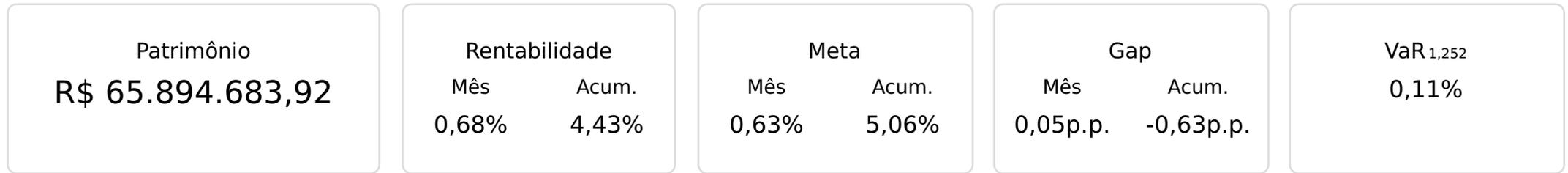




ITAPREVI

 Junho/2024





Evolução do Patrimônio

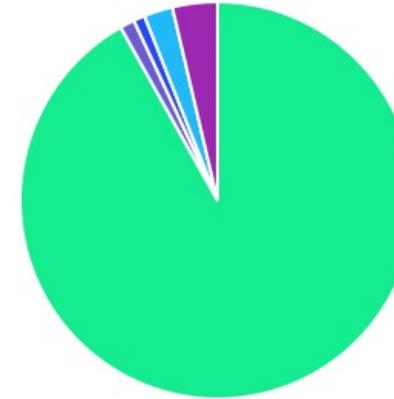


Comparativo (Rentabilidades | Metas)

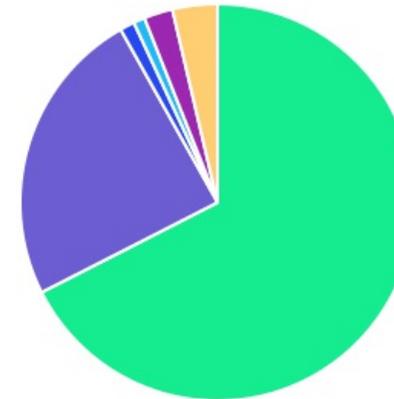


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 20.667.264,11	31,38%	D+0	7, I "b"	R\$ 126.826,44	0,60%	0,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF	R\$ 18.946.086,95	28,77%	D+0	7, I "b"	R\$ 36.903,08	0,20%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 451.755,56	0,69%	D+0	7, I "b"	R\$ 768,72	0,17%	0,40%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RE...	R\$ 2.759.014,78	4,19%	0	7, I "b"	R\$ 31.806,33	1,17%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF	R\$ 1.648.661,64	2,50%	D+0	7, I "b"	R\$ 6.116,20	0,37%	0,20%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	R\$ 5.534.894,42	8,40%	D+0	7, III "a"	R\$ 44.939,81	0,82%	0,20%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	R\$ 396.495,90	0,60%	D+0	7, III "a"	R\$ 2.564,68	0,45%	0,80%
CAIXA RUBI RENDA FIXA REFERENCIADO FIC RF	R\$ 1.842.644,89	2,80%	D+0	7, III "a"	R\$ 14.770,62	0,81%	0,30%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	R\$ 5.977.430,24	9,08%	D+0	7, III "a"	R\$ 47.137,94	0,79%	0,20%
CAIXA SIGMA RENDA FIXA REF DI LONGO PRA...	R\$ 2.261.794,47	3,43%	D+0	7, III "a"	R\$ 17.277,09	0,77%	0,35%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPP...	R\$ 788.694,70	1,20%	D+32	8, I	R\$ 13.765,94	1,78%	1,72%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	R\$ 611.861,27	0,93%	D+3	9, III	R\$ 69.106,02	12,73%	0,70%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO...	R\$ 251.688,05	0,38%	D+1	10, I	R\$ 9.448,39	3,90%	0,80%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	R\$ 1.301.320,45	1,98%	D+0	10, I	R\$ 8.587,38	0,66%	0,70%
IMÓVEIS	R\$ 2.425.000,00	3,00%	-	-	-	-	-
Total investimentos	R\$ 65.864.607,43	100.00%			R\$ 430.018,64	0,68%	
Disponibilidade	R\$ 30.076,49	-			-	-	
Total patrimônio	R\$ 65.894.683,92	100.00%			-	-	

