

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	1.424.730,41	2,99%	704	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.078.482,56	2,26%	867	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	543.880,17	1,14%	790	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	362.853,43	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	525.178,53	1,10%	350	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	981.371,95	2,06%	214	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.735.146,02	3,64%	370	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.091.901,33	2,29%	307	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	569.261,99	1,19%	217	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...		Não há	1.668.856,06	3,50%	38	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...		Não há	1.311.529,33	2,75%	26	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.063.521,25	4,33%	789	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.208.478,19	2,53%	826	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.504.740,35	3,16%	907	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.566.958,13	3,29%	768	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.464.193,69	3,07%	1.169	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.651.629,08	3,46%	450	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	924.747,48	1,94%	735	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	290.900,57	0,61%	220	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	36,44	0,00%	1.021	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

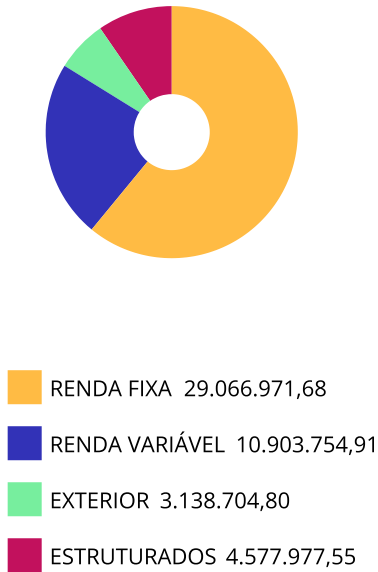
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	700.491,89	1,47%	241	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.353.454,25	4,94%	188	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.044.628,58	8,48%	447	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	913.081,37	1,91%	516	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.178.662,69	6,67%	2.588	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.462.280,39	3,07%	877	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.716.298,07	5,70%	121	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	452.224,63	0,95%	5.013	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	576.955,26	1,21%	12.292	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	881.737,45	1,85%	55	0,77%	Artigo 8º, Inciso I
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	179.108,40	0,38%	261	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	543.406,65	1,14%	7.323	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	268.474,52	0,56%	44	0,07%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.271.227,64	2,67%	138	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.599.002,64	3,35%	453	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	724.508,72	1,52%	169	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	32.465,06	0,07%	4.618	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.599.357,69	5,45%	106	0,50%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC M...	D+2	Não há	731.731,80	1,53%	461	1,21%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	489.914,28	1,03%	4.787	0,10%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			47.687.408,94				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			18.137,64	Artigo 6º			
PL Total			47.705.546,58				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 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%	15,00%	7.153.111,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	21.968.360,52	46,07%	30,00%	40,00%	95,00%	23.334.677,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	7.098.611,16	14,89%	10,00%	15,00%	60,00%	21.513.834,20
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	9.537.481,79
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.384.370,45
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.384.370,45
Total Renda Fixa	100,00%	29.066.971,68	60,95%	40,00%	65,00%	200,00%	

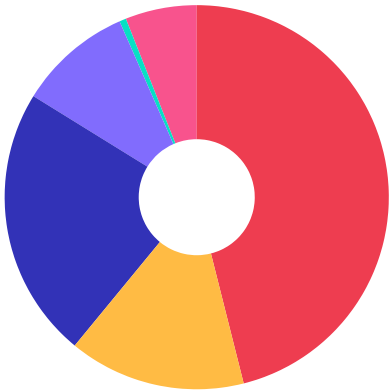


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

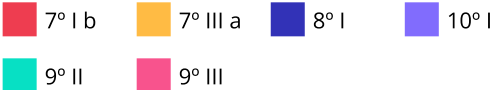


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2024)

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%	10.903.754,91	22,87%	11,00%	20,00%	35,00%	5.786.838,22
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	16.690.593,13
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.577.977,55	9,60%	5,00%	7,00%	10,00%	190.763,34
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.384.370,45
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.384.370,45
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	15.481.732,46	32,47%	16,00%	29,00%	90,00%	



