

# 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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	584.890,13	0,07%	790	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	159.979.650,79	18,78%	350	5,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA F...	D+0	15/05/2025	9.047.908,42	1,06%	49	5,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRDESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	33.575.213,95	3,94%	13	30,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	317.726.277,52	37,29%	217	14,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	6.526.265,87	0,77%	34	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	185.704,75	0,02%	15	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	795.683,80	0,09%	789	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.401.921,47	0,16%	826	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	348.821,06	0,04%	907	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.461.850,30	0,29%	279	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.609.950,57	0,66%	768	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	12.975.118,73	1,52%	30	5,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	390.678,81	0,05%	220	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.260.898,33	0,27%	24	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	872.171,36	0,10%	132	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.231.174,81	1,91%	62	5,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	112.611.673,93	13,22%	118	8,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.302.105,86	1,21%	98	1,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	14.472,64	0,00%	1.021	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

**Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)**

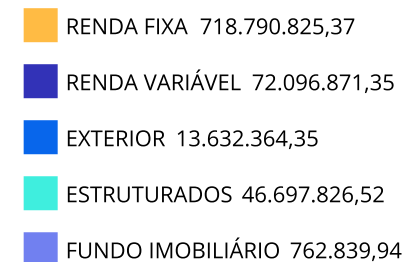
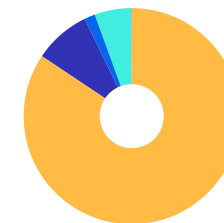
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.615.702,18	0,42%	104	0,69%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	2.809.823,56	0,33%	1.439	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	431.509,22	0,05%	477	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	8.590.866,22	1,01%	362	0,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	497.625,88	0,06%	1.002	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.922.451,62	0,34%	224	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	159.486,91	0,02%	62	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	5.860.926,68	0,69%	1.100	0,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	12.737.419,04	1,50%	20.261	0,89%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	10.422.636,50	1,22%	16.544	0,95%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.894.374,29	0,22%	877	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	2.885.536,97	0,34%	201	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	142.487,35	0,02%	82	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	102.714,47	0,01%	86	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.677.333,31	0,20%	5.761	1,68%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.712.610,72	0,44%	2.284	1,50%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.945.168,73	0,46%	2.043	2,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	12.847.738,23	1,51%	16.124	1,45%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	D+4	Não há	8.318.268,51	0,98%	14.337	1,31%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.482.613,04	0,17%	3.202	0,57%	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
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.399.188,18	0,40%	123	2,41%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FI...	D+3 du	Não há	3.722.765,79	0,44%	2.689	6,85%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	4.806.016,22	0,56%	27	2,22%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3 du	Não há	13.632.364,35	1,60%	3.175	8,31%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	7.888.589,60	0,93%	7.376	0,42%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.892.018,27	1,63%	606	0,98%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	24.917.218,65	2,92%	95	3,33%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	762.839,94	0,09%		0,27%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>851.980.727,53</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>610.463,24</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>852.591.190,77</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	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%	40,00%	340.792.291,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	693.887.960,46	81,44%	15,00%	73,00%	90,00%	72.894.694,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	70,00%	19.041.938,23	2,24%	2,00%	9,00%	60,00%	492.146.498,29
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	170.396.145,51
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	10,00%	5.860.926,68	0,69%	0,00%	1,00%	5,00%	36.738.109,70
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>718.790.825,37</b>	<b>84,37%</b>	<b>17,00%</b>	<b>87,00%</b>	<b>215,00%</b>	



**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!

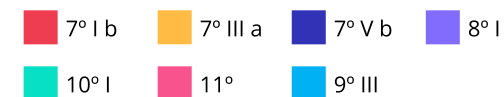
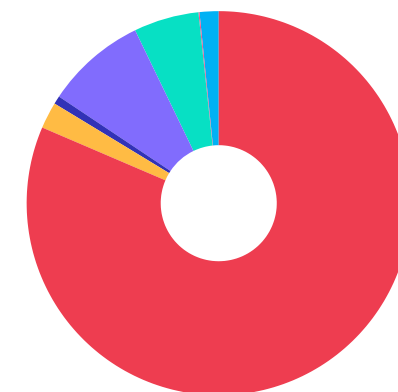