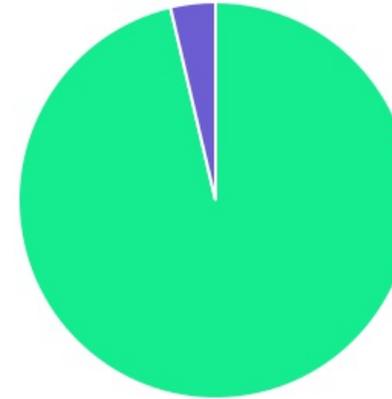
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	91,83%	R\$ 60.486.042,96	
Imóveis	3,68%	R\$ 2.425.000,00	
Estruturados	2,36%	R\$ 1.553.008,50	
Renda Variável	1,20%	R\$ 788.694,70	
Exterior	0,93%	R\$ 611.861,27	
Total	100,00%	R\$ 65.864.607,43	



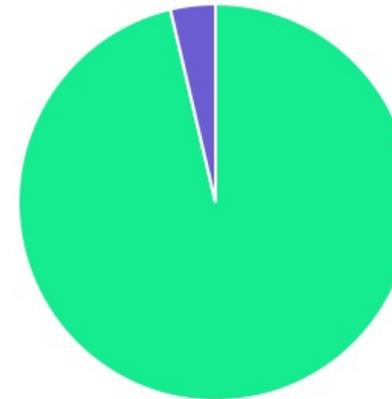
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	67,52%	R\$ 44.472.783,04	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	24,31%	R\$ 16.013.259,92	
Imóveis	3,68%	R\$ 2.425.000,00	
Artigo 10, Inciso I	2,36%	R\$ 1.553.008,50	
Artigo 8º, Inciso I	1,20%	R\$ 788.694,70	
Artigo 9º, Inciso III	0,93%	R\$ 611.861,27	
Total	100,00%	R\$ 65.864.607,43	



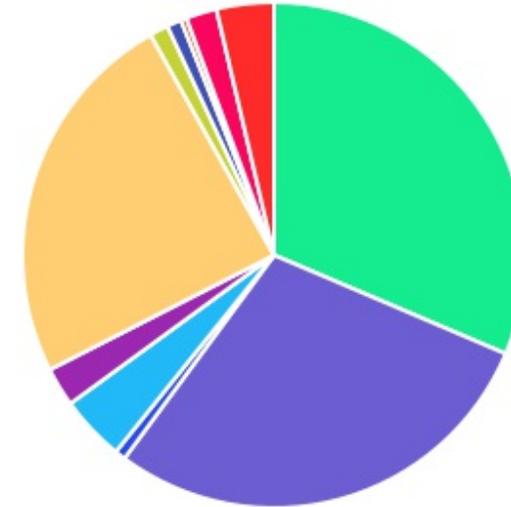
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	96,32%	R\$ 63.439.607,43	
IMÓVEIS	3,68%	R\$ 2.425.000,00	
Total	100,00%	R\$ 65.864.607,43	



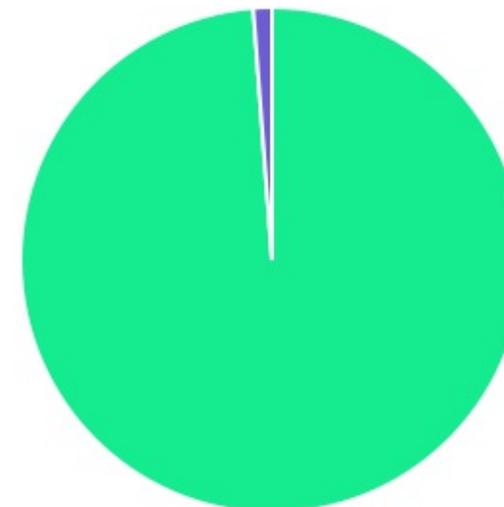
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	96,32%	R\$ 63.439.607,43	
IMÓVEIS	3,68%	R\$ 2.425.000,00	
Total	100,00%	R\$ 65.864.607,43	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IRF-M 1	31,38%	R\$ 20.667.264,11	
IDKA IPCA 2A	28,77%	R\$ 18.946.086,95	
CDI	24,31%	R\$ 16.013.259,92	
IPCA	4,19%	R\$ 2.759.014,78	
IMÓVEIS	3,68%	R\$ 2.425.000,00	
IMA-B 5	2,50%	R\$ 1.648.661,64	
125% do CDI	1,98%	R\$ 1.301.320,45	
IDIV	1,20%	R\$ 788.694,70	
GLOBAL BDRX	0,93%	R\$ 611.861,27	
IMA Geral ex-C	0,69%	R\$ 451.755,56	
S&P 500	0,38%	R\$ 251.688,05	
Total	100,00%	R\$ 65.864.607,43	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	98,80%	R\$ 65.075.912,73	■
31 a 180 dias	1,20%	R\$ 788.694,70	■
Total	100,00%	R\$ 65.864.607,43	



