

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	4.031.989,73	5,03%	704	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.072.810,63	1,34%	867	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.257.388,71	1,57%	790	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.436.360,22	1,79%	648	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	52.481,62	0,07%	1.148	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	610.393,72	0,76%	645	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	5.642.220,14	7,04%	350	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	Não há	1.001.737,99	1,25%	41	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	1.889.131,17	2,36%	214	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	1.094.733,18	1,37%	88	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	6.367.594,54	7,94%	370	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	3.990.414,78	4,98%	217	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	1.478.981,72	1,84%	77	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.676.489,90	4,59%	789	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.779.642,62	3,47%	826	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.742.552,00	2,17%	247	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.955.704,64	4,93%	450	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.423.254,97	3,02%	30	1,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	70.724,67	0,09%	220	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.416.427,96	1,77%	1.021	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

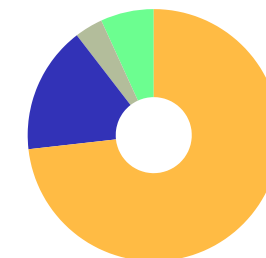
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.286.875,34	5,35%	188	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.148.391,42	6,42%	447	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.503.943,35	1,88%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	292.178,24	0,36%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	65.772,01	0,08%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.259.409,17	1,57%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	Não se ...	Não se aplica	44.631,44	0,06%	20	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	97.319,41	0,12%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	7.611,81	0,01%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.255.544,30	1,57%	2.588	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	728.693,12	0,91%	16.544	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.711.835,18	2,14%	201	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	202.755,05	0,25%	82	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.187.922,24	2,73%	2.171	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	1.572.223,58	1,96%	334	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	D+4	Não há	583.575,33	0,73%	6	1,95%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	D+3	Não há	606.961,09	0,76%	335	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	444.479,09	0,55%	7.794	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.584.530,14	1,98%	13	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	1.145.643,03	1,43%	19	0,16%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	D+31	Não há	856.212,99	1,07%	295	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	514.784,30	0,64%	44	0,13%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	591.358,07	0,74%	19.234	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.142.875,04	1,43%	138	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	653.973,41	0,82%	453	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.987.532,16	2,48%	81	1,74%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.632.128,85	2,04%	4.618	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.077.173,68	1,34%	7.376	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	779.651,29	0,97%	606	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	213.797,80	0,27%		0,00%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			80.170.816,84				

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%	1,00%	10,00%	8.017.081,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	44.574.606,95	55,60%	20,00%	59,00%	90,00%	27.579.128,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	12.713.588,32	15,86%	5,00%	9,50%	60,00%	35.388.901,78
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	8.017.081,68
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.408.971,83	1,76%	0,00%	2,00%	3,00%	996.152,68
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	3,00%	2.405.124,51
Total Renda Fixa	100,00%	58.697.167,10	73,22%	25,00%	73,00%	176,00%	



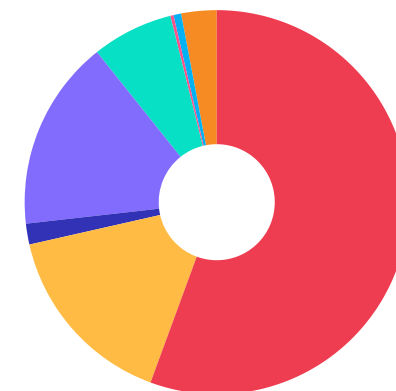
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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%	12.880.375,14	16,07%	0,00%	18,00%	30,00%	11.170.869,91
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.476.485,98	6,83%	0,00%	7,00%	10,00%	2.540.595,70
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,20%	5,00%	4.008.540,84
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,30%	5,00%	4.008.540,84
Desenquadrado - RV	0,00%	213.797,80	0,27%	0,00%	0,00%	0,00%	-213.797,80
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	18.570.658,92	23,16%	0,00%	25,50%	50,00%	

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%	514.784,30	0,64%	0,00%	0,50%	1,00%	286.923,87
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.388.206,52	2,98%	0,00%	1,00%	10,00%	5.628.875,16
Total Exterior	10,00%	2.902.990,82	3,62%	0,00%	1,50%	11,00%	