**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2024)**

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	72.096.871,35	8,46%	0,00%	9,90%	30,00%	183.497.346,91
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	46.697.826,52	5,48%	0,00%	2,00%	10,00%	38.500.246,23
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	8.519.807,28
Artigo 11º	10,00%	762.839,94	0,09%	0,00%	0,10%	1,00%	7.756.967,34
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>40,00%</b>	<b>119.557.537,81</b>	<b>14,03%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>42,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	85.198.072,75
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	13.632.364,35	1,60%	0,00%	1,00%	10,00%	71.565.708,40
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>13.632.364,35</b>	<b>1,60%</b>	<b>0,00%</b>	<b>1,00%</b>	<b>20,00%</b>	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	85.198.072,75



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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	693.887.960,46	81,44	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	19.041.938,23	2,24	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5.860.926,68	0,69	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	72.096.871,35	8,46	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	13.632.364,35	1,60	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	46.697.826,52	5,48	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 11º	762.839,94	0,09	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ASSET	390.482.241,24	45,83	1,53
BB ASSET MANAGEMENT	192.786.977,52	22,63	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	147.673.736,61	17,33	0,03
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	41.049.667,07	4,82	0,00
BRADERCO ASSET MANAGEMENT	36.816.546,73	4,32	0,53
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	32.932.089,56	3,87	-
ITAÚ UNIBANCO	5.860.926,68	0,69	0,00
BANCO BRADERCO	3.615.702,18	0,42	0,00
ZION INVEST	762.839,94	0,09	-

**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
<b>IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,87%	4,35%	2,24%	5,38%	9,12%	19,09%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,95%	4,76%	2,49%	5,88%	10,16%	21,37%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	1,91%	2,73%	2,89%	4,34%	8,73%	0,06%	3,81%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	1,59%	-2,85%	-1,91%	0,98%	4,24%	16,02%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,56%	-2,90%	-1,95%	0,92%	4,18%	15,43%	2,05%	5,90%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03%	2,81%	1,56%	4,30%	8,67%	18,70%	0,55%	1,73%
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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	1,33%	-0,13%	-0,23%	2,62%	6,56%	17,72%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,27%	-0,36%	-0,41%	2,35%	6,00%	16,86%	1,32%	3,90%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,31%	-0,22%	-0,32%	2,55%	6,45%	17,32%	1,33%	3,94%

**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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	-0,23%	-0,30%	2,49%	6,35%	17,30%	1,28%	3,83%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	1,36%	-0,80%	-0,70%	1,95%	5,60%	17,44%	1,45%	4,09%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	1,31%	-0,25%	-0,30%	2,47%	6,30%	17,13%	1,29%	3,86%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
BRDESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	0,89%	4,55%	2,64%	5,52%	11,23%	-	0,65%	0,86%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,75%	3,96%	2,32%	4,81%	10,90%	23,72%	0,00%	0,06%
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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,84%	4,51%	2,62%	5,47%	12,52%	27,70%	0,03%	0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,07%	5,75%	4,06%	7,16%	12,28%	24,97%	0,48%	1,73%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,89%	4,83%	2,83%	5,86%	13,47%	29,35%	0,05%	0,15%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,89%	1,52%	2,62%	2,46%	4,81%	-	0,65%	4,14%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,82%	4,33%	2,53%	5,25%	11,82%	26,78%	0,00%	0,07%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,67%	3,53%	2,06%	4,28%	9,75%	21,82%	0,01%	0,06%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	4,81%	2,76%	5,79%	13,06%	28,67%	0,03%	0,11%

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,46%	2,27%	1,00%	2,84%	3,93%	8,02%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,70%	2,19%	0,96%	3,42%	9,47%	23,13%	0,46%	1,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,75%	2,12%	1,07%	3,76%	9,65%	22,11%	1,18%	2,64%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,84%	1,86%	0,93%	3,42%	9,10%	21,84%	0,66%	1,92%

