

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

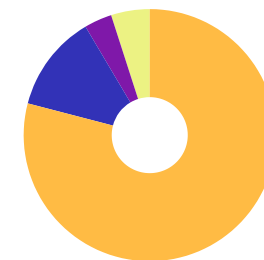
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.499.528,54	3,00%	704	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	11.894.335,04	5,49%	867	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.423.021,52	1,12%	1.148	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	D+0	Não há	7.378.426,67	3,41%	185	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	7.074.752,58	3,27%	350	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.857.673,53	1,78%	214	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	7.452.314,79	3,44%	88	1,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	4.833.613,83	2,23%	370	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRASESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.372.593,05	2,48%	89	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	10.056.745,15	4,64%	307	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	2.622.187,98	1,21%	217	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	8.788.227,15	4,06%	77	2,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	5.599.343,26	2,59%	110	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.822.537,29	3,61%	789	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.296.471,41	5,68%	907	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.132.016,38	1,45%	1.169	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	13.061.583,99	6,03%	450	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	D+0	46524	4.180.110,18	1,93%	8	2,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.015.099,69	1,85%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.718.242,05	4,95%	241	1,20%	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
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	2.686.862,76	1,24%	87	0,53%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.303.075,86	0,60%	138	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.181.405,09	1,01%	453	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	816.931,67	0,38%	316	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.269.420,59	1,51%	4.618	0,24%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	630.218,15	0,29%	7.376	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	256.330,51	0,12%	4.787	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	1.997.149,66	0,92%	583	0,47%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTI...	D+1	1185 dias	4.007.737,32	1,85%	12	7,35%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	583.819,22	0,27%	95	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			216.539.742,43				

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%	0,00%	5,00%	10.826.987,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	128.360.582,03	59,28%	30,00%	59,00%	90,00%	66.525.186,16
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	42.827.960,61	19,78%	10,00%	13,00%	60,00%	87.095.884,85
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	43.307.948,49
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.330.794,85
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	10.826.987,12
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.330.794,85
Total Renda Fixa	100,00%	171.188.542,64	79,06%	40,00%	74,00%	184,00%	



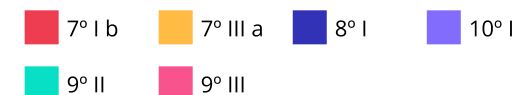
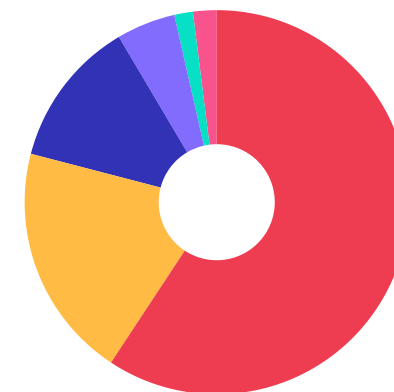
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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%	26.920.661,81	12,43%	5,00%	16,00%	30,00%	38.041.260,92
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.826.987,12
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.744.675,45	4,96%	2,00%	4,00%	10,00%	10.909.298,79
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	10.826.987,12
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	10.826.987,12
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	37.665.337,26	17,39%	7,00%	23,00%	55,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.384.449,91	1,56%	0,00%	1,50%	10,00%	18.269.524,33
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.301.412,62	1,99%	0,00%	1,50%	10,00%	17.352.561,62
Total Exterior	10,00%	7.685.862,53	3,55%	0,00%	3,00%	20,00%	



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	5,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	128.360.582,03	59,28	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	42.827.960,61	19,78	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso I	26.920.661,81	12,43	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	3.384.449,91	1,56	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	4.301.412,62	1,99	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	10.744.675,45	4,96	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	88.395.260,63	40,82	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	83.382.066,14	38,51	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	17.819.807,19	8,23	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	11.787.174,99	5,44	-
TRÍGONO CAPITAL	4.418.681,90	2,04	-
BANCO J. SAFRA S/A	4.007.737,32	1,85	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.985.405,67	1,38	-
ICATU VANGUARDA	1.997.149,66	0,92	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	1.746.458,93	0,81	-

