



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			521.715.988,35	28,37%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	75.809.676,29	4,12%	704	1,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.476.879,71	0,73%	790	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	18.005.021,21	0,98%	645	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	36.064.138,29	1,96%	789	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	44.076.951,19	2,40%	907	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	15.386.635,98	0,84%	450	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	36.025.175,45	1,96%	18	17,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	12.062.122,87	0,66%	220	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	7.058.074,11	0,38%	1.979	4,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	81.381.617,68	4,43%	118	6,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	45.614.218,18	2,48%	98	8,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	15.128.365,49	0,82%	78	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	16.892.510,36	0,92%	241	1,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	39.683.458,27	2,16%	145	4,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.777.383,43	1,29%	104	4,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	18.457.585,54	1,00%	224	1,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	16.149.688,50	0,88%	14	11,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	8.525.928,07	0,46%	31	3,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	21.556.874,00	1,17%	464	0,73%	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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	593.854,26	0,03%	35	4,29%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	1	0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	11.579.975,08	0,63%	48.503	1,00%	Artigo 8º, Inciso I
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	37.024.224,81	2,01%	6	9,91%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.105.238,50	0,60%	2.739	6,01%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	43.206.084,35	2,35%	2.436	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	9.384.870,27	0,51%	39	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	9.402.816,71	0,51%	4.095	4,24%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	4.479.796,28	0,24%	5.167	2,72%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.745.792,99	0,09%	1.903	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	24.527.418,90	1,33%	201	3,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	17.241.096,03	0,94%	152	1,74%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	35.063.166,35	1,91%	121	4,97%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	16.857.219,67	0,92%	182	6,94%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	32.442.900,05	1,76%	12.292	2,34%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.858.249,32	0,37%	33	1,77%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	14.002.683,65	0,76%	957	1,66%	Artigo 8º, Inciso I
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+7 du	Não há	2.095.064,03	0,11%	3	12,51%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	9.775.702,79	0,53%	7.323	4,45%	Artigo 8º, Inciso I
SPX APACHE FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	9.442.271,13	0,51%	113	1,43%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

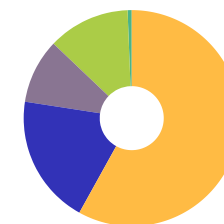
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	27.605.526,55	1,50%	55	1,37%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.216.153,83	0,23%	49	0,62%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	16.834.106,51	0,92%	3.556	5,48%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	11.475.231,44	0,62%	1.682	5,80%	Artigo 8º, Inciso I
AQR LONG-BIASED EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+12 du	Não há	4.985.565,68	0,27%	8	3,14%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	26.575.323,35	1,45%	110	1,86%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	16.923.648,41	0,92%	1	1,18%	Artigo 9º, Inciso II
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+6 du	Não há	5.677.426,39	0,31%	147	0,00%	Artigo 9º, Inciso II
FRANKLIN CLEARBRIDGE AÇÕES EUA GROWTH INVESTIMEN...	D+5 du	Não há	4.983.400,29	0,27%	1.277	3,06%	Artigo 9º, Inciso II
JANUS HENDERSON GLOBAL TECHNOLOGY DÓLAR INSTITUC...	D+5	Não há	5.298.953,47	0,29%	7	5,22%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	5.314.778,57	0,29%	1.021	5,69%	Artigo 9º, Inciso II
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO ...	D+11 du	Não há	17.763.508,47	0,97%	2	84,34%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	18.815.940,84	1,02%	3.662	2,87%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS INVESTIMENT...	D+6 du	Não há	21.631.974,30	1,18%	3.127	5,23%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	6.638.699,88	0,36%	183	1,92%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO ...	D+8 du	Não há	22.284.627,78	1,21%	1.058	13,87%	Artigo 9º, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	20.834.214,87	1,13%	58.363	1,29%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	57.593.960,71	3,13%	5.096	8,45%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	25 Meses	12.790.477,25	0,70%	121	14,44%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	5.773.979,72	0,31%	583	3,07%	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
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	8.699.989,44	0,47%	155	7,26%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	13.835.769,93	0,75%	21	14,23%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	22.802.460,26	1,24%	21	9,71%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.534.117,57	0,79%	20	11,20%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	15.109.284,17	0,82%	20	8,92%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	Não se ...	Não se aplica	554.263,09	0,03%	32	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	21.103.949,01	1,15%	105	0,70%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	59.161,45	0,00%	55	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	12.488.674,98	0,68%	53	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.051.899,34	0,11%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	23.073.844,38	1,25%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	742.473,95	0,04%	18	0,12%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	13.274.018,98	0,72%	46	18,02%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	D+0	Não há	1.311.849,00	0,07%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	4.238.528,91	0,23%		3,38%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	7.105.000,00	0,39%		2,86%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.838.679.500,92				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			194.997,97				Artigo 6º
PL Total			1.838.874.498,89				