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%	268.474,52	0,56%	0,20%	1,00%	10,00%	4.500.266,37
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.870.230,28	6,02%	3,80%	5,00%	10,00%	1.898.510,61
Total Exterior	10,00%	3.138.704,80	6,58%	4,00%	6,00%	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 ' b '	21.968.360,52	46,07	30,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.098.611,16	14,89	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	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	10.903.754,91	22,87	11,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	268.474,52	0,56	0,20	10,00
Artigo 9º, Inciso III	2.870.230,28	6,02	3,80	10,00
Artigo 10º, Inciso I	4.577.977,55	9,60	5,00	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
CAIXA DTVM	28.421.988,22	59,60	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.061.580,59	33,68	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.749.593,28	3,67	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	731.731,80	1,53	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	543.406,65	1,14	-
PRÓPIO CAPITAL	179.108,40	0,38	-

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%
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%
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%
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%
IMA-B (Benchmark)	1,33%	-0,13%	-0,23%	2,62%	6,56%	17,72%	-	-
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%
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%	-	-
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%
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%	-	-

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 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%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,19%	2,41%	5,13%	11,73%	26,70%	0,04%	0,11%
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 FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	3,97%	2,32%	4,82%	10,90%	24,61%	0,01%	0,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,83%	4,40%	2,52%	5,38%	12,44%	27,60%	0,05%	0,12%

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 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%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	1,03%	-	-	-	-	-	0,69%	-
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-1,73%	-	-	-	-	-	4,55%	-

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%

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
--	-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,49%	-1,65%	-1,46%	0,36%	9,02%	19,22%	2,49%	4,63%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,10%	-0,15%	-0,70%	1,38%	8,82%	21,45%	2,24%	3,79%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	1,90%	0,81%	3,75%	10,54%	22,53%	1,25%	3,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	2,41%	0,91%	3,56%	9,78%	23,77%	0,92%	1,38%

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%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-2,54%	-9,95%	-5,87%	-4,56%	10,35%	5,33%	4,26%	13,63%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	-5,07%	-11,50%	-8,39%	-5,95%	3,85%	-4,02%	7,53%	19,64%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	-5,07%	-11,50%	-8,39%	-5,95%	3,85%	-4,02%	7,53%	19,64%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-2,74%	-10,28%	-7,07%	-5,43%	5,91%	0,52%	5,64%	14,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	-1,08%	-1,74%	-1,47%	0,62%	7,41%	6,72%	2,32%	4,83%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,96%	-2,57%	-3,01%	4,60%	16,13%	11,16%	4,12%	13,32%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-4,96%	-16,13%	-10,48%	-11,64%	-6,79%	-20,05%	6,89%	17,51%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,80%	-5,32%	-2,99%	1,27%	19,33%	17,72%	5,82%	12,53%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,81%	-10,05%	-7,13%	-4,78%	9,47%	3,71%	5,23%	14,48%

