

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

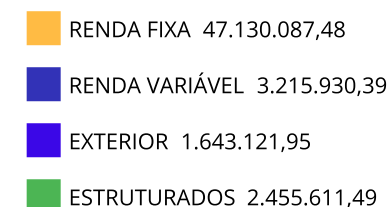
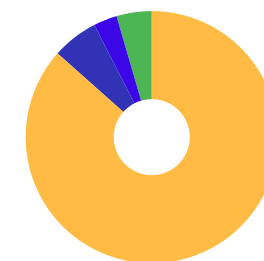
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			25.967.273,43	47,69%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.049.544,52	1,93%	350	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	535.306,67	0,98%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.426.921,96	6,29%	1.169	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.180.324,82	2,17%	247	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	562.347,91	1,03%	450	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	824.356,80	1,51%	220	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.135.685,01	2,09%	45.044	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	988.645,93	1,82%	1.021	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.261.568,84	2,32%	1.144	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.080.170,50	11,17%	477	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	718.431,19	1,32%	416	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.402.754,10	2,58%	211	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.996.755,80	3,67%	96	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	D+4	Não há	298.047,42	0,55%	5.039	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	102.842,78	0,19%	1.203	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	427.381,73	0,78%	11.686	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	92.352,44	0,17%	2.588	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB PETROBRAS I FI AÇÕES	D+3	Não há	116.338,07	0,21%	41.284	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	219.800,94	0,40%	23.261	0,03%	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
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	91.278,06	0,17%	4.093	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	573.199,25	1,05%	5.761	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÃO...	D+24	Não há	260.462,95	0,48%	16	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	758.796,78	1,39%	7.794	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	D+92	Não há	275.429,97	0,51%	16	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	655.015,63	1,20%	138	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	236.726,42	0,43%	21.094	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	751.379,90	1,38%	453	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	2.455.611,49	4,51%	5.096	0,36%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			54.444.751,31				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.654,99	Artigo 6º			
PL Total			54.451.406,30				

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

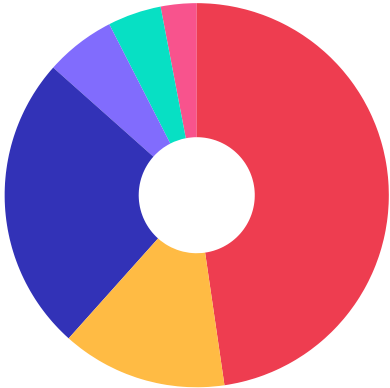
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	25.967.273,43	47,69%	22,00%	40,00%	60,00%	6.699.577,36
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	7.578.802,68	13,92%	0,00%	20,00%	100,00%	46.865.948,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	13.584.011,37	24,95%	0,00%	14,50%	60,00%	19.082.839,42
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.888.950,26
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	544.447,51
Total Renda Fixa	100,00%	47.130.087,48	86,56%	22,00%	75,00%	241,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	3.215.930,39	5,91%	0,00%	8,00%	30,00%	13.117.495,00
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.455.611,49	4,51%	0,00%	10,00%	10,00%	2.988.863,64
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	5.671.541,88	10,42%	0,00%	18,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.643.121,95	3,02%	0,00%	7,00%	10,00%	3.801.353,18
Total Exterior	10,00%	1.643.121,95	3,02%	0,00%	7,00%	10,00%	



Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	25.967.273,43	47,69	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.210.534,46	13,24	-
CAIXA DTVM	6.494.173,84	11,93	0,03
BANCO BRADESCO	6.080.170,50	11,17	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	5.701.094,67	10,47	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.455.611,49	4,51	0,00
TARPON INVESTIMENTOS	275.429,97	0,51	-
ITAÚ DTVM	260.462,95	0,48	0,00

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
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,60%	0,94%	0,00%	2,69%	10,22%	27,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	0,84%	-0,07%	2,56%	9,95%	26,74%	1,85%	3,32%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,78%	3,85%	2,21%	4,80%	11,56%	26,65%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,76%	3,85%	2,16%	4,77%	11,40%	26,22%	0,18%	0,32%

IRF-M (Benchmark)	0,66%	1,81%	0,67%	3,32%	10,51%	26,78%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,69%	0,58%	3,18%	10,24%	26,33%	1,32%	2,36%

CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,87%	4,17%	2,72%	5,35%	11,03%	25,10%	0,22%	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86%	4,63%	2,70%	5,62%	12,92%	28,34%	0,03%	0,10%
BRANDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	4,81%	2,76%	5,79%	13,06%	28,67%	0,03%	0,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	4,42%	2,59%	5,36%	12,05%	27,13%	0,02%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	3,97%	2,32%	4,82%	10,90%	24,61%	0,01%	0,07%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,88%	6,18%	3,39%	4,79%	11,02%	24,15%	1,50%	2,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,10%	4,71%	3,08%	5,73%	12,04%	26,64%	0,45%	0,56%

IPCA (Benchmark)	0,46%	2,27%	1,00%	2,84%	3,93%	8,02%	-	-
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%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	4,51%	2,62%	5,48%	11,10%	19,57%	0,65%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	4,56%	2,64%	5,53%	11,21%	-	0,65%	0,86%

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
Global BDRX (Benchmark)	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,78%	23,76%	11,38%	26,96%	35,62%	54,35%	4,53%	13,52%

Ibovespa (Benchmark)	-3,04%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-3,43%	-13,30%	-8,90%	-6,94%	6,85%	9,10%	8,12%	17,60%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-3,43%	-13,97%	-9,72%	-9,15%	5,29%	-8,25%	4,79%	14,64%
BB PETROBRAS I FI AÇÕES	-3,79%	11,24%	5,14%	14,83%	66,54%	112,32%	14,37%	28,80%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-0,92%	-18,05%	-11,37%	-11,12%	-1,90%	15,06%	10,64%	25,31%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,30%	-8,63%	-4,82%	-3,12%	10,82%	-0,56%	4,31%	14,18%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	-2,38%	-3,02%	0,43%	1,70%	17,96%	4,65%	4,06%	12,01%
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	-3,22%	-3,19%	0,82%	6,32%	32,45%	-	5,14%	16,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-3,53%	-10,82%	-7,66%	-5,91%	3,64%	0,02%	5,85%	14,71%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-2,35%	-15,07%	-7,22%	-10,00%	-8,71%	-24,21%	8,61%	20,82%

IDIV (Benchmark)	-0,99%	-5,29%	-2,73%	1,24%	19,55%	18,54%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-2,78%	-6,87%	-7,56%	0,72%	9,44%	13,03%	7,20%	14,90%

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%

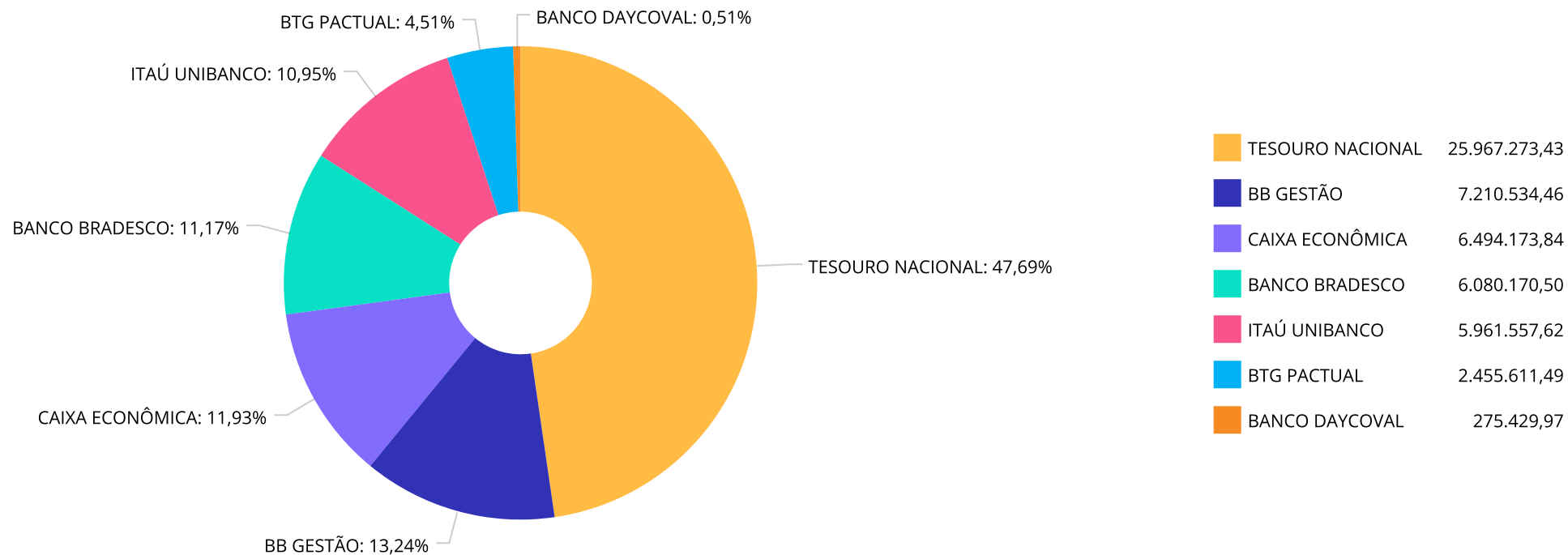
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-3,38%	-14,52%	-8,96%	-8,50%	-4,39%	-11,41%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-2,11%	-12,72%	-7,98%	-6,22%	-3,70%	-9,06%	6,89%	18,19%

