

2024

Relatório Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Junho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.212.116,91	29,63%	4.649.802.742,18	0,05%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	447.296,45	5,99%	197.669.973,94	0,23%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	883.547,35	11,84%	1.312.208.437,83	0,07%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	964.330,45	12,92%	476.058.771,06	0,20%	7º I b
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	898.299,22	12,03%	7.377.738.310,48	0,01%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	307.259,10	4,12%	649.126.137,40	0,05%	8º I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	836.615,76	11,21%	217.889.058,81	0,38%	8º I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	915.361,94	12,26%	400.466.578,46	0,23%	9º III

Investimentos

\$ 7.464.827,18

Disponibilidades Financeiras

\$ 3.092.510,44

Total Carteira

\$ 10.557.337,62

Governança (Pró Gestão)

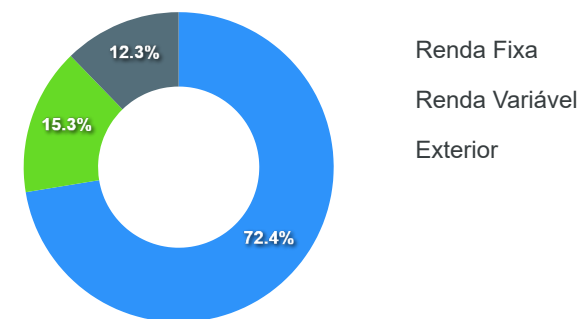
📄

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	60,38%	4.507.291,16 39,62%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	12,03%	898.299,22 47,97%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	15,32%	1.143.874,86 14,68%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	12,26%	915.361,94 -2,26%

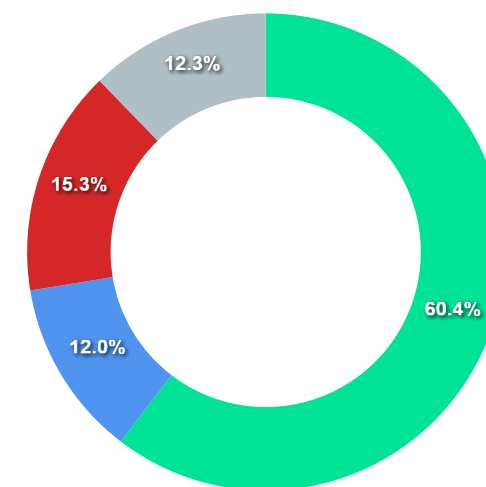
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos