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

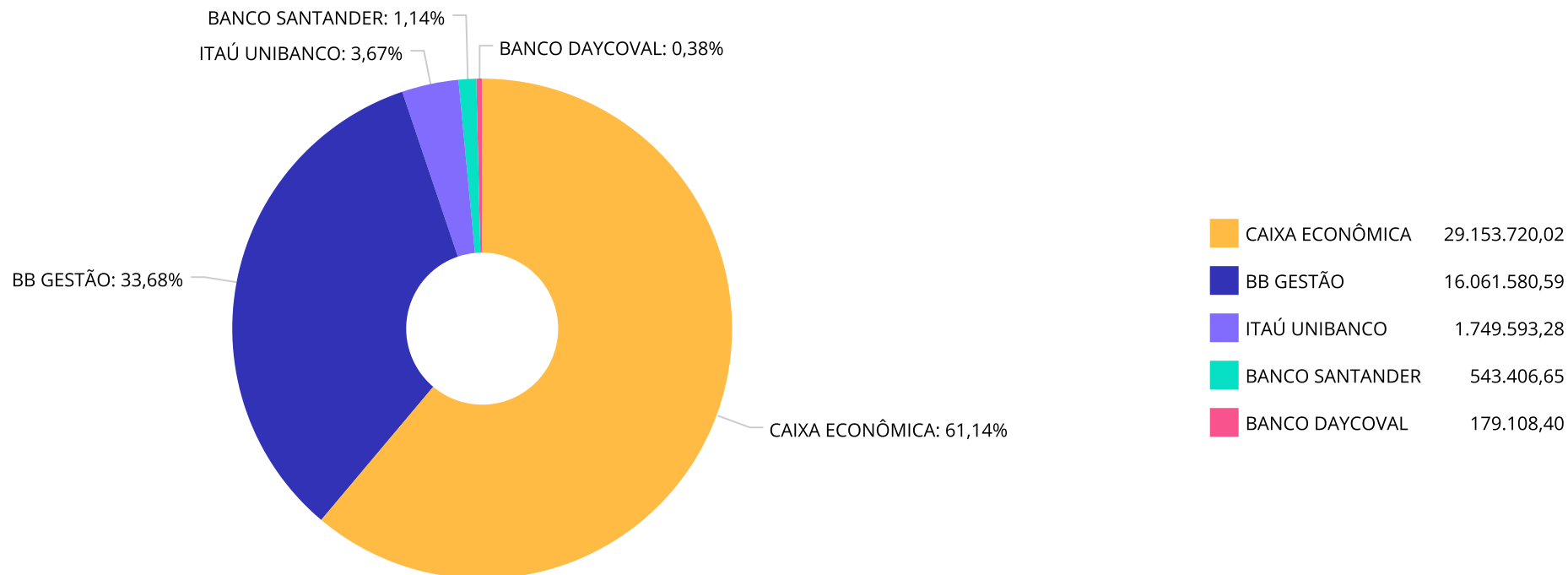
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	-0,99%	-5,29%	-2,73%	1,24%	19,55%	18,54%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-2,78%	-6,87%	-7,56%	0,72%	9,44%	13,03%	7,20%	14,90%
SMLL (Benchmark)	-3,38%	-14,52%	-8,96%	-8,50%	-4,39%	-11,41%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-3,37%	-14,74%	-9,07%	-8,83%	-5,11%	-12,61%	7,20%	19,54%

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

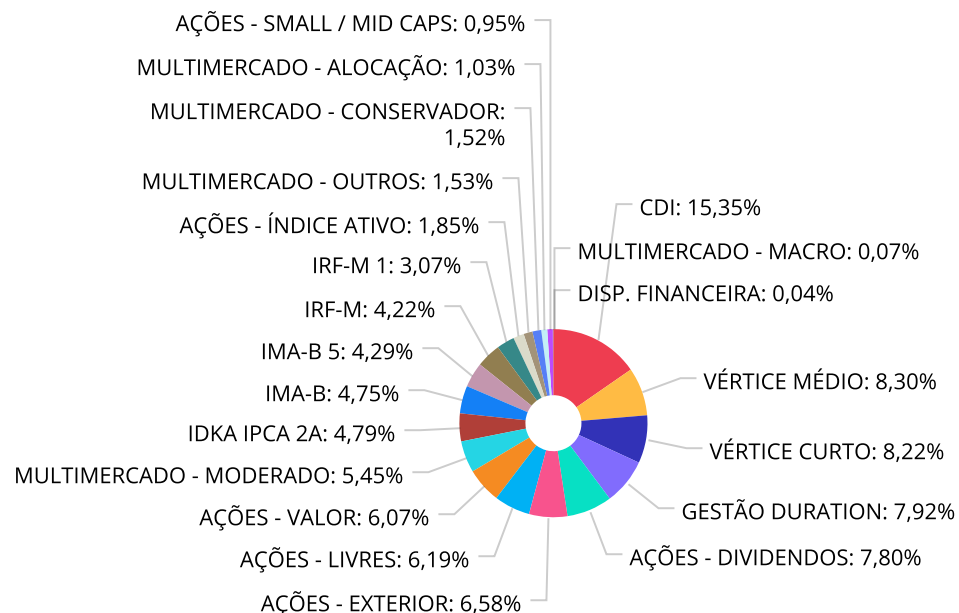
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	6,26%	18,59%	6,42%	22,19%	31,61%	43,37%	4,50%	13,600%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	6,78%	23,76%	11,38%	26,96%	35,62%	54,35%	4,53%	13,518%

