

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2024



Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

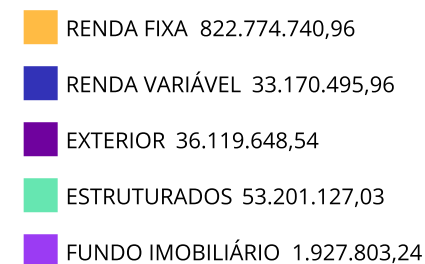
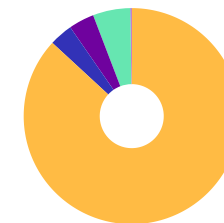
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|---------------|----------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | 738.784.186,25 | 78,00% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 13.729.092,41 | 1,45% | 907 | 0,18% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 1.255.611,94 | 0,13% | 768 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 39.445.973,75 | 4,16% | 1.002 | 0,25% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | D+1009 | Não há | 801.083,63 | 0,08% | 28 | 1,05% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| LETRA FINANCEIRA BTG | S/Info | Não se aplica | 25.511.591,84 | 2,69% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1 | D+1601 | 29 dias | 2.480.221,43 | 0,26% | 33 | 2,07% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1 | D+1260 | Não há | 0,01 | 0,00% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | D+1260 | 90 dias | 766.979,70 | 0,08% | 70 | 1,09% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 6.105.411,35 | 0,64% | 16.544 | 0,55% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | D+15 | Não há | 3.254.748,22 | 0,34% | 201 | 0,43% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 8.226.810,12 | 0,87% | 12.292 | 0,59% | Artigo 8º, Inciso I |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 15.151.379,90 | 1,60% | 1.014 | 1,43% | Artigo 8º, Inciso I |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE... | D+6 du | Não há | 9.697.190,64 | 1,02% | 2.044 | 4,59% | Artigo 9º, Inciso II |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME... | D+5 | Não há | 11.971.167,26 | 1,26% | 6.710 | 1,62% | Artigo 9º, Inciso II |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 14.451.290,64 | 1,53% | 453 | 0,59% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+1 | Não há | 22.718.383,51 | 2,40% | 7.376 | 1,21% | Artigo 10º, Inciso I |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 23.951.356,26 | 2,53% | 606 | 1,69% | Artigo 10º, Inciso I |
| SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP | D+1 du | Não há | 2.652.211,32 | 0,28% | 10.394 | 0,84% | Artigo 10º, Inciso I |
| BRASIL FLORESTAL FICFIP | Não se ... | Não se aplica | 744.820,72 | 0,08% | 17 | 2,71% | Artigo 10º, Inciso II |

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|--|------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP | Não se ... | Não se aplica | 755.815,57 | 0,08% | 22 | 0,56% | Artigo 10º, Inciso II |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | Não se ... | Não se aplica | 2.378.539,65 | 0,25% | 28 | 3,47% | Artigo 10º, Inciso II |
| BR HOTÉIS FII - BRHT11 | Não se ... | Não se aplica | 1.927.803,24 | 0,20% | | 1,49% | Artigo 11º |
| OSASCO PROPERTIES FII | Não se ... | Não se aplica | 432.146,37 | 0,05% | | 0,00% | Desenquadrado - RV |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 947.193.815,73 | | | | |

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

| Artigos - Renda Fixa | Resolução Pró Gestão - Nivel 2 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|-----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 738.784.186,25 | 78,00% | 50,00% | 75,00% | 90,00% | 113.690.247,91 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 14.984.704,35 | 1,58% | 0,00% | 2,00% | 30,00% | 269.173.440,37 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 47.359.690,79 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 70,00% | 40.247.057,38 | 4,25% | 0,00% | 2,50% | 30,00% | 243.911.087,34 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 70,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 94.719.381,57 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 25.511.591,84 | 2,69% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 69.207.789,73 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' | 10,00% | 3.247.201,14 | 0,34% | 0,00% | 0,50% | 5,00% | 44.112.489,65 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 47.359.690,79 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c ' | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 47.359.690,79 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 822.774.740,96 | 86,86% | 50,00% | 80,00% | 190,00% | |

