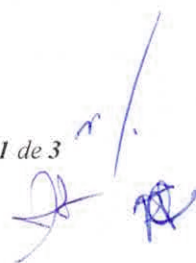


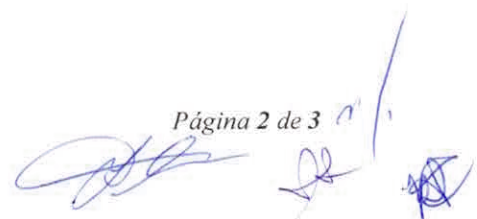
RELATORIO DE INVESTIMENTOS

MAIO 2024

Handwritten signature and initials in blue ink, located in the bottom right corner of the page.

SUMÁRIO

1. Apresentação	3
2. Parecer do Comitê de Investimentos	3
3. Aprovação do Conselho de Administração	3

Handwritten signatures in blue ink, including a large signature on the left and several smaller ones on the right.

1. APRESENTAÇÃO

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

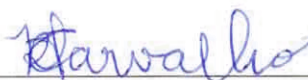
2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês maio/2024 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

3. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de maio de 2024, em reunião realizada em 18 de junho de 2024.

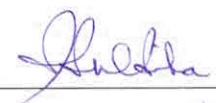
Rosana Teixeira de Carvalho



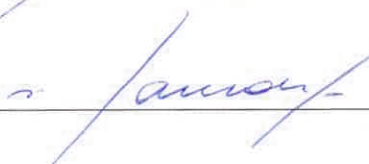
Lisete de Fátima Oliveira



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira





CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2024

21/05/2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			223.327.860,43	45,25%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.372.924,72	3,32%	790	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.226.578,99	1,26%	648	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	49444	20.757.625,81	4,21%	62	3,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	542.141,86	0,11%	789	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.130.105,17	0,63%	220	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.336.019,66	2,09%	98	1,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.291.127,18	1,07%	78	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	225.488,04	0,05%	1.021	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	18.685.763,20	3,79%	1.144	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.591.622,50	0,73%	104	0,68%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.829.405,19	2,40%	477	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	982.307,84	0,20%	114	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.893.470,43	1,60%	416	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+4 du	Não há	5.707.277,84	1,16%	136	0,78%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	S/Info	Não se aplica	35.793.767,94	7,25%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	63.996.944,20	12,97%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.396.966,44	1,09%	55	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.515.941,98	0,71%	9.841	0,46%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.752.421,44	0,76%	453	0,15%	Artigo 9º, Inciso III



Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2024)

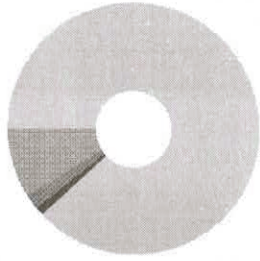
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.486.704,47	0,50%	1.625	2,33%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	633.995,68	0,13%	2.363	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	317.263,52	0,06%	4.787	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	4.317.608,31	0,87%	583	1,02%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	38.400.428,00	7,78%	11.706	12,48%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			493.511.760,84				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			222.507,00				Artigo 6º
PL Total			493.734.267,84				

3



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%	223.327.860,43	45,25%	20,00%	40,50%	80,00%	171.481.548,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	62.656.523,39	12,70%	3,00%	4,78%	60,00%	233.450.533,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	48.915.335,04	9,91%	2,00%	10,56%	60,00%	247.191.721,46
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	99.790.712,14	20,22%	15,00%	19,91%	20,00%	-1.088.359,97
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	24.675.588,04
Total Renda Fixa	100,00%	434.690.431,00	88,08%	40,00%	76,75%	225,00%	

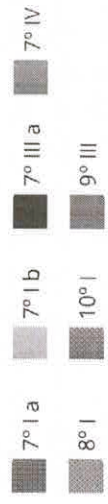
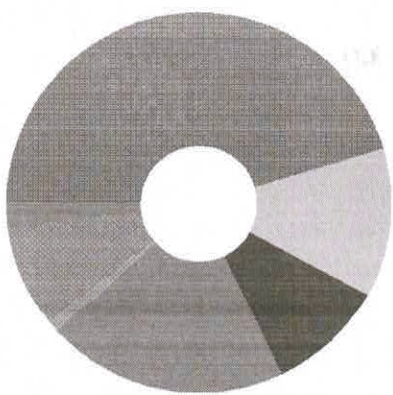


Handwritten signature and initials.



