

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
TÍTULOS PÚBLICOS			25.025.382,94	4,82%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	632.354,84	0,12%	704	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.124.878,32	1,57%	867	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	23.325.323,25	4,50%	790	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.969.490,58	1,15%	645	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	20.204.271,76	3,89%	350	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	9.033.861,48	1,74%	105	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	23.128.790,33	4,46%	307	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.247.788,53	1,98%	789	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	17.495.858,64	3,37%	826	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.555.160,16	4,35%	907	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.441.649,20	2,01%	768	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.988.595,98	1,15%	450	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	8.413.668,82	1,62%	220	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	19.942.432,33	3,84%	1.021	0,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	40.950.683,87	7,89%	188	1,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	46.445.668,46	8,95%	477	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	30.700.519,45	5,92%	447	0,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	25.040.317,33	4,83%	464	0,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info	Não se aplica	5.092.771,47	0,98%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

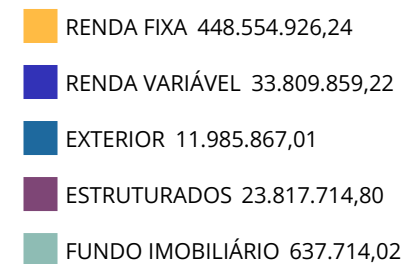
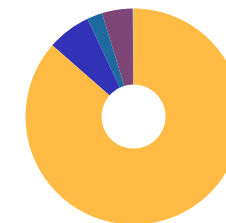
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	27.877.178,97	5,37%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	61.918.279,53	11,93%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	5.729.883,51	1,10%	669	1,59%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	710.658,67	0,14%	189	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	27.720,13	0,01%	1.785	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.376.450,82	0,46%	2.171	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	8.204.378,31	1,58%	99	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	638.500,69	0,12%	261	0,78%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+92	Não há	4.036.355,87	0,78%	146	0,80%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	12.085.911,22	2,33%	13	1,69%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	3.863.212,21	0,74%	110	0,27%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	4.010.880,17	0,77%	44	1,03%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+6 du	Não há	322.429,83	0,06%	11	0,01%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INV...	D+6 du	Não há	376.820,03	0,07%	14	0,00%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.412.524,77	0,66%	316	0,47%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	7.406.570,00	1,43%	5.096	1,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.865.121,77	0,94%	4.618	0,36%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.709.390,06	1,10%	10	11,13%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	5.836.632,97	1,13%	95	0,78%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	637.714,02	0,12%		0,22%	Artigo 11º

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			518.806.081,29				

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

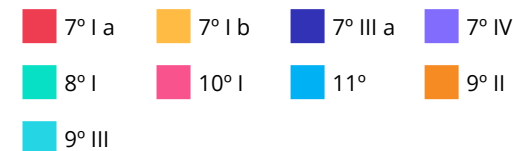
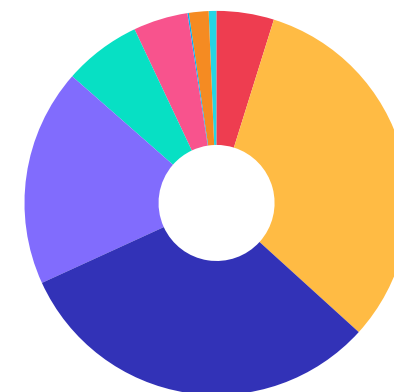
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	25.025.382,94	4,82%	0,00%	2,00%	45,00%	208.437.353,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	165.561.691,89	31,91%	10,00%	30,00%	90,00%	301.363.781,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	163.079.621,44	31,43%	15,00%	24,00%	60,00%	148.204.027,33
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	94.888.229,97	18,29%	10,00%	20,00%	20,00%	8.872.986,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	25.940.304,06
Total Renda Fixa	100,00%	448.554.926,24	86,46%	35,00%	77,00%	220,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	33.809.859,22	6,52%	0,00%	15,00%	30,00%	121.831.965,17
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	23.817.714,80	4,59%	0,00%	5,00%	10,00%	28.062.893,33
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	5.188.060,81
Artigo 11º	5,00%	637.714,02	0,12%	0,00%	1,00%	2,00%	9.738.407,61
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	58.265.288,04	11,23%	0,00%	21,00%	43,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	8.573.342,24	1,65%	0,00%	1,00%	10,00%	43.307.265,89
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.412.524,77	0,66%	0,00%	1,00%	10,00%	48.468.083,36
Total Exterior	10,00%	11.985.867,01	2,31%	0,00%	2,00%	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 '	25.025.382,94	4,82	0,00	45,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	165.561.691,89	31,91	10,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	163.079.621,44	31,43	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	94.888.229,97	18,29	10,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	33.809.859,22	6,52	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	8.573.342,24	1,65	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.412.524,77	0,66	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	23.817.714,80	4,59	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 11º	637.714,02	0,12	0,00	2,00
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	134.457.345,54	25,92	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	127.023.527,33	24,48	-
BANCO DAYCOVAL	61.918.279,53	11,93	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	46.445.668,46	8,95	-
BANCO BTG PACTUAL	27.877.178,97	5,37	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	25.040.317,33	4,83	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	25.025.382,94	4,82	-
TRÍGONO CAPITAL	12.085.911,22	2,33	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	9.249.157,74	1,78	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	8.413.668,82	1,62	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	8.204.378,31	1,58	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	7.406.570,00	1,43	-
4UM INVESTIMENTOS	5.729.883,51	1,10	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.709.390,06	1,10	-
BANCO BRADESCO	5.092.771,47	0,98	-
TARPON INVESTIMENTOS	4.036.355,87	0,78	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.376.450,82	0,46	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	710.658,67	0,14	-
MIRAE ASSET	699.249,86	0,13	-
PRÓPIO CAPITAL	638.500,69	0,12	-

