

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

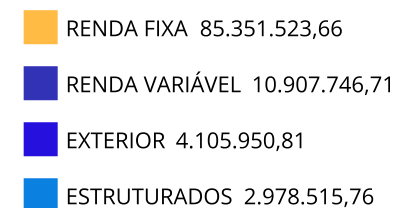
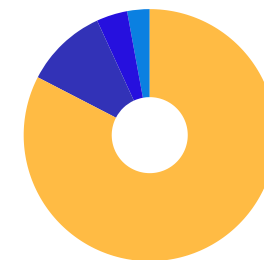
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.747.444,21	6,53%	704	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	627.973,36	0,61%	645	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	11.782.239,77	11,40%	214	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	2.584.510,75	2,50%	100	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.079.903,34	3,95%	253	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	18.532.904,22	17,93%	307	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	5.458.224,72	5,28%	217	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	6.264.158,55	6,06%	77	1,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	188.383,35	0,18%	789	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.679.303,24	6,46%	768	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.162.592,21	4,03%	1.169	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	912.256,62	0,88%	247	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	104.766,47	0,10%	450	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	569.707,05	0,55%	30	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	D+0	46524	215.056,89	0,21%	8	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	313.089,72	0,30%	220	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	703.088,26	0,68%	1.021	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	259.707,79	0,25%	1.144	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	8.028.428,22	7,77%	148	1,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.939.494,16	2,84%	145	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	117.286,20	0,11%	114	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	4.081.004,56	3,95%	1.100	0,04%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	268.516,65	0,26%	16.544	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.612.120,99	4,46%	244	9,81%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	227.889,67	0,22%	877	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.767.306,23	2,68%	86	0,77%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.874.614,84	2,78%	12.292	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	157.298,33	0,15%	55	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	3.860.016,34	3,74%	19.234	0,99%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	245.934,47	0,24%	9.841	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.978.515,76	2,88%	4.618	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			103.343.736,94				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	20.668.747,39
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	69.222.514,47	66,98%	30,00%	40,00%	95,00%	28.954.035,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	12.048.004,63	11,66%	10,00%	15,00%	55,00%	44.791.050,69
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	20.668.747,39
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.167.186,85
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	4.081.004,56	3,95%	0,00%	0,00%	5,00%	1.086.182,29
Total Renda Fixa	100,00%	85.351.523,66	82,59%	40,00%	70,00%	200,00%	



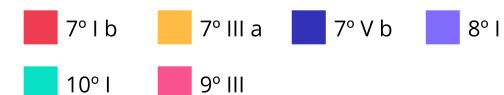
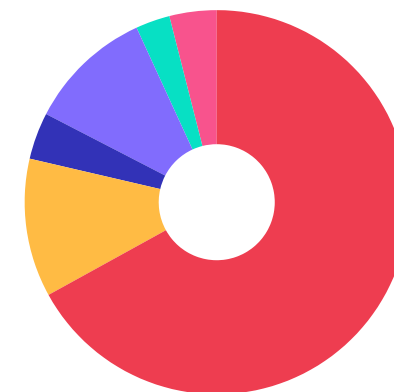
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	10.907.746,71	10,55%	10,00%	15,00%	30,00%	20.095.374,37
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	31.003.121,08
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.978.515,76	2,88%	2,00%	5,00%	10,00%	7.355.857,93
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	5.167.186,85
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	5.167.186,85
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	13.886.262,47	13,44%	12,00%	23,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.105.950,81	3,97%	3,00%	5,00%	10,00%	6.228.422,88
Total Exterior	10,00%	4.105.950,81	3,97%	3,00%	5,00%	10,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	69.222.514,47	66,98	30,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	12.048.004,63	11,66	10,00	55,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	4.081.004,56	3,95	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	10.907.746,71	10,55	10,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	4.105.950,81	3,97	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.978.515,76	2,88	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	48.393.587,24	46,83	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.494.920,85	23,70	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	22.244.457,46	21,52	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	8.210.771,39	7,95	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,60%	0,94%	0,00%	2,69%	10,22%	27,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	0,84%	-0,07%	2,56%	9,95%	26,74%	1,85%	3,32%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,78%	3,85%	2,21%	4,80%	11,56%	26,65%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,76%	3,81%	2,15%	4,74%	11,36%	26,18%	0,18%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,76%	3,85%	2,16%	4,77%	11,40%	26,22%	0,18%	0,32%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	2,92%	1,62%	4,42%	8,94%	19,23%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,03%	2,78%	1,54%	4,26%	8,60%	18,50%	0,55%	1,73%
IMA-B (Benchmark)	1,33%	-0,13%	-0,23%	2,62%	6,56%	17,72%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,30%	-0,27%	-0,31%	2,45%	6,23%	16,98%	1,28%	3,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	-0,23%	-0,30%	2,49%	6,35%	17,30%	1,28%	3,83%
IRF-M (Benchmark)	0,66%	1,81%	0,67%	3,32%	10,51%	26,78%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,69%	0,58%	3,18%	10,24%	26,33%	1,32%	2,36%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	1,69%	0,58%	3,17%	10,09%	25,93%	1,32%	2,35%
CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,89%	4,83%	2,83%	5,86%	13,47%	29,35%	0,05%	0,15%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	1,61%	2,62%	2,55%	5,22%	6,72%	0,65%	3,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	4,42%	2,59%	5,36%	12,05%	27,13%	0,02%	0,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	3,44%	1,78%	4,42%	11,34%	25,22%	0,35%	0,80%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	3,97%	2,32%	4,82%	10,90%	24,61%	0,01%	0,07%