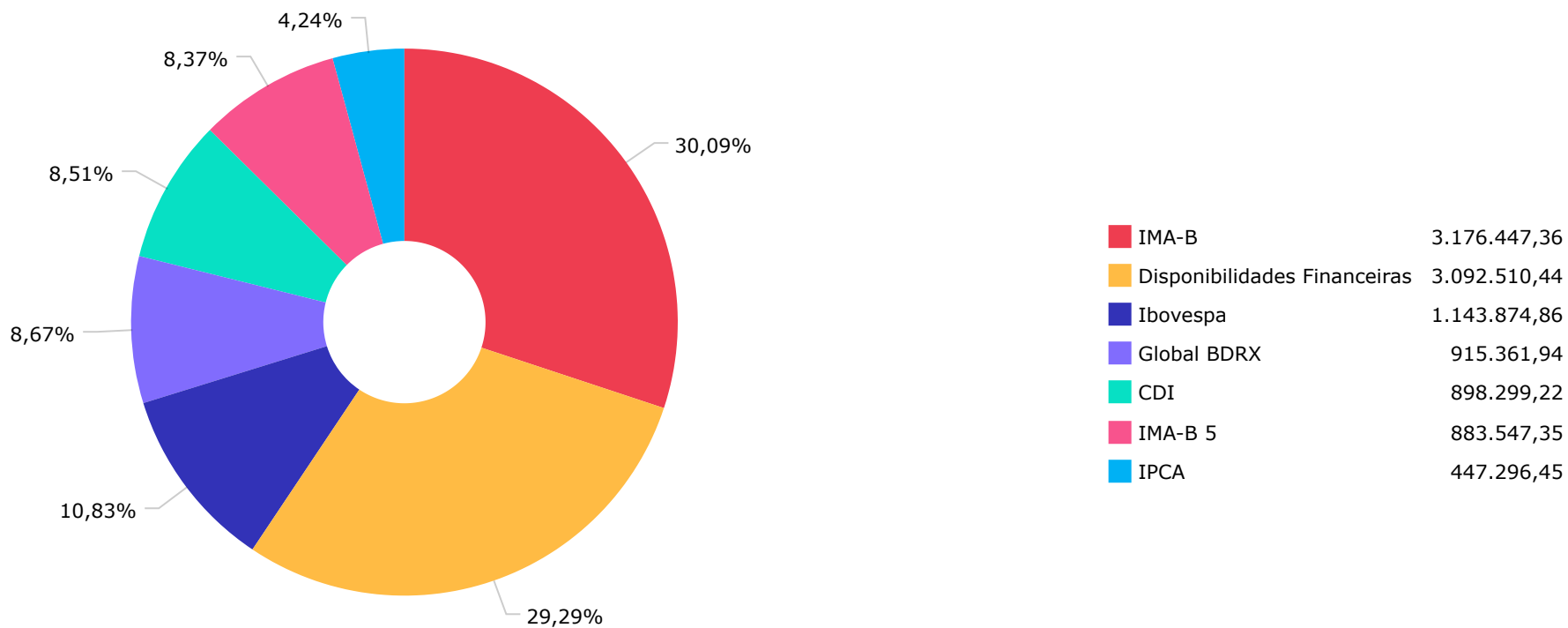


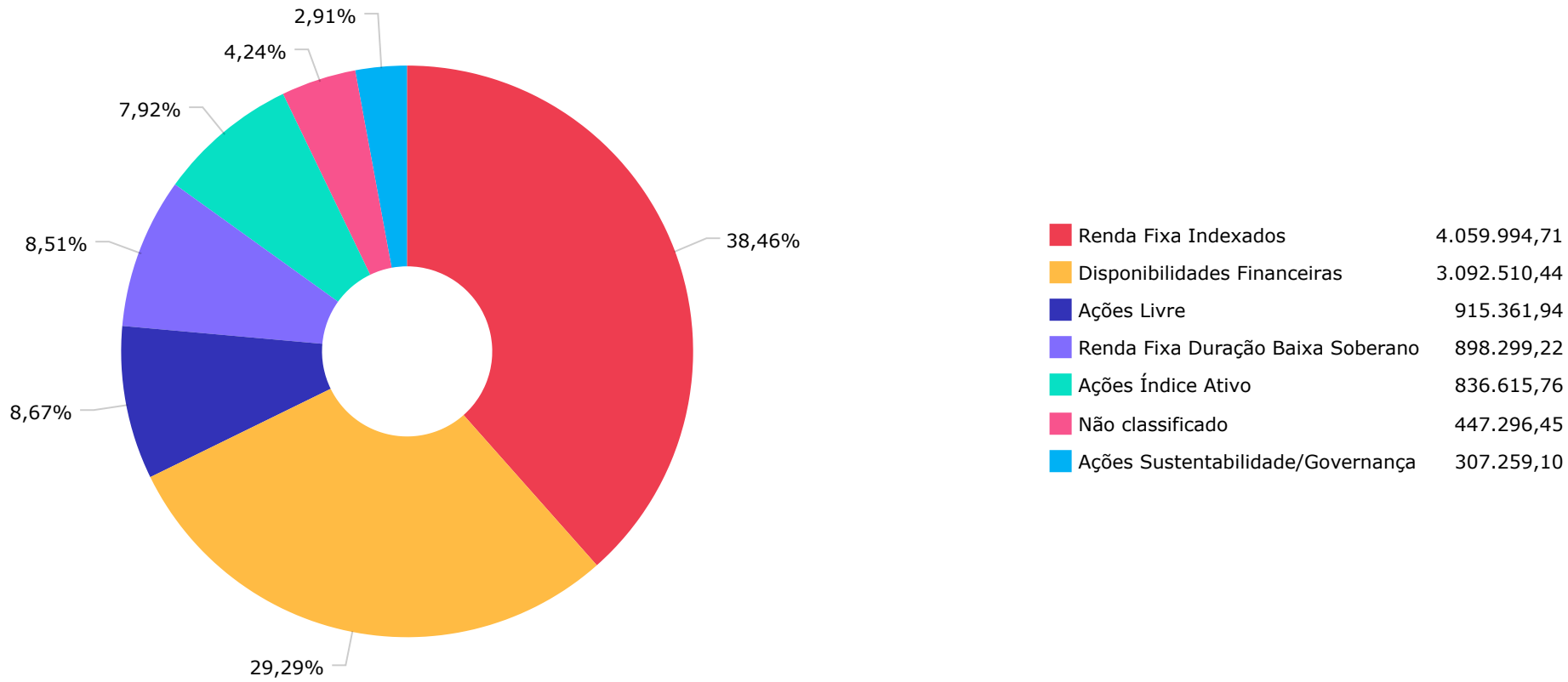
Artigos

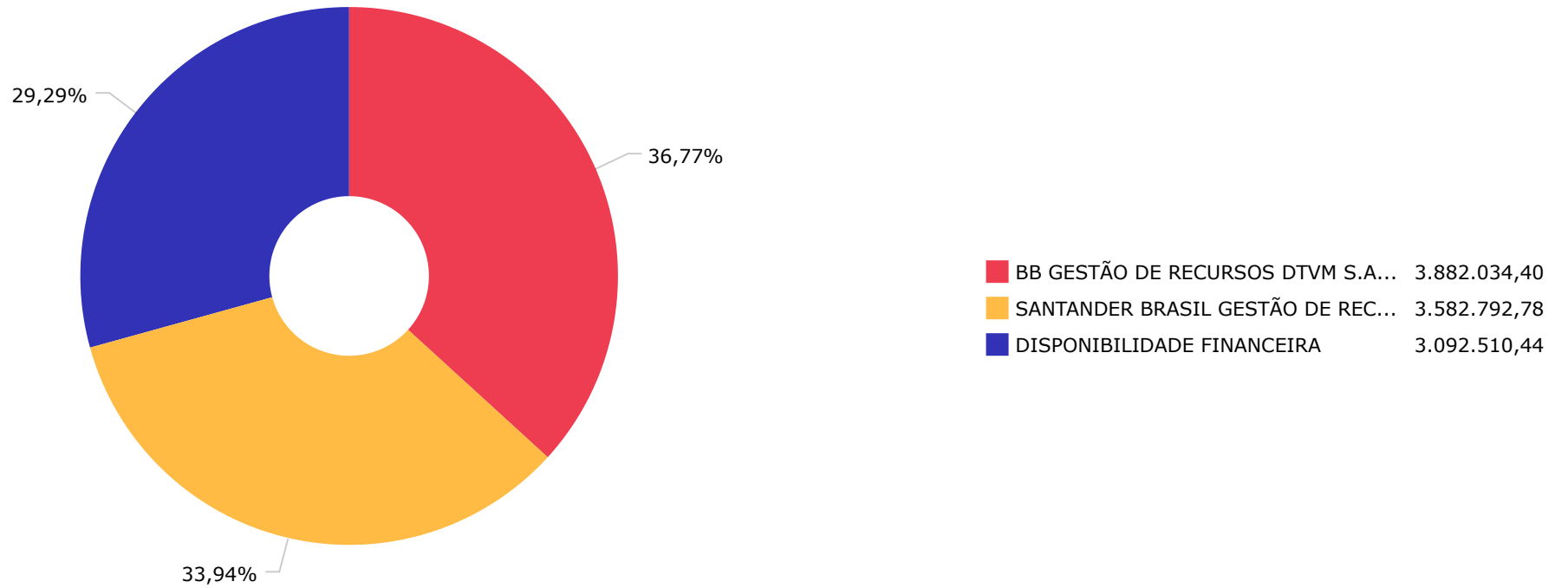


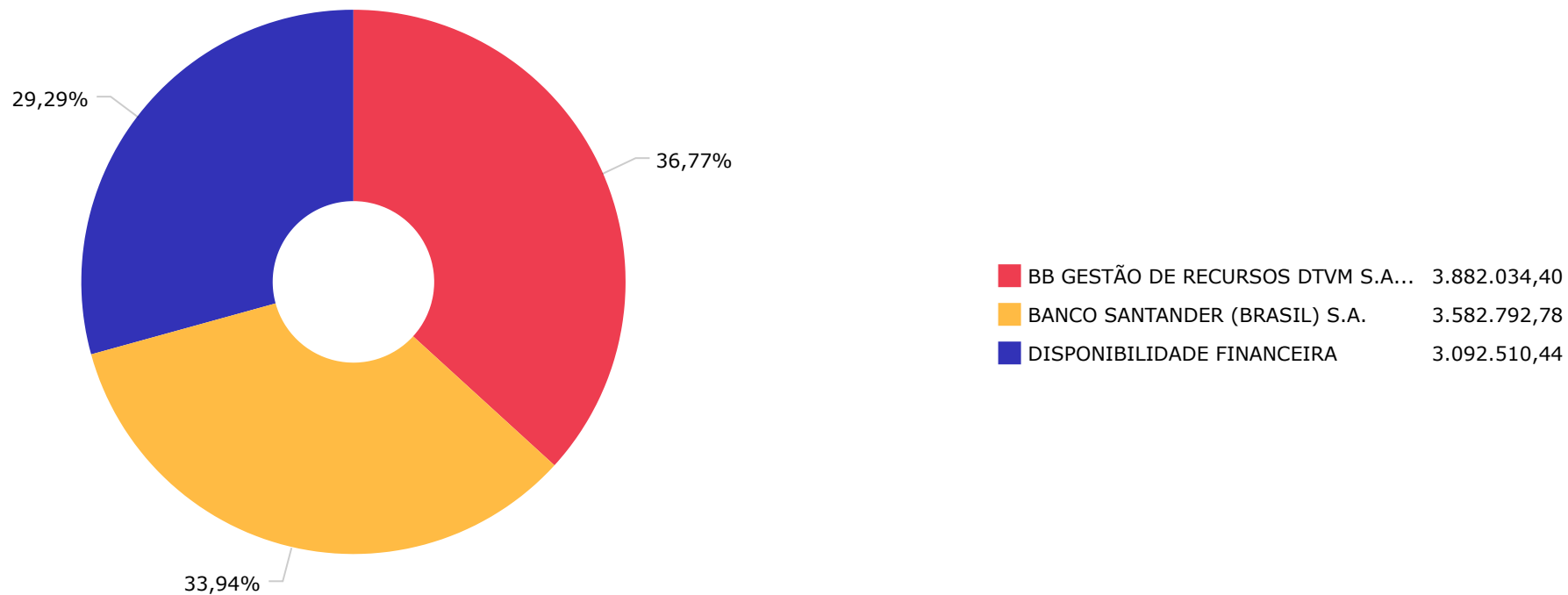
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	7.464.827,18	8° I - Fundos de Ações	15,32%	0,00%	0,00%	30,00%	1.095.573,29
7° I b - FI 100% Títulos TN	60,38%	0,00%	70,00%	100,00%	2.957.536,02	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	2.239.448,15
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	7.464.827,18	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	746.482,72
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	373.241,36	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	746.482,72
7° III a - FI Referenciados RF	12,03%	0,00%	30,00%	60,00%	3.580.597,09	9° III - Ações - BDR Nível I	12,26%	0,00%	0,00%	10,00%	-168.879,22
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.478.896,31	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	746.482,72
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.492.965,44	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	373.241,36
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	373.241,36	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	373.241,36
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	373.241,36	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	373.241,36
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	373.241,36	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	373.241,36

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82		
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,78	5,16	2,49	5,16	11,52	26,51	0,01	0,01
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	12,79	41,07	21,74	41,07	54,78	77,13		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,19	11,40	2,93	11,40	18,06	37,05	3,35	7,06
IBOVESPA - BENCHMARK	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74		
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1,55	-6,94	-2,88	-6,94	5,04	22,95	5,95	12,53
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1,73	-8,00	-3,35	-8,00	4,03	24,30	5,77	12,16
IMA-B - BENCHMARK	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01		
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,99	-1,24	-1,34	-1,24	2,80	16,41	1,90	3,99
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99	-1,23	-1,33	-1,23	2,76	16,42	1,89	3,99
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30		
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,37	3,19	1,18	3,19	7,97	18,76	0,81	1,71
IPCA - BENCHMARK	0,20	2,47	1,04	2,47	4,22	7,51		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16	5,70	2,85	5,70	11,31	21,59	0,48	1,01









Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	14.943.356,18	3.804.571,22	3.690.000,00	15.039.788,94	-18.138,46	-18.138,46	-0,12% ▼	-0,12%	0,85%	0,85%	-14,12%	1,61%
Fevereiro	15.039.788,94	1.954.074,48	3.229.233,29	13.888.591,61	123.961,48	105.823,02	0,82% ▲	0,70%	1,20%	2,06%	33,98%	1,36%
Março	13.888.591,61	3.056.299,43	3.861.308,96	13.158.517,29	74.935,21	180.758,23	0,54% ▲	1,25%	0,55%	2,62%	47,71%	1,39%
Abril	13.158.517,29	3.380.603,62	3.871.411,52	12.525.109,69	-142.599,70	38.158,53	-1,08% ▼	0,15%	0,81%	3,45%	4,35%	1,99%
Mai	12.525.109,69	2.748.836,54	3.942.145,22	11.465.800,74	133.999,73	172.158,26	1,07% ▲	1,22%	0,87%	4,35%	28,05%	1,59%
Junho	11.465.800,74	1.982.214,11	5.990.371,58	7.464.827,18	7.183,91	179.342,17	0,06% ▲	1,28%	0,59%	4,96%	25,81%	2,23%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	180.758,23	1,25%	2,62%
2º Trim	-1.416,06	0,04%	2,28%
1º Sem	179.342,17	1,28%	4,96%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

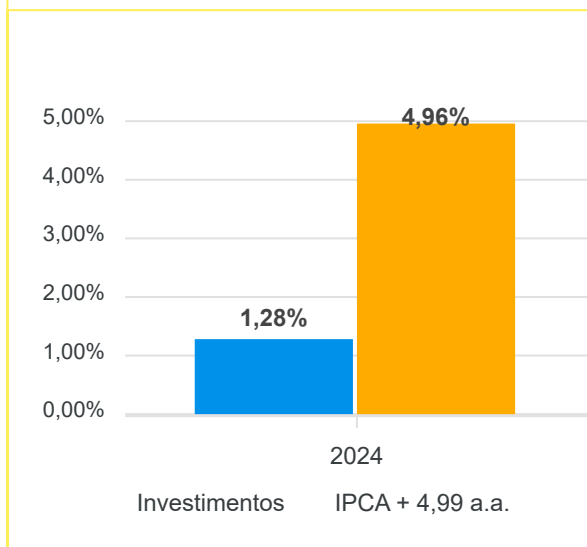


Gráfico Risco x Retorno

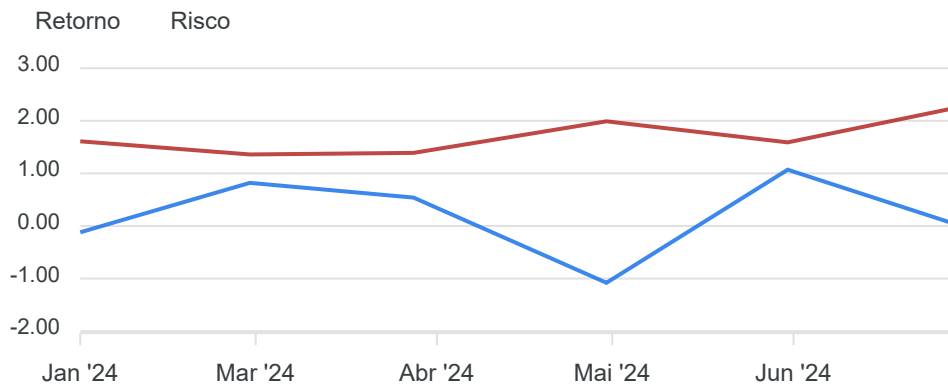
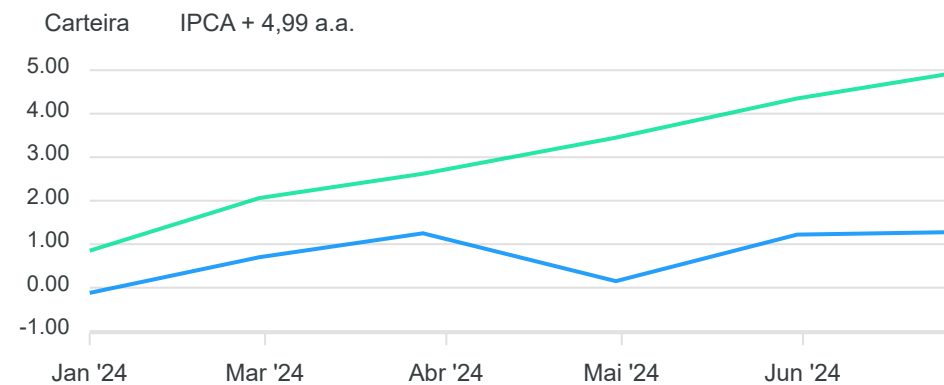
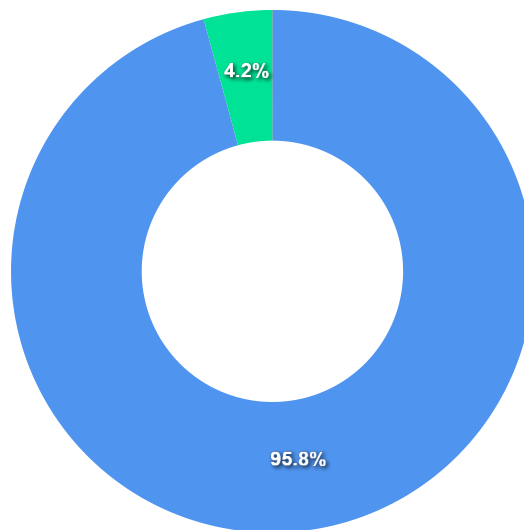