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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	44.574.606,95	55,60	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	12.713.588,32	15,86	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.408.971,83	1,76	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	12.880.375,14	16,07	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	514.784,30	0,64	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso III	2.388.206,52	2,98	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.476.485,98	6,83	0,00	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	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.380.931,94	45,38	-
CAIXA DTVM	28.050.043,25	34,99	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.718.110,02	4,64	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.868.283,74	3,58	-
TRÍGONO CAPITAL	2.730.173,17	3,41	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.187.922,24	2,73	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	1.572.223,58	1,96	-
ITAÚ UNIBANCO	1.190.536,42	1,48	-
VOKIN INVESTIMENTOS	856.212,99	1,07	-
RJI CORRETORA DE VALORES	292.178,24	0,36	-
CADENCE GESTORA	213.797,80	0,27	-
PLURAL	110.403,45	0,14	-

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 IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,07%	3,03%	1,78%	4,53%	9,23%	18,78%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	2,76%	1,57%	4,20%	8,99%	18,09%	0,66%	1,67%
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	5,17%	2,73%	6,38%	11,20%	23,67%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,40%	-2,31%	-1,27%	-2,74%	-4,96%	-4,67%	0,08%	15,24%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,20%	-4,20%	-3,68%	-4,33%	-4,64%	-14,19%	0,04%	3,51%
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%	-	-
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%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	2,82%	1,56%	4,30%	8,68%	18,75%	0,55%	1,73%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,34%	-8,14%	0,95%	-16,96%	-27,13%	-24,36%	0,02%	23,12%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,40%	-75,24%	-68,90%	-79,79%	-80,04%	-84,08%	0,48%	65,87%
IMA-B (Benchmark)	1,33%	-0,13%	-0,23%	2,62%	6,56%	17,72%	-	-

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
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,29%	0,40%	0,02%	0,92%	2,64%	8,53%	0,38%	0,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,31%	-0,24%	-0,29%	2,49%	6,25%	17,16%	1,28%	3,85%
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%	-	-
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-0,59%	-4,56%	-2,36%	-5,63%	-8,63%	-22,07%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,83%	4,40%	2,52%	5,38%	12,44%	27,60%	0,05%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	3,97%	2,32%	4,82%	10,90%	24,61%	0,01%	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 INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,85%	4,61%	2,66%	5,66%	12,57%	27,23%	0,06%	0,13%
IPCA (Benchmark)	0,46%	2,27%	1,00%	2,84%	3,93%	8,02%	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	4,56%	2,64%	5,53%	11,21%	-	0,65%	0,86%
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%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	4,51%	2,62%	5,48%	11,10%	19,57%	0,65%	0,86%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	1,53%	2,64%	2,47%	4,94%	-	0,65%	4,11%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,29%	-0,18%	0,76%	-0,66%	-7,58%	-6,90%	0,32%	8,04%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,89%	1,52%	2,62%	2,46%	4,81%	-	0,65%	4,14%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,80%	-0,85%	-1,96%	0,83%	1,26%	-	4,50%	4,56%

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%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,26%	1,98%	0,78%	3,23%	8,54%	20,97%	0,96%	1,65%
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%	-	-
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-2,01%	-7,94%	-5,34%	-2,01%	11,79%	13,72%	6,65%	14,42%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,99%	-9,98%	-7,53%	-4,14%	4,11%	0,50%	6,64%	13,99%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	-3,06%	-8,56%	-5,09%	-3,35%	13,25%	8,44%	4,69%	14,24%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	-3,05%	-9,06%	-5,39%	-4,07%	12,95%	10,34%	4,70%	14,10%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,32%	-6,76%	-6,29%	-0,55%	15,12%	13,46%	7,67%	15,63%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90%	-12,76%	-7,23%	-8,21%	7,50%	-3,15%	4,12%	14,01%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,49%	-12,94%	-5,59%	-8,79%	-1,55%	1,30%	4,57%	16,44%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,27%	-14,06%	-7,56%	-10,12%	-6,37%	-6,40%	5,28%	16,33%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	-8,80%	-14,44%	-11,93%	-10,10%	0,63%	-	7,90%	17,29%
IBX-50 (Benchmark)	-3,11%	-7,63%	-4,50%	-2,72%	14,94%	9,84%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-3,52%	-8,82%	-5,65%	-3,50%	10,23%	3,09%	4,27%	13,99%