IPCA (Benchmark)	0,26%	2,06%	0,80%	2,63%	3,72%	7,80%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,75%	2,12%	1,07%	3,76%	9,65%	22,11%	1,18%	2,64%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,70%	2,19%	0,96%	3,42%	9,47%	23,13%	0,46%	1,45%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,66%	3,18%	1,61%	4,19%	9,83%	22,96%	0,33%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,99%	0,85%	3,72%	7,14%	-	0,92%	2,69%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,86%	2,02%	0,97%	3,60%	9,56%	23,23%	0,79%	1,90%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,89%	1,52%	2,62%	2,46%	4,81%	-	0,65%	4,14%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	-1,86%	-0,93%	-2,04%	0,75%	1,15%	-	4,61%	4,62%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,80%	-0,85%	-1,96%	0,83%	1,26%	-	4,50%	4,56%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	1,53%	2,64%	2,47%	4,94%	-	0,65%	4,11%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	1,90%	0,81%	3,75%	10,54%	22,53%	1,25%	3,04%

Ibovespa (Benchmark)	-3,04%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	-	-
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-4,96%	-16,13%	-10,48%	-11,64%	-6,79%	-20,05%	6,89%	17,51%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,96%	-2,57%	-3,01%	4,60%	16,13%	11,16%	4,12%	13,32%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-2,74%	-10,28%	-7,07%	-5,43%	5,91%	0,52%	5,64%	14,44%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-3,03%	-9,04%	-5,42%	-4,17%	12,36%	9,48%	4,61%	13,84%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90%	-12,76%	-7,23%	-8,21%	7,50%	-3,15%	4,12%	14,01%

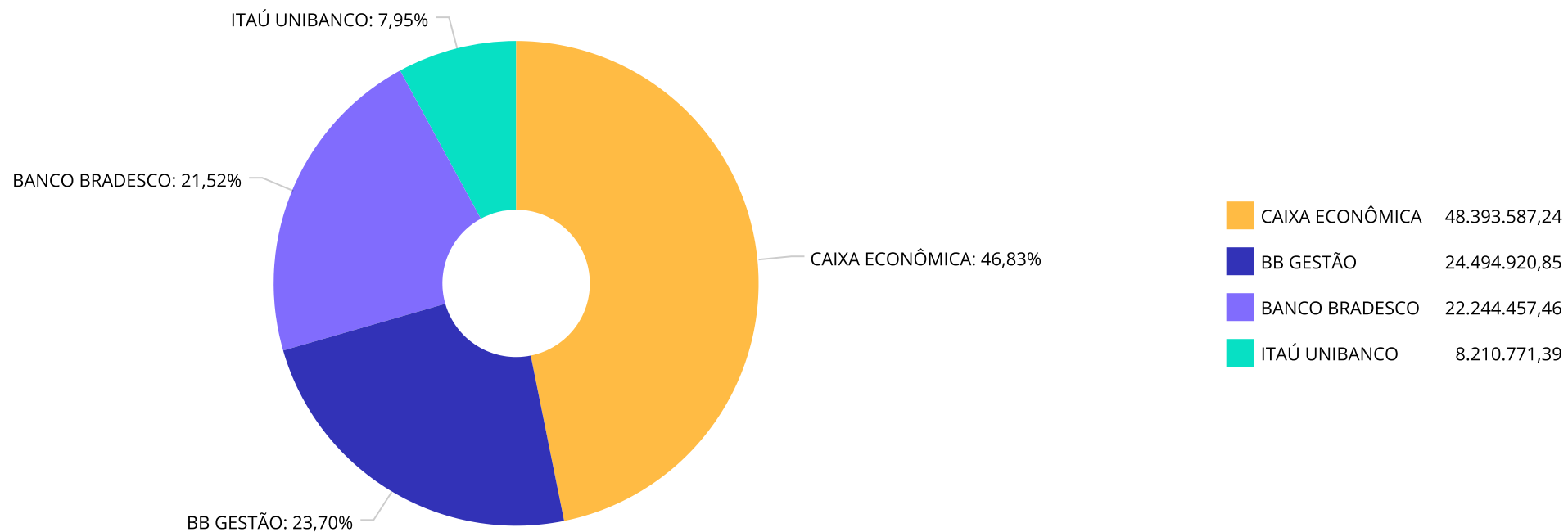
IDIV (Benchmark)	-0,99%	-5,29%	-2,73%	1,24%	19,55%	18,54%	-	-
BRDESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,14%	-5,78%	-3,03%	0,70%	18,48%	16,46%	5,76%	12,68%

MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	6,03%	19,05%	8,68%	22,11%	29,33%	39,51%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,17%	18,10%	6,15%	21,58%	30,30%	40,54%	4,50%	13,60%

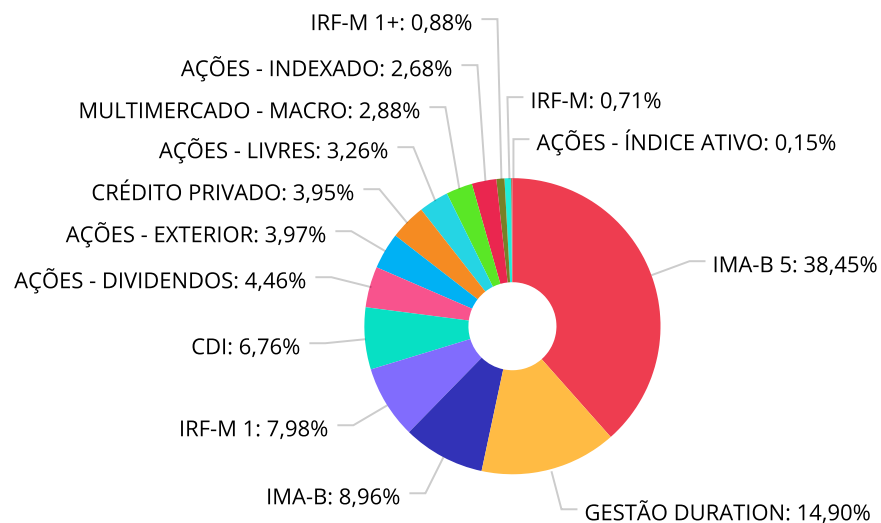
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	6,03%	19,05%	8,68%	22,11%	29,33%	39,51%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,17%	18,10%	6,15%	21,58%	30,30%	40,54%	4,50%	13,600%
Global BDRX (Benchmark)	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,48%	9,02%	3,65%	11,51%	21,18%	23,78%	4,20%	13,694%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Maio / 2024)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2024)

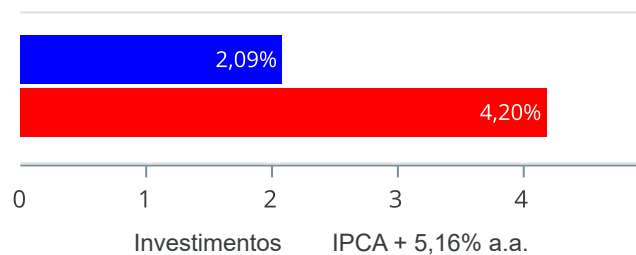


IMA-B 5	39.733.853,59	GESTÃO DURATION	15.394.631,70	IMA-B	9.263.813,99	IRF-M 1	8.242.495,55
CDI	6.990.727,82	AÇÕES - DIVIDENDOS	4.612.120,99	AÇÕES - EXTERIOR	4.105.950,81	CRÉDITO PRIVADO	4.081.004,56
AÇÕES - LIVRES	3.371.021,16	MULTIMERCADO - MACRO	2.978.515,76	AÇÕES - INDEXADO	2.767.306,23	IRF-M 1+	912.256,62
IRF-M	732.739,83	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	157.298,33				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

