1,20%	13,81%

CDI	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Fundo	0,85%	0,74%	0,82%	0,11%	0,78%	0,72%							4,08%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%							5,22%
INPC + 4,35%	0,94%	1,13%	0,53%	0,74%	0,82%	0,59%							4,85%
Bench 2024	0,79%	0,94%	0,87%	0,78%	0,79%	1,05%							5,33%

	12m	24m	36m
Fundo	11,48%	24,77%	25,63%
CDI	11,69%	26,82%	37,79%
%CDI	98,23%	92,38%	67,81%

Rentabilidade acumulada

Rentabilidade Acumulada



Performance Individuais

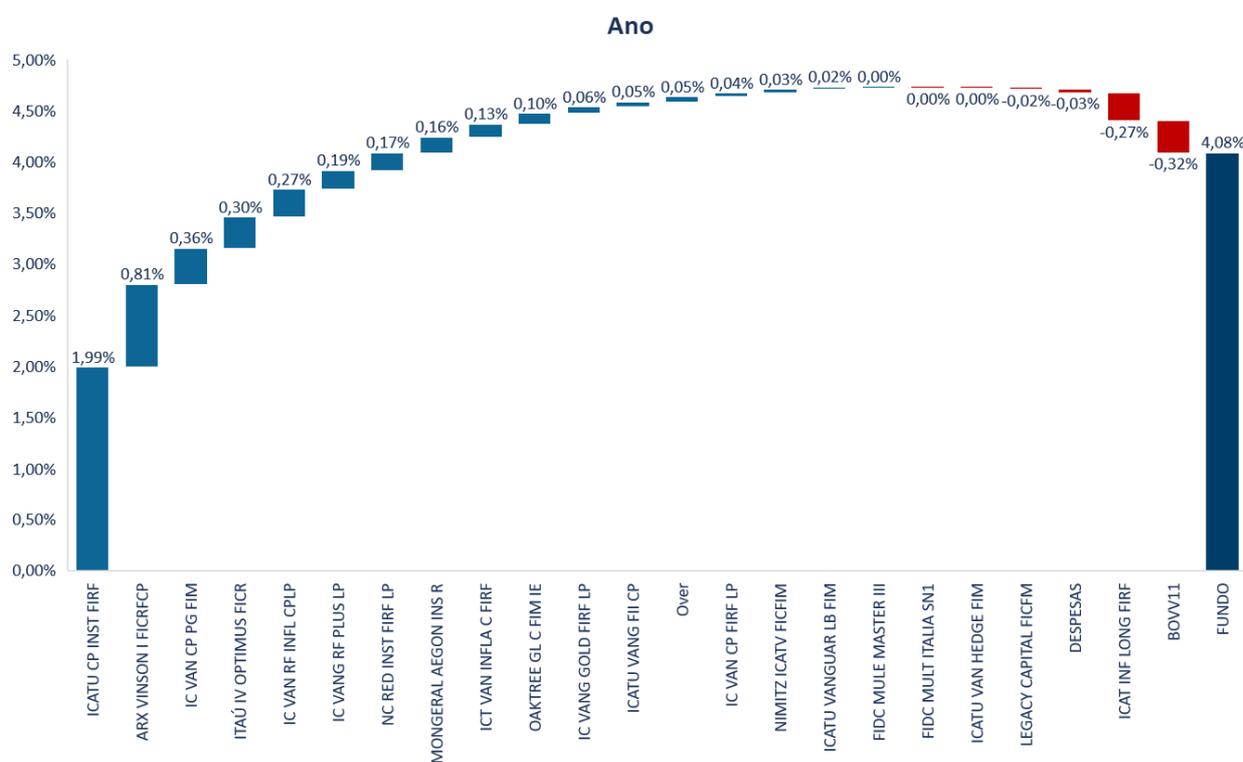
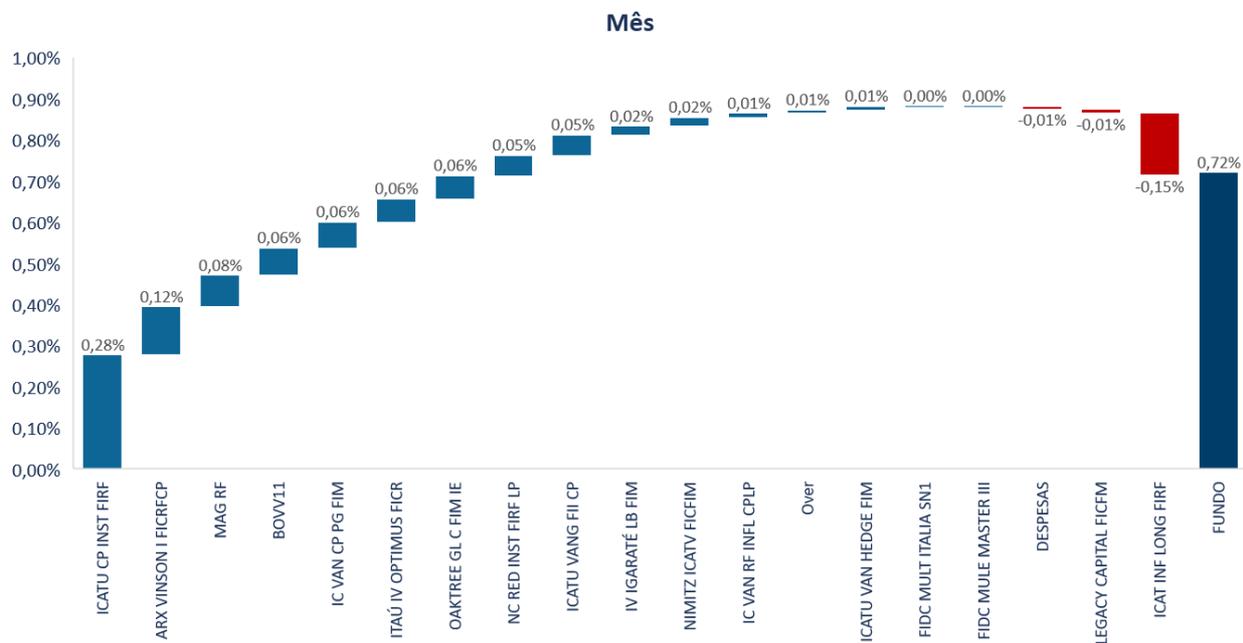
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	1,04%	0,85%	0,91%	0,71%	0,87%	0,83%	-	-	-	-	-	-	5,32%
Icatu Vanguarda CP Institucional FIRF	1,62%	1,10%	1,13%	1,06%	0,97%	0,98%	-	-	-	-	-	-	7,06%
Nc Red Institucional FIRF	0,67%	0,33%	0,63%	-0,33%	1,17%	0,85%	-	-	-	-	-	-	3,37%
Icatu Vanguarda PG FIM CP	1,78%	1,08%	1,17%	1,03%	0,93%	0,89%	-	-	-	-	-	-	7,07%
Arx Vinson FIC FIRF CP	1,23%	0,94%	1,16%	0,93%	0,90%	1,07%	-	-	-	-	-	-	6,39%
Itaú Iv Optimus RF LP Ficf	0,88%	0,68%	0,95%	0,99%	1,09%	1,16%	-	-	-	-	-	-	5,89%
Legacy Capital FICFI MM	0,46%	-0,40%	1,22%	-2,37%	0,45%	-0,29%	-	-	-	-	-	-	-0,95%
