

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2024



Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

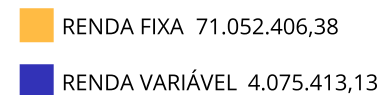
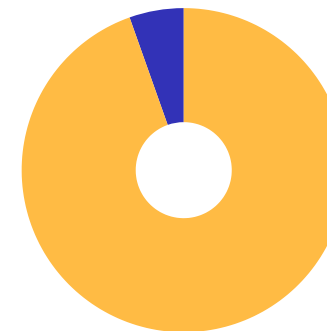
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|---------|------------|--------------|--------------------|----------|------------------|---------------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1 | Não há | 6.252.837,89 | 8,32% | 880 | 0,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 3.589.452,06 | 4,78% | 796 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2 | Não há | 2.096.683,09 | 2,79% | 292 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 2.335.542,71 | 3,11% | 652 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0 | Não há | 2.108.157,51 | 2,81% | 1.151 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 3.663.934,38 | 4,88% | 651 | 0,09% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | D+0 | 15/08/2024 | 1.728.684,58 | 2,30% | 370 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR... | D+0 | Não há | 8.916.866,03 | 11,87% | 242 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | 15/08/2024 | 4.183.057,05 | 5,57% | 306 | 0,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | D+0 | 17/05/2027 | 3.109.754,82 | 4,14% | 53 | 1,29% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 4.029.260,15 | 5,36% | 910 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0 | Não há | 4.772.146,03 | 6,35% | 283 | 0,35% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA... | D+0 | Não há | 2.460.918,17 | 3,28% | 163 | 0,37% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 4.720.803,56 | 6,28% | 1.187 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0 | Não há | 2.780.887,15 | 3,70% | 254 | 0,18% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA... | D+1 | Não há | 1.400.426,34 | 1,86% | 221 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0 | Não há | 5.713.402,97 | 7,60% | 1.141 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 6.157.130,89 | 8,20% | 227 | 0,48% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1800 | Não há | 227.362,59 | 0,30% | 18 | 0,56% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 514.417,86 | 0,68% | 716 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|--|------------|---------------|----------------------|--------------------|----------|------------------|---------------------------------|
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA | D+31 ou... | Não há | 239.199,39 | 0,32% | 15 | 0,64% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | Não se ... | Não se aplica | 51.481,16 | 0,07% | 98 | 0,18% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea a |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES | D+4 | Não há | 1.870.812,76 | 2,49% | 82 | 0,46% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 1.192.464,43 | 1,59% | 12.892 | 0,08% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 1.012.135,94 | 1,35% | 61 | 0,42% | Artigo 8º, Inciso I |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 75.127.819,51 | | | | |

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

| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 | | | GAP Superior |
|---------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea b | 100,00% | 58.149.411,52 | 77,40% | 45,00% | 68,00% | 90,00% | 9.465.626,04 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea a | 60,00% | 12.851.513,70 | 17,11% | 15,00% | 25,00% | 60,00% | 32.225.178,01 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,40% | 5,00% | 3.756.390,98 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea a | 5,00% | 51.481,16 | 0,07% | 0,00% | 0,10% | 1,00% | 699.797,04 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 71.052.406,38 | 94,58% | 60,00% | 93,50% | 156,00% | |

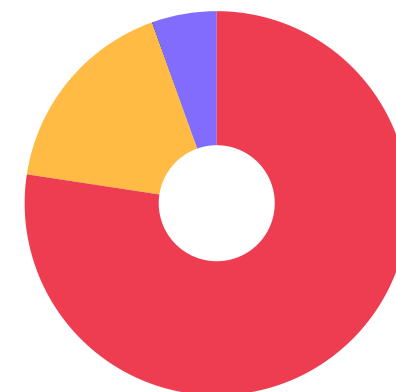


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2024)

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 | | | GAP Superior |
|---|---------------|---------------------|--------------|-------------------------------|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 4.075.413,13 | 5,42% | 0,00% | 5,00% | 20,00% | 10.950.150,77 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,50% | 10,00% | 7.512.781,95 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 4.075.413,13 | 5,42% | 0,00% | 5,50% | 30,00% | |

| 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% | 0,50% | 5,00% | 3.756.390,98 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,50% | 5,00% | 3.756.390,98 |
| Total Exterior | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | |

| Empréstimo Consignado | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2024 | | | GAP Superior |
|-----------------------|-----------|-------------|----------|--|-------|----------|--------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 12º | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 3.756.390,98 |