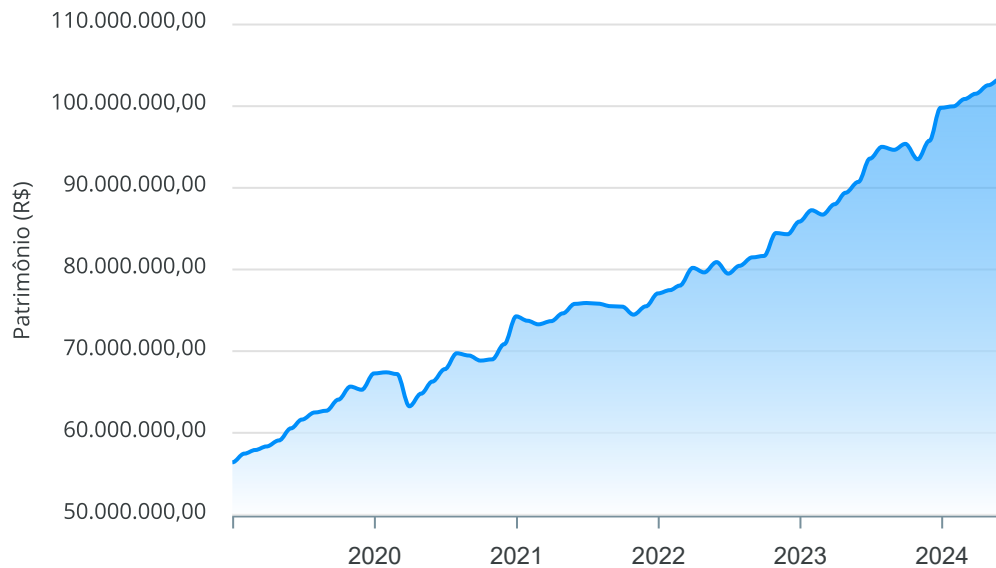
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	99.799.947,54	255,38	0,00	99.980.733,46	180.530,54	180.530,54	0,18%	0,18%	0,86%	0,86%	20,98%	1,31%
Fevereiro	99.980.733,46	6.400.191,42	6.389.271,51	100.877.490,54	885.837,17	1.066.367,71	0,89%	1,07%	1,21%	2,09%	51,22%	2,29%
Março	100.877.490,54	1.946,06	0,00	101.520.674,90	641.238,30	1.707.606,01	0,64%	1,71%	0,56%	2,66%	64,36%	1,10%
Abril	101.520.674,90	1.394.750,23	0,00	102.567.767,48	-347.657,65	1.359.948,36	-0,34%	1,37%	0,82%	3,50%	39,04%	1,57%
Maio	102.567.767,48	574.048,63	528.249,68	103.343.736,94	730.170,51	2.090.118,87	0,71%	2,09%	0,68%	4,20%	49,68%	1,54%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