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 28/06/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	10.110.041,17	135,44
Até D+180	447.296,45	5,99
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	569.010,92	0,00	571.714,79	0,00	2.703,87	0,48% ▲	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.353.396,47	0,00	1.360.851,17	0,00	7.454,70	0,55% ▲	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.230.319,74	0,00	1.202.244,79	0,00	-28.074,95	-2,28% ▼	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.234.128,80	0,00	0,00	2.212.116,91	-22.011,89	-0,99% ▼	1,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	141.410,01	0,00	142.290,86	0,00	880,85	0,62% ▲	0,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	442.185,22	0,00	0,00	447.296,45	5.111,23	1,16% ▲	0,48%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	880.287,81	0,00	0,00	883.547,35	3.259,54	0,37% ▲	0,81%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	1.538.151,75	0,00	561.446,57	964.330,45	-12.374,73	-0,80% ▼	1,90%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.056.165,99	1.982.214,11	2.151.823,40	898.299,22	11.742,52	0,39% ▲	0,01%
	9.445.056,71	1.982.214,11	5.990.371,58	5.405.590,38	-31.308,86	-0,33%	1,29%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	302.555,91	0,00	0,00	307.259,10	4.703,19	1,55% ▲	5,95%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	822.401,22	0,00	0,00	836.615,76	14.214,54	1,73% ▲	5,77%
-	1.124.957,13	0,00	0,00	1.143.874,86	18.917,73	1,68%	5,82%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	895.786,90	0,00	0,00	915.361,94	19.575,04	2,19% ▲	3,35%
	895.786,90	0,00	0,00	915.361,94	19.575,04	2,19%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	564.564,39	0,00	571.714,79	0,00	7.150,40	1,27% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.342.650,56	0,00	1.360.851,17	0,00	18.200,61	1,36% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.247.855,96	0,00	1.202.244,79	0,00	-45.611,17	-3,66% ▼
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.241.937,97	0,00	0,00	2.212.116,91	-29.821,06	-1,33% ▼
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	139.578,66	0,00	142.290,86	0,00	2.712,20	1,94% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	434.886,92	0,00	0,00	447.296,45	12.409,53	2,85% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	2.849.652,88	0,00	1.982.145,22	883.547,35	16.039,69	0,56% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	1.543.591,13	0,00	561.446,57	964.330,45	-17.814,11	-1,15% ▼
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	722.512,13	8.111.654,27	7.983.234,92	898.299,22	47.367,74	0,54% ▲
	11.087.230,60	8.111.654,27	13.803.928,32	5.405.590,38	10.633,83	0,10%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	316.379,50	0,00	0,00	307.259,10	-9.120,40	-2,88% ▼
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	865.577,11	0,00	0,00	836.615,76	-28.961,35	-3,35% ▼
	1.181.956,61	0,00	0,00	1.143.874,86	-38.081,75	-3,22%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	889.330,08	0,00	0,00	915.361,94	26.031,86	2,93% ▲
	889.330,08	0,00	0,00	915.361,94	26.031,86	2,93%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	553.242,07	0,00	571.714,79	0,00	18.472,72	3,34% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.316.317,81	0,00	1.360.851,17	0,00	44.533,36	3,38% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.268.301,21	0,00	1.202.244,79	0,00	-66.056,42	-5,21% ▼
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.239.561,47	0,00	0,00	2.212.116,91	-27.444,56	-1,23% ▼
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	136.269,77	0,00	142.290,86	0,00	6.021,09	4,42% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	435.650,41	0,00	12.681,34	447.296,45	24.327,38	5,58% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	4.039.600,73	1.257.818,79	4.512.402,43	883.547,35	98.530,26	1,86% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	1.541.982,67	0,00	561.446,57	964.330,45	-16.205,65	-1,05% ▼
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.351.206,71	15.668.780,61	16.220.838,62	898.299,22	99.150,52	0,58% ▲
	12.882.132,85	16.926.599,40	24.584.470,57	5.405.590,38	181.328,70	1,41%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	330.189,66	0,00	0,00	307.259,10	-22.930,56	-6,94% ▼
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	909.346,42	0,00	0,00	836.615,76	-72.730,66	-8,00% ▼
	1.239.536,08	0,00	0,00	1.143.874,86	-95.661,22	-7,72%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	821.687,25	0,00	0,00	915.361,94	93.674,69	11,40% ▲
	821.687,25	0,00	0,00	915.361,94	93.674,69	11,40%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	638
Patrimônio Líquido Fundo	4.649.802.742,18

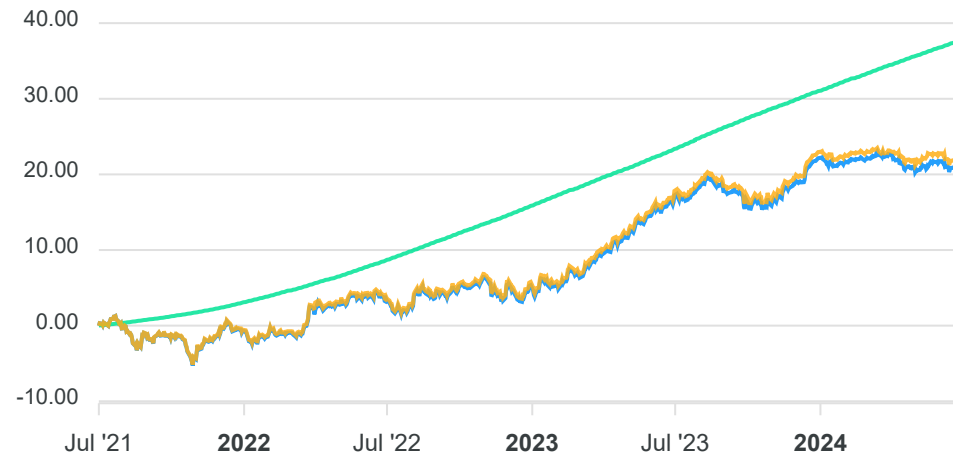
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

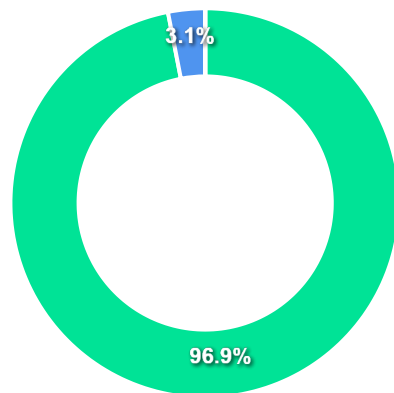
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,99%	-1,23%	-1,33%	-1,23%	2,76%	16,42%	1,89%	3,99%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.800.985,39	96.93%
Operação compromissada	151.683,59	3.06%
Outros	156,79	0.00%
Valores a pagar/receber	114,45	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	589.633,61	11,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	578.501,68	11,68	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	519.085,86	10,48	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	493.776,79	9,97	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	403.780,48	8,15	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	373.082,80	7,53	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	333.132,53	6,73	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	315.747,73	6,38	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	314.683,41	6,35	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	274.975,32	5,55	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	190.498,82	3,85	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	151.683,59	3,06	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	135.103,64	2,73	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	126.980,06	2,56	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	123.012,98	2,48	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029	28.989,68	0,59	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	208,80	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	73,50	0,00	Outros
Valores a receber / DIFERIR CVM 31/12/24	37,69	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	19,59	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Selic	15,01	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	10,57	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	7,58	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	7,24	0,00	Outros
Valores a pagar / Auditoria	2,70	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	0,62	0,00	Outros
Outros Valores a receber	0,08	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 140
Patrimônio Líquido Fundo 197.669.973,94

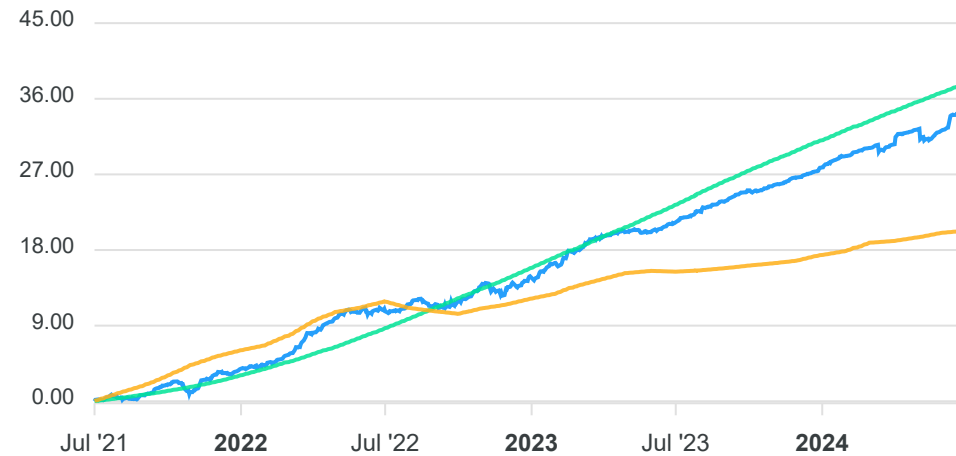
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IPCA
Classificação ANBIMA Não classificado
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

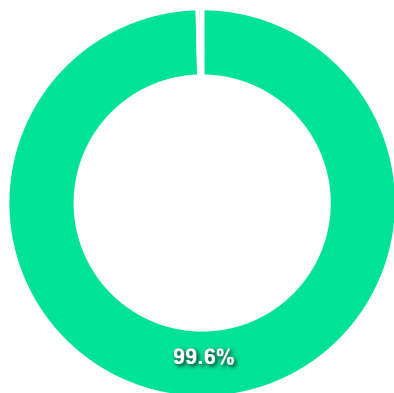
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	5,70%	2,85%	5,70%	11,31%	21,59%	0,48%	1,01%
Benchmark	0,20%	2,47%	1,04%	2,47%	4,22%	7,51%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	194.674,22	99,62	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	631,34	0,32	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	103,29	0,05	Valores a pagar/receber
Valores a receber / DIFERIR CVM 31/12/24	20,10	0,01	Outros
Valores a pagar / Taxa Selic	0,61	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / PROV.AUDIT 31/03/25	0,12	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-1,62	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-2,37	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-4,52	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-8,51	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	194.674,22	99.62%
Operação compromissada	631,34	0.32%
Valores a pagar/receber	86,88	0.04%
Outros	20,22	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,10%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 115
Patrimônio Líquido Fundo 1.312.208.437,83

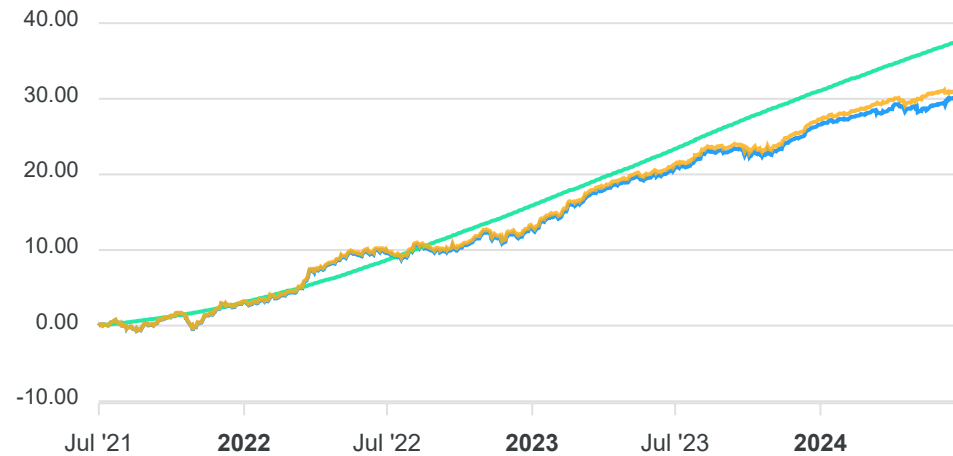
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B 5
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento.