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

RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	10,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 44.472.783,04	70.10%	30,00%	50,00%	100,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	100,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 16.013.259,92	25.24%	0,00%	15,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	4,00%	20,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 60.486.042,96	95,34%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 788.694,70	1.24%	0,00%	10,00%	30,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	30,00%
Total Renda Variável		R\$ 788.694,70	1,24%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	10,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	10,00%
FI Ações - BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 611.861,27	0.96%	0,00%	5,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 611.861,27	0,96%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 1.553.008,50	2,45%	0,00%	5,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Fundos Estruturados		R\$ 1.553.008,50	2,45%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 63.439.607,43	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2024			IPCA + 5.1% a.a.			
Janeiro	R\$ 61.489.331,75	R\$ 61.117.706,48	0,84%	R\$ 508.164,27	0,86%	0,03p.p.
Fevereiro	R\$ 61.117.706,48	R\$ 61.893.296,12	1,25%	R\$ 444.625,11	0,75%	-0,50p.p.
Março	R\$ 61.893.296,12	R\$ 62.914.239,95	0,58%	R\$ 513.501,70	0,85%	0,27p.p.
Abril	R\$ 62.914.239,95	R\$ 63.616.244,91	0,80%	R\$ 186.465,40	0,31%	-0,49p.p.
Mai	R\$ 63.616.244,91	R\$ 64.852.008,57	0,88%	R\$ 562.012,65	0,91%	0,03p.p.
Junho	R\$ 64.852.008,57	R\$ 65.894.683,92	0,63%	R\$ 430.018,64	0,68%	0,05p.p.
Total	R\$ 64.852.008,57	R\$ 65.894.683,92	5,06%	R\$ 2.644.787,77	4,43%	-0,63p.p.
2023			IPCA + 4.9% a.a.			
Janeiro	R\$ 48.828.362,92	R\$ 48.635.556,86	0,93%	R\$ 582.351,31	1,26%	0,33p.p.
Fevereiro	R\$ 48.635.556,86	R\$ 49.373.562,49	1,24%	R\$ 308.366,51	0,65%	-0,59p.p.
Março	R\$ 49.373.562,49	R\$ 51.256.044,83	1,11%	R\$ 574.777,27	1,20%	0,09p.p.
Abril	R\$ 51.256.044,83	R\$ 51.304.045,24	1,01%	R\$ 421.781,22	0,86%	-0,15p.p.
Mai	R\$ 51.304.045,24	R\$ 53.505.597,75	0,63%	R\$ 509.918,98	1,03%	0,40p.p.
Junho	R\$ 53.505.597,75	R\$ 54.563.026,34	0,32%	R\$ 627.301,64	1,23%	0,91p.p.
Julho	R\$ 54.563.026,34	R\$ 54.352.016,19	0,52%	R\$ 562.954,73	1,09%	0,57p.p.
Agosto	R\$ 54.352.016,19	R\$ 55.364.138,24	0,63%	R\$ 526.771,06	1,00%	0,37p.p.
Setembro	R\$ 55.364.138,24	R\$ 56.519.170,23	0,66%	R\$ 401.395,20	0,74%	0,08p.p.
Outubro	R\$ 56.519.170,23	R\$ 57.162.037,32	0,64%	R\$ 281.697,59	0,51%	-0,12p.p.
Novembro	R\$ 57.162.037,32	R\$ 58.423.857,17	0,68%	R\$ 745.483,80	1,35%	0,67p.p.
Dezembro	R\$ 58.423.857,17	R\$ 61.489.331,75	0,96%	R\$ 646.304,20	1,13%	0,18p.p.
Total	R\$ 58.423.857,17	R\$ 61.489.331,75	9,75%	R\$ 6.189.103,51	12,73%	2,98p.p.