**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 VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	4,56%	2,64%	5,53%	11,21%	-	0,65%	0,86%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	-2,71%	-0,36%	-0,47%	0,11%	-	1,34%	5,45%
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, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-3,04%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,32%	-6,76%	-6,29%	-0,55%	15,12%	13,46%	7,67%	15,63%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-2,74%	-10,28%	-7,07%	-5,43%	5,91%	0,52%	5,64%	14,44%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-4,17%	-9,21%	-7,16%	-3,42%	9,39%	1,53%	5,54%	14,93%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-4,68%	-10,18%	-8,18%	-4,44%	7,61%	2,10%	6,07%	15,60%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	-0,31%	-15,06%	-1,82%	-11,35%	7,88%	-15,17%	6,46%	23,40%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-3,01%	-9,56%	-5,85%	-4,55%	11,60%	7,71%	4,64%	14,16%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	-3,91%	11,29%	5,78%	14,94%	63,29%	107,97%	14,95%	29,89%
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FIC AÇÕES	-3,33%	-11,87%	-8,68%	-7,16%	0,66%	-6,93%	6,82%	16,44%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-4,96%	-12,50%	-9,35%	-8,36%	5,54%	10,11%	5,63%	14,98%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90%	-12,76%	-7,23%	-8,21%	7,50%	-3,15%	4,12%	14,01%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-2,35%	-15,07%	-7,22%	-10,00%	-8,71%	-24,21%	8,61%	20,82%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-3,03%	-9,04%	-5,42%	-4,17%	12,36%	9,48%	4,61%	13,84%
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	-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%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-0,99%	-5,29%	-2,73%	1,24%	19,55%	18,54%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,09%	-5,65%	-2,95%	0,68%	18,02%	15,80%	5,65%	12,38%

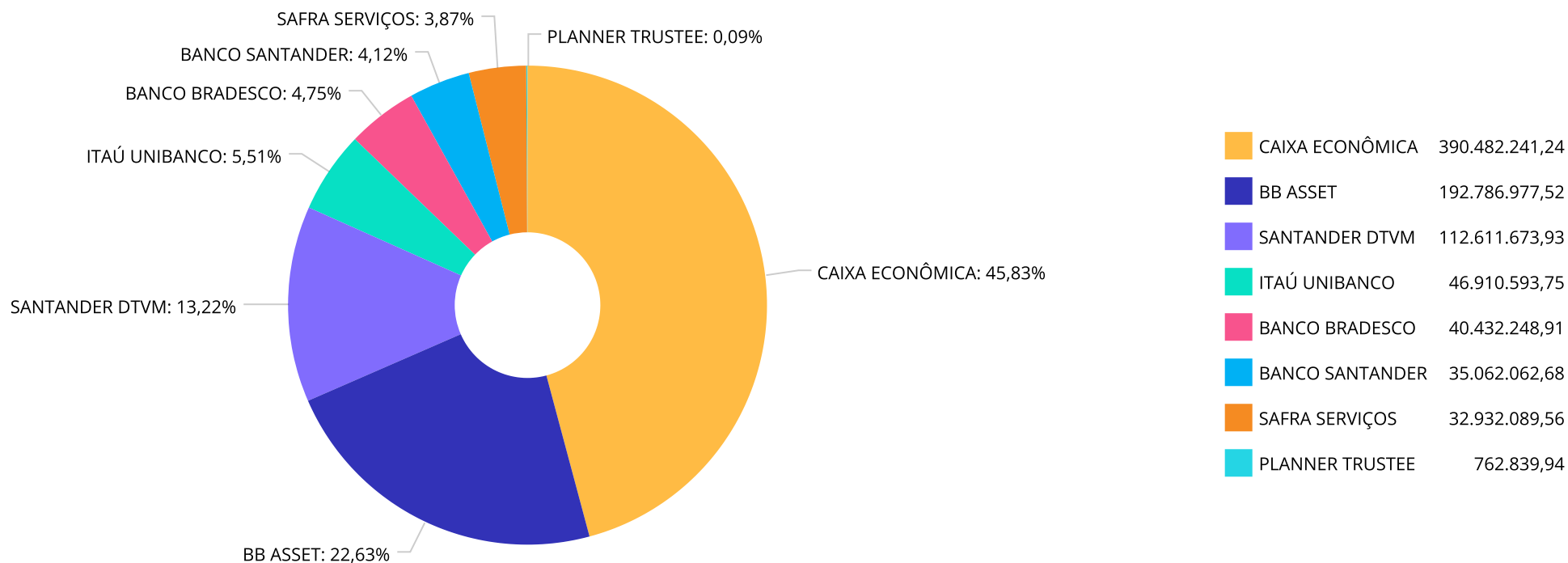
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IFIX (Benchmark)</b>	0,02%	2,14%	0,66%	6,48%	12,24%	19,92%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,59%	35,77%	0,54%	31,92%	-3,13%	-60,17%	24,06%	38,67%
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	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%
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	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%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5,01%	12,08%	4,39%	17,87%	32,77%	46,52%	4,03%	11,27%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5,03%	11,83%	4,49%	17,51%	28,91%	39,21%	4,47%	11,43%