7º I b 7º III a 7º V a 8º I

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2024 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|---------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea b | 58.149.411,52 | 77,40 | 45,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea a | 12.851.513,70 | 17,11 | 15,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea a | 51.481,16 | 0,07 | 0,00 | 1,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 4.075.413,13 | 5,42 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 12º | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM S.A | 43.001.636,61 | 57,24 | 0,17 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 27.488.695,19 | 36,59 | - |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT | 3.605.026,71 | 4,80 | 0,00 |
| SICREDI | 514.417,86 | 0,68 | 0,00 |
| VERITAS CAPITAL MANAGEMENT | 466.561,98 | 0,62 | - |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS | 51.481,16 | 0,07 | 0,06 |

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 Março/2024 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark) | 0,55% | 2,62% | 2,66% | 5,05% | 9,12% | 19,91% | - | - |
| CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,62% | 1,76% | 1,76% | 2,10% | - | - | 0,75% | - |
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 0,99% | 2,24% | 2,24% | 5,19% | 9,48% | 20,66% | - | - |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,88% | 2,05% | 2,05% | 4,99% | 9,24% | 20,06% | 0,47% | 1,63% |
| IMA Geral (Benchmark) | 0,52% | 1,64% | 1,64% | 5,51% | 12,59% | 24,78% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,51% | 1,60% | 1,60% | 5,44% | 12,50% | 24,64% | 0,46% | 1,71% |
| IRF-M 1+ (Benchmark) | 0,43% | 1,37% | 1,37% | 6,49% | 15,26% | 28,03% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,39% | 1,30% | 1,30% | 6,37% | 15,00% | 27,13% | 0,97% | 3,20% |
| IMA-B 5+ (Benchmark) | -0,55% | -1,51% | -1,51% | 4,82% | 13,38% | 19,08% | - | - |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,59% | -1,61% | -1,61% | 4,67% | 13,00% | 18,25% | 1,71% | 6,07% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,56% | -1,52% | -1,52% | 4,78% | 13,14% | 18,45% | 1,68% | 5,96% |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,84% | 2,46% | 2,46% | 5,42% | 12,28% | 27,08% | - | - |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,80% | 2,43% | 2,43% | 5,30% | 11,98% | 26,36% | 0,09% | 0,25% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,80% | 2,47% | 2,47% | 5,37% | 12,08% | 26,60% | 0,08% | 0,24% |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|-------|-------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| IMA-B 5 (Benchmark) | 0,77% | 2,06% | 2,06% | 5,09% | 9,62% | 21,01% | - | - |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 3,01% | 2,33% | 2,33% | -5,22% | -14,69% | -43,11% | 6,62% | 32,90% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 0,75% | 2,00% | 2,00% | 4,98% | 9,44% | 20,53% | 0,44% | 1,70% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,75% | 2,01% | 2,01% | 4,98% | 9,48% | 20,72% | 0,44% | 1,68% |

| | | | | | | | | |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|--------|
| IMA-B (Benchmark) | 0,08% | 0,18% | 0,18% | 4,94% | 11,81% | 20,21% | - | - |
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA | -19,07% | -15,28% | -15,28% | -22,44% | -32,14% | -39,84% | 33,27% | 24,97% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,06% | 0,11% | 0,11% | 4,82% | 11,56% | 19,65% | 1,09% | 3,88% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 0,10% | 0,20% | 0,20% | 4,97% | 11,90% | 19,88% | 1,10% | 3,97% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IRF-M (Benchmark) | 0,54% | 1,68% | 1,68% | 6,13% | 14,03% | 27,20% | - | - |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP | 0,47% | 1,67% | 1,67% | 6,08% | 13,93% | 27,07% | 0,71% | 2,34% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,50% | 1,61% | 1,61% | 6,00% | 13,61% | 26,42% | 0,72% | 2,21% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|
| CDI (Benchmark) | 0,83% | 2,62% | 2,62% | 5,54% | 12,36% | 27,28% | - | - |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,85% | 2,65% | 2,65% | 5,55% | 12,40% | 27,30% | 0,01% | 0,06% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,82% | 2,57% | 2,57% | 5,42% | 12,11% | 26,70% | 0,01% | 0,05% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,92% | -0,07% | -0,07% | 2,09% | 4,00% | 7,21% | 0,20% | 3,88% |

| | | | | | | | | |
|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|---|---|
| IPCA (Benchmark) | 0,16% | 1,42% | 1,42% | 2,51% | 3,93% | 8,76% | - | - |
|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|---|---|