2022		IPCA + 5.04% a.a.				
Janeiro	R\$ 39.599.948,80	R\$ 39.087.386,56	0,95%	R\$ 100.917,28	0,28%	-0,67p.p.
Fevereiro	R\$ 39.087.386,56	R\$ 39.582.590,03	1,42%	R\$ 238.340,89	0,65%	-0,77p.p.
Março	R\$ 39.582.590,03	R\$ 41.197.658,73	2,03%	R\$ 888.213,44	2,33%	0,29p.p.
Abril	R\$ 41.197.658,73	R\$ 41.647.615,31	1,47%	R\$ 185.586,38	0,48%	-0,99p.p.
Maiο	R\$ 41.647.615,31	R\$ 43.119.363,72	0,88%	R\$ 328.492,97	0,82%	-0,06p.p.
Junho	R\$ 43.119.363,72	R\$ 43.312.315,54	1,08%	R\$ -101.750,95	-0,25%	-1,33p.p.
Julho	R\$ 43.312.315,54	R\$ 43.888.409,16	-0,27%	R\$ 169.591,91	0,43%	0,70p.p.
Agosto	R\$ 43.888.409,16	R\$ 43.503.025,82	0,05%	R\$ 302.018,04	0,72%	0,67p.p.
Setembro	R\$ 43.503.025,82	R\$ 45.222.140,11	0,12%	R\$ 261.135,61	0,63%	0,51p.p.
Outubro	R\$ 45.222.140,11	R\$ 46.809.002,09	1,00%	R\$ 727.347,27	1,71%	0,71p.p.
Novembro	R\$ 46.809.002,09	R\$ 46.379.092,23	0,82%	R\$ -161.955,12	-0,36%	-1,18p.p.
Dezembro	R\$ 46.379.092,23	R\$ 48.828.362,92	1,03%	R\$ 267.647,80	0,61%	-0,42p.p.
Total	R\$ 46.379.092,23	R\$ 48.828.362,92	11,12%	R\$ 3.205.585,52	8,33%	-2,79p.p.
2021		IPCA + 5.87% a.a.				
Janeiro	R\$ 31.284.654,99	R\$ 33.020.231,00	0,73%	R\$ -99.930,75	-0,31%	-1,04p.p.
Fevereiro	R\$ 33.020.231,00	R\$ 33.204.433,37	1,34%	R\$ -241.985,50	-0,75%	-2,09p.p.
Março	R\$ 33.204.433,37	R\$ 33.763.060,18	1,41%	R\$ 174.839,33	0,57%	-0,83p.p.
Abril	R\$ 33.763.060,18	R\$ 34.485.001,37	0,79%	R\$ 339.315,33	1,05%	0,27p.p.
Maiο	R\$ 34.485.001,37	R\$ 36.352.339,55	1,31%	R\$ 401.628,66	1,23%	-0,08p.p.
Junho	R\$ 36.352.339,55	R\$ 36.742.064,98	1,01%	R\$ -13.655,65	-0,03%	-1,04p.p.
Julho	R\$ 36.742.064,98	R\$ 37.019.692,73	1,44%	R\$ -150.334,10	-0,45%	-1,88p.p.
Agosto	R\$ 37.019.692,73	R\$ 36.568.084,56	1,35%	R\$ -90.528,98	-0,26%	-1,61p.p.

Setembro	R\$ 36.568.084,56	R\$ 37.827.882,98	1,64%	R\$ 54.017,76	0,14%	-1,49p.p.
Outubro	R\$ 37.827.882,98	R\$ 37.513.690,55	1,73%	R\$ -574.542,85	-1,61%	-3,33p.p.
Novembro	R\$ 37.513.690,55	R\$ 38.860.767,28	1,43%	R\$ 579.111,90	1,64%	0,21p.p.
Dezembro	R\$ 38.860.767,28	R\$ 39.599.948,80	1,21%	R\$ 288.903,69	0,79%	-0,41p.p.
Total	R\$ 38.860.767,28	R\$ 39.599.948,80	16,52%	R\$ 666.838,84	1,99%	-14,53p.p.