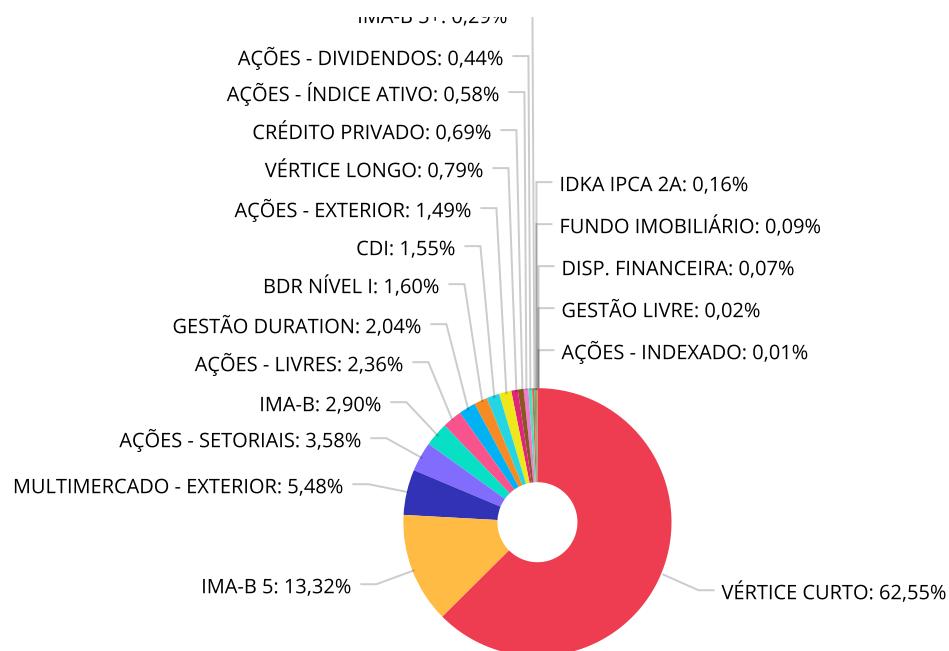
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	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%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5,38%	19,80%	9,94%	22,27%	30,56%	35,21%	5,39%	11,797%