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%	521.715.988,35	28,37%	17,00%	31,00%	100,00%	1.316.963.512,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	400.088.876,45	21,76%	10,00%	23,00%	100,00%	1.438.590.624,47
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.838.679.500,92
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.933.975,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	145.043.428,17	7,89%	1,00%	8,00%	60,00%	958.164.272,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.103.207.700,55
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	367.735.900,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	593.854,27	0,03%	0,00%	0,00%	5,00%	91.340.120,78
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.933.975,05
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.933.975,05
Total Renda Fixa	100,00%	1.067.442.147,24	58,05%	28,00%	62,00%	460,00%	

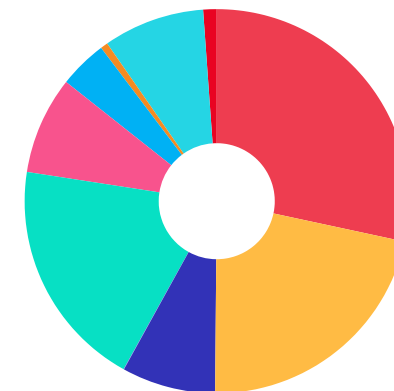


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

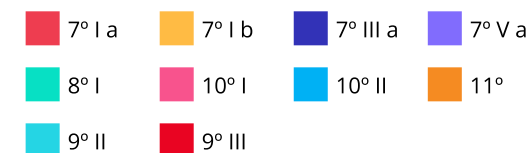


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2024)

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%	356.365.589,24	19,38%	6,00%	18,50%	35,00%	287.172.236,08
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	643.537.825,32
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	151.140.039,05	8,22%	1,00%	8,00%	10,00%	32.727.911,04
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	74.660.134,18	4,06%	1,00%	4,00%	5,00%	17.273.840,87
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.933.975,05
Artigo 11º	5,00%	11.343.528,91	0,62%	0,00%	0,00%	5,00%	80.590.446,14
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	593.509.291,38	32,28%	8,00%	30,50%	95,00%	



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%	156.893.847,43	8,53%	1,00%	6,00%	10,00%	26.974.102,66
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	20.834.214,87	1,13%	1,00%	1,50%	10,00%	163.033.735,22
Total Exterior	10,00%	177.728.062,30	9,67%	2,00%	7,50%	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 '	521.715.988,35	28,37	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	400.088.876,45	21,76	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	145.043.428,17	7,89	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	593.854,27	0,03	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	356.365.589,24	19,38	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	156.893.847,43	8,53	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	20.834.214,87	1,13	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	151.140.039,05	8,22	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	74.660.134,18	4,06	1,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	11.343.528,91	0,62	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
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	521.715.988,35	28,37	-
CAIXA DTVM	218.081.438,69	11,86	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	213.904.693,28	11,63	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	177.085.876,04	9,63	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	96.980.051,07	5,27	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	69.624.272,85	3,79	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	63.696.193,12	3,46	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	63.460.841,70	3,45	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	61.362.242,59	3,34	-
ARX INVESTIMENTOS	37.024.224,81	2,01	-
ICATU VANGUARDA	36.025.175,45	1,96	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	33.651.785,44	1,83	-
XP ASSET MANAGEMENT	33.276.832,74	1,81	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	28.309.337,95	1,54	-
TARPON INVESTIMENTOS	27.605.526,55	1,50	-
WESTERN ASSET	25.817.615,16	1,40	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	23.816.318,33	1,30	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	20.893.844,04	1,14	-
VINCI PARTNERS	18.802.021,81	1,02	-
OCCAM BRASIL	14.002.683,65	0,76	-

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
ALASKA ASSET MANAGEMENT	11.579.975,08	0,63	-
SPX CAPITAL	9.442.271,13	0,51	-
REAG GESTORA DE RECURSOS	7.105.000,00	0,39	-
ITAÚ DTVM	6.858.249,32	0,37	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	6.638.699,88	0,36	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	4.479.796,28	0,24	-
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	4.238.528,91	0,23	-
KINEA INVESTIMENTOS	2.051.899,34	0,11	-
GENIAL GESTÃO LTDA	593.854,27	0,03	-
BRZ INVESTIMENTOS	554.263,09	0,03	-

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
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,12%	5,89%	3,46%	7,16%	15,93%	36,15%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,76%	1.102,54%	994,83%	1.014,36%	757,73%	101.125.778.950,00%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	2,92%	1,62%	4,42%	8,94%	19,23%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,03%	2,78%	1,54%	4,26%	8,60%	18,50%	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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,03%	2,81%	1,56%	4,30%	8,67%	18,70%	0,55%	1,73%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	1,02%	2,83%	1,55%	4,32%	8,72%	18,50%	0,55%	1,72%
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%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,22%	-0,49%	-0,51%	2,18%	6,00%	16,53%	1,32%	3,88%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,27%	-0,36%	-0,41%	2,35%	6,00%	16,86%	1,32%	3,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	-0,30%	-0,32%	2,44%	6,16%	16,93%	1,28%	3,87%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	1,31%	-0,25%	-0,30%	2,47%	6,30%	17,13%	1,29%	3,86%
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%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,64%	1,66%	0,55%	3,14%	10,20%	26,22%	1,33%	2,37%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,69%	0,58%	3,18%	10,24%	26,33%	1,32%	2,36%
CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	3,44%	1,78%	4,42%	11,34%	25,22%	0,35%	0,80%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	-	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,46%	2,27%	1,00%	2,84%	3,93%	8,02%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1,03%	4,32%	2,59%	5,25%	6,35%	-	0,91%	7,45%
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%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,74%	-3,37%	-3,04%	-0,92%	1,19%	-	2,11%	6,03%