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
ZION INVEST	637.714,02	0,12	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	27.720,13	0,01	-

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%
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%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,88%	1,60%	2,61%	2,54%	5,24%	6,94%	0,65%	3,85%
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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	-0,23%	-0,30%	2,49%	6,35%	17,30%	1,28%	3,83%
IRF-M (Benchmark)	0,66%	1,81%	0,67%	3,32%	10,51%	26,78%	-	-
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%	-	-
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	4,81%	2,76%	5,79%	13,06%	28,67%	0,03%	0,11%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,84%	4,63%	2,67%	5,62%	12,76%	27,98%	0,01%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	3,97%	2,32%	4,82%	10,90%	24,61%	0,01%	0,07%

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 INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,85%	4,61%	2,66%	5,66%	12,57%	27,23%	0,06%	0,13%
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%
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%
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%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	4,56%	2,64%	5,53%	11,21%	-	0,65%	0,86%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,70%	2,19%	0,96%	3,42%	9,47%	23,13%	0,46%	1,45%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,75%	2,12%	1,07%	3,76%	9,65%	22,11%	1,18%	2,64%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	-1,29%	-2,20%	-0,62%	-1,66%	3,83%	-	1,68%	8,34%

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 definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	-1,29%	-2,20%	-0,62%	-1,66%	3,83%	-	1,68%	8,34%
CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	1,90%	0,81%	3,75%	10,54%	22,53%	1,25%	3,04%
Ibovespa (Benchmark)	-3,04%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,48%	-3,40%	0,66%	6,10%	32,24%	59,75%	5,08%	16,44%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	-2,97%	-9,31%	-7,43%	-2,88%	11,33%	11,75%	6,53%	14,13%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-3,85%	-12,94%	-8,49%	-8,31%	0,49%	-6,66%	5,09%	14,10%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,49%	-12,94%	-5,59%	-8,79%	-1,55%	1,30%	4,57%	16,44%
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%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,99%	-9,98%	-7,53%	-4,14%	4,11%	0,50%	6,64%	13,99%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,02%	-6,66%	-7,92%	-4,17%	18,87%	30,64%	7,28%	15,97%
IFIX (Benchmark)	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%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,80%	10,64%	3,56%	15,54%	26,26%	27,72%	-	-