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
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,56%	1,87%	0,64%	3,40%	10,79%	27,10%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,53%	1,55%	0,44%	3,06%	10,14%	25,62%	1,37%	2,65%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,07%	3,03%	1,78%	4,53%	9,23%	18,78%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	2,85%	1,67%	4,31%	8,93%	18,32%	0,58%	1,67%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,78%	3,85%	2,21%	4,80%	11,56%	26,65%	-	-
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	3,77%	2,13%	4,69%	11,27%	25,97%	0,18%	0,33%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	2,92%	1,62%	4,42%	8,94%	19,23%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	2,83%	1,56%	4,31%	8,70%	18,94%	0,55%	1,72%

IMA-B (Benchmark)	1,33%	-0,13%	-0,23%	2,62%	6,56%	17,72%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,39%	-2,77%	-0,36%	-0,52%	0,18%	2,79%	1,34%	5,42%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,30%	-1,35%	-1,06%	1,45%	4,73%	14,17%	1,39%	4,26%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,27%	-0,36%	-0,41%	2,35%	6,00%	16,86%	1,32%	3,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	-0,30%	-0,32%	2,44%	6,16%	16,93%	1,28%	3,87%

IRF-M (Benchmark)	0,66%	1,81%	0,67%	3,32%	10,51%	26,78%	-	-
--------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,69%	0,58%	3,18%	10,24%	26,33%	1,32%	2,36%
CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	4,81%	2,76%	5,79%	13,06%	28,67%	0,03%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86%	4,63%	2,70%	5,62%	12,92%	28,34%	0,03%	0,10%
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	4,38%	2,56%	5,31%	11,94%	27,01%	0,00%	0,06%
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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,84%	4,51%	2,62%	5,47%	12,52%	27,70%	0,03%	0,09%
IPCA (Benchmark)	0,46%	2,27%	1,00%	2,84%	3,93%	8,02%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,14%	0,88%	0,16%	2,88%	6,45%	-	1,10%	3,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,99%	0,85%	3,72%	7,14%	-	0,92%	2,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	4,51%	2,62%	5,48%	11,10%	19,57%	0,65%	0,86%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,66%	3,18%	1,61%	4,19%	9,83%	22,96%	0,33%	1,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,70%	2,19%	0,96%	3,42%	9,47%	23,13%	0,46%	1,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	4,56%	2,64%	5,53%	11,21%	-	0,65%	0,86%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

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
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
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	0,25%	-0,05%	0,04%	3,81%	11,81%	27,63%	2,74%	5,23%
CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,73%	8,93%	3,52%	14,08%	26,22%	-	4,28%	9,14%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	1,90%	0,81%	3,75%	10,54%	22,53%	1,25%	3,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,49%	-1,65%	-1,46%	0,36%	9,02%	19,22%	2,49%	4,63%
Global BDRX (Benchmark)	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,78%	23,76%	11,38%	26,96%	35,62%	54,35%	4,53%	13,52%
Ibovespa (Benchmark)	-3,04%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,81%	-10,05%	-7,13%	-4,78%	9,47%	3,71%	5,23%	14,48%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,49%	-12,94%	-5,59%	-8,79%	-1,55%	1,30%	4,57%	16,44%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-2,91%	-8,37%	-4,84%	-3,31%	12,61%	6,80%	4,56%	14,21%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,27%	-14,06%	-7,56%	-10,12%	-6,37%	-6,40%	5,28%	16,33%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,32%	-6,76%	-6,29%	-0,55%	15,12%	13,46%	7,67%	15,63%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-4,17%	-9,21%	-7,16%	-3,42%	9,39%	1,53%	5,54%	14,93%
BRANCO SELECTION FIC AÇÕES	-4,06%	-13,22%	-11,05%	-7,79%	-0,11%	-2,17%	6,12%	14,91%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,30%	-8,63%	-4,82%	-3,12%	10,82%	-0,56%	4,31%	14,18%