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 FI MULTIMERCADO	-3,82%	-0,80%	-1,03%	0,19%	7,74%	-	2,97%	4,13%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	4,51%	11,88%	8,39%	12,39%	6,55%	-	4,28%	8,43%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	0,15%	1,84%	1,65%	2,22%	-0,41%	1,69%	-	-
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	-1,27%	12,30%	-1,67%	8,51%	0,74%	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,74%	5,56%	6,99%	5,02%	4,33%	-	-	-
CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	0,67%	3,00%	1,67%	4,19%	10,79%	22,74%	0,32%	0,82%
Ibovespa (Benchmark)	-3,04%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	-1,15%	-2,25%	-1,63%	0,45%	8,38%	-	2,41%	6,08%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	-3,25%	-6,52%	-5,50%	-3,47%	10,67%	-	4,67%	9,39%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	-0,85%	-2,36%	-1,65%	2,79%	12,52%	5,10%	2,19%	7,99%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	-3,18%	-7,94%	-5,77%	-4,68%	2,88%	7,82%	4,32%	7,65%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,32%	-6,76%	-6,29%	-0,55%	15,12%	13,46%	7,67%	15,63%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-1,83%	-7,08%	-3,65%	-2,91%	5,91%	12,47%	3,46%	8,54%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,92%	-11,63%	-10,72%	-7,37%	4,96%	0,34%	7,20%	15,63%

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
OCCAM FIC AÇÕES	-3,15%	-9,63%	-7,14%	-5,21%	10,19%	3,74%	4,27%	14,00%
BB AGRO FIC AÇÕES	-1,48%	-8,67%	-4,26%	-4,91%	6,48%	-6,67%	5,79%	15,83%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-3,84%	-11,17%	-7,43%	-6,41%	6,58%	5,47%	4,91%	13,93%
XP INVESTOR FI AÇÕES	-3,77%	-11,73%	-11,30%	-7,09%	7,36%	10,19%	8,53%	14,38%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-3,86%	-7,18%	-7,29%	-2,13%	12,44%	2,29%	5,08%	15,71%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,96%	-2,57%	-3,01%	4,60%	16,13%	11,16%	4,12%	13,32%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,48%	-10,01%	-10,28%	-5,51%	7,72%	13,99%	7,65%	13,44%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,15%	-5,69%	-3,37%	-0,97%	16,91%	4,22%	7,20%	15,23%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,81%	-10,05%	-7,13%	-4,78%	9,47%	3,71%	5,23%	14,48%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-3,17%	-7,99%	-5,41%	-3,16%	12,92%	5,59%	5,59%	15,35%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-3,51%	-16,65%	-10,39%	-12,33%	4,92%	9,15%	7,65%	17,63%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-3,23%	-3,23%	0,87%	6,31%	32,63%	60,37%	5,09%	16,45%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,80%	-5,32%	-2,99%	1,27%	19,33%	17,72%	5,82%	12,53%
IBX (Benchmark)	-3,18%	-8,57%	-5,17%	-3,56%	13,24%	8,19%	-	-
SPX APACHE FIC AÇÕES	-2,14%	-9,59%	-6,47%	-4,90%	9,40%	21,70%	7,09%	14,49%
IDIV (Benchmark)	-0,99%	-5,29%	-2,73%	1,24%	19,55%	18,54%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,29%	-6,02%	-3,30%	0,51%	17,28%	14,23%	4,76%	13,32%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-1,49%	-5,08%	-3,80%	0,54%	15,29%	14,39%	5,22%	12,41%

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
IFIX (Benchmark)	0,02%	2,14%	0,66%	6,48%	12,24%	19,92%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	0,56%	-2,65%	-3,01%	0,56%	4,34%	-13,80%	8,80%	23,67%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,80%	10,64%	3,56%	15,54%	26,26%	27,72%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5,12%	12,54%	4,63%	18,43%	33,91%	54,76%	4,06%	11,34%
SMLL (Benchmark)	-3,38%	-14,52%	-8,96%	-8,50%	-4,39%	-11,41%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-4,69%	-14,21%	-10,54%	-8,62%	-5,67%	-14,81%	8,50%	18,32%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,70%	-5,76%	-4,45%	-1,42%	7,16%	-0,22%	5,37%	16,25%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-3,57%	-6,16%	-4,74%	-1,24%	7,57%	-0,31%	5,64%	16,98%
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,64%	8,34%	4,59%	10,29%	19,51%	42,85%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-3,76%	-30,05%	-12,22%	-32,00%	-45,86%	-96,76%	0,90%	12,30%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,95%	4,76%	2,49%	5,88%	10,16%	21,37%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	-0,12%	2,60%	-0,26%	3,01%	3,36%	-5,88%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	-2,74%	11,79%	14,35%	11,58%	9,14%	15,17%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,18%	3,57%	3,93%	3,40%	2,77%	0,11%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	5,17%	2,73%	6,38%	11,20%	23,67%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	2,82%	-0,69%	-0,69%	25,44%	53,83%	114,78%	14,45%	31,34%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,11%	5,57%	2,97%	6,88%	12,24%	25,99%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	-2,81%	-3,05%	-2,94%	6,54%	7,08%	5,81%	-	-
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,22%	6,17%	3,32%	7,62%	13,80%	29,51%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,03%	-4,26%	-4,21%	-4,28%	-6,98%	28,22%	0,00%	4,88%