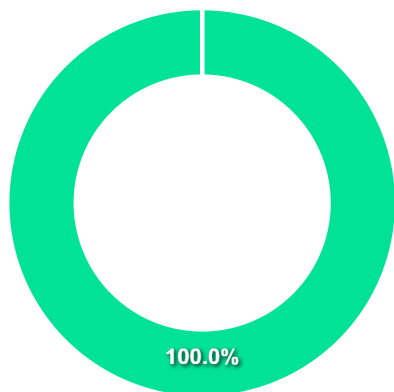
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,37%	3,19%	1,18%	3,19%	7,97%	18,76%	0,81%	1,71%
Benchmark	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.311.740,10	100,02	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	44,61	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-360,62	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.311.740,10	100.02%
Valores a pagar/receber	-311,01	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	20,00%
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	94
Patrimônio Líquido Fundo	476.058.771,06

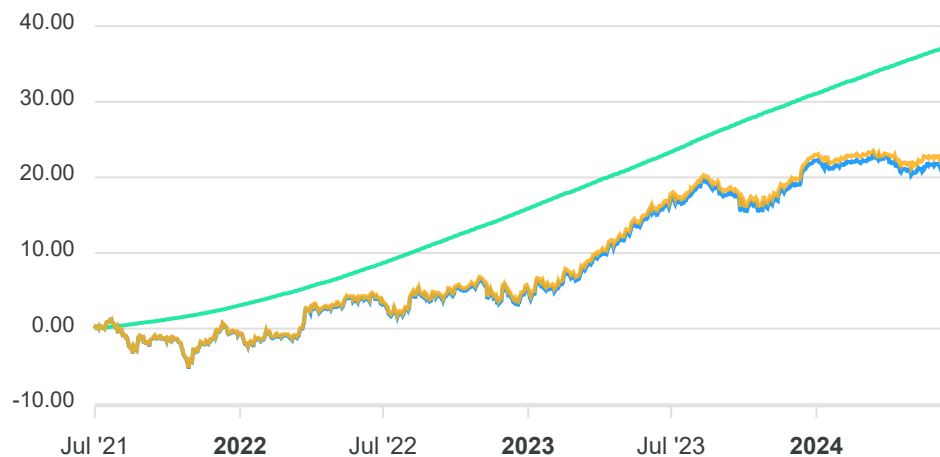
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa.

COMPARATIVO

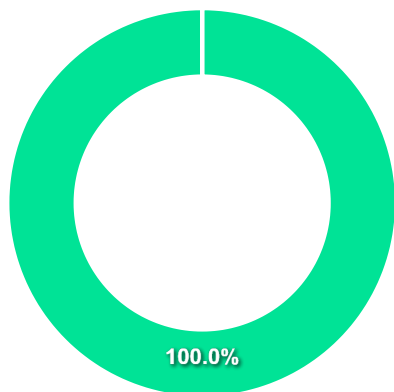
📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,99%	-1,24%	-1,34%	-1,24%	2,80%	16,41%	1,90%	3,99%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	525.381,14	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	35,69	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-108,70	-0,02	Valores a pagar/receber



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	525.381,14	100.01%
Valores a pagar/receber	-68,01	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 734
Patrimônio Líquido Fundo 7.377.738.310,48

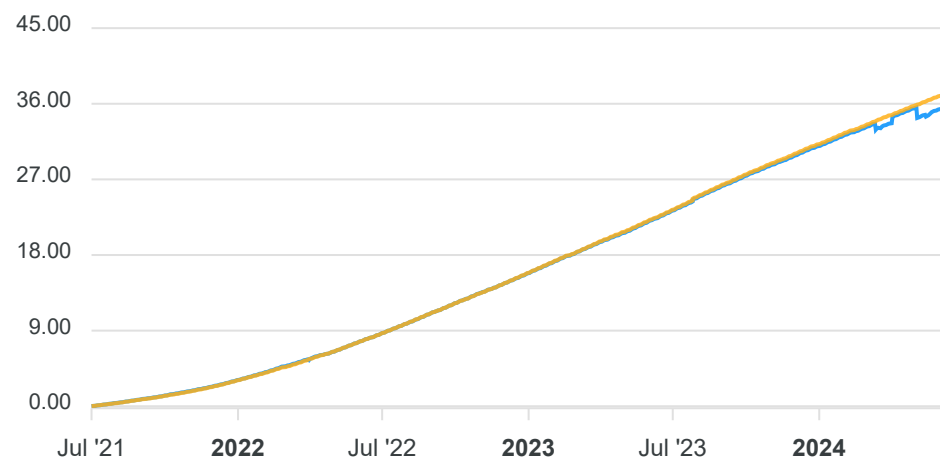
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark CDI
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Baixa Soberano
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais investem em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas nestes títulos.

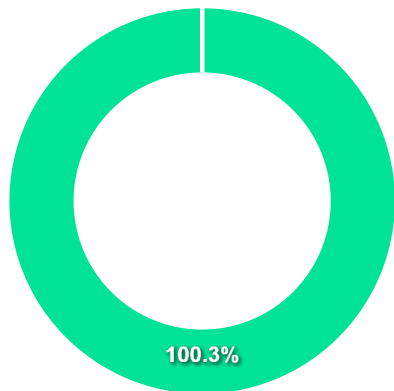
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,78%	5,16%	2,49%	5,16%	11,52%	26,51%	0,01%	0,01%
Benchmark	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	7.349.951,14	100,30	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	50,18	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-21.839,48	-0,30	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	7.349.951,14	100.30%
Valores a pagar/receber	-21.784,29	-0.30%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	1.088
Patrimônio Líquido Fundo	649.126.137,40

PERFIL DO FUNDO

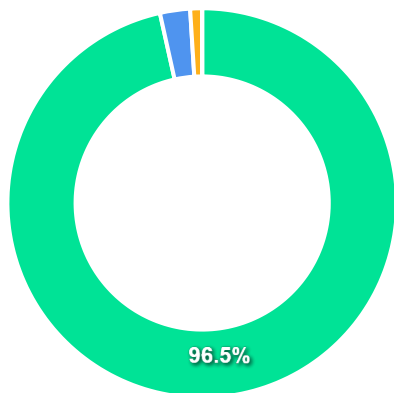
Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Sustentabilidade/Governança
Política de Investimento	Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,55%	-6,94%	-2,88%	-6,94%	5,04%	22,95%	5,95%	12,53%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	630.681,90	96.51%
Operação compromissada	16.319,26	2.50%
Valores a pagar/receber	6.371,17	0.97%
Outros	94,57	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	81.702,43	12,50	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	52.350,98	8,01	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	44.485,10	6,81	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	43.484,17	6,65	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	22.009,67	3,37	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	19.757,24	3,02	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	18.970,88	2,90	Ações
B3 ON NM - B3SA3	17.535,02	2,68	Ações
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2027	16.319,26	2,50	Operação compromissada
WEG ON NM - WEGE3	16.070,65	2,46	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	15.738,26	2,41	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	11.359,76	1,74	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	10.665,41	1,63	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	9.957,27	1,52	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	9.771,61	1,50	Ações
JBS ON NM - JBSS3	9.563,34	1,46	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	9.385,36	1,44	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	9.328,70	1,43	Ações
EMBRAER ON NM - EMBR3	8.825,63	1,35	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	7.425,99	1,14	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	7.176,15	1,10	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	7.118,97	1,09	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	7.070,72	1,08	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	6.834,68	1,05	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	6.474,70	0,99	Ações
ENEVA ON NM - ENEV3	6.050,92	0,93	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	5.428,74	0,83	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,75%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	28
Patrimônio Líquido Fundo	217.889.058,81

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Índice Ativo
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III.

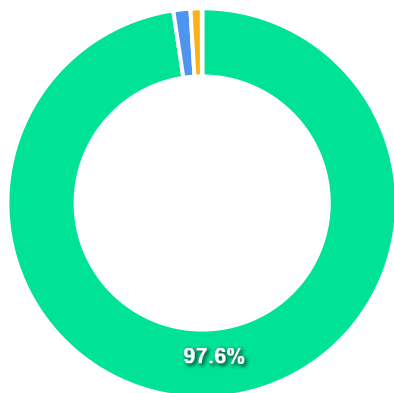
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,73%	-8,00%	-3,35%	-8,00%	4,03%	24,30%	5,77%	12,16%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	242.918,73	97.63%
Operação compromissada	3.502,91	1.41%
Valores a pagar/receber	2.321,41	0.93%
Derivativos	65,79	0.03%
Fundos de Investimento	15,60	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	36.132,88	14,52	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	18.099,29	7,27	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	16.718,12	6,72	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	10.734,58	4,31	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	8.954,26	3,60	Ações
B3 ON NM - B3SA3	8.844,19	3,55	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	8.489,82	3,41	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	8.488,32	3,41	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	7.952,06	3,20	Ações
WEG ON NM - WEGE3	5.590,07	2,25	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	5.378,66	2,16	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	5.322,33	2,14	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	5.095,03	2,05	Ações
Outros Valores a receber	4.341,29	1,74	Valores a pagar/receber
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.127,12	1,66	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	4.067,27	1,63	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	4.046,43	1,63	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	3.833,46	1,54	Ações
JBS ON NM - JBSS3	3.510,93	1,41	Ações
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2027	3.502,91	1,41	Operação compromissada
REDE D OR ON NM - RDOR3	3.460,18	1,39	Ações
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	3.210,27	1,29	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	3.019,90	1,21	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	2.891,15	1,16	Ações
BRF SA ON NM - BRFS3	2.773,86	1,11	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	2.696,05	1,08	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	2.679,51	1,08	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	10,00%
Disponibilidade de Resgate	D+2 du
Quantidade de Cotistas	19.477
Patrimônio Líquido Fundo	400.466.578,46

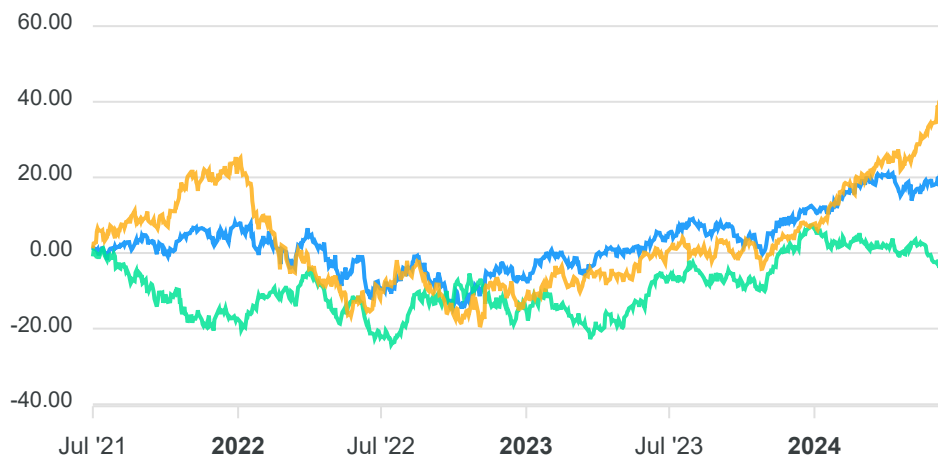
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 9º, Inciso III
Benchmark	Global BDRX
Classificação ANBIMA	Ações Livre
Política de Investimento	Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I, CNPJ: 39.272.928/0001-60.