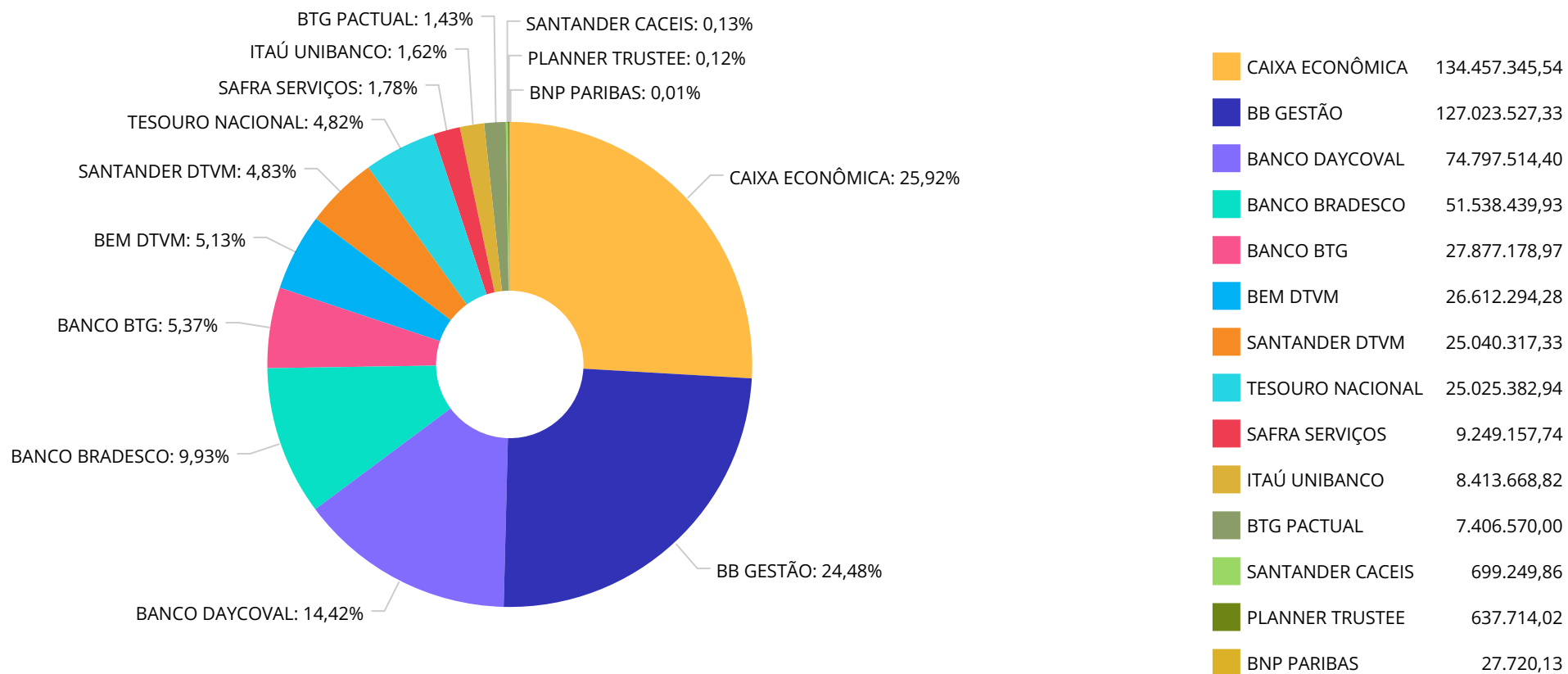
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5,12%	12,54%	4,63%	18,43%	33,91%	54,76%	4,06%	11,34%
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%	-	-
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	-3,11%	-12,23%	-7,70%	-4,96%	14,97%	16,92%	6,77%	18,29%