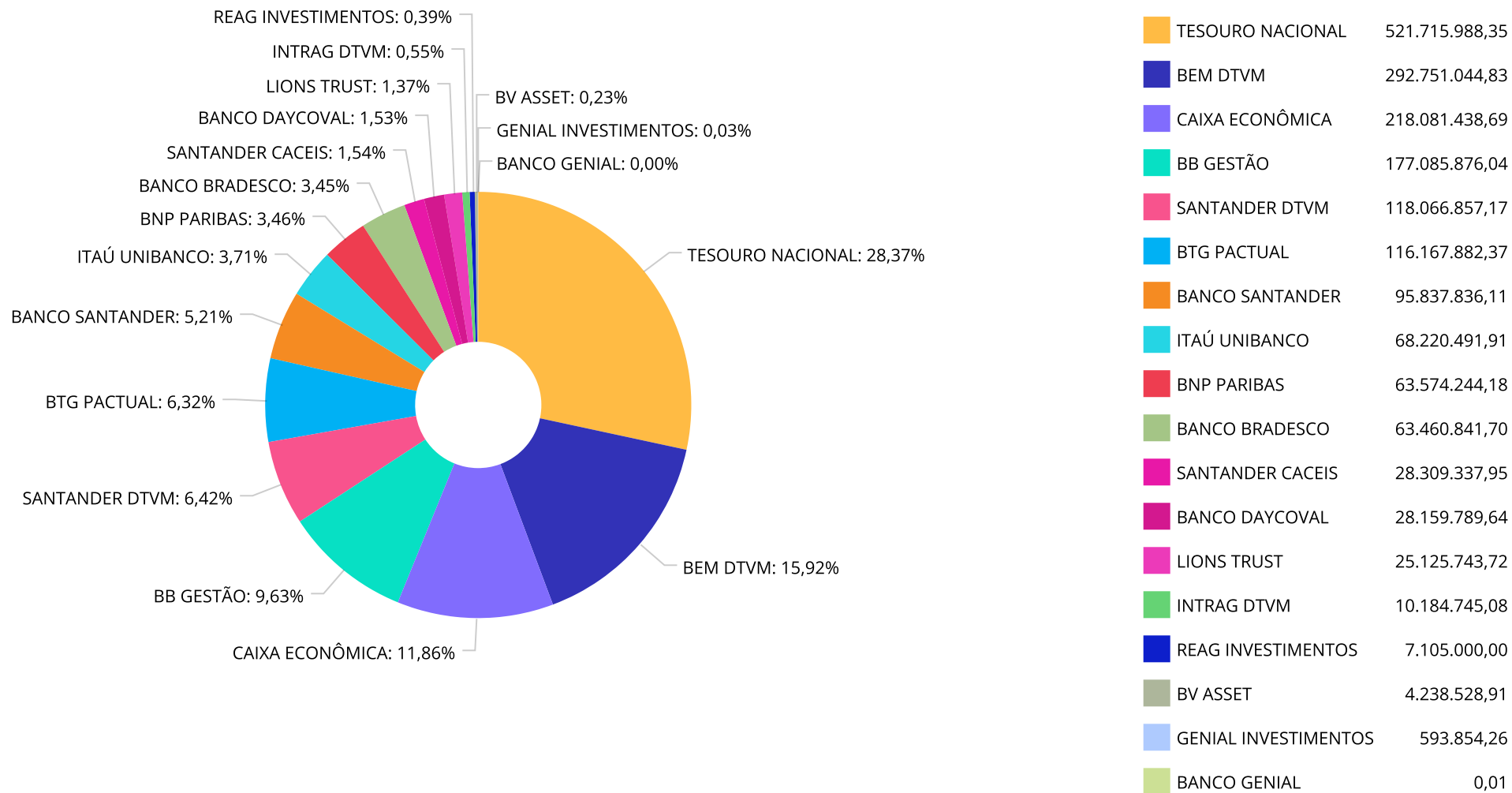
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,25%	19,97%	4,67%	23,29%	33,53%	60,02%	4,95%	15,004%
MSCI WORLD (Benchmark)	5,64%	17,70%	8,59%	21,01%	26,53%	36,82%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4,67%	16,83%	8,43%	21,54%	25,50%	34,92%	4,75%	10,421%
FRANKLIN CLEARBRIDGE AÇÕES EUA GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	5,19%	12,28%	0,63%	17,15%	35,08%	61,07%	4,93%	14,346%
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%
MSCI ACWI (Benchmark)	5,22%	16,99%	8,53%	20,14%	25,00%	33,38%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	3,47%	14,01%	7,76%	18,66%	20,91%	36,99%	6,27%	13,939%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	5,21%	18,06%	9,20%	21,93%	25,78%	37,59%	6,59%	11,727%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI ...	4,63%	11,02%	3,87%	15,60%	28,89%	38,87%	4,33%	11,510%
JANUS HENDERSON GLOBAL TECHNOLOGY DÓLAR INSTITUCIONAL INVESTIMENT...	6,06%	29,28%	11,76%	34,09%	-	-	9,99%	-
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6,36%	15,83%	11,61%	19,64%	9,95%	36,11%	5,72%	12,000%
AQR LONG-BIASED EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-0,58%	14,28%	2,22%	13,52%	29,05%	49,80%	6,62%	11,161%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULT...	-4,01%	6,16%	1,58%	8,11%	8,95%	13,96%	7,37%	12,261%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