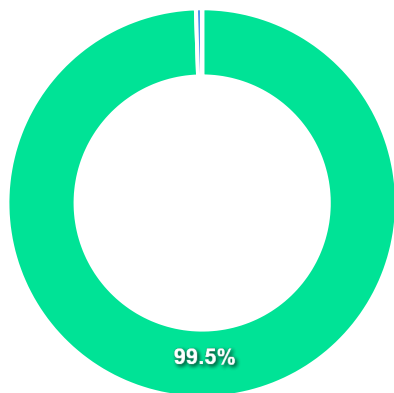
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,19%	11,40%	2,93%	11,40%	18,06%	37,05%	3,35%	7,06%
Benchmark	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%		
IBOVESPA	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BD...	382.258,78	98,10	Fundos de Investimento
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.397,08	1,39	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.778,07	0,71	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	242,03	0,06	Valores a pagar/receber
Valores a receber / DIFERIR CVM 31/12/24	26,45	0,01	Outros
Valores a pagar / Auditoria	-2,54	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-3,23	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,23	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR a recolher	-5,58	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-46,17	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-252,58	-0,06	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-724,03	-0,19	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	387.655,86	99.48%
Valores a pagar/receber	1.981,75	0.51%
Outros	26,45	0.01%

2024

Relatório Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Junho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	883.547,35	40,44%	1.312.208.437,83	0,07%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	964.330,45	44,14%	476.058.771,06	0,20%	7º I b
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	336.852,65	15,42%	7.377.738.310,48	0,00%	7º III a

Investimentos

\$ 2.184.730,45

Disponibilidades Financeiras

\$ 23.890,96

Total Carteira

\$ 2.208.621,41

Governança (Pró Gestão)

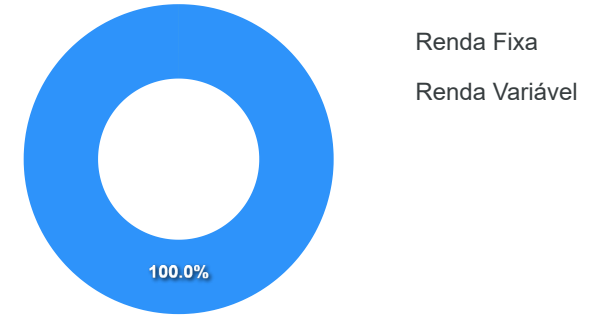


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	83,67%	1.847.877,80
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	15,25%	336.852,65

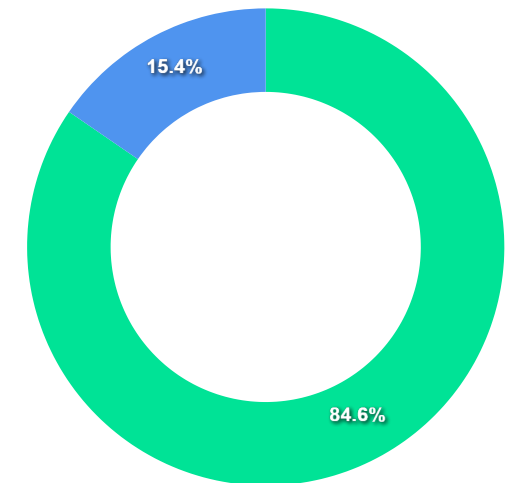
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos

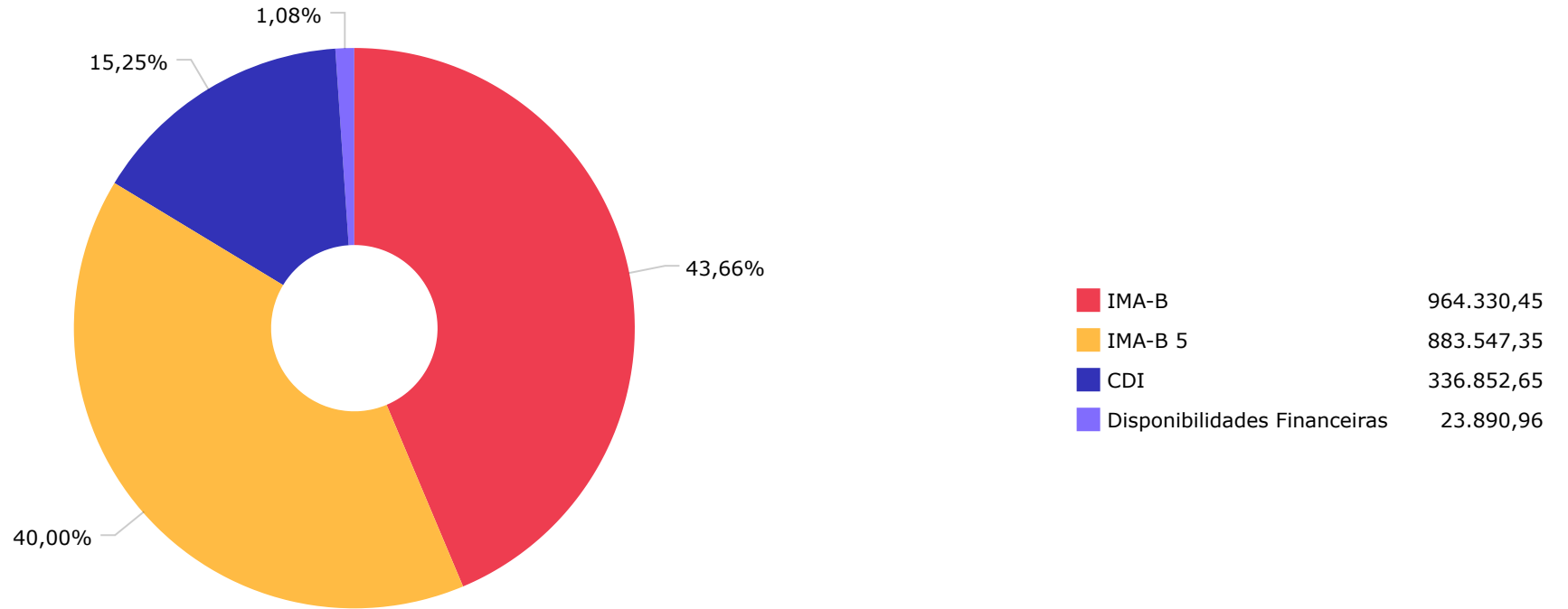


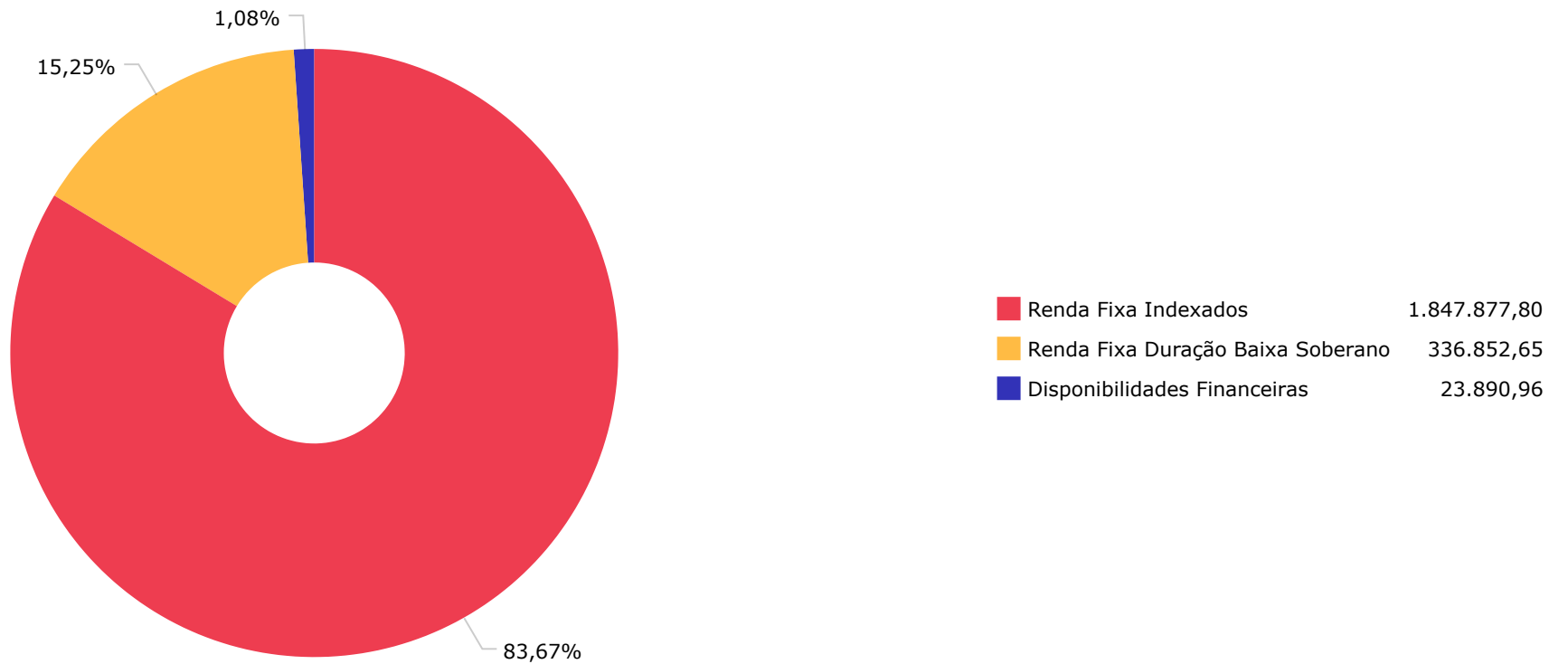
Artigos

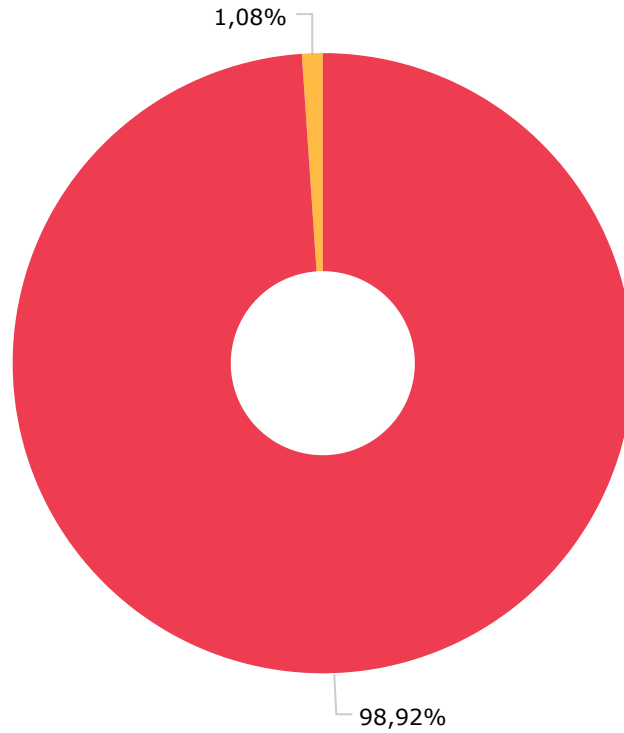


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.208.621,41	8° I - Fundos de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	662.586,42
7° I b - FI 100% Títulos TN	83,67%	0,00%	70,00%	100,00%	360.743,61	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	662.586,42
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.208.621,41	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	220.862,14
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	110.431,07	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	220.862,14
7° III a - FI Referenciados RF	15,25%	0,00%	30,00%	60,00%	988.320,20	9° III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	220.862,14
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.325.172,85	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	220.862,14
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	441.724,28	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	110.431,07
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	110.431,07	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	110.431,07
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	110.431,07	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	110.431,07
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	110.431,07	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	110.431,07