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)

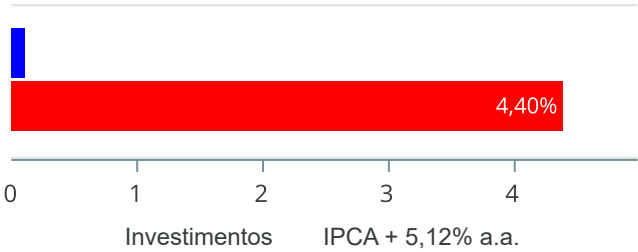


CDI	7.322.866,75	Vértice Médio	3.961.757,34	Vértice Curto	3.921.487,87
Gestão Duration	3.779.152,23	Ações - Dividendos	3.722.069,34	Ações - Exterior	3.138.704,80
Ações - Livres	2.952.317,02	Ações - Valor	2.895.406,47	Multimercado - Moderado	2.599.357,69
IDKA IPCA 2A	2.286.960,75	IMA-B	2.267.450,02	IMA-B 5	2.048.620,52
IRF-M	2.014.482,51	IRF-M 1	1.464.193,69	Ações - Índice Ativo	881.737,45
Multimercado - Outros	731.731,80	Multimercado - Conservador	724.508,72	Multimercado - Alocação	489.914,28
Ações - Small / Mid Caps	452.224,63	Multimercado - Macro	32.465,06	Disp. Financeira	18.137,64

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

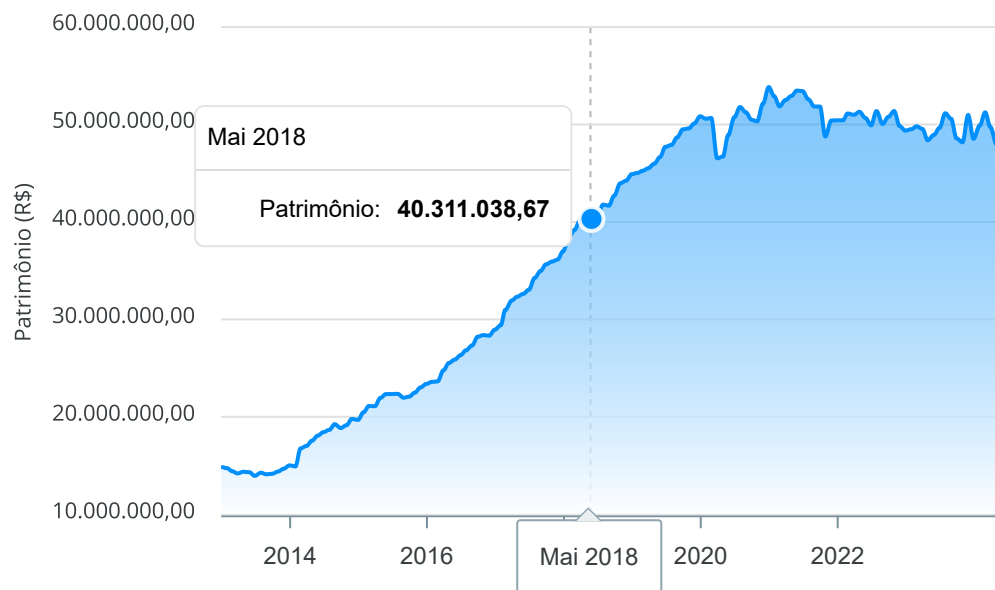
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	48.452.028,05	2.154.000,00	1.179.474,13	49.139.202,34	-287.351,58	-287.351,58	-0,58%	-0,58%	0,86%	0,86%	-67,70%	2,57%
Fevereiro	49.139.202,34	1.819.890,94	1.547.337,95	49.954.288,83	542.533,50	255.181,92	1,10%	0,51%	1,21%	2,08%	24,54%	2,93%
Março	49.954.288,83	6.091.500,00	7.222.162,45	49.163.433,24	339.806,86	594.988,78	0,68%	1,19%	0,56%	2,65%	45,08%	1,93%
Abril	49.163.433,24	3.437.715,85	4.600.410,63	47.388.077,73	-612.660,73	-17.671,95	-1,25%	-0,07%	0,82%	3,49%	-1,92%	2,78%
Maio	47.388.077,73	5.115.062,88	4.901.716,75	47.687.408,94	85.985,08	68.313,13	0,18%	0,11%	0,88%	4,40%	2,58%	2,35%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