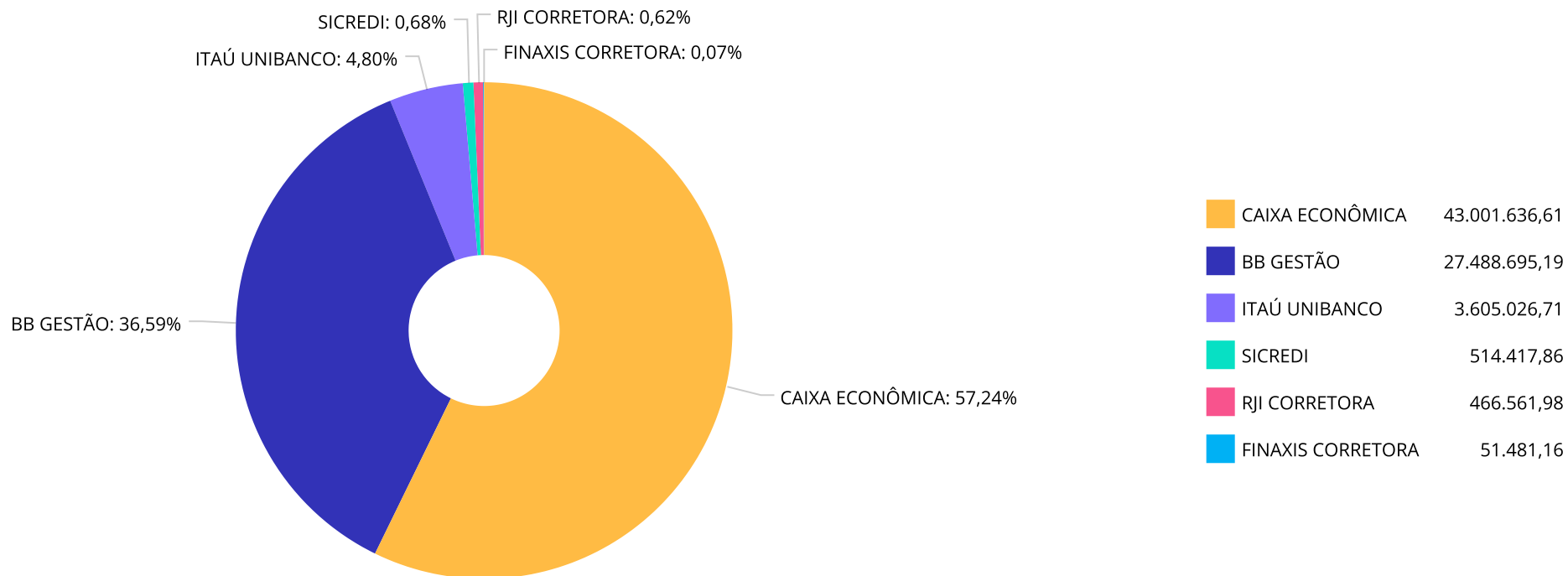
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ... | 0,55% | 1,59% | 1,59% | 5,69% | 13,03% | 23,64% | 0,42% | 2,70% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,92% | 2,78% | 2,78% | 5,01% | 9,81% | 20,12% | 0,20% | 0,94% |
| Não definido (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | -0,50% | -1,42% | -1,42% | -7,00% | -15,14% | -62,09% | 0,73% | 7,76% |

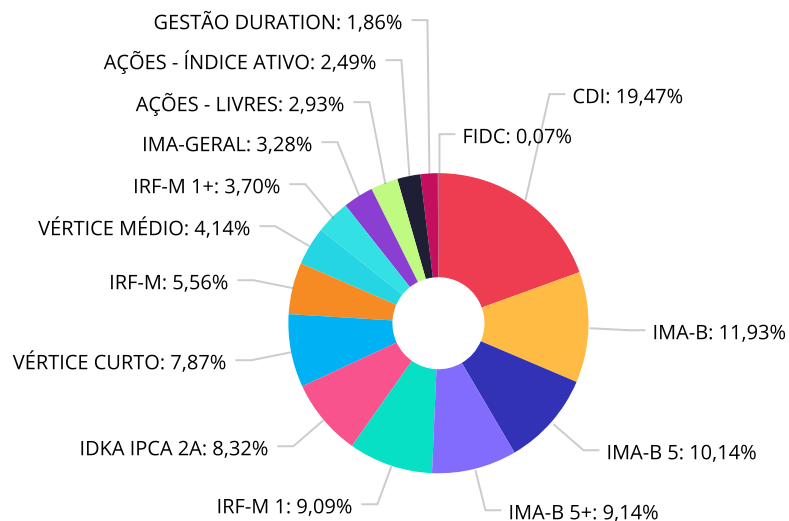
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| Ibovespa (Benchmark) | -0,71% | -4,53% | -4,53% | 9,90% | 25,74% | 6,76% | - | - |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 0,97% | 1,44% | 1,44% | 17,99% | 23,28% | 12,52% | 5,29% | 14,03% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 0,83% | -5,43% | -5,43% | 3,21% | 12,93% | -17,12% | 5,56% | 18,19% |
| IBX-50 (Benchmark) | -0,81% | -4,06% | -4,06% | 9,78% | 24,88% | 5,45% | - | - |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES | -0,80% | -4,14% | -4,14% | 9,00% | 20,75% | 0,41% | 5,32% | 15,33% |