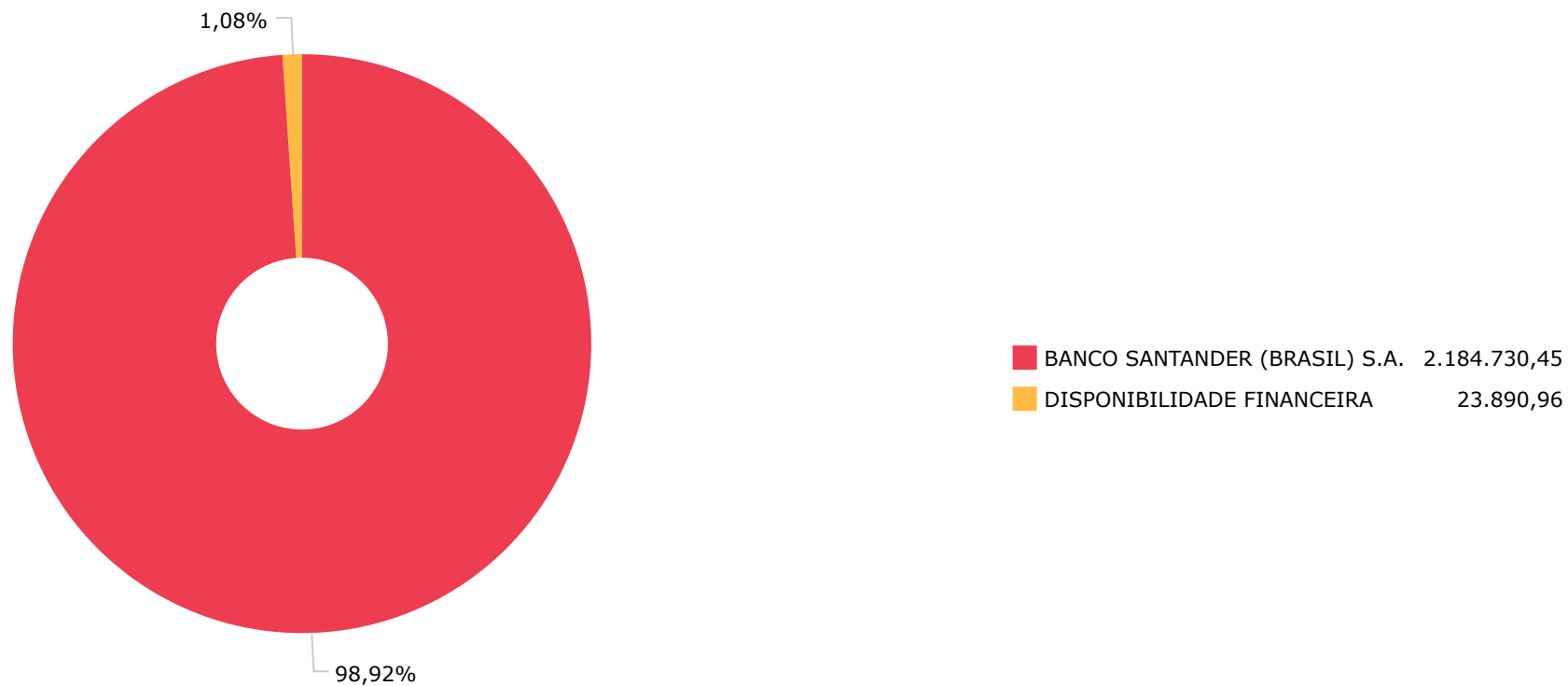
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82		
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,78	5,16	2,49	5,16	11,52	26,51	0,01	0,01
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	12,79	41,07	21,74	41,07	54,78	77,13		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,19	11,40	2,93	11,40	18,06	37,05	3,35	7,06
IBOVESPA - BENCHMARK	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74		
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1,55	-6,94	-2,88	-6,94	5,04	22,95	5,95	12,53
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1,73	-8,00	-3,35	-8,00	4,03	24,30	5,77	12,16
IMA-B - BENCHMARK	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01		
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,99	-1,24	-1,34	-1,24	2,80	16,41	1,90	3,99
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99	-1,23	-1,33	-1,23	2,76	16,42	1,89	3,99
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30		
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,37	3,19	1,18	3,19	7,97	18,76	0,81	1,71
IPCA - BENCHMARK	0,20	2,47	1,04	2,47	4,22	7,51		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16	5,70	2,85	5,70	11,31	21,59	0,48	1,01







■ SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	2.184.730,45
■ DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	23.890,96



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	2.383.469,95	0,00	50.000,00	2.339.251,39	5.781,44	5.781,44	0,24% ▲	0,24%	0,85%	0,85%	28,24%	0,74%
Fevereiro	2.339.251,39	0,00	0,00	2.353.348,86	14.097,47	19.878,91	0,60% ▲	0,85%	1,20%	2,06%	41,26%	0,48%
Março	2.353.348,86	0,00	0,00	2.364.581,11	11.232,25	31.111,16	0,48% ▲	1,33%	0,55%	2,62%	50,76%	0,61%
Abril	2.364.581,11	0,00	0,00	2.351.155,29	-13.425,82	17.685,34	-0,57% ▼	0,75%	0,81%	3,45%	21,74%	1,01%
Mai	2.351.155,29	0,00	0,00	2.376.881,76	25.726,47	43.411,81	1,09% ▲	1,86%	0,87%	4,35%	42,76%	0,73%
Junho	2.376.881,76	0,00	189.780,21	2.184.730,45	-2.371,10	41.040,71	-0,10% ▼	1,75%	0,59%	4,96%	35,28%	1,17%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	31.111,16	1,33%	2,62%
2º Trim	9.929,55	0,42%	2,28%
1º Sem	41.040,71	1,75%	4,96%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

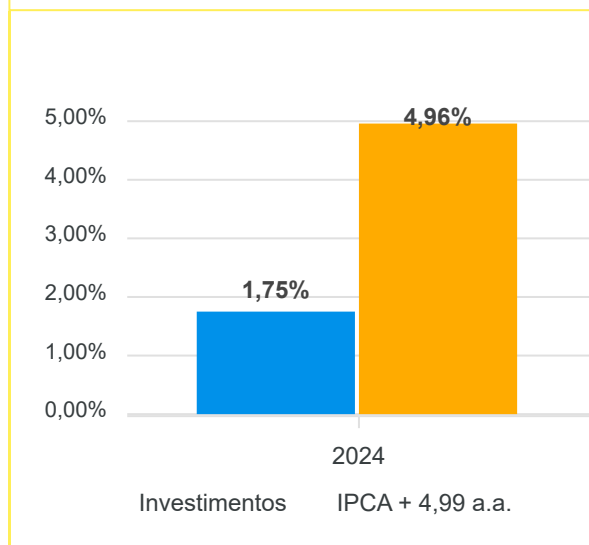


Gráfico Risco x Retorno

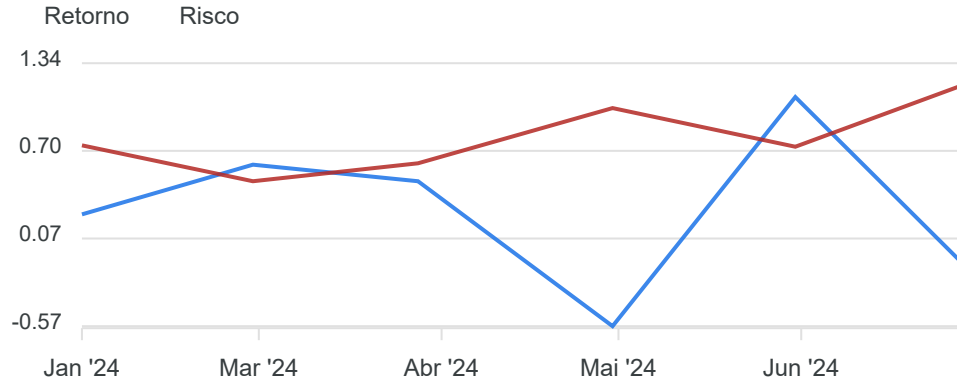
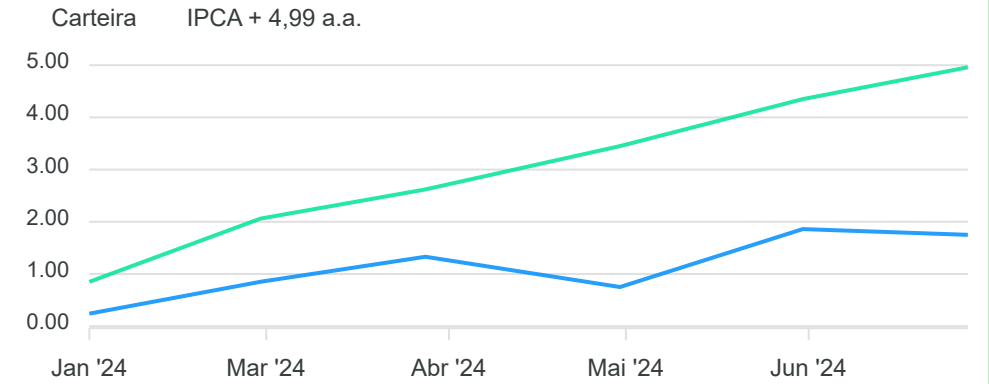
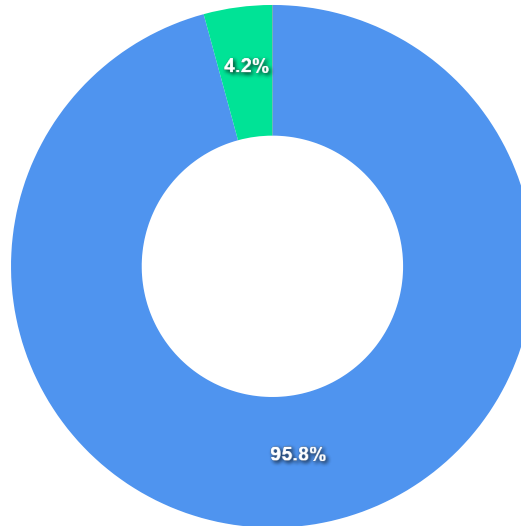