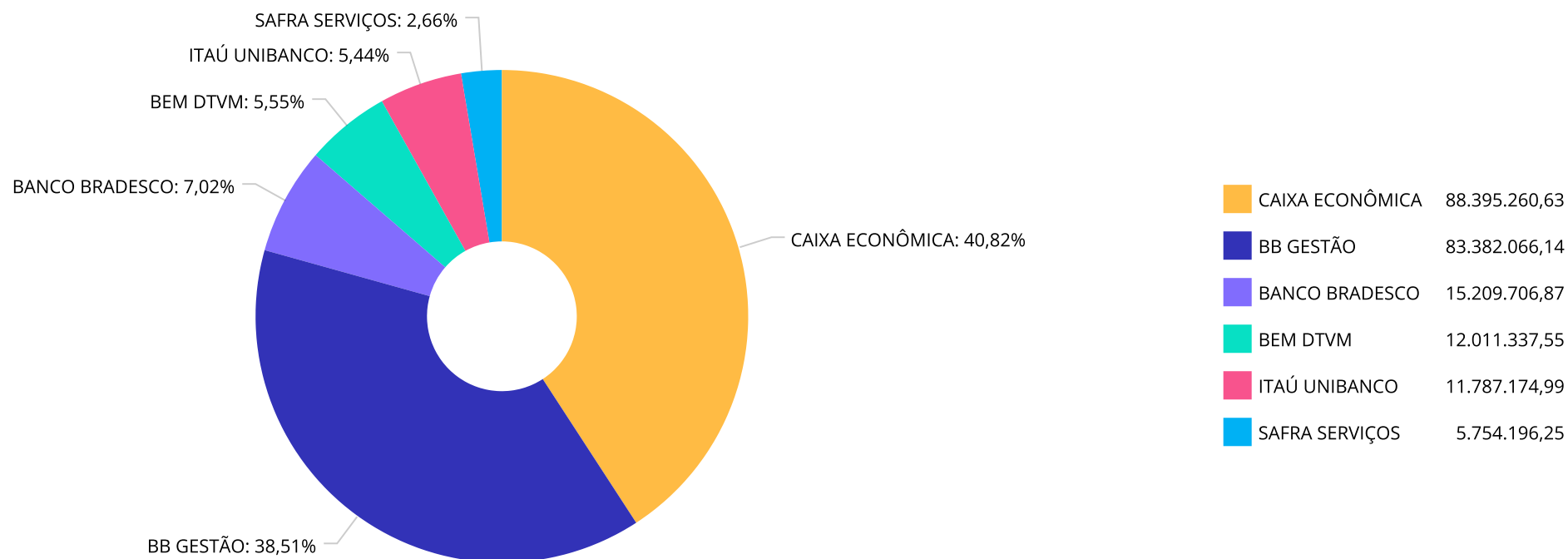
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90%	-12,76%	-7,23%	-8,21%	7,50%	-3,15%	4,12%	14,01%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-2,01%	-7,94%	-5,34%	-2,01%	11,79%	13,72%	6,65%	14,42%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-4,96%	-16,13%	-10,48%	-11,64%	-6,79%	-20,05%	6,89%	17,51%
IDIV (Benchmark)	-0,99%	-5,29%	-2,73%	1,24%	19,55%	18,54%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-2,78%	-6,87%	-7,56%	0,72%	9,44%	13,03%	7,20%	14,90%
MSCI ACWI (Benchmark)	5,22%	16,99%	8,53%	20,14%	25,00%	33,38%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,07%	12,32%	4,50%	18,15%	33,23%	47,36%	4,06%	11,33%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,80%	10,64%	3,56%	15,54%	26,26%	27,72%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5,01%	12,08%	4,39%	17,87%	32,77%	46,52%	4,03%	11,27%
SMLL (Benchmark)	-3,38%	-14,52%	-8,96%	-8,50%	-4,39%	-11,41%	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-0,24%	-12,79%	-8,23%	-7,77%	-7,78%	-19,46%	7,05%	19,48%