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.396.966,44	1,09%	0,00%	5,25%	30,00%	142.656.561,81
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	49.351.176,08
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	43.669.295,51	8,85%	0,00%	9,00%	10,00%	5.681.880,57
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	24.675.588,04
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	24.675.588,04
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	49.066.261,95	9,94%	0,00%	17,25%	60,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	49.351.176,08
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.755.067,89	1,98%	0,00%	6,00%	10,00%	39.596.108,19
Total Exterior	10,00%	9.755.067,89	1,98%	0,00%	6,00%	20,00%	

3



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	223.327.860,43	45,25	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	62.656.523,39	12,70	3,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	48.915.335,04	9,91	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	99.790.712,14	20,22	15,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	5.396.966,44	1,09	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	9.755.067,89	1,98	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	43.669.295,51	8,85	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

27



Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	223.327.860,43	45,25	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.784.322,74	13,33	-
BANCO BTG PACTUAL	63.996.944,20	12,97	-
NOVUS CAPITAL	44.107.705,84	8,94	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	15.627.146,84	3,17	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	15.421.027,69	3,12	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	13.510.280,07	2,74	-
CAIXA DTVM	6.228.130,34	1,26	-
TARPON INVESTIMENTOS	5.396.966,44	1,09	-
ICATU VANGUARDA	4.317.608,31	0,87	-

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 496/3)

23

Handwritten signature



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
IMA-B 5 (Benchmark)								
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	2,92%	1,62%	4,42%	8,94%	19,23%	-	-
	1,03%	2,82%	1,56%	4,30%	8,68%	18,75%	0,55%	1,73%
IMA-B (Benchmark)								
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	1,33%	-0,13%	-0,23%	2,62%	6,56%	17,72%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,31%	-0,25%	-0,30%	2,47%	6,30%	17,13%	1,29%	3,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	-0,36%	-0,41%	2,35%	6,00%	16,86%	1,32%	3,90%
	1,31%	-0,24%	-0,29%	2,49%	6,25%	17,16%	1,28%	3,85%
IRF-M (Benchmark)								
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,66%	1,81%	0,67%	3,32%	10,51%	26,78%	-	-
	0,64%	1,66%	0,55%	3,14%	10,20%	26,22%	1,33%	2,37%
CDI (Benchmark)								
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,18%	2,49%	1,47%	3,75%	12,69%	28,68%	0,60%	1,66%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,83%	4,42%	2,59%	5,36%	12,05%	27,13%	0,02%	0,07%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,75%	3,97%	2,32%	4,82%	10,90%	24,61%	0,01%	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	4,81%	2,76%	5,79%	13,06%	28,67%	0,03%	0,11%
	0,86%	4,63%	2,70%	5,62%	12,92%	28,34%	0,03%	0,10%
IPCA (Benchmark)								
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	0,26%	2,06%	0,80%	2,63%	3,72%	7,80%	-	-
	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,71%	-1,88%	-1,28%	1,26%	4,39%	-	1,94%	5,22%
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,66%	3,18%	1,61%	4,19%	9,83%	22,96%	0,33%	1,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,70%	2,19%	0,96%	3,42%	9,47%	23,13%	0,46%	1,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,75%	2,12%	1,07%	3,76%	9,65%	22,11%	1,18%	2,64%

3
-




CRÉDITO
& MERCADO

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 Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	0,25%	-0,05%	0,04%	3,81%	11,81%	27,63%	2,74%	5,23%
CDI (Benchmark)	0,83%	4,40%	2,58%	5,33%	12,01%	27,10%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,36%	2,14%	1,12%	3,25%	9,56%	24,16%	0,44%	1,18%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,49%	-1,65%	-1,46%	0,36%	9,02%	19,22%	2,49%	4,63%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,72%	3,57%	1,92%	4,51%	10,69%	25,58%	0,17%	0,40%
Global BDRX (Benchmark)	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES 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%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-3,23%	-3,23%	0,87%	6,31%	32,63%	60,37%	5,09%	16,45%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	6,03%	19,05%	8,68%	22,11%	29,33%	39,51%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,17%	18,10%	6,15%	21,58%	30,30%	40,54%	4,50%	13,60%

[Handwritten signature]