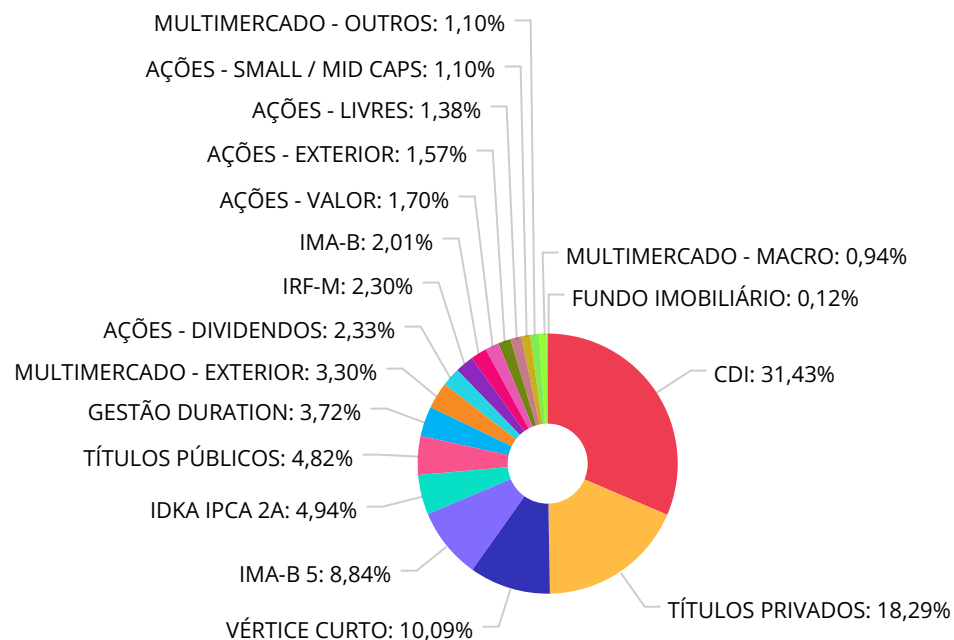
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
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%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	4,31%	18,91%	8,55%	23,26%	30,43%	47,96%	6,51%	12,870%
Ibovespa (Benchmark)	-3,04%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	-	-
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO EXTE...	2,63%	15,96%	5,15%	24,03%	15,58%	39,40%	3,79%	19,381%
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-0,55%	-3,89%	-2,33%	4,50%	12,53%	26,32%	6,14%	20,860%

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



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



■ CDI	163.079.621,44	■ TÍTULOS PRIVADOS	94.888.229,97	■ VÉRTICE CURTO	52.366.923,57	■ IMA-B 5	45.880.483,41
■ IDKA IPCA 2A	25.620.736,96	■ TÍTULOS PÚBLICOS	25.025.382,94	■ GESTÃO DURATION	19.293.812,19	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	17.106.415,18
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	12.085.911,22	■ IRF-M	11.958.086,56	■ IMA-B	10.441.649,20	■ AÇÕES - VALOR	8.842.879,00
■ AÇÕES - EXTERIOR	8.122.654,80	■ AÇÕES - LIVRES	7.151.185,49	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	5.729.883,51	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.709.390,06
■ MULTIMERCADO - MACRO	4.865.121,77	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	637.714,02				

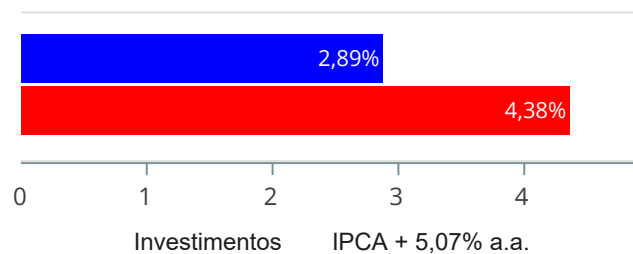
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	29/05/2024	5.780	4.327,817683	4.330,552766	25.014.786,21	25.030.594,98	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