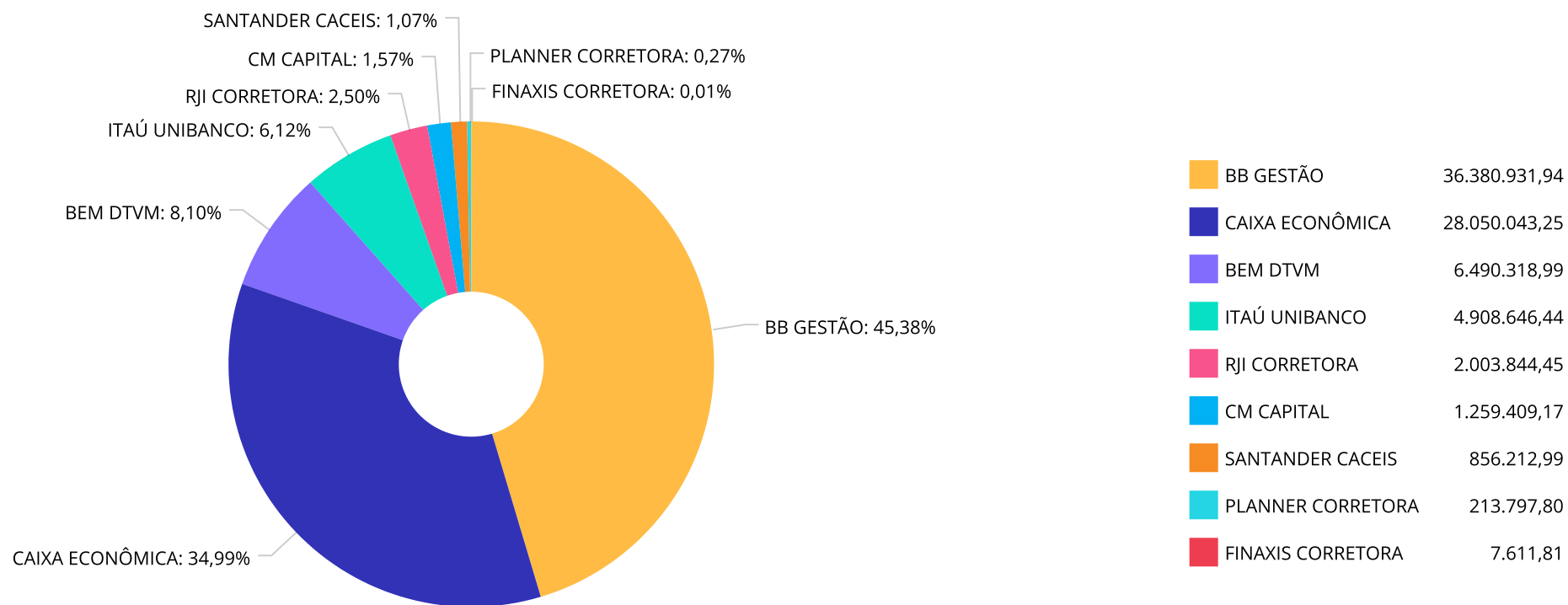
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IFIX (Benchmark)	0,02%	2,14%	0,66%	6,48%	12,24%	19,92%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-	-	-	-	-	-	-	-
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%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	5,06%	12,30%	4,52%	18,11%	33,16%	47,28%	4,06%	11,32%
SMLL (Benchmark)	-3,38%	-14,52%	-8,96%	-8,50%	-4,39%	-11,41%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-2,11%	-12,72%	-7,98%	-6,22%	-3,70%	-9,06%	6,89%	18,19%