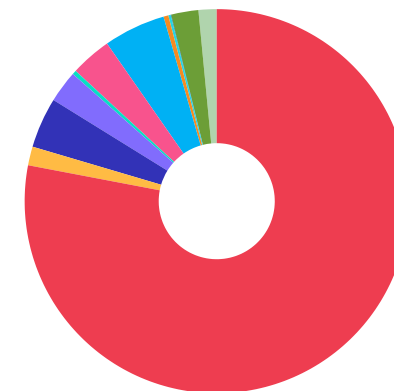


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

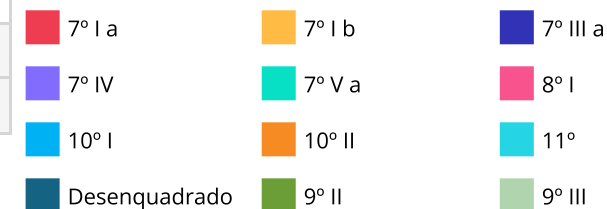


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2024)

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução Pró Gestão - Nivel 2 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 | | | GAP Superior |
|---|--------------------------------|----------------------|--------------|-------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 40,00% | 32.738.349,59 | 3,46% | 5,00% | 9,00% | 20,00% | 156.700.413,56 |
| Artigo 8º, Inciso II | 40,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 94.719.381,57 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 49.321.951,09 | 5,21% | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 45.397.430,48 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 3.879.175,94 | 0,41% | 0,00% | 0,50% | 5,00% | 43.480.514,85 |
| Artigo 11º | 10,00% | 1.927.803,24 | 0,20% | 0,00% | 0,50% | 5,00% | 45.431.887,55 |
| Desenquadrado - RV | 0,00% | 432.146,37 | 0,05% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -432.146,37 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 40,00% | 88.299.426,23 | 9,32% | 5,00% | 15,00% | 50,00% | |



| Artigos - Exterior | Resolução Pró Gestão - Nivel 2 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2024 | | | GAP Superior |
|-----------------------|--------------------------------|----------------------|--------------|--|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso II | 10,00% | 21.668.357,90 | 2,29% | 0,00% | 3,00% | 10,00% | 73.051.023,67 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 14.451.290,64 | 1,53% | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 32.908.400,15 |
| Total Exterior | 10,00% | 36.119.648,54 | 3,81% | 0,00% | 5,00% | 15,00% | |



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 ' | 738.784.186,25 | 78,00 | 50,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 14.984.704,35 | 1,58 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 40.247.057,38 | 4,25 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 25.511.591,84 | 2,69 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' | 3.247.201,14 | 0,34 | 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 | 32.738.349,59 | 3,46 | 5,00 | 40,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 21.668.357,90 | 2,29 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 14.451.290,64 | 1,53 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 49.321.951,09 | 5,21 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso II | 3.879.175,94 | 0,41 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 11º | 1.927.803,24 | 0,20 | 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... | 738.784.186,25 | 78,00 | - |
| CAIXA DTVM | 94.855.100,47 | 10,01 | - |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT | 32.178.166,38 | 3,40 | - |
| BANCO BTG PACTUAL | 25.511.591,84 | 2,69 | - |
| XP ASSET MANAGEMENT | 21.668.357,90 | 2,29 | - |
| NAVI CAPITAL | 15.151.379,90 | 1,60 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 6.105.411,35 | 0,64 | - |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS | 5.976.088,00 | 0,63 | - |
| SICREDI | 2.652.211,32 | 0,28 | - |
| KPTL | 2.378.539,65 | 0,25 | - |
| QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS | 1.500.636,29 | 0,16 | - |
| CADENCE GESTORA | 432.146,37 | 0,05 | - |
| GENIAL GESTÃO LTDA | 0,01 | 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 |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark) | 1,03% | 5,17% | 2,73% | 6,38% | 11,20% | 23,67% | - | - |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1 | -0,20% | -4,20% | -3,68% | -4,33% | -4,64% | -14,19% | 0,04% | 3,51% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | -0,40% | -2,31% | -1,27% | -2,74% | -4,96% | -4,67% | 0,08% | 15,24% |
| 120% do CDI (Benchmark) | 1,00% | 5,30% | 3,10% | 6,43% | 14,56% | 33,31% | - | - |
| INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,05% | 2,92% | 1,62% | 4,42% | 8,94% | 19,23% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,03% | 2,83% | 1,56% | 4,31% | 8,70% | 18,94% | 0,55% | 1,72% |
| IMA-B (Benchmark) | 1,33% | -0,13% | -0,23% | 2,62% | 6,56% | 17,72% | - | - |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | 0,29% | 0,40% | 0,02% | 0,92% | 2,64% | 8,53% | 0,38% | 0,90% |
| 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% |
| CDI (Benchmark) | 0,83% | 4,40% | 2,58% | 5,33% | 12,01% | 27,10% | - | - |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,84% | 4,51% | 2,62% | 5,47% | 12,52% | 27,70% | 0,03% | 0,09% |
| IPCA (Benchmark) | 0,46% | 2,27% | 1,00% | 2,84% | 3,93% | 8,02% | - | - |
| LETRA FINANCEIRA BTG | - | - | - | - | - | - | - | - |