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



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

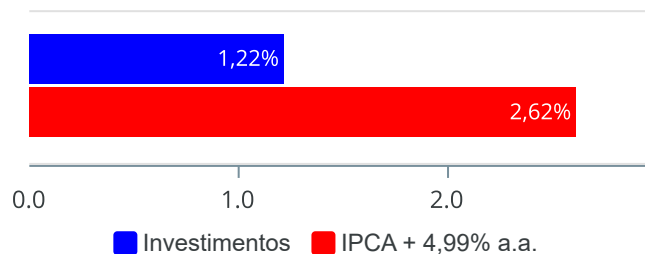


| | | | | | | | |
|------------------------|---------------|-------------------|--------------|-----------------|--------------|------------------|--------------|
| ■ CDI | 14.630.269,00 | ■ IMA-B | 8.959.235,58 | ■ IMA-B 5 | 7.618.712,21 | ■ IMA-B 5+ | 6.868.829,12 |
| ■ IRF-M 1 | 6.828.961,07 | ■ IDKA IPCA 2A | 6.252.837,89 | ■ VÉRTICE CURTO | 5.911.741,63 | ■ IRF-M | 4.178.352,24 |
| ■ VÉRTICE MÉDIO | 3.109.754,82 | ■ IRF-M 1+ | 2.780.887,15 | ■ IMA-GERAL | 2.460.918,17 | ■ AÇÕES - LIVRES | 2.204.600,37 |
| ■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 1.870.812,76 | ■ GESTÃO DURATION | 1.400.426,34 | ■ FIDC | 51.481,16 | | |

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

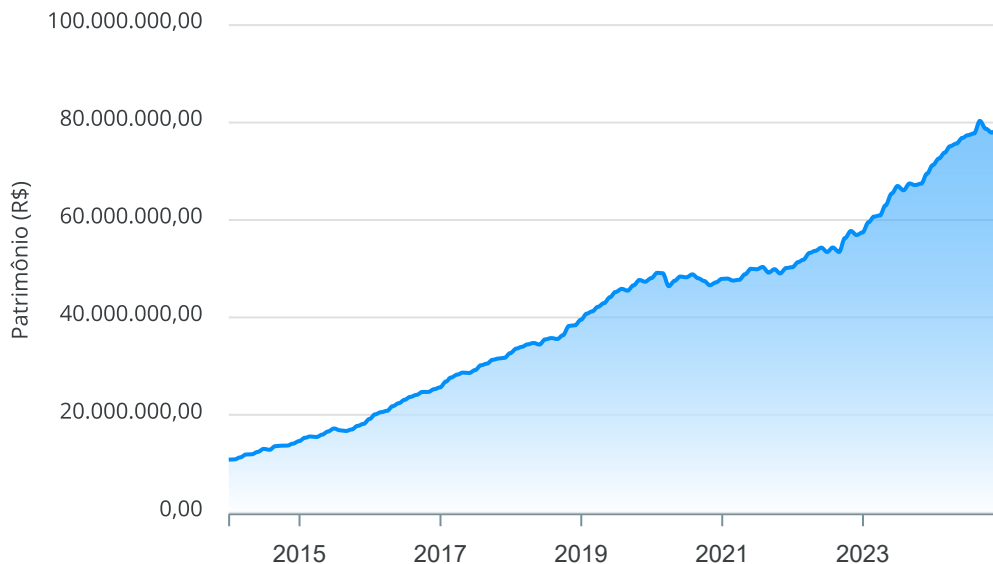
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|--------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 71.240.367,83 | 1.300.000,00 | 0,00 | 72.630.519,90 | 90.152,07 | 90.152,07 | 0,12% | 0,12% | 0,85% | 0,85% | 14,66% | 0,99% |
| Fevereiro | 72.630.519,90 | 2.570.000,00 | 1.866.963,53 | 73.811.348,34 | 477.791,97 | 567.944,04 | 0,65% | 0,78% | 1,20% | 2,06% | 37,72% | 1,09% |
| Março | 73.811.348,34 | 2.140.000,00 | 1.150.000,00 | 75.127.819,51 | 326.471,17 | 894.415,21 | 0,44% | 1,22% | 0,55% | 2,62% | 46,47% | 0,93% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