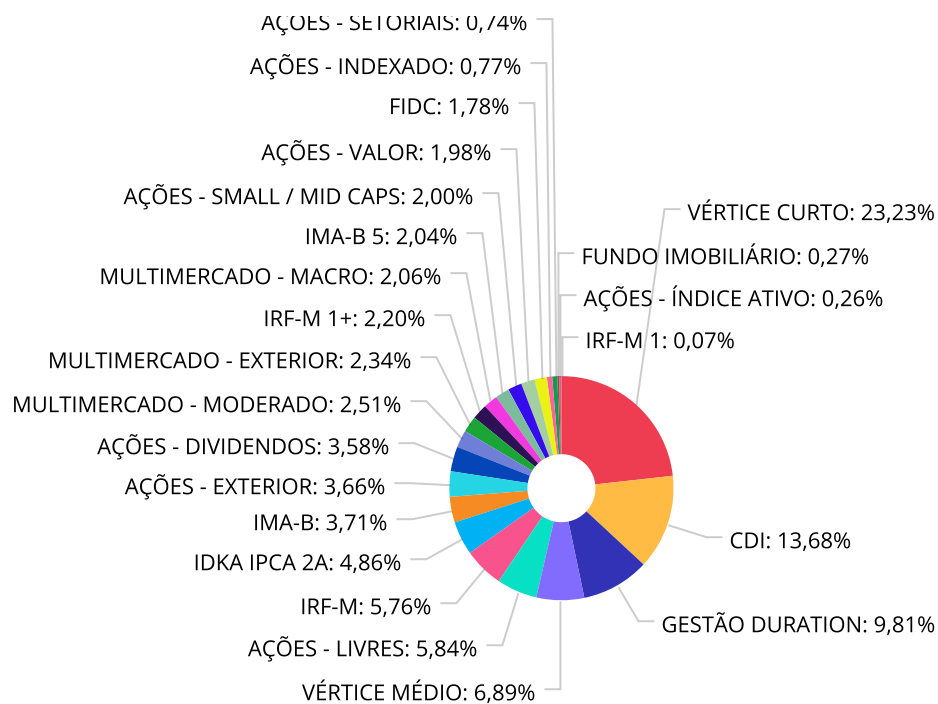
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
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 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%
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 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)

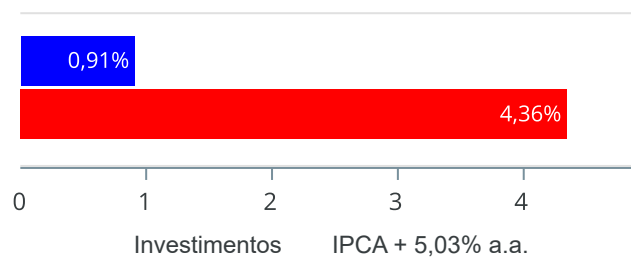


■ VÉRTICE CURTO	18.423.484,43	■ CDI	10.851.694,72	■ GESTÃO DURATION	7.779.204,30	■ VÉRTICE MÉDIO	5.464.584,06
■ AÇÕES - LIVRES	4.628.450,54	■ IRF-M	4.566.098,36	■ IDKA IPCA 2A	3.852.453,25	■ IMA-B	2.940.303,57
■ AÇÕES - EXTERIOR	2.902.990,82	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.840.074,44	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.987.532,16	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.856.824,97
■ IRF-M 1+	1.742.552,00	■ MULTIMERCADO - MACRO	1.632.128,85	■ IMA-B 5	1.615.338,96	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.590.122,12
■ AÇÕES - VALOR	1.572.223,58	■ FIDC	1.408.971,83	■ AÇÕES - INDEXADO	606.961,09	■ AÇÕES - SETORIAIS	583.575,33
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	213.797,80	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	202.755,05	■ IRF-M 1	52.481,62		