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 |
|---|--------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| 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% | - | - |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | -2,32% | -6,76% | -6,29% | -0,55% | 15,12% | 13,46% | 7,67% | 15,63% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | -2,96% | -2,57% | -3,01% | 4,60% | 16,13% | 11,16% | 4,12% | 13,32% |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | -3,11% | -9,36% | -8,31% | -4,20% | 14,58% | 12,90% | 5,92% | 14,49% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | -2,90% | -12,76% | -7,23% | -8,21% | 7,50% | -3,15% | 4,12% | 14,01% |
| IFIX (Benchmark) | 0,02% | 2,14% | 0,66% | 6,48% | 12,24% | 19,92% | - | - |
| OSASCO PROPERTIES FII | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BR HOTÉIS FII - BRHT11 | - | - | - | - | - | - | 0,00% | 0,00% |
| MSCI ACWI (Benchmark) | 5,22% | 16,99% | 8,53% | 20,14% | 25,00% | 33,38% | - | - |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 5,07% | 12,32% | 4,50% | 18,15% | 33,23% | 47,36% | 4,06% | 11,33% |
| S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark) | 4,80% | 10,64% | 3,56% | 15,54% | 26,26% | 27,72% | - | - |
| SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP | 5,11% | 12,53% | 4,66% | 18,42% | 33,85% | 48,51% | 4,06% | 11,33% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 5,06% | 12,30% | 4,52% | 18,11% | 33,16% | 47,28% | 4,06% | 11,32% |