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 28/06/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	10.110.041,17	462,76
Até D+180	447.296,45	20,47
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	880.287,81	0,00	0,00	883.547,35	3.259,54	0,37% ▲	0,81%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	973.974,80	0,00	0,00	964.330,45	-9.644,35	-0,99% ▼	1,90%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	522.619,15	0,00	189.780,21	336.852,65	4.013,71	0,77% ▲	0,01%
	2.376.881,76	0,00	189.780,21	2.184.730,45	-2.371,10	-0,10%	1,17%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	873.269,77	0,00	0,00	883.547,35	10.277,58	1,18% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	977.419,07	0,00	0,00	964.330,45	-13.088,62	-1,34% ▼
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	513.892,27	0,00	189.780,21	336.852,65	12.740,59	2,48% ▲
	2.364.581,11	0,00	189.780,21	2.184.730,45	9.929,55	0,42%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	856.206,74	0,00	0,00	883.547,35	27.340,61	3,19% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	976.400,58	0,00	0,00	964.330,45	-12.070,13	-1,24% ▼
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	550.862,63	0,00	239.780,21	336.852,65	25.770,23	4,68% ▲
	2.383.469,95	0,00	239.780,21	2.184.730,45	41.040,71	1,72%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	638
Patrimônio Líquido Fundo	4.649.802.742,18

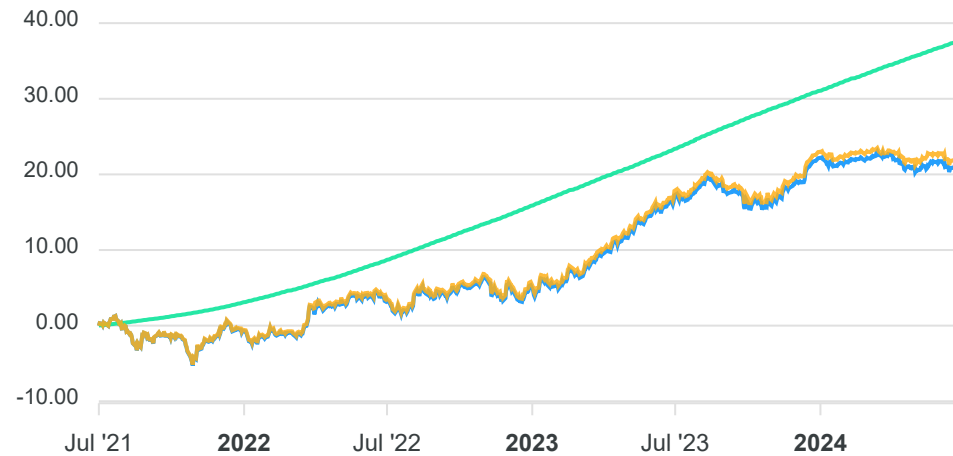
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

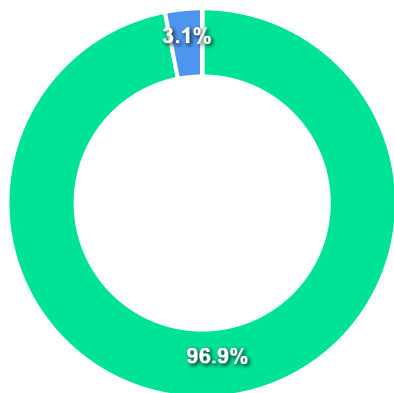
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,99%	-1,23%	-1,33%	-1,23%	2,76%	16,42%	1,89%	3,99%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.800.985,39	96.93%
Operação compromissada	151.683,59	3.06%
Outros	156,79	0.00%
Valores a pagar/receber	114,45	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	589.633,61	11,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	578.501,68	11,68	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	519.085,86	10,48	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	493.776,79	9,97	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	403.780,48	8,15	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	373.082,80	7,53	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	333.132,53	6,73	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	315.747,73	6,38	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	314.683,41	6,35	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	274.975,32	5,55	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	190.498,82	3,85	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	151.683,59	3,06	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	135.103,64	2,73	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	126.980,06	2,56	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	123.012,98	2,48	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029	28.989,68	0,59	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	208,80	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	73,50	0,00	Outros
Valores a receber / DIFERIR CVM 31/12/24	37,69	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	19,59	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Selic	15,01	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	10,57	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	7,58	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	7,24	0,00	Outros
Valores a pagar / Auditoria	2,70	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	0,62	0,00	Outros
Outros Valores a receber	0,08	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 140
Patrimônio Líquido Fundo 197.669.973,94

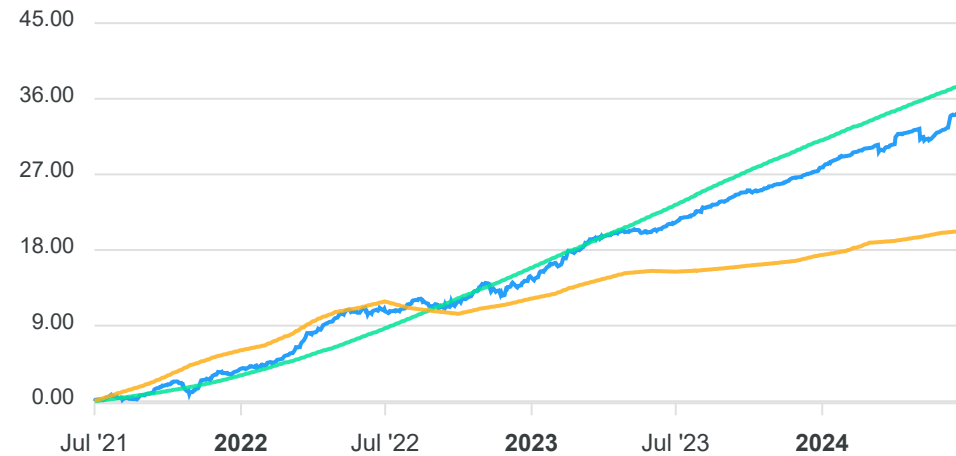
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IPCA
Classificação ANBIMA Não classificado
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

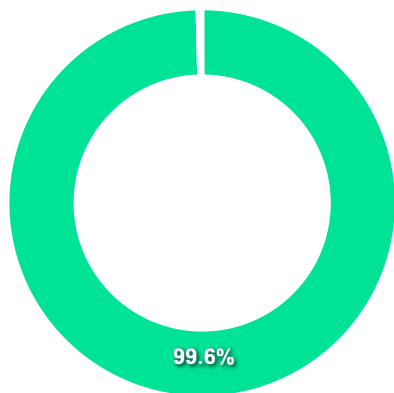
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	5,70%	2,85%	5,70%	11,31%	21,59%	0,48%	1,01%
Benchmark	0,20%	2,47%	1,04%	2,47%	4,22%	7,51%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	194.674,22	99,62	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	631,34	0,32	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	103,29	0,05	Valores a pagar/receber
Valores a receber / DIFERIR CVM 31/12/24	20,10	0,01	Outros
Valores a pagar / Taxa Selic	0,61	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / PROV.AUDIT 31/03/25	0,12	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-1,62	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-2,37	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-4,52	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-8,51	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	194.674,22	99.62%
Operação compromissada	631,34	0.32%
Valores a pagar/receber	86,88	0.04%
Outros	20,22	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,10%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 115
Patrimônio Líquido Fundo 1.312.208.437,83

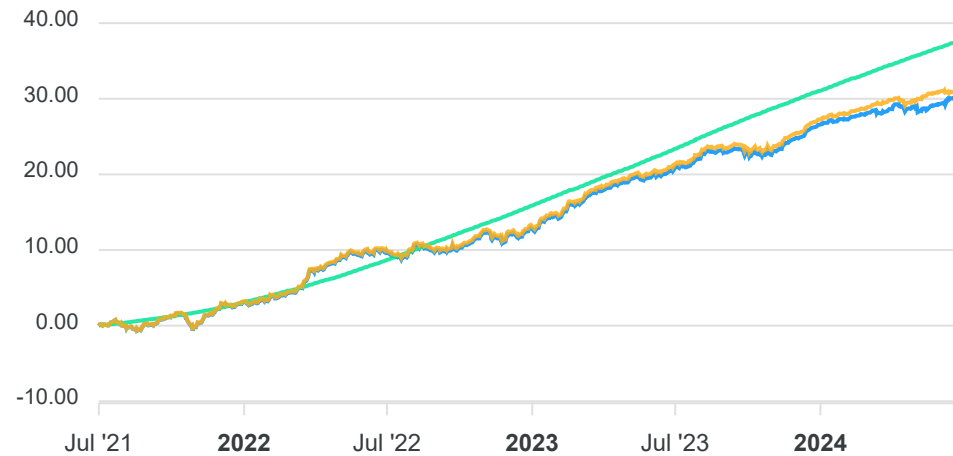
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B 5
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento.

COMPARATIVO

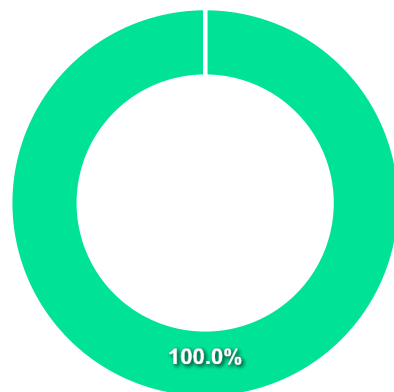
📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,37%	3,19%	1,18%	3,19%	7,97%	18,76%	0,81%	1,71%
Benchmark	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.311.740,10	100,02	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	44,61	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-360,62	-0,03	Valores a pagar/receber



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.311.740,10	100.02%
Valores a pagar/receber	-311,01	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance 20,00%
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 94
Patrimônio Líquido Fundo 476.058.771,06

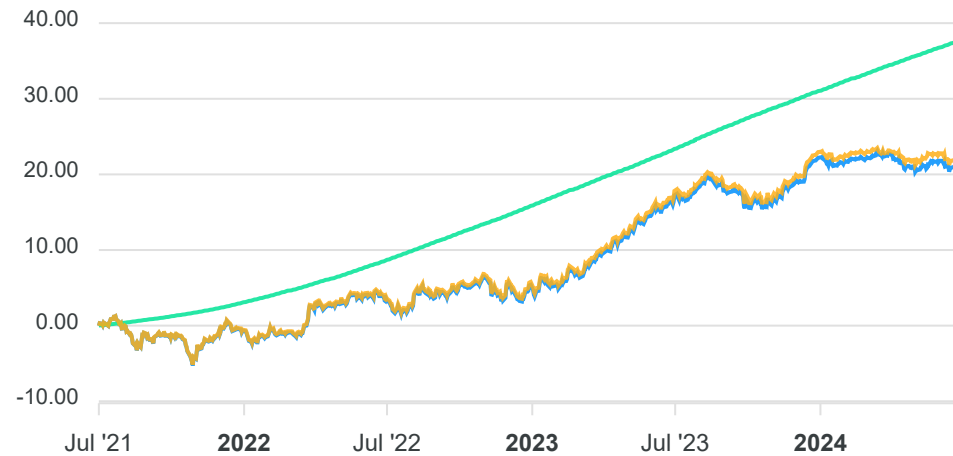
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa.