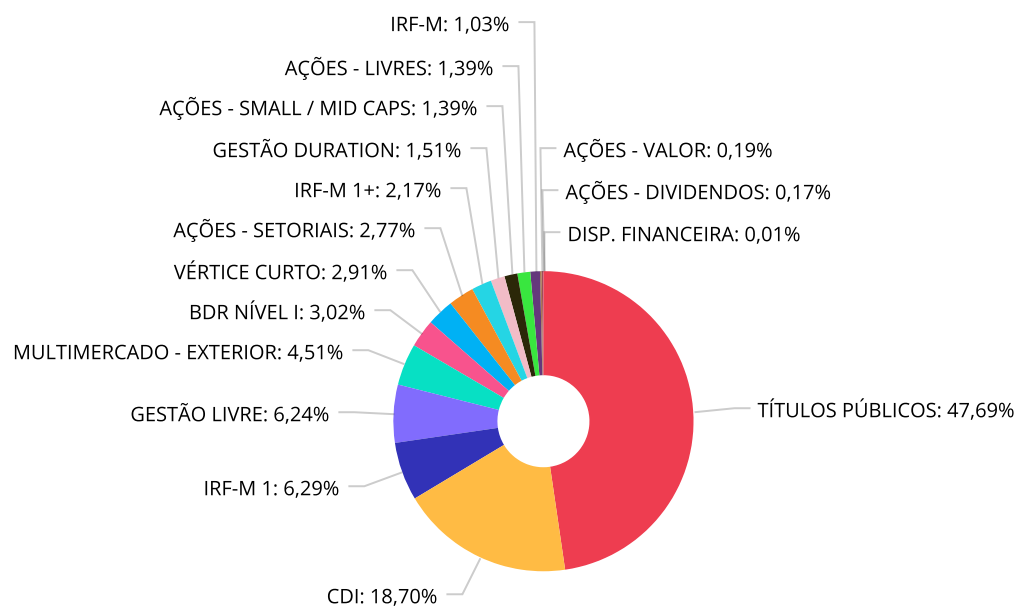
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,78%	19,02%	5,54%	23,41%	41,18%	63,31%	5,91%	15,317%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,26%	18,59%	6,42%	22,19%	31,61%	43,37%	4,50%	13,600%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,78%	23,76%	11,38%	26,96%	35,62%	54,35%	4,53%	13,518%

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



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



TÍTULOS PÚBLICOS	25.967.273,43	CDI	10.184.501,47	IRF-M 1	3.426.921,96	GESTÃO LIVRE	3.399.509,90
MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.455.611,49	BDR NÍVEL I	1.643.121,95	VÉRTICE CURTO	1.584.851,19	AÇÕES - SETORIAIS	1.506.244,53
IRF-M 1+	1.180.324,82	GESTÃO DURATION	824.356,80	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	758.796,78	AÇÕES - LIVRES	755.693,86
IRF-M	562.347,91	AÇÕES - VALOR	102.842,78	AÇÕES - DIVIDENDOS	92.352,44	DISP. FINANCEIRA	6.654,99