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

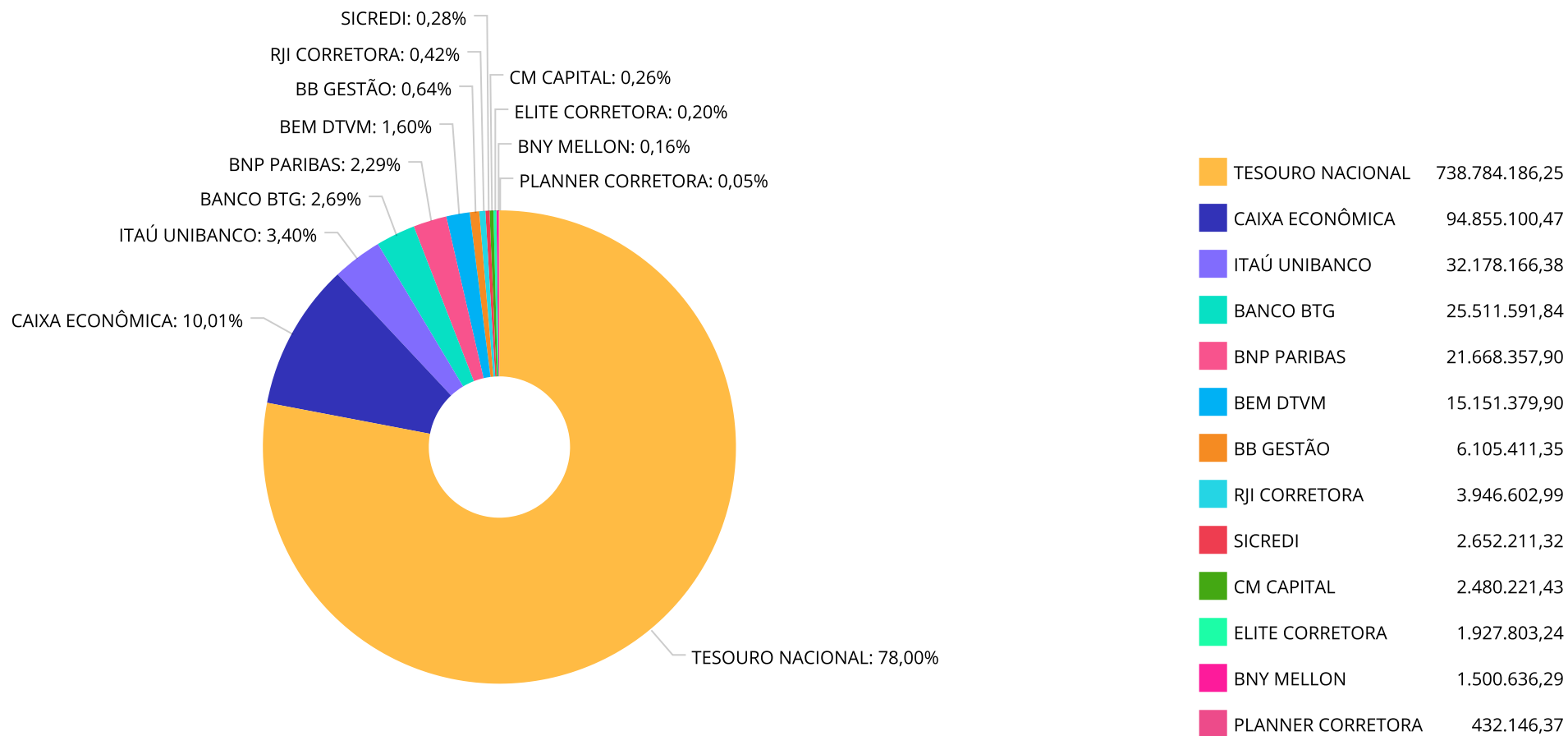
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark) | 1,30% | 6,57% | 3,56% | 8,11% | 14,84% | 31,89% | - | - |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | -0,13% | -44,11% | -0,40% | -44,19% | -44,67% | -49,34% | - | - |

| | | | | | | | | |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---|---|
| IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark) | 1,18% | 5,97% | 3,20% | 7,37% | 13,28% | 28,33% | - | - |
| BRASIL FLORESTAL FICFIP | -0,05% | -0,23% | -0,14% | -0,28% | -0,56% | -1,24% | - | - |
| BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP | -0,03% | -0,15% | -0,09% | -0,18% | -0,36% | -0,74% | - | - |

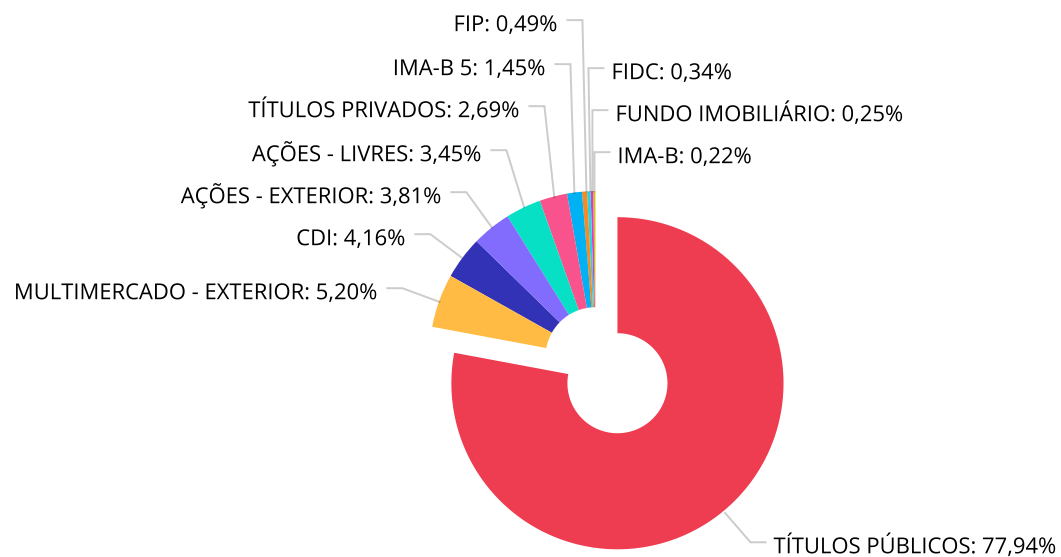
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | 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% | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,78% | 23,76% | 11,38% | 26,96% | 35,62% | 54,35% | 4,53% | 13,518% |
| MSCI WORLD (Benchmark) | 5,64% | 17,70% | 8,59% | 21,01% | 26,53% | 36,82% | - | - |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | -0,58% | 13,92% | 0,99% | 18,50% | 29,89% | 58,02% | 8,29% | 18,382% |
| MSCI ACWI (Benchmark) | 5,22% | 16,99% | 8,53% | 20,14% | 25,00% | 33,38% | - | - |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER... | 0,52% | -0,64% | -6,09% | 4,54% | 21,40% | 24,53% | 7,38% | 15,790% |