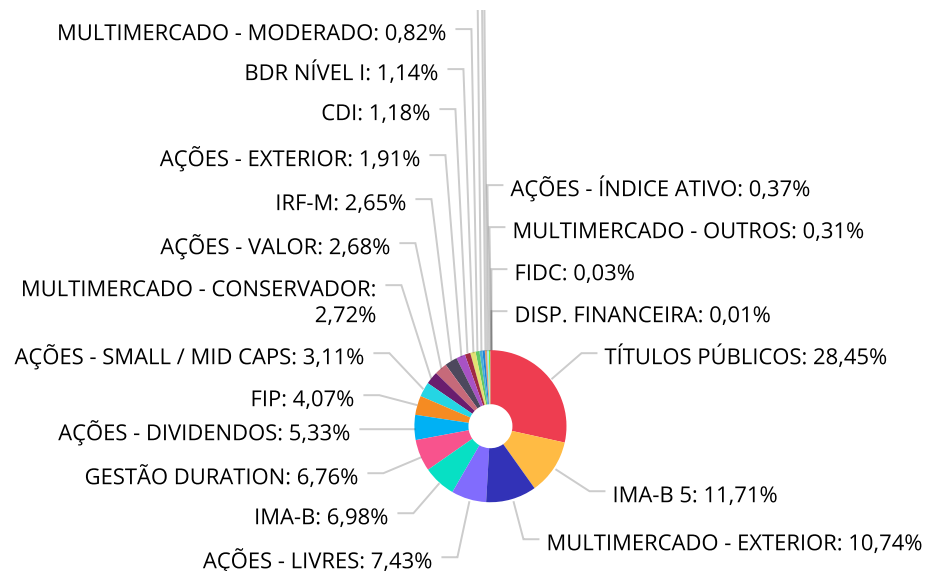
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIM...	4,21%	18,35%	8,28%	22,55%	29,15%	-	6,45%	12,696%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	8,10%	18,39%	18,12%	26,67%	19,52%	42,21%	5,09%	13,502%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	521.715.988,35	■ IMA-B 5	214.644.082,30	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	196.928.279,90
■ AÇÕES - LIVRES	136.235.572,50	■ IMA-B	127.949.460,12	■ GESTÃO DURATION	123.935.937,45
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	97.732.349,81	■ FIP	74.660.134,18	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	57.070.750,90
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	49.860.354,19	■ AÇÕES - VALOR	49.065.850,00	■ IRF-M	48.520.022,68
■ AÇÕES - EXTERIOR	35.063.035,03	■ CDI	21.556.874,00	■ BDR NÍVEL I	20.834.214,87
■ MULTIMERCADO - MODERADO	15.109.284,17	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	11.343.528,91	■ AÇÕES - SETORIAIS	9.402.816,71
■ IDKA IPCA 2A	8.525.928,07	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.858.249,32	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.773.979,72
■ FIDC	593.854,27	■ DISP. FINANCEIRA	194.997,97		

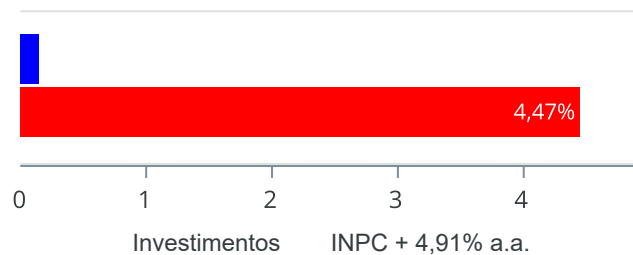
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.335,456785	10.048.181,87	14.740.553,07	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	13/12/2022	12.000	3959,170000	4.270,412203	47.510.040,00	51.244.946,44	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.241,792586	14.651.394,86	14.634.184,42	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.241,792586	7.520.551,00	13.573.736,28	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.241,792586	13.087.396,08	16.967.170,34	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.241,792586	25.480.686,71	25.450.755,52	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.241,792586	36.097.639,50	36.055.236,98	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.241,792586	55.208.154,53	55.143.303,62	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.305,908572	24.699.419,65	25.835.451,43	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.305,908572	20.000.340,99	21.206.599,72	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.305,908572	20.609.488,43	21.852.486,00	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.305,908572	25.008.464,96	26.696.633,15	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.224,106451	25.038.468,13	26.611.870,64	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/04/2022	12.000	4159,261023	4.224,106451	49.911.132,28	50.689.277,41	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.224,106451	25.347.747,49	25.344.638,71	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.224,106451	41.512.279,91	42.241.064,51	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	16/05/2023	10.000	428.739,166800	4.274,246410	4.287.391.668,00	42.742.464,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	16/05/2024	2.500	4.265,763648	4.274,246410	10.664.409,12	10.685.616,03	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