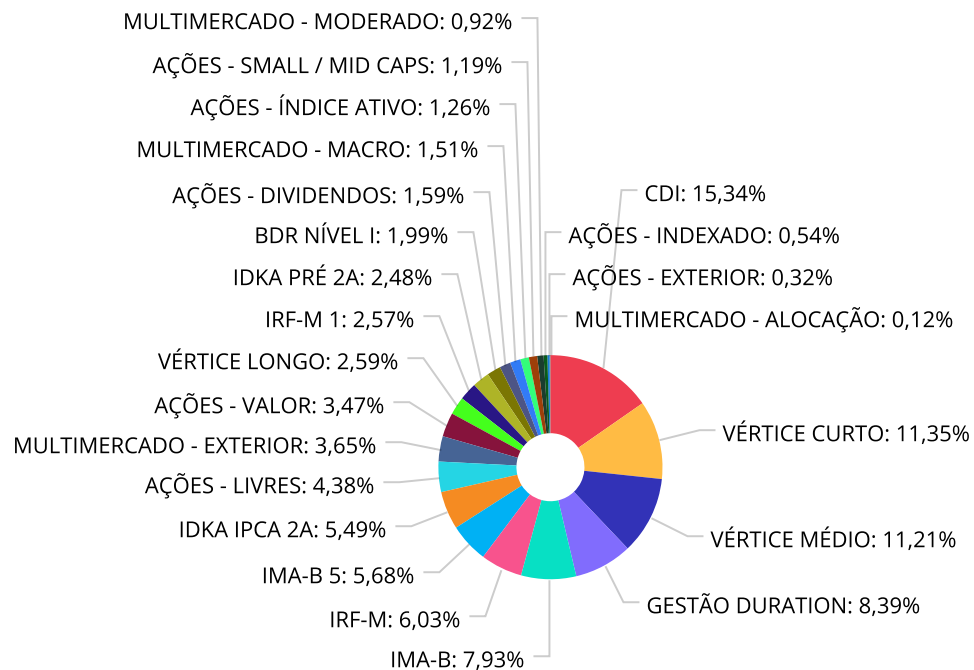
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,86%	15,95%	7,97%	18,86%	26,60%	36,89%	4,31%	12,188%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,78%	23,76%	11,38%	26,96%	35,62%	54,35%	4,53%	13,518%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,26%	18,59%	6,42%	22,19%	31,61%	43,37%	4,50%	13,600%
MSCI WORLD (Benchmark)	5,64%	17,70%	8,59%	21,01%	26,53%	36,82%	-	-
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	4,57%	18,78%	9,44%	21,78%	27,96%	38,09%	5,74%	13,198%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	4,54%	15,27%	9,38%	21,16%	18,48%	21,66%	7,09%	13,443%