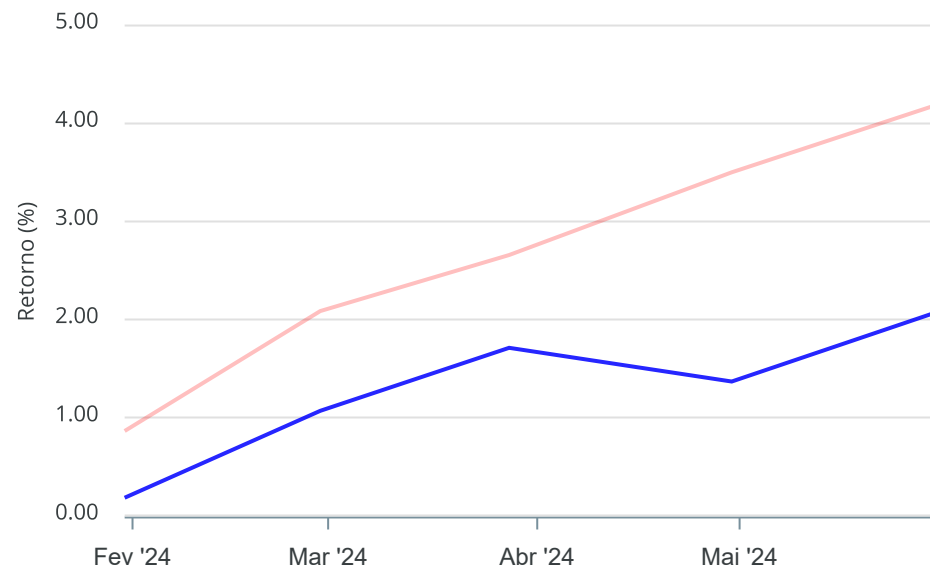
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.551.290,66	0,00	0,00	2.584.510,75	33.220,09	1,30%	1,30%	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.593.585,61	0,00	0,00	6.679.303,24	85.717,63	1,30%	1,30%	1,28%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.378.668,91	0,00	180.663,49	6.264.158,55	66.153,13	1,04%	-1,80%	4,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	12.005.885,98	0,00	347.586,19	11.782.239,77	123.939,98	1,03%	1,04%	0,92%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	2.909.647,64	0,00	0,00	2.939.494,16	29.846,52	1,03%	1,03%	0,55%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.409.950,25	0,00	0,00	5.458.224,72	48.274,47	0,89%	0,89%	0,65%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.044.985,96	0,00	0,00	4.081.004,56	36.018,60	0,89%	0,89%	0,05%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	564.695,22	0,00	0,00	569.707,05	5.011,83	0,89%	0,89%	0,65%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.370.246,86	0,00	0,00	18.532.904,22	162.657,36	0,89%	0,89%	0,65%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.959.856,18	0,00	0,00	8.028.428,22	68.572,04	0,86%	0,86%	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	257.560,18	0,00	0,00	259.707,79	2.147,61	0,83%	0,83%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.131.188,39	0,00	0,00	4.162.592,21	31.403,82	0,76%	0,76%	0,18%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.049.333,73	0,00	0,00	4.079.903,34	30.569,61	0,75%	0,75%	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	310.768,66	0,00	0,00	313.089,72	2.321,06	0,75%	0,75%	1,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.699.114,22	0,00	0,00	6.747.444,21	48.329,99	0,72%	0,72%	0,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	187.068,59	0,00	0,00	188.383,35	1.314,76	0,70%	0,70%	0,46%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	116.521,99	0,00	0,00	117.286,20	764,21	0,66%	0,66%	0,33%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	623.997,06	0,00	0,00	627.973,36	3.976,30	0,64%	0,64%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	104.108,69	0,00	0,00	104.766,47	657,78	0,63%	0,63%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	906.979,04	0,00	0,00	912.256,62	5.277,58	0,58%	0,58%	1,85%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	345.092,09	354.048,63	0,00	703.088,26	3.947,54	0,56%	0,75%	0,01%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	0,00	220.000,00	0,00	215.056,89	-4.943,11	-2,25%	-1,86%	4,61%
Total Renda Fixa	84.520.545,91	574.048,63	528.249,68	85.351.523,66	785.178,80	0,93%		0,97%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.963.704,49	0,00	0,00	2.978.515,76	14.811,27	0,50%	0,50%	1,25%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.665.162,43	0,00	0,00	4.612.120,99	-53.041,44	-1,14%	-1,14%	5,76%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	234.301,87	0,00	0,00	227.889,67	-6.412,20	-2,74%	-2,74%	5,64%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	276.535,82	0,00	0,00	268.516,65	-8.019,17	-2,90%	-2,90%	4,12%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.962.216,15	0,00	0,00	2.874.614,84	-87.601,31	-2,96%	-2,96%	4,12%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.853.633,05	0,00	0,00	2.767.306,23	-86.326,82	-3,03%	-3,03%	4,61%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	165.513,65	0,00	0,00	157.298,33	-8.215,32	-4,96%	-4,96%	6,89%
Total Renda Variável	14.121.067,46	0,00	0,00	13.886.262,47	-234.804,99	-1,66%		4,20%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Maio / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	231.635,01	0,00	0,00	245.934,47	14.299,46	6,17%	6,17%	4,50%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	3.694.519,10	0,00	0,00	3.860.016,34	165.497,24	4,48%	4,48%	4,20%
Total Exterior	3.926.154,11	0,00	0,00	4.105.950,81	179.796,70	4,58%		4,22%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