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	78.339.301,28	174.577,22	966.684,11	77.277.707,78	-269.486,61	-269.486,61	-0,34%	-0,34%	0,85%	0,85%	-40,42%	2,03%
Fevereiro	77.277.707,78	2.216.264,40	1.766.285,57	78.471.595,28	743.908,67	474.422,06	0,96%	0,61%	1,20%	2,07%	29,53%	2,29%
Março	78.471.595,28	10.143.739,99	9.632.986,14	79.605.791,84	623.442,71	1.097.864,77	0,79%	1,40%	0,55%	2,63%	53,43%	1,72%
Abril	79.605.791,84	3.787.128,65	3.313.627,20	79.389.618,63	-689.674,66	408.190,11	-0,86%	0,53%	0,81%	3,46%	15,34%	2,26%
Maio	79.389.618,63	2.616.020,71	2.136.767,61	80.170.816,84	301.945,11	710.135,22	0,38%	0,91%	0,87%	4,36%	20,88%	1,85%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



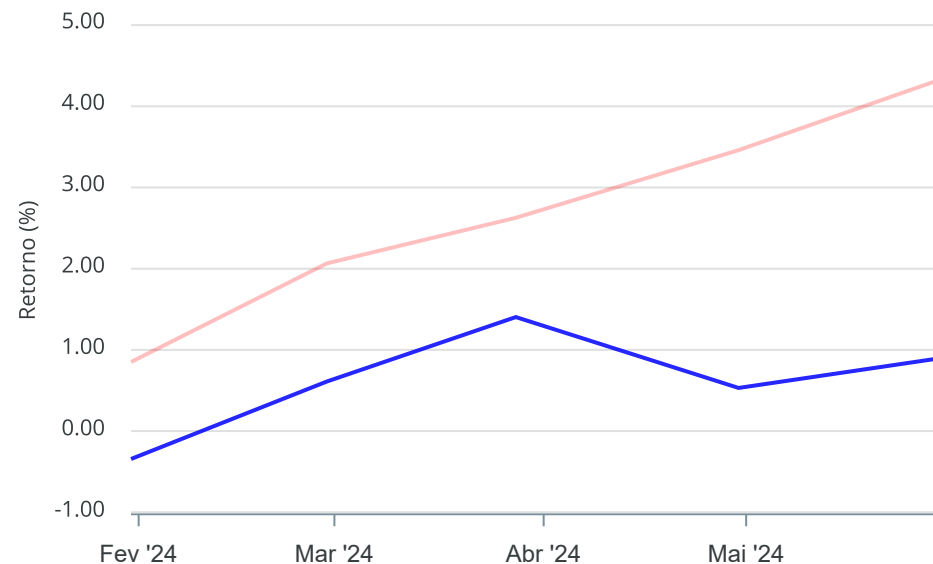
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.417.850,24	0,00	0,00	1.436.360,22	18.509,98	1,31%	1,31%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.082.349,72	0,00	0,00	1.094.733,18	12.383,46	1,14%	1,14%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.061.667,43	0,00	0,00	1.072.810,63	11.143,20	1,05%	1,05%	0,58%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.244.611,31	0,00	0,00	1.257.388,71	12.777,40	1,03%	1,03%	0,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.751.396,70	0,00	0,00	2.779.642,62	28.245,92	1,03%	1,03%	0,66%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.463.818,64	41.459,84	41.459,84	1.478.981,72	15.163,08	1,01%	-1,80%	4,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.823.139,18	100.000,00	52.782,28	1.889.131,17	18.774,27	0,98%	1,04%	0,92%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.955.122,13	0,00	0,00	3.990.414,78	35.292,65	0,89%	0,89%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	5.592.327,41	0,00	0,00	5.642.220,14	49.892,73	0,89%	0,89%	0,65%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	2.401.937,08	0,00	0,00	2.423.254,97	21.317,89	0,89%	0,89%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.311.683,28	0,00	0,00	6.367.594,54	55.911,26	0,89%	0,89%	0,65%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	4.250.704,36	0,00	0,00	4.286.875,34	36.170,98	0,85%	0,85%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.106.119,61	0,00	0,00	5.148.391,42	42.271,81	0,83%	0,83%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	70.200,36	0,00	0,00	70.724,67	524,31	0,75%	0,75%	1,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	52.093,78	0,00	0,00	52.481,62	387,84	0,74%	0,74%	0,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.003.109,76	0,00	0,00	4.031.989,73	28.879,97	0,72%	0,72%	0,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.650.831,05	0,00	0,00	3.676.489,90	25.658,85	0,70%	0,70%	0,46%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	606.528,73	0,00	0,00	610.393,72	3.864,99	0,64%	0,64%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.930.868,57	0,00	0,00	3.955.704,64	24.836,07	0,63%	0,63%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.732.471,01	0,00	0,00	1.742.552,00	10.080,99	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	1.965.385,97	1.474.560,87	2.042.525,49	1.416.427,96	19.006,61	0,55%	0,75%	0,01%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	291.180,38	0,00	0,00	292.178,24	997,86	0,34%	0,34%	0,02%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.499.568,17	0,00	0,00	1.503.943,35	4.375,18	0,29%	0,29%	0,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.001.737,99	1.737,99	0,17%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.261.940,67	0,00	0,00	1.259.409,17	-2.531,50	-0,20%	-0,20%	0,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	7.633,61	0,00	0,00	7.611,81	-21,80	-0,29%	-0,29%	0,32%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	97.714,50	0,00	0,00	97.319,41	-395,09	-0,40%	-0,40%	0,08%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	44.893,89	0,00	0,00	44.631,44	-262,45	-0,58%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	66.705,56	0,00	0,00	65.772,01	-933,55	-1,40%	-1,40%	0,48%
Total Renda Fixa	57.743.853,10	2.616.020,71	2.136.767,61	58.697.167,10	474.060,90	0,81%		0,70%