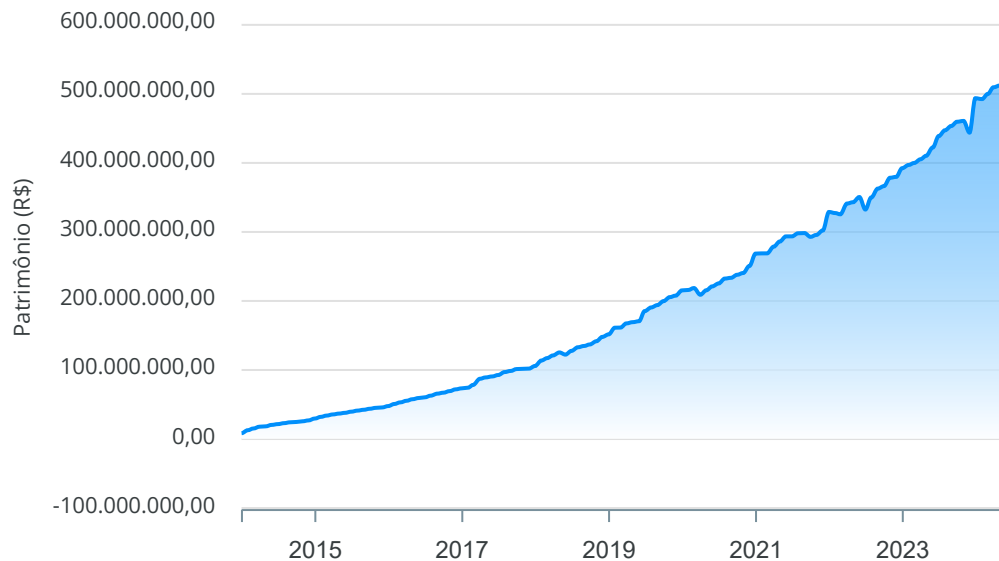
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	493.711.794,42	7.937.647,56	9.511.339,87	492.452.541,40	314.439,29	314.439,29	0,06%	0,06%	0,85%	0,85%	7,45%	1,74%
Fevereiro	492.452.541,40	13.217.914,82	10.903.152,81	499.908.706,02	5.141.402,61	5.455.841,90	1,04%	1,10%	1,21%	2,07%	53,27%	2,01%
Março	499.908.706,02	79.625.810,68	75.657.734,26	509.527.428,03	5.650.645,59	11.106.487,49	1,12%	2,24%	0,55%	2,64%	84,85%	1,11%
Abril	509.527.428,03	24.172.670,09	20.834.978,42	512.198.456,36	-666.663,34	10.439.824,15	-0,13%	2,10%	0,81%	3,47%	60,60%	1,46%
Mai	512.198.456,36	137.935.047,30	135.305.193,61	518.806.081,29	3.977.771,24	14.417.595,39	0,77%	2,89%	0,87%	4,38%	66,09%	1,21%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



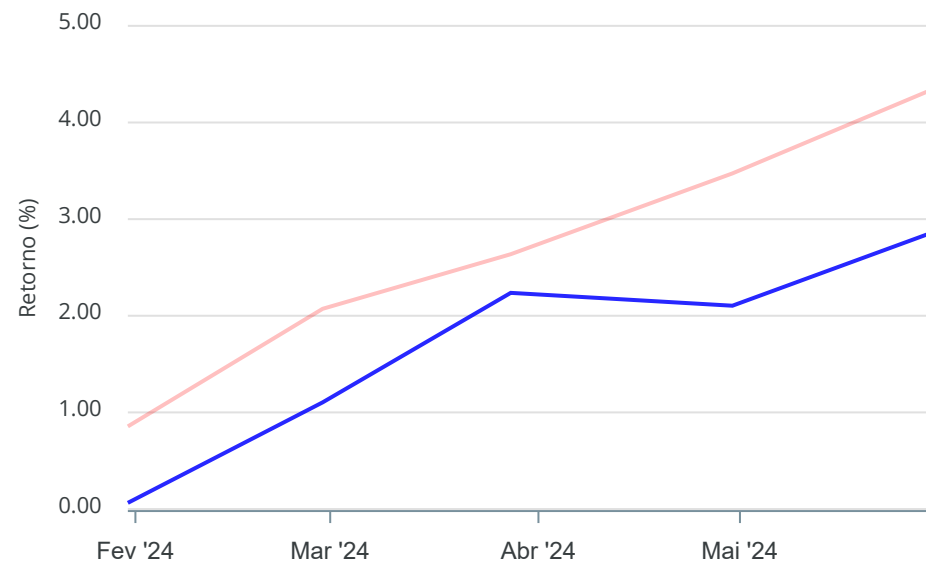
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.307.648,19	0,00	0,00	10.441.649,20	134.001,01	1,30%	1,30%	1,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.040.485,79	0,00	0,00	8.124.878,32	84.392,53	1,05%	1,05%	0,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.325.720,20	0,00	0,00	22.555.160,16	229.439,96	1,03%	1,03%	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	23.088.294,72	0,00	0,00	23.325.323,25	237.028,53	1,03%	1,03%	0,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	17.318.070,86	0,00	0,00	17.495.858,64	177.787,78	1,03%	1,03%	0,66%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	61.332.934,28	0,00	0,00	61.918.279,53	585.345,25	0,95%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	27.621.940,92	0,00	0,00	27.877.178,97	255.238,05	0,92%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	20.025.610,47	0,00	0,00	20.204.271,76	178.661,29	0,89%	0,89%	0,65%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.925.796,35	0,00	0,00	23.128.790,33	202.993,98	0,89%	0,89%	0,65%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.954.658,68	0,00	0,00	9.033.861,48	79.202,80	0,88%	0,88%	0,65%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	5.048.802,53	0,00	0,00	5.092.771,47	43.968,94	0,87%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	42.589.796,30	0,00	2.000.000,00	40.950.683,87	360.887,57	0,85%	0,85%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	55.307.267,08	0,00	25.024.426,41	30.700.519,45	417.678,78	0,76%	0,83%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	8.351.294,88	0,00	0,00	8.413.668,82	62.373,94	0,75%	0,75%	1,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	627.825,46	0,00	0,00	632.354,84	4.529,38	0,72%	0,72%	0,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.176.267,47	0,00	0,00	10.247.788,53	71.521,06	0,70%	0,70%	0,46%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.931.692,04	0,00	0,00	5.969.490,58	37.798,54	0,64%	0,64%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.950.996,33	0,00	0,00	5.988.595,98	37.599,65	0,63%	0,63%	1,32%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	21.214.698,42	25.000.000,00	0,00	46.445.668,46	230.970,04	0,50%	0,88%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	33.755.478,65	62.920.261,10	77.106.001,07	19.942.432,33	372.693,65	0,39%	0,75%	0,01%