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



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



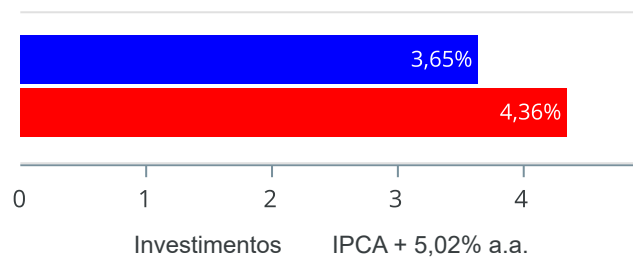
■ VÉRTICE CURTO	533.304.169,41	■ IMA-B 5	113.545.385,12	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	46.697.826,52	■ AÇÕES - SETORIAIS	30.511.274,57
■ IMA-B	24.711.108,56	■ AÇÕES - LIVRES	20.084.348,98	■ GESTÃO DURATION	17.417.537,42	■ BDR NÍVEL I	13.632.364,35
■ CDI	13.216.468,88	■ AÇÕES - EXTERIOR	12.737.419,04	■ VÉRTICE LONGO	6.711.970,62	■ CRÉDITO PRIVADO	5.860.926,68
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	4.948.503,57	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.712.610,72	■ IMA-B 5+	2.461.850,30	■ IDKA IPCA 2A	1.401.921,47
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	762.839,94	■ DISP. FINANCEIRA	610.463,24	■ GESTÃO LIVRE	159.486,91	■ AÇÕES - INDEXADO	102.714,47



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024**

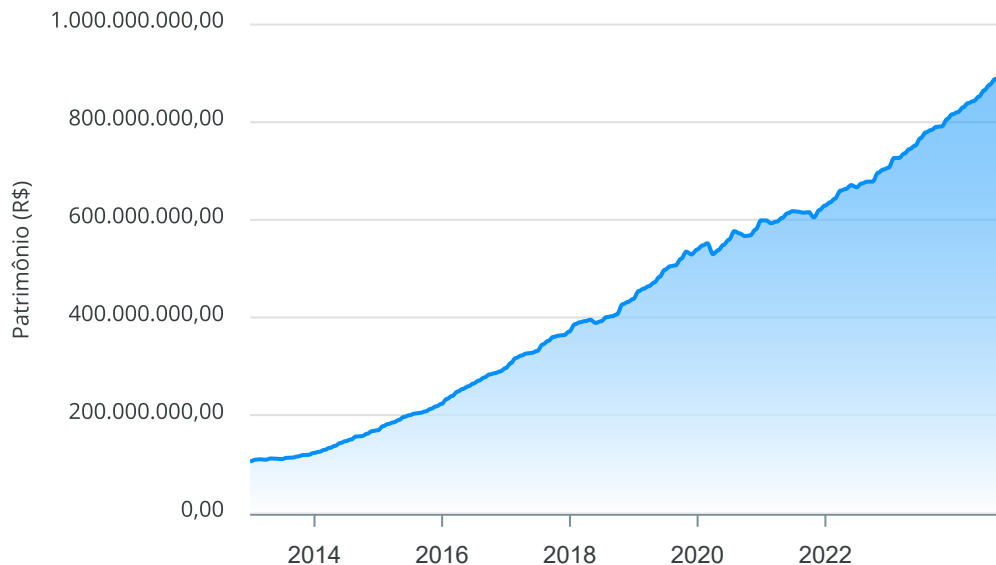
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	815.459.060,46	5.843.434,05	6.667.030,67	820.025.866,71	5.390.402,87	5.390.402,87	0,66%	0,66%	0,85%	0,85%	77,74%	1,25%
Fevereiro	820.025.866,71	27.096.214,82	25.027.641,67	829.671.554,41	7.577.114,55	12.967.517,42	0,92%	1,59%	1,20%	2,06%	76,99%	3,15%
Março	829.671.554,41	12.201.692,97	10.191.560,82	838.166.939,56	6.485.253,00	19.452.770,42	0,78%	2,38%	0,55%	2,63%	90,70%	1,16%
Abril	838.166.939,56	28.164.040,91	26.461.333,75	842.643.986,59	2.774.339,87	22.227.110,29	0,33%	2,72%	0,81%	3,46%	78,67%	1,37%
Maio	842.643.986,59	39.303.413,95	37.644.011,57	851.980.727,53	7.677.338,56	29.904.448,85	0,91%	3,65%	0,87%	4,36%	83,84%	1,48%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