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



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



| | | | | | | | |
|--------------------|----------------|---------------------------|---------------|-----------|---------------|--------------------|---------------|
| ■ TÍTULOS PÚBLICOS | 738.784.186,25 | ■ MULTIMERCADO - EXTERIOR | 49.321.951,09 | ■ CDI | 39.445.973,75 | ■ AÇÕES - EXTERIOR | 36.119.648,54 |
| ■ AÇÕES - LIVRES | 32.738.349,59 | ■ TÍTULOS PRIVADOS | 25.511.591,84 | ■ IMA-B 5 | 13.729.092,41 | ■ FIP | 4.623.996,66 |
| ■ FIDC | 3.247.201,14 | ■ FUNDO IMOBILIÁRIO | 2.359.949,61 | ■ IMA-B | 2.056.695,57 | | |

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 | 03/08/2023 | 1.784 | 4.203,592272 | 4.342,49615 | 7.499.208,61 | 7.747.013,13 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 02/12/2022 | 1.724 | 4.059,444003 | 4.363,815367 | 6.998.481,46 | 7.523.217,69 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 29/12/2022 | 3.200 | 4.062,499278 | 4.338,546403 | 12.999.997,69 | 13.883.348,48 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 24/05/2022 | 10.309 | 4.151,368820 | 4.474,840479 | 42.796.461,17 | 46.131.130,49 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 01/06/2022 | 1.942 | 4119,013540 | 4.433,147757 | 7.999.124,29 | 8.609.172,94 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 18/08/2022 | 2.161 | 4.003,343810 | 4.420,361362 | 8.651.225,97 | 9.552.400,90 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 23/08/2022 | 3.607 | 4.003,343810 | 4.398,032241 | 14.440.061,12 | 15.863.702,29 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 16/09/2022 | 13.717 | 4.009,617406 | 4.385,780752 | 54.999.921,96 | 60.159.754,57 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 07/10/2022 | 1.592 | 4080,866490 | 4.448,668593 | 6.496.739,45 | 7.082.280,40 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 09/11/2022 | 1.600 | 4060,354006 | 4.399,786733 | 6.496.566,41 | 7.039.658,77 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 28/10/2021 | 1.449 | 3977,478261 | 4.305,908572 | 5.763.366,00 | 6.239.261,52 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 30/11/2021 | 1.387 | 4169,633376 | 4.305,908572 | 5.783.281,49 | 5.972.295,19 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 17/11/2021 | 303 | 4.128,989331 | 4.305,908572 | 1.251.083,77 | 1.304.690,30 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 06/12/2021 | 1.452 | 4200,155373 | 4.305,908572 | 6.098.625,60 | 6.252.179,25 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 25/05/2022 | 13.639 | 4.193,558503 | 4.530,222517 | 57.195.944,42 | 61.787.704,90 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 07/07/2022 | 2.940 | 4081,521882 | 4.354,679171 | 11.999.674,33 | 12.802.756,76 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 18/08/2022 | 803 | 4.010,486989 | 4.448,082336 | 3.220.421,05 | 3.571.810,11 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 06/03/2023 | 7.730 | 3.880,60527900 | 4.173,671224 | 29.997.078,81 | 32.262.478,56 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 08/03/2023 | 5.532 | 3.886,16363200 | 4.173,996447 | 21.498.257,21 | 23.090.548,34 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 27/03/2023 | 13.187 | 4.011,33 | 4.265,957505 | 52.897.408,71 | 56.255.181,61 | Curva |