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
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	31.093.974,97	0,00	31.174.766,13	0,00	80.791,16	0,26%	0,70%	0,36%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	0,00	25.000.000,00	0,00	25.040.317,33	40.317,33	0,16%	0,84%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	25.014.786,20	0,00	25.025.382,94	10.596,74	0,04%	-	-
Total Renda Fixa	441.989.254,59	137.935.047,30	135.305.193,61	448.554.926,24	3.935.817,96	0,89%		0,38%

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
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.045.787,34	0,00	0,00	7.406.570,00	360.782,66	5,12%	5,12%	4,06%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5.558.115,17	0,00	0,00	5.836.632,97	278.517,80	5,01%	5,01%	4,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.840.928,96	0,00	0,00	4.865.121,77	24.192,81	0,50%	0,50%	1,25%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.784.128,63	0,00	0,00	5.709.390,06	-74.738,57	-1,29%	-1,29%	1,68%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	647.999,73	0,00	0,00	637.714,02	-10.285,71	-1,59%	-1,59%	24,06%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.373.575,04	0,00	0,00	8.204.378,31	-169.196,73	-2,02%	-2,02%	7,28%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	732.380,87	0,00	0,00	710.658,67	-21.722,20	-2,97%	-2,97%	6,53%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.449.787,30	0,00	0,00	2.376.450,82	-73.336,48	-2,99%	-2,99%	6,64%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	5.913.977,84	0,00	0,00	5.729.883,51	-184.094,33	-3,11%	-3,11%	6,77%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.182.078,22	0,00	0,00	4.036.355,87	-145.722,35	-3,48%	-3,48%	5,08%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.523.472,56	0,00	0,00	12.085.911,22	-437.561,34	-3,49%	-3,49%	4,57%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	28.828,98	0,00	0,00	27.720,13	-1.108,85	-3,85%	-3,85%	5,09%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	672.632,27	0,00	0,00	638.500,69	-34.131,58	-5,07%	-5,07%	7,53%
Total Renda Variável	58.753.692,91	0,00	0,00	58.265.288,04	-488.404,87	-0,83%		4,88%

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.223.650,40	0,00	0,00	3.412.524,77	188.874,37	5,86%	5,86%	4,31%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	3.836.793,82	0,00	0,00	4.010.880,17	174.086,35	4,54%	4,54%	7,09%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3.703.681,96	0,00	0,00	3.863.212,21	159.530,25	4,31%	4,31%	6,51%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	367.163,05	0,00	0,00	376.820,03	9.656,98	2,63%	2,63%	3,79%
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	324.219,63	0,00	0,00	322.429,83	-1.789,80	-0,55%	-0,55%	6,14%
Total Exterior	11.455.508,86	0,00	0,00	11.985.867,01	530.358,15	4,63%		5,98%

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.