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
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	6,03%	19,05%	8,68%	22,11%	29,33%	39,51%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,17%	18,10%	6,15%	21,58%	30,30%	40,54%	4,50%	13,600%
Global BDRX (Benchmark)	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5,28%	19,27%	9,64%	21,63%	29,18%	32,33%	5,40%	11,805%
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,78%	23,76%	11,38%	26,96%	35,62%	54,35%	4,53%	13,518%

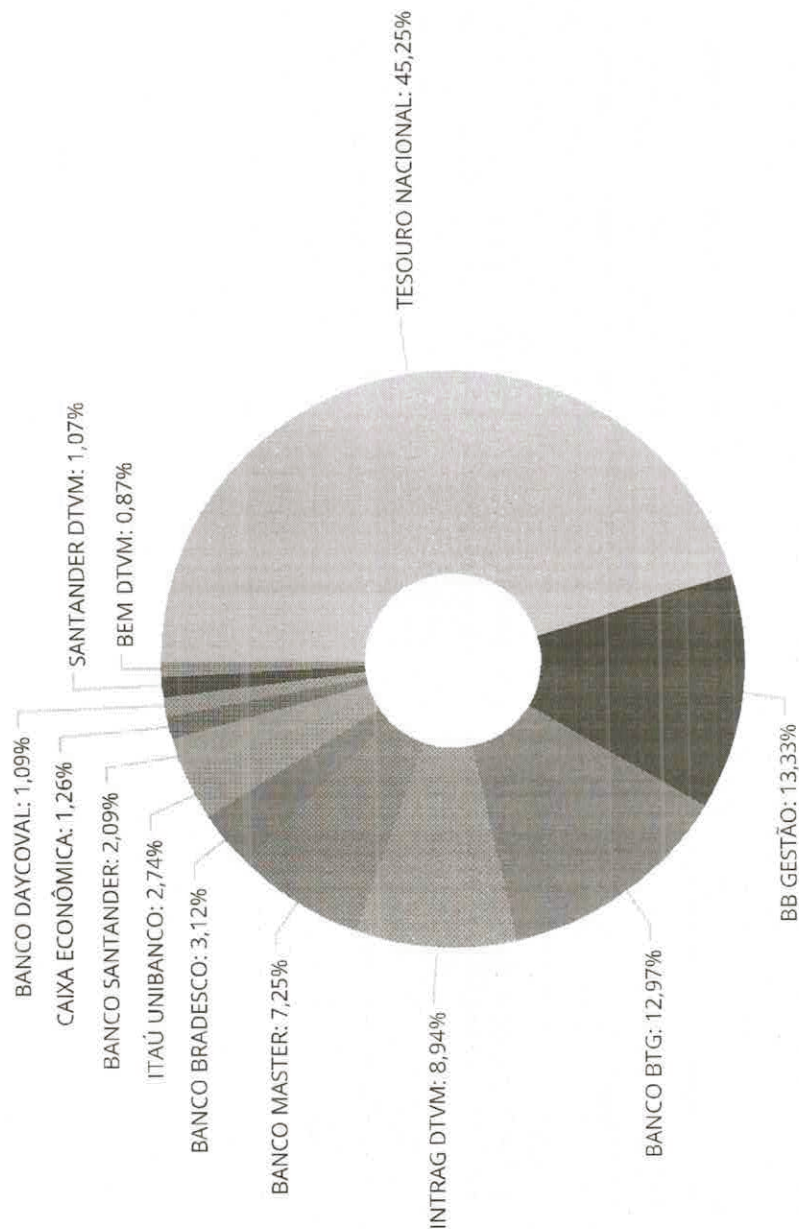
2





CRÉDITO
& MERCADO

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



TESOIRO NACIONAL	223.327.860,43
BB GESTÃO	65.784.322,74
BANCO BTG	63.996.944,20
INTRAG DTVM	44.107.705,84
BANCO MASTER	35.793.767,94
BANCO BRADESCO	15.421.027,69
ITAÚ UNIBANCO	13.510.280,07
BANCO SANTANDER	10.336.019,66
CAIXA ECONÔMICA	6.228.130,34
BANCO DAYCOVAL	5.396.966,44
SANTANDER DTVM	5.291.127,18
BEM DTVM	4.317.608,31



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



2



CRÉDITO
& MERCADO

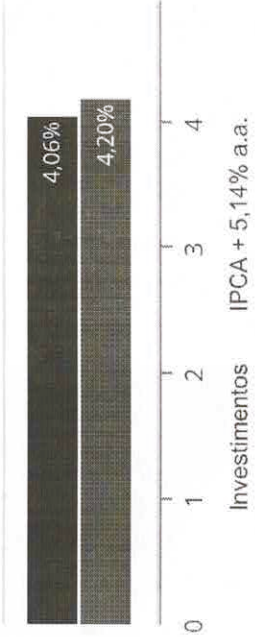
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2024)