Nimitz IV FIC FIM	0,32%	0,41%	1,31%	-1,02%	-0,40%	1,59%	-	-	-	-	-	-	2,21%
Icatu Vanguarda Hedge FIM	0,80%	-0,75%	0,11%	-1,43%	0,64%	0,64%	-	-	-	-	-	-	0,00%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	-	-	-	-	-	-	5,22%
Icatu Vanguarda Inflação CP FIRF LP	1,23%	0,89%	0,91%	-0,66%	1,20%	0,11%	-	-	-	-	-	-	3,72%
IMAB-5	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	1,05%	0,39%	-	-	-	-	-	-	3,32%
Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	-1,49%	0,47%	-0,57%	-2,94%	1,56%	-2,25%	-	-	-	-	-	-	-5,17%
IMAB-5+	-1,47%	0,51%	-0,55%	-2,91%	1,59%	-2,25%	-	-	-	-	-	-	-5,04%
Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	1,02%	0,66%	0,53%	-0,19%	-1,33%	2,57%	-	-	-	-	-	-	3,27%
IFIX	0,66%	0,81%	1,43%	-0,79%	0,03%	-1,03%	-	-	-	-	-	-	1,09%
BOVV11	-4,80%	1,04%	-0,84%	-1,67%	-3,00%	1,55%	-	-	-	-	-	-	-7,60%
Icatu Vanguarda Long Biased FIM	-0,96%	0,89%	1,32%	-1,51%	0,25%	1,25%	-	-	-	-	-	-	1,20%
IBOV	-4,79%	0,99%	-0,71%	-1,70%	-3,04%	1,48%	-	-	-	-	-	-	-7,66%
IBX	-4,51%	0,96%	-0,73%	-1,34%	-3,18%	1,51%	-	-	-	-	-	-	-7,19%
Oaktree Global Credit Brl FI MM Ie	1,13%	0,63%	1,25%	0,17%	1,37%	1,42%	-	-	-	-	-	-	6,11%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	-	-	-	-	-	-	5,22%