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



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

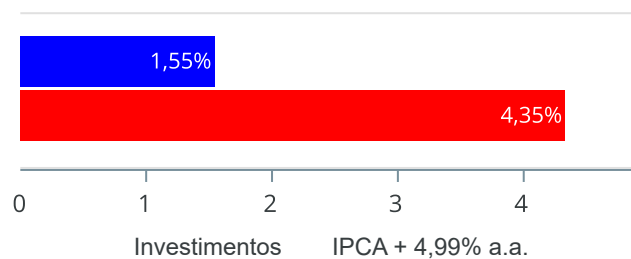


■ CDI	33.209.272,33	■ VÉRTICE CURTO	24.587.299,54	■ VÉRTICE MÉDIO	24.278.325,65	■ GESTÃO DURATION	18.168.464,59
■ IMA-B	17.165.815,88	■ IRF-M	13.061.583,99	■ IMA-B 5	12.296.471,41	■ IDKA IPCA 2A	11.894.335,04
■ AÇÕES - LIVRES	9.492.530,85	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	7.908.637,45	■ AÇÕES - VALOR	7.524.267,63	■ VÉRTICE LONGO	5.599.343,26
■ IRF-M 1	5.555.037,90	■ IDKA PRÉ 2A	5.372.593,05	■ BDR NÍVEL I	4.301.412,62	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.439.865,07
■ MULTIMERCADO - MACRO	3.269.420,59	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.721.338,05	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.577.382,27	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.997.149,66
■ AÇÕES - INDEXADO	1.165.277,94	■ AÇÕES - EXTERIOR	697.587,15	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	256.330,51		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

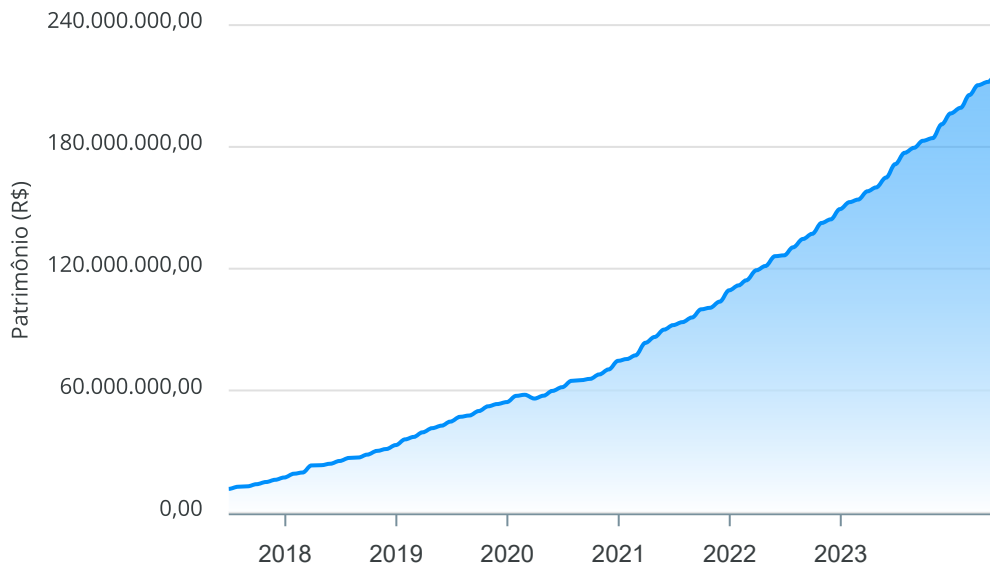
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	190.720.289,47	2.690.172,22	303.363,97	193.131.552,71	24.454,99	24.454,99	0,01%	0,01%	0,85%	0,85%	1,49%	1,55%
Fevereiro	193.131.552,71	5.453.268,00	1.161.385,35	199.269.550,25	1.846.114,89	1.870.569,88	0,94%	0,95%	1,20%	2,06%	46,04%	2,05%
Março	199.269.550,25	13.358.483,49	10.319.603,54	203.932.602,90	1.624.172,70	3.494.742,58	0,80%	1,76%	0,55%	2,62%	67,16%	1,42%
Abril	203.932.602,90	3.394.899,64	332.311,52	205.451.325,29	-1.543.865,73	1.950.876,85	-0,75%	1,00%	0,81%	3,45%	28,99%	1,96%
Maio	205.451.325,29	22.052.048,49	18.836.323,25	209.803.538,90	1.136.488,37	3.087.365,22	0,54%	1,55%	0,87%	4,35%	35,66%	1,81%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