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	30/06/2022	19.713	4058,06717400	4.349,141823	79.996.678,20	85.734.632,75	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.429,334946	49.999.526,70	54.197.342,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.163,961608	39.999.580,25	41.772.862,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	20/11/2023	1.000	4.352,820989	4.492,359724	4.352.820,99	4.492.359,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	23/11/2023	8.300	4.339,115559	4.473,573821	36.014.659,14	37.130.662,71	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	467.376.655,34	3.971.877,17	6.323.338,57	468.727.859,94	3.702.666,00	3.702.666,00	0,79%	0,79%	0,86%	0,86%	92,08%	1,32%
Fevereiro	468.727.859,94	7.476.358,11	6.872.203,35	474.036.452,55	4.704.437,85	8.407.103,85	1,00%	1,80%	1,21%	2,08%	86,55%	1,17%
Março	474.036.452,55	7.709.133,81	6.728.315,32	479.556.933,65	4.539.662,61	12.946.766,46	0,96%	2,78%	0,56%	2,65%	104,60%	1,07%
Abril	479.556.933,65	40.919.744,40	42.823.013,07	479.041.124,04	1.387.459,06	14.334.225,52	0,29%	3,07%	0,82%	3,50%	87,91%	1,59%
Maio	479.041.124,04	11.045.744,85	8.755.318,18	485.930.839,81	4.599.289,10	18.933.514,62	0,96%	4,06%	0,68%	4,20%	96,72%	1,14%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