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	0,82%	5,36%	12,19%	27,40%	40,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES...	14.508.643/0001-55	0,45%	2,55%	5,12%	9,88%	16,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	0,17%	2,36%	7,39%	23,06%	28,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	0,60%	4,42%	10,53%	24,23%	33,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	0,37%	2,89%	-	-	3,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-	-	7,75%	8,45%	5,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	0,20%	2,95%	8,03%	18,00%	31,34%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	12,73%	39,52%	52,18%	72,57%	45,10%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS...	15.154.441/0001-15	1,78%	-3,39%	8,56%	27,99%	16,07%
CAIXA JUROS E...	14.120.520/0001-42	0,66%	4,26%	10,08%	-	20,91%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.154.220/0001-47	-	-	-28,20%	-35,73%	-36,32%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	10.577.512/0001-79	-	-	-38,85%	-50,90%	-53,19%
CAIXA BOLSA AMERICANA...	30.036.235/0001-02	3,90%	16,70%	29,37%	66,02%	43,82%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	23.215.008/0001-70	0,79%	5,23%	12,03%	27,21%	32,66%
CAIXA RUBI RENDA...	10.646.885/0001-54	0,81%	5,32%	12,11%	26,74%	36,70%
CAIXA SIGMA RENDA FIXA REF...	10.731.794/0001-17	0,77%	5,08%	11,36%	-	19,16%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS...	50.635.944/0001-03	1,17%	2,71%	-	-	6,12%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U. COMPRA	ATUAL	MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
Total Públicos							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Privados							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Global							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)

Cenário Econômico | Junho/2024

Setor Externo

Em junho, os mercados foram fortemente influenciados por eventos políticos. No México, o partido do atual presidente elegeu seu sucessor e obteve resultados expressivos na Câmara e no Senado, gerando aversão ao risco nos ativos mexicanos e impacto nos demais países da América Latina. Nas eleições do Parlamento Europeu, os partidos de centro confirmaram sua maioria, mas houve um avanço significativo dos partidos de direita. Na França, o resultado do primeiro turno das eleições parlamentares sinalizou uma possível vitória do partido de direita, que defende diretrizes contrárias às regras fiscais da União Europeia. Nos Estados Unidos, o primeiro debate presidencial aumentou a possibilidade de retorno do ex-presidente Trump.



A inflação nos EUA ficou abaixo das expectativas, sugerindo um progresso gradual. No mercado de trabalho, houve forte geração de empregos e

crescimento de salários, mas o número de vagas abertas diminuiu e o desemprego aumentou. O FOMC manteve a taxa de juros inalterada, elevou as projeções de inflação e indicou apenas um corte de juros para 2024. Na Europa, a economia mostrou fraqueza, com os PMIs de serviços e manufatura abaixo das expectativas. A inflação no bloco europeu mostrou alívio gradual, mas o componente de serviços progrediu lentamente. O Banco Central Europeu iniciou o afrouxamento monetário com um corte de 25 bps na taxa de juros, adotando uma postura conservadora para futuras decisões.

Na China, os dados de atividade ficaram aquém das expectativas, com desaceleração na atividade doméstica e piora nos indicadores do mercado imobiliário. No Japão, o Banco Central manteve a política monetária e anunciou um plano para reduzir seu balanço de ativos, com previsão de detalhes em julho. As minutas da reunião revelaram um debate sobre o progresso da inflação e a necessidade de reduzir a acomodação monetária se o cenário projetado em abril se confirmar.

Brasil

No Brasil, a atividade econômica surpreendeu positivamente, com destaque para a agricultura e o setor de serviços. O mercado de trabalho registrou queda no desemprego e crescimento robusto da massa salarial. A inflação, por sua vez, veio abaixo das expectativas, com destaque para a queda nos preços de passagens aéreas, embora a inflação de serviços permaneça alta. As finanças governamentais mostraram evolução preocupante, concentrando-se em aumentar receitas, mas o Congresso tem resistido a ajustes, como na devolução da MP que limitava o uso de créditos do PIS/COFINS. Medidas concretas de controle de gastos são necessárias para garantir a sustentabilidade fiscal.

Diante desse cenário, o Copom interrompeu o ciclo de cortes de juros, elevou as projeções de inflação e de juro neutro, e ajustou o hiato de produto para neutro. Além disso, o governo publicou o decreto que estabelece a meta contínua de inflação.

Reider Ferreira Puxoto

SETE CAPITAL CONSULTORIA LTDA.
CNPJ: 14.057.808/0001-10