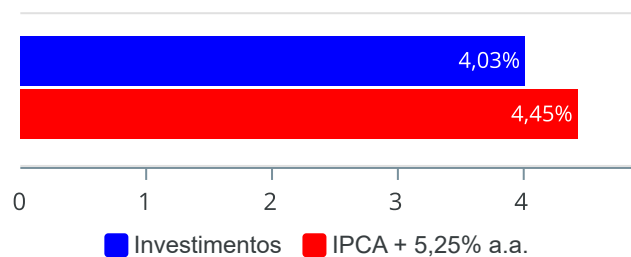
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2024)

| Títulos Públicos | Vencimento | Compra | Qtde | P.U. Compra | P.U. Atual | \$ Pago | \$ Atual | Marcação |
|--|------------|------------|--------|----------------|--------------|---------------|---------------|----------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 08/03/2023 | 5.530 | 3.887,58634400 | 4.170,654353 | 21.498.352,48 | 23.063.718,57 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 10/04/2023 | 5.626 | 4.088,420000 | 4.321,955755 | 23.001.450,92 | 24.315.323,07 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 18/05/2023 | 3.620 | 4.289,326116 | 4.464,874108 | 15.527.360,54 | 16.162.844,27 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 09/06/2023 | 1.650 | 4.423,334274 | 4.579,189962 | 7.298.501,55 | 7.555.663,43 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 05/12/2023 | 7.742 | 4.359,205871 | 4.479,821524 | 33.748.971,85 | 34.682.778,23 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 01/02/2023 | 1.766 | 3.849,911563 | 4.062,988452 | 6.798.943,82 | 7.175.237,60 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 06/03/2023 | 7.752 | 3.869,91365700 | 4.034,783923 | 29.999.570,67 | 31.277.644,97 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 11/05/2023 | 1.735 | 4.263,612425 | 4.331,810865 | 7.397.367,56 | 7.515.691,85 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 10/07/2023 | 11.310 | 4.472,934683 | 4.619,170984 | 50.588.891,26 | 52.242.823,82 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 04/07/2023 | 1.618 | 4.511,125907 | 4.661,471359 | 7.299.001,72 | 7.542.260,65 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 06/09/2023 | 4.520 | 4.424,351235 | 4.514,432089 | 19.998.067,58 | 20.405.233,04 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 19/09/2023 | 2.835 | 4.407,941612 | 4.486,082066 | 12.496.514,47 | 12.718.042,65 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 08/11/2023 | 1.725 | 4.346,059236 | 4.369,429742 | 7.496.952,18 | 7.537.266,30 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 04/10/2023 | 1.751 | 4.282,214064 | 4.338,636267 | 7.498.156,83 | 7.596.952,10 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 30/10/2023 | 5.716 | 4.320,770189 | 4.351,452617 | 24.697.522,40 | 24.872.903,15 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 02/02/2024 | 1.671 | 4.483,496122 | 4.467,839628 | 7.491.922,02 | 7.465.760,01 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 14/03/2024 | 2.792 | 4.502,030000 | 4.461,121207 | 12.569.667,76 | 12.455.450,40 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 18/04/2024 | 3.684 | 4.342,950000 | 4.269,081356 | 15.999.427,80 | 15.727.295,71 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 07/05/2024 | 2.108 | 4.316,000000 | 4.223,117944 | 9.098.128,00 | 8.902.332,62 | Curva |