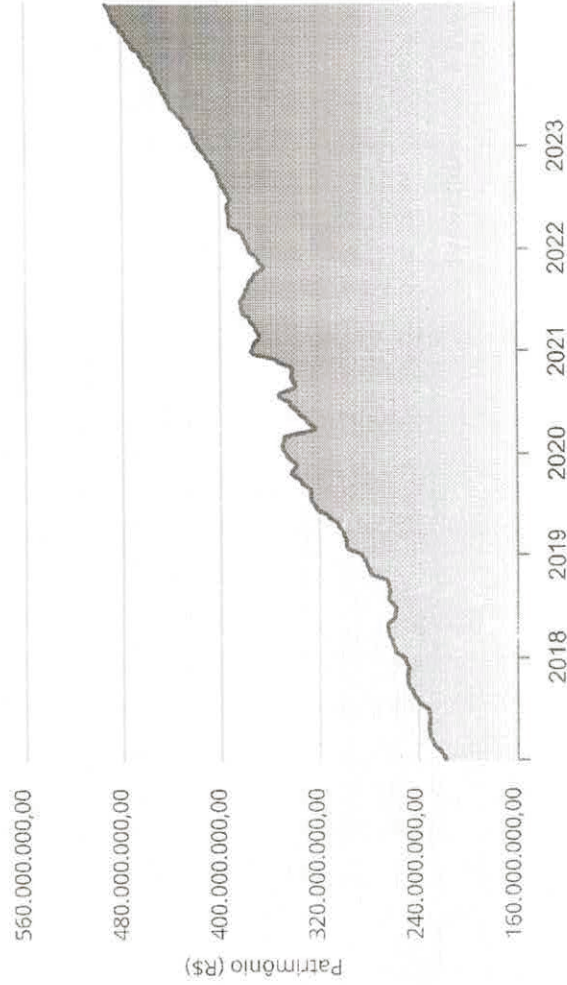




CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

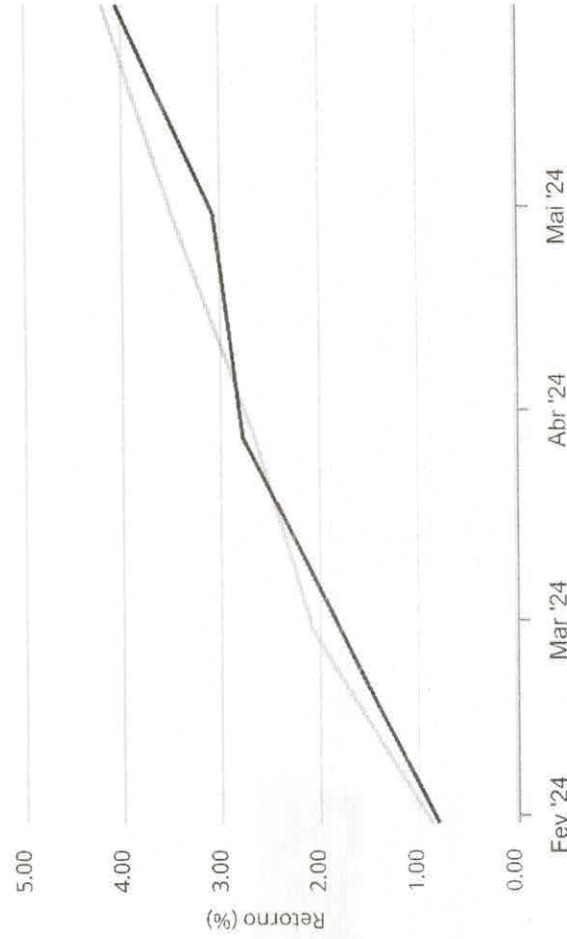
Evolução do Patrimônio



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

[Handwritten signature]

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	21.017.610,93	0,00	6.17.196,39	20.757.625,81	357.211,27	1,70%	1,71%	1,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.146.338,78	0,00	0,00	6.226.578,99	80.240,21	1,31%	1,31%	1,28%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	10.202.914,18	0,00	0,00	10.336.019,66	133.105,48	1,30%	1,30%	1,29%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.546.532,88	0,00	0,00	3.591.622,50	45.089,62	1,27%	1,27%	1,32%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.641.011,10	0,00	0,00	5.707.277,84	66.266,74	1,17%	1,17%	0,60%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.206.545,45	0,00	0,00	16.372.924,72	166.379,27	1,03%	1,03%	0,55%
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	32.917.480,33	2.550.000,00	0,00	35.793.767,94	326.287,61	0,92%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	223.766.916,01	0,00	2.440.644,33	223.327.860,43	2.001.588,75	0,89%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.726.173,36	0,00	0,00	11.829.405,19	103.231,83	0,88%	0,88%	0,03%
LETRA FINANCEIRA BTG	64.836.658,31	0,00	1.399.434,44	63.996.944,20	559.720,33	0,86%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.826.086,77	0,00	0,00	7.893.470,43	67.383,66	0,86%	0,86%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.106.900,43	0,00	0,00	3.130.105,17	23.204,74	0,75%	0,75%	1,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	14.614.236,84	4.000.000,00	64.490,22	18.685.763,20	136.016,58	0,73%	0,83%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	538.358,16	0,00	0,00	542.141,86	3.783,70	0,70%	0,70%	0,46%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	975.907,34	0,00	0,00	982.307,84	6.400,50	0,66%	0,66%	0,33%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.257.537,24	0,00	0,00	5.291.127,18	33.589,94	0,64%	0,64%	1,33%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.758,08	4.495.744,85	4.298.043,02	225.488,04	13.028,13	0,29%	0,75%	0,01%
Total Renda Fixa	428.341.966,19	11.045.744,85	8.819.808,40	434.690.431,00	4.122.528,36	0,96%		0,82%






CRÉDITO
& MERCADO

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

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

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	629.471,09	0,00	0,00	633.995,68	4.524,59	0,72%	0,72%	0,17%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	38.261.943,48	0,00	0,00	38.400.428,00	138.484,52	0,36%	0,36%	0,44%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	4.306.755,70	0,00	0,00	4.317.608,31	10.852,61	0,25%	0,25%	2,74%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	318.832,51	0,00	0,00	317.263,52	-1.568,99	-0,49%	-0,49%	2,49%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.576.807,34	0,00	0,00	5.396.966,44	-179.840,90	-3,22%	-3,22%	5,09%
Total Renda Variável	49.093.810,12	0,00	0,00	49.066.261,95	-27.548,17	-0,06%		1,17%

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 FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3.514.221,93	0,00	0,00	3.752.421,44	238.199,51	6,78%	6,78%	4,53%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.311.513,23	0,00	0,00	3.515.941,98	204.428,75	6,17%	6,17%	4,50%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.361.899,27	0,00	0,00	2.486.704,47	124.805,20	5,28%	5,28%	5,40%
Total Exterior	9.187.634,43	0,00	0,00	9.755.067,89	567.433,46	6,18%		4,74%

3





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 aliquotas 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.