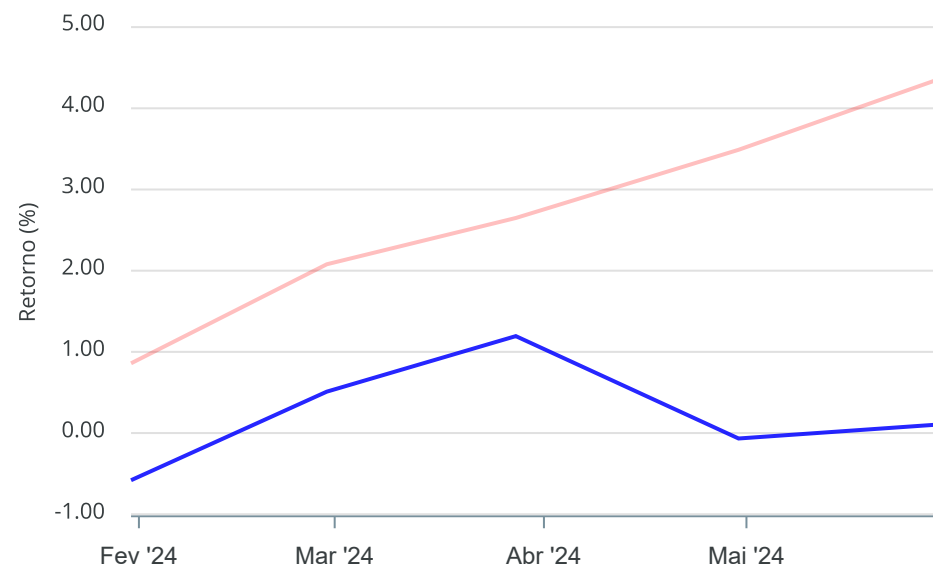
Evolução do Patrimônio



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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.067.280,44	0,00	0,00	1.078.482,56	11.202,12	1,05%	1,05%	0,58%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	556.481,78	136.785,39	0,00	700.491,89	7.224,72	1,04%	1,29%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.000.000,00	0,00	28.951,32	981.371,95	10.323,27	1,03%	1,04%	0,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	538.353,34	0,00	0,00	543.880,17	5.526,83	1,03%	1,03%	0,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.196.197,99	0,00	0,00	1.208.478,19	12.280,20	1,03%	1,03%	0,66%
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	1.700.000,00	48.206,19	1.668.856,06	17.062,25	1,00%	-1,73%	4,55%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	564.227,24	0,00	0,00	569.261,99	5.034,75	0,89%	0,89%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	520.534,50	0,00	0,00	525.178,53	4.644,03	0,89%	0,89%	0,65%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	0,00	1.300.000,00	0,00	1.311.529,33	11.529,33	0,89%	1,03%	0,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.719.910,41	0,00	0,00	1.735.146,02	15.235,61	0,89%	0,89%	0,65%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.082.318,06	0,00	0,00	1.091.901,33	9.583,27	0,89%	0,89%	0,65%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.333.596,73	0,00	0,00	2.353.454,25	19.857,52	0,85%	0,85%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.011.419,40	0,00	0,00	4.044.628,58	33.209,18	0,83%	0,83%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	288.744,00	0,00	0,00	290.900,57	2.156,57	0,75%	0,75%	1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.194.586,22	48.206,19	1.700.000,00	1.566.958,13	24.165,72	0,75%	1,30%	1,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.047.939,64	405.616,31	0,00	1.464.193,69	10.637,74	0,73%	0,76%	0,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.414.525,48	0,00	0,00	1.424.730,41	10.204,93	0,72%	0,72%	0,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.049.119,59	0,00	0,00	2.063.521,25	14.401,66	0,70%	0,70%	0,46%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	393.759,96	0,00	33.403,78	362.853,43	2.497,25	0,63%	0,64%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.641.259,26	0,00	0,00	1.651.629,08	10.369,82	0,63%	0,63%	1,32%