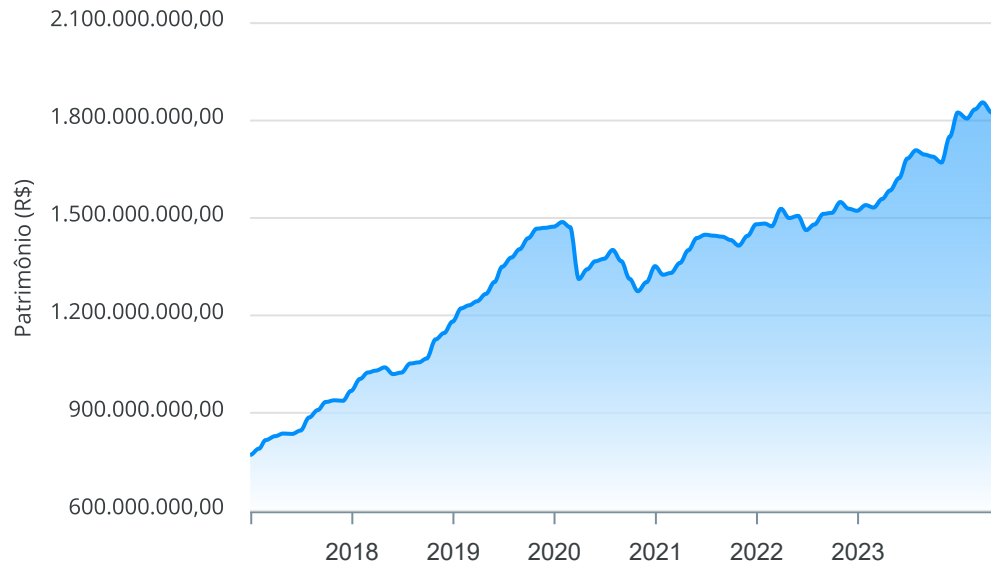
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.824.489.500,88	75.360.320,69	79.084.598,66	1.806.029.630,25	-14.735.592,66	-14.735.592,66	-0,81%	-0,81%	0,99%	0,99%	-81,44%	3,64%
Fevereiro	1.806.029.630,25	47.257.983,14	46.362.473,14	1.830.825.811,60	23.900.671,35	9.165.078,69	1,32%	0,50%	1,17%	2,18%	23,15%	3,61%
Março	1.830.825.811,60	20.228.000,00	12.187.546,10	1.855.609.218,07	16.742.952,57	25.908.031,26	0,91%	1,42%	0,57%	2,76%	51,38%	2,92%
Abril	1.855.609.218,07	43.442.819,20	41.794.585,28	1.824.354.950,93	-32.902.501,06	-6.994.469,80	-1,77%	-0,38%	0,79%	3,58%	-10,55%	3,88%
Maior	1.824.354.950,93	30.329.440,76	25.772.294,11	1.838.679.500,92	9.767.403,34	2.772.933,54	0,53%	0,15%	0,86%	4,47%	3,46%	3,39%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