COMPARATIVO

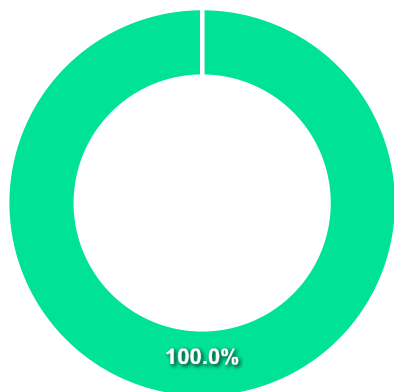
📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,99%	-1,24%	-1,34%	-1,24%	2,80%	16,41%	1,90%	3,99%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	525.381,14	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	35,69	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-108,70	-0,02	Valores a pagar/receber



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	525.381,14	100.01%
Valores a pagar/receber	-68,01	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 734
Patrimônio Líquido Fundo 7.377.738.310,48

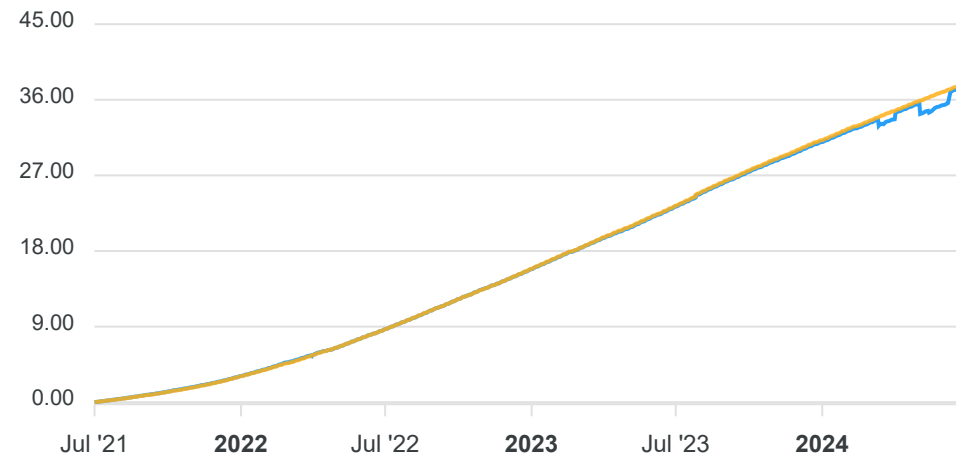
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark CDI
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Baixa Soberano
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais investem em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas nestes títulos.

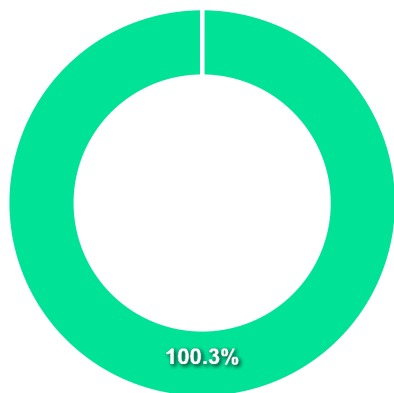
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,78%	5,16%	2,49%	5,16%	11,52%	26,51%	0,01%	0,01%
Benchmark	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	7.349.951,14	100,30	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	50,18	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-21.839,48	-0,30	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	7.349.951,14	100.30%
Valores a pagar/receber	-21.784,29	-0.30%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+4
Quantidade de Cotistas	1.088
Patrimônio Líquido Fundo	649.126.137,40

PERFIL DO FUNDO

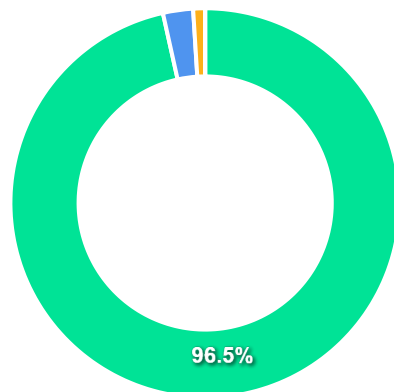
Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Benchmark	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Sustentabilidade/Governança
Política de Investimento	Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,55%	-6,94%	-2,88%	-6,94%	5,04%	22,95%	5,95%	12,53%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	630.681,90	96.51%
Operação compromissada	16.319,26	2.50%
Valores a pagar/receber	6.371,17	0.97%
Outros	94,57	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	81.702,43	12,50	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	52.350,98	8,01	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	44.485,10	6,81	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	43.484,17	6,65	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	22.009,67	3,37	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	19.757,24	3,02	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	18.970,88	2,90	Ações
B3 ON NM - B3SA3	17.535,02	2,68	Ações
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2027	16.319,26	2,50	Operação compromissada
WEG ON NM - WEGE3	16.070,65	2,46	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	15.738,26	2,41	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	11.359,76	1,74	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	10.665,41	1,63	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	9.957,27	1,52	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	9.771,61	1,50	Ações
JBS ON NM - JBSS3	9.563,34	1,46	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	9.385,36	1,44	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	9.328,70	1,43	Ações
EMBRAER ON NM - EMBR3	8.825,63	1,35	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	7.425,99	1,14	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	7.176,15	1,10	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	7.118,97	1,09	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	7.070,72	1,08	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	6.834,68	1,05	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	6.474,70	0,99	Ações
ENEVA ON NM - ENEV3	6.050,92	0,93	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	5.428,74	0,83	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,75%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+4
Quantidade de Cotistas 28
Patrimônio Líquido Fundo 217.889.058,81

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 8º, Inciso I
Benchmark Ibovespa
Classificação ANBIMA Ações Índice Ativo
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III.

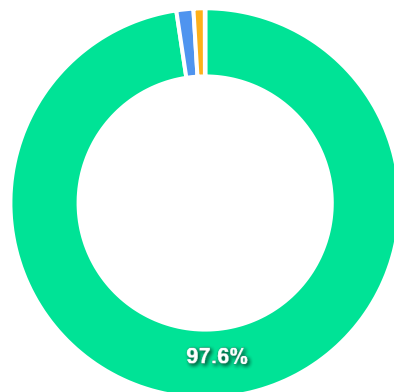
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,73%	-8,00%	-3,35%	-8,00%	4,03%	24,30%	5,77%	12,16%
Benchmark	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	242.918,73	97.63%
Operação compromissada	3.502,91	1.41%
Valores a pagar/receber	2.321,41	0.93%
Derivativos	65,79	0.03%
Fundos de Investimento	15,60	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	36.132,88	14,52	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	18.099,29	7,27	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	16.718,12	6,72	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	10.734,58	4,31	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	8.954,26	3,60	Ações
B3 ON NM - B3SA3	8.844,19	3,55	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	8.489,82	3,41	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	8.488,32	3,41	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	7.952,06	3,20	Ações
WEG ON NM - WEGE3	5.590,07	2,25	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	5.378,66	2,16	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	5.322,33	2,14	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	5.095,03	2,05	Ações
Outros Valores a receber	4.341,29	1,74	Valores a pagar/receber
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.127,12	1,66	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	4.067,27	1,63	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	4.046,43	1,63	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	3.833,46	1,54	Ações
JBS ON NM - JBSS3	3.510,93	1,41	Ações
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2027	3.502,91	1,41	Operação compromissada
REDE D OR ON NM - RDOR3	3.460,18	1,39	Ações
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	3.210,27	1,29	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	3.019,90	1,21	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	2.891,15	1,16	Ações
BRF SA ON NM - BRFS3	2.773,86	1,11	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	2.696,05	1,08	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	2.679,51	1,08	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	10,00%
Disponibilidade de Resgate	D+2 du
Quantidade de Cotistas	19.477
Patrimônio Líquido Fundo	400.466.578,46

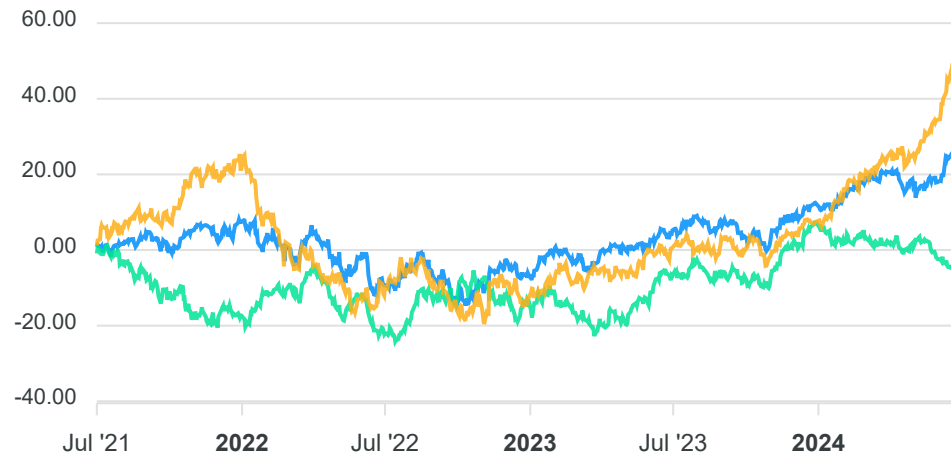
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 9º, Inciso III
Benchmark	Global BDRX
Classificação ANBIMA	Ações Livre
Política de Investimento	Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I, CNPJ: 39.272.928/0001-60.

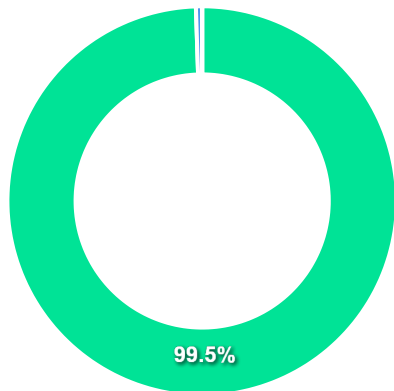
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,19%	11,40%	2,93%	11,40%	18,06%	37,05%	3,35%	7,06%
Benchmark	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	54,78%	77,13%		
IBOVESPA	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BD...	382.258,78	98,10	Fundos de Investimento
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.397,08	1,39	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.778,07	0,71	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	242,03	0,06	Valores a pagar/receber
Valores a receber / DIFERIR CVM 31/12/24	26,45	0,01	Outros
Valores a pagar / Auditoria	-2,54	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-3,23	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,23	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR a recolher	-5,58	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-46,17	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-252,58	-0,06	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-724,03	-0,19	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	387.655,86	99.48%
Valores a pagar/receber	1.981,75	0.51%
Outros	26,45	0.01%