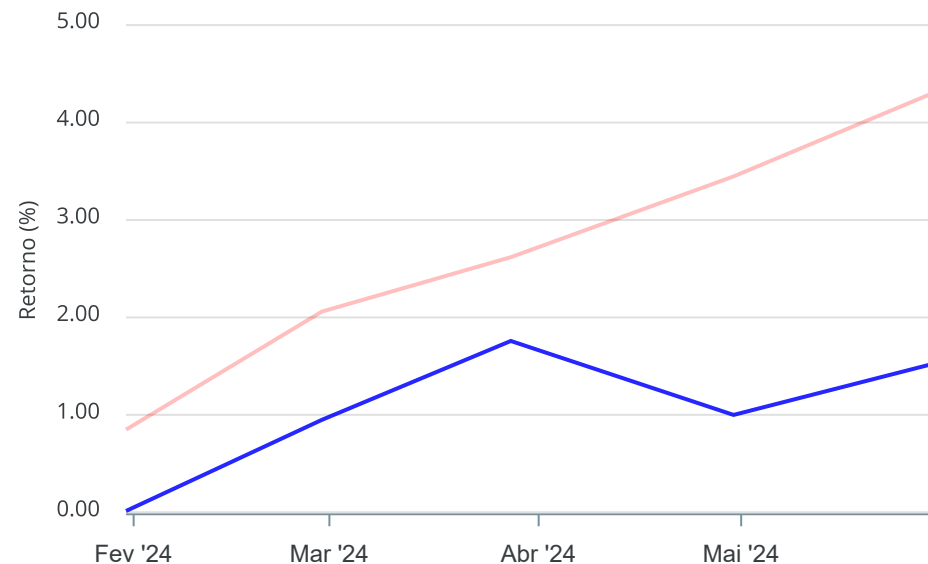
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.522.856,23	0,00	0,00	5.599.343,26	76.487,03	1,38%	1,38%	1,34%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	3.963.559,72	0,00	0,00	4.015.099,69	51.539,97	1,30%	1,30%	1,39%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.581.337,09	0,00	0,00	10.718.242,05	136.904,96	1,29%	1,29%	1,28%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.401.936,60	0,00	0,00	2.432.474,14	30.537,54	1,27%	1,27%	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.930.898,49	0,00	113.804,68	3.857.673,53	40.579,72	1,03%	1,04%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.171.386,87	0,00	0,00	12.296.471,41	125.084,54	1,03%	1,03%	0,55%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.263.105,08	0,00	2.500.000,00	11.894.335,04	131.229,96	0,92%	1,05%	0,58%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.598.996,42	0,00	0,00	2.622.187,98	23.191,56	0,89%	0,89%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	7.012.192,33	0,00	0,00	7.074.752,58	62.560,25	0,89%	0,89%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.791.171,84	0,00	0,00	4.833.613,83	42.441,99	0,89%	0,89%	0,65%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.968.480,31	0,00	0,00	10.056.745,15	88.264,84	0,89%	0,89%	0,65%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.340.021,53	0,00	0,00	7.404.639,68	64.618,15	0,88%	0,88%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.956.312,17	0,00	0,00	2.981.766,41	25.454,24	0,86%	0,86%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.108.387,54	0,00	0,00	3.132.016,38	23.628,84	0,76%	0,76%	0,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.405.115,37	0,00	0,00	2.423.021,52	17.906,15	0,74%	0,74%	0,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.452.974,29	0,00	0,00	6.499.528,54	46.554,25	0,72%	0,72%	0,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	7.400.000,00	0,00	7.452.314,79	52.314,79	0,71%	1,14%	1,10%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.767.942,48	0,00	0,00	7.822.537,29	54.594,81	0,70%	0,70%	0,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	9.215.871,43	0,00	1.900.000,00	7.378.426,67	62.555,24	0,68%	0,82%	0,00%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.821.336,45	0,00	0,00	3.846.398,76	25.062,31	0,66%	0,66%	0,33%