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

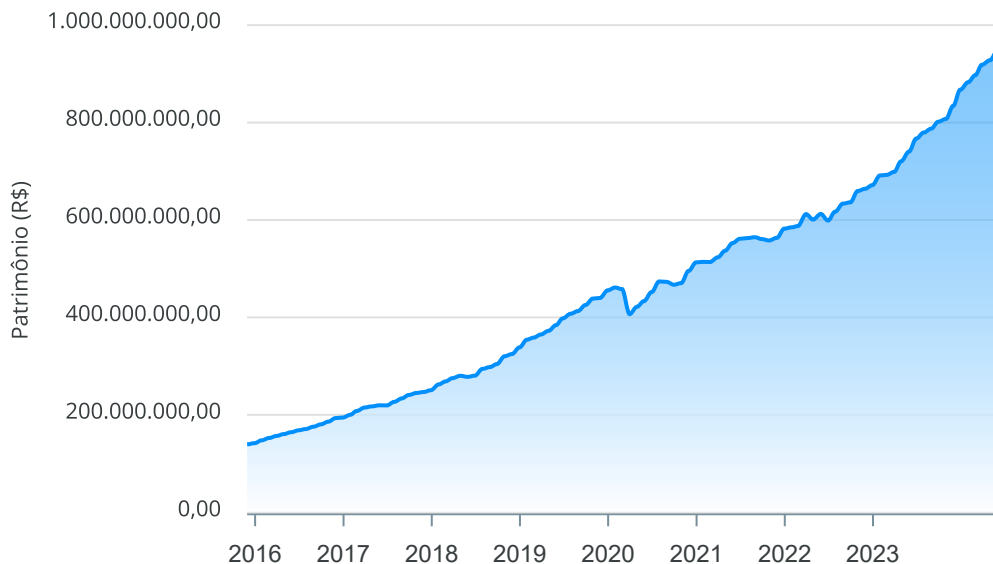
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 858.545.572,32 | 28.209.983,76 | 19.552.624,87 | 873.067.720,13 | 5.864.788,92 | 5.864.788,92 | 0,68% | 0,68% | 0,87% | 0,87% | 77,77% | 4,76% |
| Fevereiro | 873.067.720,13 | 29.566.726,69 | 26.575.025,48 | 886.629.975,32 | 10.570.553,98 | 16.435.342,90 | 1,21% | 1,89% | 1,22% | 2,10% | 90,05% | 4,57% |
| Março | 886.629.975,32 | 43.522.309,28 | 31.554.583,37 | 907.467.108,83 | 8.869.407,60 | 25.304.750,50 | 0,99% | 2,90% | 0,57% | 2,68% | 108,11% | 3,98% |
| Abril | 907.467.108,83 | 39.933.485,97 | 31.324.167,22 | 916.777.792,74 | 701.365,16 | 26.006.115,66 | 0,08% | 2,98% | 0,83% | 3,53% | 84,27% | 4,87% |
| Maio | 916.777.792,74 | 30.713.303,01 | 21.234.030,78 | 935.739.968,11 | 9.482.903,14 | 35.489.018,80 | 1,02% | 4,03% | 0,89% | 4,45% | 90,52% | 3,48% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



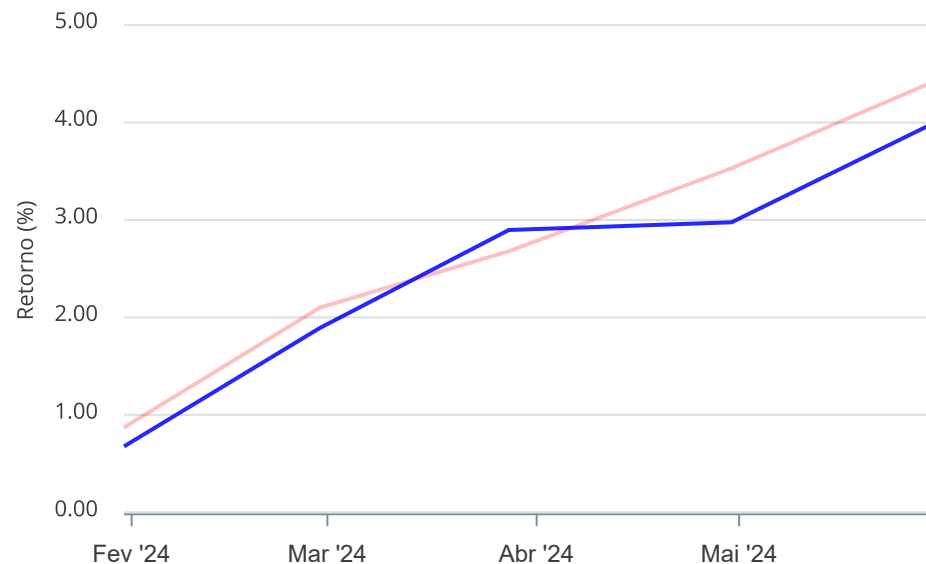
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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 ... | 1.239.498,28 | 0,00 | 0,00 | 1.255.611,94 | 16.113,66 | 1,30% | 1,30% | 1,28% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 13.589.434,68 | 0,00 | 0,00 | 13.729.092,41 | 139.657,73 | 1,03% | 1,03% | 0,55% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 731.594.210,92 | 9.098.144,32 | 8.585.558,55 | 738.784.186,25 | 6.677.389,56 | 0,90% | - | - |
| LETRA FINANCEIRA BTG | 25.288.640,19 | 0,00 | 0,00 | 25.511.591,84 | 222.951,65 | 0,88% | - | - |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 29.882.348,59 | 22.953.712,88 | 13.637.040,32 | 39.445.973,75 | 246.952,60 | 0,47% | 0,84% | 0,03% |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | 798.753,17 | 0,00 | 0,00 | 801.083,63 | 2.330,46 | 0,29% | 0,29% | 0,38% |
| INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1 | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | - | - |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1 | 2.485.206,84 | 0,00 | 0,00 | 2.480.221,43 | -4.985,41 | -0,20% | -0,20% | 0,04% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 770.093,47 | 0,00 | 0,00 | 766.979,70 | -3.113,77 | -0,40% | -0,40% | 0,08% |
| Total Renda Fixa | 805.648.186,15 | 32.051.857,20 | 22.222.598,87 | 822.774.740,96 | 7.297.296,48 | 0,89% | | 0,18% |