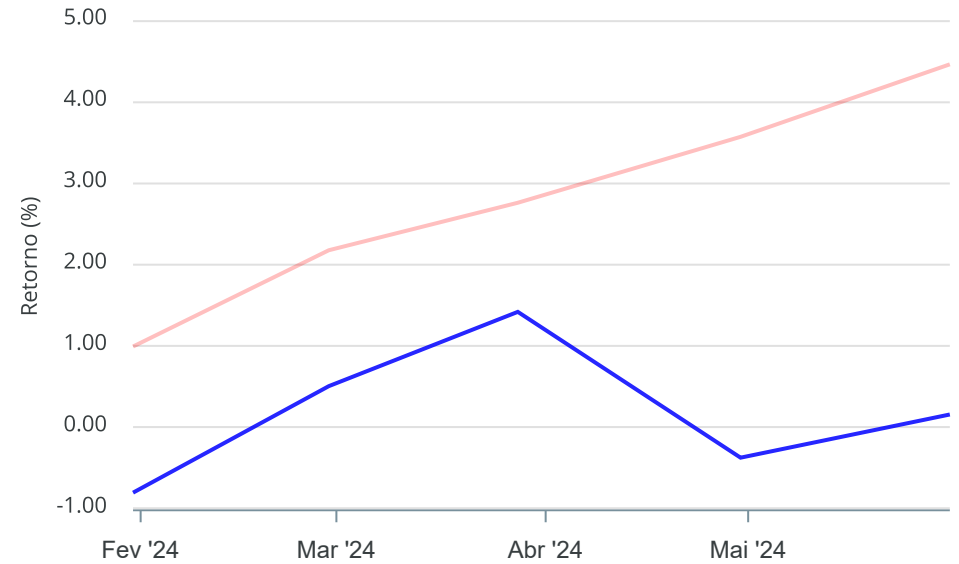
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	598.409,10	0,00	19.525,72	593.854,26	14.970,88	2,50%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	513.762.482,72	10.664.409,12	10.661.722,21	521.715.988,35	7.950.818,72	1,52%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	18.219.865,49	0,00	0,00	18.457.585,54	237.720,05	1,30%	1,30%	1,33%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	45.026.806,17	0,00	0,00	45.614.218,18	587.412,01	1,30%	1,30%	1,29%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.676.741,00	0,00	0,00	16.892.510,36	215.769,36	1,29%	1,29%	1,28%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	23.478.879,59	0,00	0,00	23.777.383,43	298.503,84	1,27%	1,27%	1,32%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.972.947,40	0,00	0,00	7.058.074,11	85.126,71	1,22%	1,22%	1,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	43.628.583,05	0,00	0,00	44.076.951,19	448.368,14	1,03%	1,03%	0,55%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	8.439.204,67	0,00	0,00	8.525.928,07	86.723,40	1,03%	1,03%	0,91%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	80.553.872,23	0,00	0,00	81.381.617,68	827.745,45	1,03%	1,03%	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.339.929,63	0,00	0,00	13.476.879,71	136.950,08	1,03%	1,03%	0,55%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	39.280.527,38	0,00	0,00	39.683.458,27	402.930,89	1,03%	1,03%	0,55%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	35.662.209,01	0,00	0,00	36.025.175,45	362.966,44	1,02%	1,02%	0,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.972.701,46	0,00	0,00	12.062.122,87	89.421,41	0,75%	0,75%	1,18%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.030.381,50	0,00	0,00	16.149.688,50	119.307,00	0,74%	0,74%	2,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	75.266.673,53	0,00	0,00	75.809.676,29	543.002,76	0,72%	0,72%	0,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	35.812.440,55	0,00	0,00	36.064.138,29	251.697,74	0,70%	0,70%	0,46%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.032.325,30	0,00	0,00	15.128.365,49	96.040,19	0,64%	0,64%	1,33%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	17.891.014,23	0,00	0,00	18.005.021,21	114.006,98	0,64%	0,64%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	15.290.030,35	0,00	0,00	15.386.635,98	96.605,63	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
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	19.197.663,51	17.160.000,00	15.005.031,64	21.556.874,00	204.242,13	0,56%	0,84%	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	1.052.133.687,88	27.824.409,12	25.686.279,57	1.067.442.147,24	13.170.329,81	1,25%		0,78%

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	54.788.491,76	0,00	0,00	57.593.960,71	2.805.468,95	5,12%	5,12%	4,06%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	2.004.662,19	0,00	0,00	2.095.064,03	90.401,84	4,51%	4,51%	4,28%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	9.623.633,04	2.505.031,64	0,00	12.488.674,98	360.010,30	2,97%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	6.999.000,00	0,00	45.000,00	7.105.000,00	151.000,00	2,16%	2,82%	14,45%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	13.744.067,35	0,00	0,00	13.835.769,93	91.702,58	0,67%	0,67%	0,32%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.255.798,19	0,00	41.014,54	4.238.528,91	23.745,26	0,56%	1,54%	8,80%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.048.757,80	0,00	0,00	2.051.899,34	3.141,54	0,15%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	554.422,44	0,00	0,00	554.263,09	-159,35	-0,03%	-0,03%	0,00%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	23.101.760,01	0,00	0,00	23.073.844,38	-27.915,63	-0,12%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	21.142.421,99	0,00	0,00	21.103.949,01	-38.472,98	-0,18%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	747.970,79	0,00	0,00	742.473,95	-5.496,84	-0,73%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	12.899.924,56	0,00	0,00	12.790.477,25	-109.447,31	-0,85%	-0,85%	2,19%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	8.800.812,15	0,00	0,00	8.699.989,44	-100.822,71	-1,15%	-1,15%	2,41%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	1.328.667,18	0,00	0,00	1.311.849,00	-16.818,18	-1,27%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.077.991,99	0,00	0,00	16.857.219,67	-220.772,32	-1,29%	-1,29%	4,76%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.543.602,23	0,00	0,00	9.402.816,71	-140.785,52	-1,48%	-1,48%	5,79%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	17.502.251,70	0,00	0,00	17.241.096,03	-261.155,67	-1,49%	-1,49%	5,22%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	9.954.866,34	0,00	0,00	9.775.702,79	-179.163,55	-1,80%	-1,80%	5,82%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	14.804.665,28	0,00	0,00	14.534.117,57	-270.547,71	-1,83%	-1,83%	3,46%
SPX APACHE FIC AÇÕES	9.648.511,45	0,00	0,00	9.442.271,13	-206.240,32	-2,14%	-2,14%	7,09%