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	15/08/2024	08/08/2023	800	4.218,270404	4.344,952438	3.374.616,32	3.475.961,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	03/10/2023	120	4.169,170000	4.347,994984	500.300,40	521.759,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	15/03/2024	300	4.235,379345	4.334,511071	1.270.613,80	1.300.353,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	13/05/2024	800	4.295,437225	4.325,006859	3.436.349,78	3.460.005,48	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	08/08/2023	800	4.159,770000	4.308,82702	3.327.816,00	3.447.061,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	03/10/2023	120	4.161,160000	4.298,578219	499.339,20	515.829,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	15/03/2024	300	4.329,415729	4.288,269508	1.298.824,72	1.286.480,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	03/10/2023	120	4.236,300000	4.404,386926	508.356,00	528.526,43	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	28/07/2023	100	4.294,800000	4.553,527307	429.480,00	455.352,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	03/10/2023	120	4.266,530000	4.437,06327	511.983,60	532.447,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	27/07/2023	100	4.387,000000	4.551,165161	438.700,00	455.116,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	27/11/2023	100	4.387,000000	4.416,916566	438.700,00	441.691,65	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	13/05/2024	450	4.354,310468	4.251,429455	1.959.439,71	1.913.143,25	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/08/2023	390	4.457,720000	4.690,488945	1.738.510,80	1.829.290,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	27/11/2023	150	4.355,990000	4.483,090871	653.398,50	672.463,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/03/2024	300	4.383,075307	4.465,759913	1.314.922,59	1.339.727,97	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	22/11/2023	150	4.287,850000	4.420,044697	643.177,50	663.006,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/08/2023	390	4.465,490000	4.641,328935	1.741.541,10	1.810.118,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/03/2024	300	4.439,089022	4.396,453198	1.331.726,71	1.318.935,95	Curva

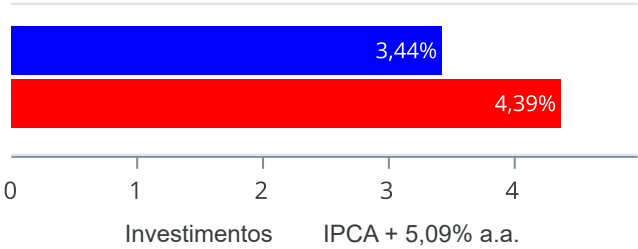
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

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	49.477.337,95	1.226.795,94	203.605,60	50.699.934,58	199.406,29	199.406,29	0,39%	0,39%	0,86%	0,86%	46,12%	1,66%
Fevereiro	50.699.934,58	899.460,65	587.147,14	51.580.733,77	568.485,68	767.891,97	1,11%	1,51%	1,21%	2,07%	72,96%	1,65%
Março	51.580.733,77	8.923.996,39	8.157.332,12	52.864.651,69	517.253,65	1.285.145,62	0,99%	2,52%	0,56%	2,64%	95,27%	1,63%
Abril	52.864.651,69	1.158.793,06	633.946,97	53.312.924,07	-76.573,71	1.208.571,91	-0,14%	2,37%	0,82%	3,48%	68,11%	2,21%
Maio	53.312.924,07	12.131.154,20	11.562.771,16	54.444.751,31	563.444,20	1.772.016,11	1,05%	3,44%	0,88%	4,39%	78,43%	1,75%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