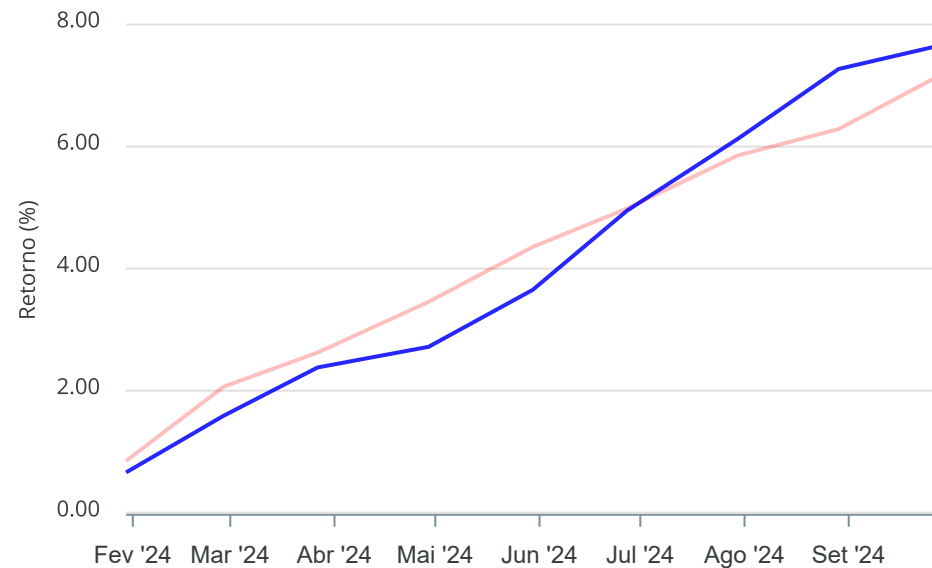
**Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores**

**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
- 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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.424.064,97	0,00	0,00	2.461.850,30	37.785,33	1,56%	1,56%	2,05%
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	183.171,48	0,00	0,00	185.704,75	2.533,27	1,38%	1,38%	1,34%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.884.812,60	0,00	0,00	2.922.451,62	37.639,02	1,30%	1,30%	1,33%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	10.169.437,12	0,00	0,00	10.302.105,86	132.668,74	1,30%	1,30%	1,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.537.956,29	0,00	0,00	5.609.950,57	71.994,28	1,30%	1,30%	1,28%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.570.310,27	0,00	0,00	3.615.702,18	45.391,91	1,27%	1,27%	1,32%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	12.123.964,70	0,00	10.000.000,00	2.260.898,33	136.933,63	1,13%	1,36%	1,45%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	157.795,30	0,00	0,00	159.486,91	1.691,61	1,07%	1,07%	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	345.272,72	0,00	0,00	348.821,06	3.548,34	1,03%	1,03%	0,55%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	111.466.282,60	0,00	0,00	112.611.673,93	1.145.391,33	1,03%	1,03%	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	578.946,57	0,00	0,00	584.890,13	5.943,56	1,03%	1,03%	0,55%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.467.289,82	0,00	0,00	6.526.265,87	58.976,05	0,91%	0,91%	0,06%
BRDESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	33.277.893,03	0,00	0,00	33.575.213,95	297.320,92	0,89%	0,89%	0,65%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	314.916.193,68	0,00	0,00	317.726.277,52	2.810.083,84	0,89%	0,89%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	158.564.991,02	0,00	0,00	159.979.650,79	1.414.659,77	0,89%	0,89%	0,65%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.809.198,64	0,00	0,00	5.860.926,68	51.728,04	0,89%	0,89%	0,05%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	12.860.973,83	0,00	0,00	12.975.118,73	114.144,90	0,89%	0,89%	0,65%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	427.743,56	0,00	0,00	431.509,22	3.765,66	0,88%	0,88%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	16.096.243,27	0,00	0,00	16.231.174,81	134.931,54	0,84%	0,84%	0,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	387.782,55	0,00	0,00	390.678,81	2.896,26	0,75%	0,75%	1,18%