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
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.979.576,33	0,00	0,00	13.061.583,99	82.007,66	0,63%	0,63%	1,32%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	8.983.192,14	246.357,66	8.788.227,15	51.392,67	0,57%	-1,80%	4,50%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	5.344.032,90	0,00	0,00	5.372.593,05	28.560,15	0,53%	0,53%	1,37%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.688.940,07	248.093,40	8.888.024,25	7.126.017,82	77.008,60	0,48%	0,84%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	8.058.091,83	3.539.229,36	3.334.882,94	8.318.421,75	55.983,50	0,48%	0,83%	0,02%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	4.137.311,44	119.961,30	0,00	4.180.110,18	-77.162,56	-1,81%	-1,86%	4,61%
Total Renda Fixa	166.481.834,81	20.290.476,20	16.983.069,53	171.188.542,64	1.399.301,16	0,82%		0,96%

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 INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	599.823,36	0,00	0,00	630.218,15	30.394,79	5,07%	5,07%	4,06%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	555.960,00	0,00	0,00	583.819,22	27.859,22	5,01%	5,01%	4,03%
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIME...	3.901.228,92	0,00	0,00	4.007.737,32	106.508,40	2,73%	2,73%	4,28%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.983.320,04	0,00	2.004.443,49	0,00	21.123,45	1,07%	0,10%	2,24%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.253.162,73	0,00	0,00	3.269.420,59	16.257,86	0,50%	0,50%	1,25%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	500.144,79	0,00	0,00	498.960,98	-1.183,81	-0,24%	-0,24%	7,05%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	2.004.443,49	0,00	1.997.149,66	-7.293,83	-0,36%	0,25%	2,74%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	257.598,17	0,00	0,00	256.330,51	-1.267,66	-0,49%	-0,49%	2,49%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.046.582,17	0,00	0,00	2.985.405,67	-61.176,50	-2,01%	-2,01%	6,65%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.532.528,49	0,00	0,00	2.474.321,15	-58.207,34	-2,30%	-2,30%	4,31%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.775.751,70	0,00	0,00	5.641.816,29	-133.935,41	-2,32%	-2,32%	7,67%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.131.085,81	0,00	0,00	1.099.604,46	-31.481,35	-2,78%	-2,78%	7,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.609.682,55	0,00	0,00	3.505.006,52	-104.676,03	-2,90%	-2,90%	4,12%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.200.203,05	0,00	0,00	1.165.277,94	-34.925,11	-2,91%	-2,91%	4,56%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	2.148.642,38	0,00	0,00	2.078.421,29	-70.221,09	-3,27%	-3,27%	5,28%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.424.987,99	0,00	0,00	2.340.260,61	-84.727,38	-3,49%	-3,49%	4,57%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.146.268,81	0,00	0,00	2.064.540,81	-81.728,00	-3,81%	-3,81%	5,23%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.200.414,57	0,00	0,00	2.111.139,34	-89.275,23	-4,06%	-4,06%	6,12%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	360.736,22	0,00	0,00	345.708,04	-15.028,18	-4,17%	-4,17%	5,54%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	642.067,95	0,00	0,00	610.198,71	-31.869,24	-4,96%	-4,96%	6,89%

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
Total Renda Variável	38.270.189,70	2.004.443,49	2.004.443,49	37.665.337,26	-604.852,44	-1,50%		5,01%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.042.931,92	0,00	0,00	2.181.405,09	138.473,17	6,78%	6,78%	4,53%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.226.297,79	0,00	0,00	1.303.075,86	76.778,07	6,26%	6,26%	4,50%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	771.716,63	0,00	0,00	816.931,67	45.215,04	5,86%	5,86%	4,31%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	2.569.354,14	0,00	0,00	2.686.862,76	117.508,62	4,57%	4,57%	5,74%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	667.309,41	0,00	0,00	697.587,15	30.277,74	4,54%	4,54%	7,09%
Total Exterior	7.277.609,89	0,00	0,00	7.685.862,53	408.252,64	5,61%		5,16%

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.