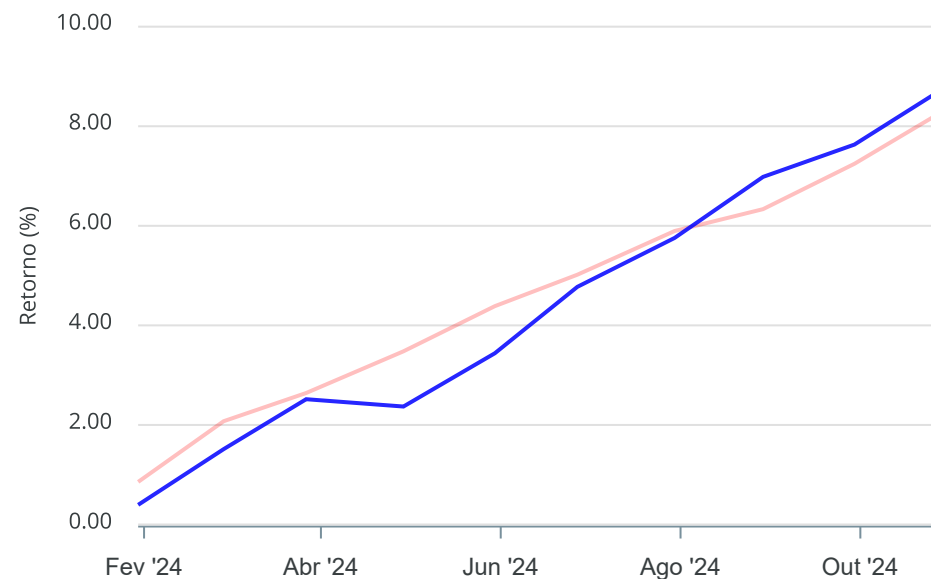
Evolução do Patrimônio



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
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.423.086,35	0,00	1.439.832,38	0,00	16.746,03	1,18%	1,57%	2,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.975.072,24	0,00	0,00	1.996.755,80	21.683,56	1,10%	1,10%	0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.040.263,67	0,00	0,00	1.049.544,52	9.280,85	0,89%	0,89%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	530.606,36	0,00	0,00	535.306,67	4.700,31	0,89%	0,89%	0,65%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.125.770,56	0,00	0,00	1.135.685,01	9.914,45	0,88%	0,88%	1,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.390.638,25	0,00	0,00	1.402.754,10	12.115,85	0,87%	0,87%	0,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.416.344,69	0,00	1.428.571,19	0,00	12.226,50	0,86%	1,30%	1,28%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	61.400,49	0,00	61.929,23	0,00	528,74	0,86%	1,31%	1,28%
TÍTULOS PÚBLICOS	20.696.370,25	5.395.789,49	342.134,59	25.967.273,43	217.248,28	0,83%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.401.068,26	0,00	0,00	3.426.921,96	25.853,70	0,76%	0,76%	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	818.245,50	0,00	0,00	824.356,80	6.111,30	0,75%	0,75%	1,18%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.363.419,09	2.672.201,25	0,00	6.080.170,50	44.550,16	0,74%	0,88%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	558.817,19	0,00	0,00	562.347,91	3.530,72	0,63%	0,63%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.173.496,42	0,00	0,00	1.180.324,82	6.828,40	0,58%	0,58%	1,85%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	1.026.499,50	0,00	1.032.303,14	0,00	5.803,64	0,57%	0,87%	0,30%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	553.714,59	0,00	556.306,27	0,00	2.591,68	0,47%	0,92%	0,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	311.871,70	1.020.389,92	76.806,10	1.261.568,84	6.113,32	0,46%	0,83%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.038.176,96	2.325.501,07	2.383.300,78	988.645,93	8.268,68	0,25%	0,75%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.589.944,53	717.272,47	2.595.484,98	718.431,19	6.699,17	0,20%	0,86%	0,03%
Total Renda Fixa	44.494.806,60	12.131.154,20	9.916.668,66	47.130.087,48	420.795,34	0,90%		0,41%

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	2.335.995,80	0,00	0,00	2.455.611,49	119.615,69	5,12%	5,12%	4,06%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.641.492,01	0,00	1.646.102,50	0,00	4.610,49	0,28%	0,72%	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	431.367,99	0,00	0,00	427.381,73	-3.986,26	-0,92%	-0,92%	10,64%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	775.150,75	0,00	0,00	758.796,78	-16.353,97	-2,11%	-2,11%	6,89%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	105.262,12	0,00	0,00	102.842,78	-2.419,34	-2,30%	-2,30%	4,31%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	587.016,17	0,00	0,00	573.199,25	-13.816,92	-2,35%	-2,35%	8,61%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	305.309,78	0,00	0,00	298.047,42	-7.262,36	-2,38%	-2,38%	4,06%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	94.996,47	0,00	0,00	92.352,44	-2.644,03	-2,78%	-2,78%	7,20%
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	284.585,18	0,00	0,00	275.429,97	-9.155,21	-3,22%	-3,22%	5,14%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	227.609,10	0,00	0,00	219.800,94	-7.808,16	-3,43%	-3,43%	4,79%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	94.524,24	0,00	0,00	91.278,06	-3.246,18	-3,43%	-3,43%	8,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	270.002,62	0,00	0,00	260.462,95	-9.539,67	-3,53%	-3,53%	5,85%
BB PETROBRAS I FI AÇÕES	120.914,16	0,00	0,00	116.338,07	-4.576,09	-3,78%	-3,78%	14,37%
Total Renda Variável	7.274.226,39	0,00	1.646.102,50	5.671.541,88	43.417,99	0,60%		5,89%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Maio / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	703.683,15	0,00	0,00	751.379,90	47.696,75	6,78%	6,78%	4,53%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	616.421,69	0,00	0,00	655.015,63	38.593,94	6,26%	6,26%	4,50%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	223.786,24	0,00	0,00	236.726,42	12.940,18	5,78%	5,78%	5,91%
Total Exterior	1.543.891,08	0,00	0,00	1.643.121,95	99.230,87	6,43%		4,72%

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 MOSAICO CONSULTORIA. 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.