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.787.465,81	0,00	1.300.000,00	1.504.740,35	17.274,54	0,62%	1,03%	0,55%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.179.688,99	1.417.000,00	1.683.321,39	924.747,48	11.379,88	0,44%	0,79%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	107.454,99	107.834,07	36,44	415,52	0,39%	0,75%	0,01%
Total Renda Fixa	28.587.408,84	5.115.062,88	4.901.716,75	29.066.971,68	266.216,71	0,92%		0,77%

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	32.303,63	0,00	0,00	32.465,06	161,43	0,50%	0,50%	1,25%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	722.604,12	0,00	0,00	724.508,72	1.904,60	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.596.890,55	0,00	0,00	2.599.357,69	2.467,14	0,10%	0,10%	2,24%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	492.337,11	0,00	0,00	489.914,28	-2.422,83	-0,49%	-0,49%	2,49%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MUL...	739.748,04	0,00	0,00	731.731,80	-8.016,24	-1,08%	-1,08%	2,32%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	553.365,90	0,00	0,00	543.406,65	-9.959,25	-1,80%	-1,80%	5,82%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	936.861,10	0,00	0,00	913.081,37	-23.779,73	-2,54%	-2,54%	4,26%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.503.424,99	0,00	0,00	1.462.280,39	-41.144,60	-2,74%	-2,74%	5,64%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.269.666,86	0,00	0,00	3.178.662,69	-91.004,17	-2,78%	-2,78%	7,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	594.537,46	0,00	0,00	576.955,26	-17.582,20	-2,96%	-2,96%	4,12%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	467.983,35	0,00	0,00	452.224,63	-15.758,72	-3,37%	-3,37%	7,20%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.823.826,87	0,00	0,00	2.716.298,07	-107.528,80	-3,81%	-3,81%	5,23%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	927.788,52	0,00	0,00	881.737,45	-46.051,07	-4,96%	-4,96%	6,89%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	188.682,79	0,00	0,00	179.108,40	-9.574,39	-5,07%	-5,07%	7,53%
Total Renda Variável	15.850.021,29	0,00	0,00	15.481.732,46	-368.288,83	-2,32%		4,84%

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	1.497.499,74	0,00	0,00	1.599.002,64	101.502,90	6,78%	6,78%	4,53%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.196.326,08	0,00	0,00	1.271.227,64	74.901,56	6,26%	6,26%	4,50%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	256.821,78	0,00	0,00	268.474,52	11.652,74	4,54%	4,54%	7,09%
Total Exterior	2.950.647,60	0,00	0,00	3.138.704,80	188.057,20	6,37%		4,74%

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.