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	14.365,57	0,00	0,00	14.472,64	107,07	0,75%	0,75%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.369.733,41	0,00	3.000.000,00	1.401.921,47	32.188,06	0,74%	1,03%	0,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	790.130,59	0,00	0,00	795.683,80	5.553,21	0,70%	0,70%	0,46%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	10.171.236,60	6.303.413,95	7.978.064,74	8.590.866,22	94.280,41	0,57%	0,75%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	0,00	9.000.000,00	0,00	9.047.908,42	47.908,42	0,53%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.480.204,76	0,00	4.000.668,60	497.625,88	18.089,72	0,40%	0,84%	0,03%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	9.840.444,04	0,00	9.000.000,00	872.171,36	31.727,32	0,32%	0,82%	0,00%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.464.582,77	5.000.000,00	3.665.278,23	2.809.823,56	10.519,02	0,16%	0,67%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>729.381.021,76</b>	<b>20.303.413,95</b>	<b>37.644.011,57</b>	<b>718.790.825,37</b>	<b>6.750.401,23</b>	<b>0,93%</b>		<b>0,64%</b>

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	7.508.130,79	0,00	0,00	7.888.589,60	380.458,81	5,07%	5,07%	4,06%
ITAU PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	13.222.474,00	0,00	0,00	13.892.018,27	669.544,27	5,06%	5,06%	4,06%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	12.127.015,91	0,00	0,00	12.737.419,04	610.403,13	5,03%	5,03%	4,47%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5.559.599,97	19.000.000,00	0,00	24.917.218,65	357.618,68	1,46%	5,01%	4,03%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	8.344.065,97	0,00	0,00	8.318.268,51	-25.797,46	-0,31%	-0,31%	6,46%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.753.482,85	0,00	0,00	3.712.610,72	-40.872,13	-1,09%	-1,09%	5,65%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	775.143,81	0,00	0,00	762.839,94	-12.303,87	-1,59%	-1,59%	24,06%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.954.038,97	0,00	0,00	2.885.536,97	-68.502,00	-2,32%	-2,32%	7,67%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1.717.765,25	0,00	0,00	1.677.333,31	-40.431,94	-2,35%	-2,35%	8,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.947.676,83	0,00	0,00	1.894.374,29	-53.302,54	-2,74%	-2,74%	5,64%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	10.733.905,64	0,00	0,00	10.422.636,50	-311.269,14	-2,90%	-2,90%	4,12%
SANTANDER IBOVESPAATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.955.119,33	0,00	0,00	4.806.016,22	-149.103,11	-3,01%	-3,01%	4,64%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	105.918,67	0,00	0,00	102.714,47	-3.204,20	-3,03%	-3,03%	4,61%
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FIC ...	3.850.845,98	0,00	0,00	3.722.765,79	-128.080,19	-3,33%	-3,33%	6,82%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	147.678,96	0,00	0,00	142.487,35	-5.191,61	-3,52%	-3,52%	4,27%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	13.370.180,22	0,00	0,00	12.847.738,23	-522.441,99	-3,91%	-3,91%	14,95%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	3.546.953,30	0,00	0,00	3.399.188,18	-147.765,12	-4,17%	-4,17%	5,54%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.555.346,15	0,00	0,00	1.482.613,04	-72.733,11	-4,68%	-4,68%	6,07%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4.150.854,15	0,00	0,00	3.945.168,73	-205.685,42	-4,96%	-4,96%	5,63%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>100.326.196,75</b>	<b>19.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>119.557.537,81</b>	<b>231.341,06</b>	<b>0,19%</b>		<b>6,02%</b>

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	12.936.768,08	0,00	0,00	13.632.364,35	695.596,27	5,38%	5,38%	5,39%
<b>Total Exterior</b>	<b>12.936.768,08</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>13.632.364,35</b>	<b>695.596,27</b>	<b>5,38%</b>		<b>5,39%</b>

## 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.