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	1.025.222,67	0,00	0,00	1.077.173,68	51.951,01	5,07%	5,07%	4,06%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	742.074,96	0,00	0,00	779.651,29	37.576,33	5,06%	5,06%	4,06%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.624.012,76	0,00	0,00	1.632.128,85	8.116,09	0,50%	0,50%	1,25%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.982.420,04	0,00	0,00	1.987.532,16	5.112,12	0,26%	0,26%	0,96%
OSASCO PROPERTIES FII	213.929,41	0,00	0,00	213.797,80	-131,61	-0,06%	-	-
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.604.441,36	0,00	0,00	1.572.223,58	-32.217,78	-2,01%	-2,01%	6,65%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	454.058,73	0,00	0,00	444.479,09	-9.579,64	-2,11%	-2,11%	6,89%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.752.473,75	0,00	0,00	1.711.835,18	-40.638,57	-2,32%	-2,32%	7,67%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.291.490,17	0,00	0,00	1.255.544,30	-35.945,87	-2,78%	-2,78%	7,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	750.455,34	0,00	0,00	728.693,12	-21.762,22	-2,90%	-2,90%	4,12%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.255.440,79	0,00	0,00	2.187.922,24	-67.518,55	-2,99%	-2,99%	6,64%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	626.081,52	0,00	0,00	606.961,09	-19.120,43	-3,05%	-3,05%	4,70%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	601.998,03	0,00	0,00	583.575,33	-18.422,70	-3,06%	-3,06%	4,69%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.184.349,48	0,00	0,00	1.145.643,03	-38.706,45	-3,27%	-3,27%	5,28%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.641.896,87	0,00	0,00	1.584.530,14	-57.366,73	-3,49%	-3,49%	4,57%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	210.142,55	0,00	0,00	202.755,05	-7.387,50	-3,52%	-3,52%	4,27%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	938.836,48	0,00	0,00	856.212,99	-82.623,49	-8,80%	-8,80%	7,90%
Total Renda Variável	18.899.324,91	0,00	0,00	18.570.658,92	-328.665,99	-1,74%		4,97%

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	612.459,92	0,00	0,00	653.973,41	41.513,49	6,78%	6,78%	4,53%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.075.536,11	0,00	0,00	1.142.875,04	67.338,93	6,26%	6,26%	4,50%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	492.440,85	0,00	0,00	514.784,30	22.343,45	4,54%	4,54%	7,09%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	566.003,74	0,00	0,00	591.358,07	25.354,33	4,48%	4,48%	4,20%
Total Exterior	2.746.440,62	0,00	0,00	2.902.990,82	156.550,20	5,70%		4,91%

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.