Alocação

ESTRATÉGIA	FUNDOS	% PL	
CDI	Nc Red Institucional FIRF	6,0%	
	Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	11,5%	23,4%
	Itaú IV Optimus FICR	6,0%	
Inflação Curta	Icatu Vanguarda Inflação CP FIRF LP	9,8%	9,8%
Inflação Longa	Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	6,7%	6,7%
Crédito Privado	Icatu Vanguarda Crédito Privado Institucional FIRF	28,2%	
	Arx Vinson FIC FIRF CP	7,5%	42,9%
	Icatu Vanguarda PG FIM CP	7,2%	
Investimento Estruturado	Legacy Capital FICFI MM	1,2%	
	Nimitz IV FIC FIM	1,3%	3,8%
	Icatu Vanguarda Hedge FIM	1,3%	
Imobiliário	Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	1,9%	1,9%
Renda Variável	Icatu Vanguarda Igaratê LB FIM	2,0%	6,0%
	BOVV11	4,0%	
FIDC	FIDC Mult. Italia	0,1%	0,1%
	FIDC MULE MASTER III	0,0%	
Investimento Exterior	Oaktree Global Credit Brl FI MM Ie	4,0%	4,0%
Caixa	-	1,5%	1,5%

Alocação	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24
CDI	17,2%	20,5%	14,7%	16,9%	18,0%	23,4%
Crédito	42,8%	42,8%	42,6%	49,7%	48,6%	42,9%
Inflação Curta	17,3%	10,0%	9,9%	9,7%	10,0%	9,8%
Inflação Longa	1,8%	3,0%	4,9%	6,7%	6,6%	6,7%
Multimercado	13,6%	13,5%	14,0%	6,5%	4,9%	3,8%
Renda Variável	5,0%	5,9%	6,0%	4,9%	5,0%	6,0%
FIDC's	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%
Imobiliário	2,0%	2,0%	2,0%	1,9%	1,9%	1,9%
Exterior	-	-	2,7%	2,7%	4,0%	4,0%
Caixa	0,2%	2,2%	3,2%	0,9%	1,2%	1,5%

P&L



Movimentações

Fundo	Classe Fundo						Data	% Fin.	Data Cotização (Resgates)	Data Liquidação (Resgates)
	CDI	Crédito Privado	Inflação	Estruturado	Renda Variável	Invest. Exterior				
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP BOVV11			302.500,00				03/06/2024	0,12%	-	-
					178.760,72		07/06/2024	0,07%	-	-
Icatu Vanguarda Long Biased FI MM Mag RF FI					2.473.000,00		10/06/2024	1,00%	-	-
	-2.473.000,00						10/06/2024	-1,00%	10/06/2024	10/06/2024
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP Mag RF FI			365.000,00				11/06/2024	0,15%	-	-
	2.475.000,00						11/06/2024	1,00%	-	-
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP BOVV11			284.000,00				14/06/2024	0,11%	-	-
					206.528,84		17/06/2024	0,08%	-	-
Itaú Iv Optimus RF LP FICFI Mag RF FI	4.875.000,00						18/06/2024	1,96%	-	-
	8.455.000,00						18/06/2024	3,40%	-	-
Nc RF Red Institucional FI LP BOVV11	430.000,00						18/06/2024	0,17%	-	18/06/2024
					-147.972,46		21/06/2024	-0,06%	21/06/2024	25/06/2024
					-162.123,05		27/06/2024	-0,06%	27/06/2024	01/07/2024