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 |
|---|----------------------|-------------|------------------|----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP | 2.523.165,16 | 0,00 | 0,00 | 2.652.211,32 | 129.046,16 | 5,11% | 5,11% | 4,06% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 21.622.698,54 | 0,00 | 0,00 | 22.718.383,51 | 1.095.684,97 | 5,07% | 5,07% | 4,06% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 22.796.988,83 | 0,00 | 0,00 | 23.951.356,26 | 1.154.367,43 | 5,06% | 5,06% | 4,06% |
| BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP | 756.036,34 | 0,00 | 0,00 | 755.815,57 | -220,77 | -0,03% | - | - |
| BR HOTÉIS FII - BRHT11 | 2.006.183,79 | 0,00 | 77.567,89 | 1.927.803,24 | -812,66 | -0,04% | 0,00% | 0,00% |
| BRASIL FLORESTAL FICFIP | 745.165,08 | 0,00 | 0,00 | 744.820,72 | -344,36 | -0,05% | - | - |
| OSASCO PROPERTIES FII | 432.412,40 | 0,00 | 0,00 | 432.146,37 | -266,03 | -0,06% | - | - |
| W7 FIP MULTISTRATÉGIA | 2.381.742,88 | 0,00 | 0,00 | 2.378.539,65 | -3.203,23 | -0,13% | - | - |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 3.332.015,21 | 0,00 | 0,00 | 3.254.748,22 | -77.266,99 | -2,32% | -2,32% | 7,67% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 6.287.747,76 | 0,00 | 0,00 | 6.105.411,35 | -182.336,41 | -2,90% | -2,90% | 4,12% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 8.477.514,78 | 0,00 | 0,00 | 8.226.810,12 | -250.704,66 | -2,96% | -2,96% | 4,12% |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 15.637.449,95 | 0,00 | 0,00 | 15.151.379,90 | -486.070,05 | -3,11% | -3,11% | 5,92% |
| Total Renda Variável | 86.999.120,72 | 0,00 | 77.567,89 | 88.299.426,23 | 1.377.873,40 | 1,58% | | 4,45% |

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 | 13.533.938,89 | 0,00 | 0,00 | 14.451.290,64 | 917.351,75 | 6,78% | 6,78% | 4,53% |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST... | 9.647.071,72 | 0,00 | 0,00 | 9.697.190,64 | 50.118,92 | 0,52% | 0,52% | 7,38% |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT... | 12.040.603,50 | 0,00 | 0,00 | 11.971.167,26 | -69.436,24 | -0,58% | -0,58% | 8,29% |
| Total Exterior | 35.221.614,11 | 0,00 | 0,00 | 36.119.648,54 | 898.034,43 | 2,55% | | 6,54% |

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.