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
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	37.837.186,27	0,00	0,00	37.024.224,81	-812.961,46	-2,15%	-2,15%	7,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	25.109.694,29	0,00	0,00	24.527.418,90	-582.275,39	-2,32%	-2,32%	7,67%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	13.657.422,83	0,00	0,00	13.274.018,98	-383.403,85	-2,81%	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	33.431.568,31	0,00	0,00	32.442.900,05	-988.668,26	-2,96%	-2,96%	4,12%
OCCAM FIC AÇÕES	14.457.812,09	0,00	0,00	14.002.683,65	-455.128,44	-3,15%	-3,15%	4,27%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.354.077,98	0,00	0,00	4.216.153,83	-137.924,15	-3,17%	-3,17%	5,59%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	15.604.954,95	0,00	0,00	15.109.284,17	-495.670,78	-3,18%	-3,18%	4,32%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	28.525.414,18	0,00	0,00	27.605.526,55	-919.887,63	-3,22%	-3,22%	5,09%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.967.884,72	0,00	0,00	5.773.979,72	-193.905,00	-3,25%	-3,25%	4,67%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.440.173,92	0,00	0,00	16.834.106,51	-606.067,41	-3,48%	-3,48%	7,65%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	12.001.495,48	0,00	0,00	11.579.975,08	-421.520,40	-3,51%	-3,51%	7,65%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	44.803.169,13	0,00	0,00	43.206.084,35	-1.597.084,78	-3,56%	-3,56%	5,64%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.745.897,26	0,00	0,00	9.384.870,27	-361.026,99	-3,70%	-3,70%	5,37%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	61.474,35	0,00	0,00	59.161,45	-2.312,90	-3,76%	-3,76%	0,90%
XP INVESTOR FI AÇÕES	11.924.963,45	0,00	0,00	11.475.231,44	-449.732,01	-3,77%	-3,77%	8,53%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	36.451.195,36	0,00	0,00	35.063.166,35	-1.388.029,01	-3,81%	-3,81%	5,23%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	23.709.162,72	0,00	0,00	22.802.460,26	-906.702,46	-3,82%	-3,82%	2,97%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	7.132.088,79	0,00	0,00	6.858.249,32	-273.839,47	-3,84%	-3,84%	4,91%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.550.749,93	0,00	0,00	11.105.238,50	-445.511,43	-3,86%	-3,86%	5,08%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.817.086,29	0,00	0,00	1.745.792,99	-71.293,30	-3,92%	-3,92%	7,20%

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
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	4.700.100,05	0,00	0,00	4.479.796,28	-220.303,77	-4,69%	-4,69%	8,50%
Total Renda Variável	600.855.850,79	2.505.031,64	86.014,54	593.509.291,38	-9.765.576,51	-1,62%		5,28%

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
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	16.432.448,81	0,00	0,00	17.763.508,47	1.331.059,66	8,10%	8,10%	5,09%
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.337.710,01	0,00	0,00	5.677.426,39	339.716,38	6,36%	6,36%	5,72%
JANUS HENDERSON GLOBAL TECHNOLOGY DÓLAR INSTITUCIO...	4.996.249,96	0,00	0,00	5.298.953,47	302.703,51	6,06%	6,06%	9,99%
WESTERN ASSET FIAÇÕES BDR NÍVEL I	19.795.208,25	0,00	0,00	20.834.214,87	1.039.006,62	5,25%	5,25%	4,95%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	5.051.459,12	0,00	0,00	5.314.778,57	263.319,45	5,21%	5,21%	6,59%
FRANKLIN CLEARBRIDGE AÇÕES EUA GROWTH INVESTIMENTO...	4.737.738,16	0,00	0,00	4.983.400,29	245.662,13	5,19%	5,19%	4,93%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	17.976.293,14	0,00	0,00	18.815.940,84	839.647,70	4,67%	4,67%	4,75%
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS INVESTIMENTO ...	20.674.301,57	0,00	0,00	21.631.974,30	957.672,73	4,63%	4,63%	4,33%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	25.477.902,87	0,00	0,00	26.575.323,35	1.097.420,48	4,31%	4,31%	6,51%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	16.239.944,59	0,00	0,00	16.923.648,41	683.703,82	4,21%	4,21%	6,45%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	6.416.202,42	0,00	0,00	6.638.699,88	222.497,46	3,47%	3,47%	6,27%
AQR LONG-BIASED EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.014.802,24	0,00	0,00	4.985.565,68	-29.236,56	-0,58%	-0,58%	6,62%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	23.215.151,12	0,00	0,00	22.284.627,78	-930.523,34	-4,01%	-4,01%	7,37%
Total Exterior	171.365.412,26	0,00	0,00	177.728.062,30	6.362.650,04	3,71%		5,87%

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.