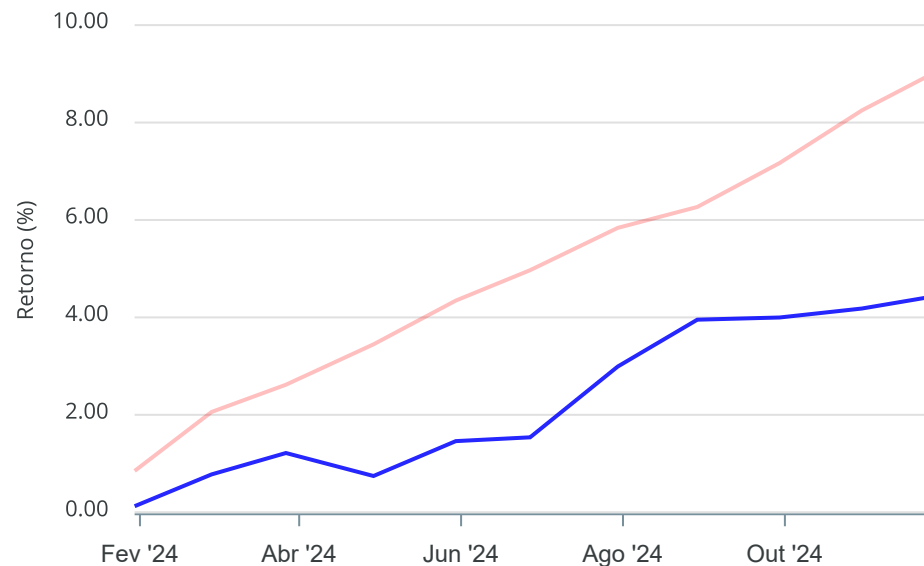
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Março/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 220.711,12 | 0,00 | 0,00 | 227.362,59 | 6.651,47 | 3,01% | 3,01% | 6,62% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | 1.712.968,82 | 0,00 | 0,00 | 1.728.684,58 | 15.715,76 | 0,92% | 0,92% | 0,20% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 4.145.039,30 | 0,00 | 0,00 | 4.183.057,05 | 38.017,75 | 0,92% | 0,92% | 0,20% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 6.198.506,20 | 0,00 | 0,00 | 6.252.837,89 | 54.331,69 | 0,88% | 0,88% | 0,47% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 5.665.090,82 | 0,00 | 0,00 | 5.713.402,97 | 48.312,15 | 0,85% | 0,85% | 0,01% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 2.091.356,48 | 0,00 | 0,00 | 2.108.157,51 | 16.801,03 | 0,80% | 0,80% | 0,09% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 4.683.504,88 | 0,00 | 0,00 | 4.720.803,56 | 37.298,68 | 0,80% | 0,80% | 0,08% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 3.999.158,90 | 0,00 | 0,00 | 4.029.260,15 | 30.101,25 | 0,75% | 0,75% | 0,44% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 3.562.678,58 | 0,00 | 0,00 | 3.589.452,06 | 26.773,48 | 0,75% | 0,75% | 0,44% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO... | 8.101.026,40 | 1.900.000,00 | 1.150.000,00 | 8.916.866,03 | 65.839,63 | 0,66% | 0,82% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3.090.632,56 | 0,00 | 0,00 | 3.109.754,82 | 19.122,26 | 0,62% | 0,62% | 0,75% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA... | 1.392.731,77 | 0,00 | 0,00 | 1.400.426,34 | 7.694,57 | 0,55% | 0,55% | 0,42% |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | 2.448.337,31 | 0,00 | 0,00 | 2.460.918,17 | 12.580,86 | 0,51% | 0,51% | 0,46% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 3.406.585,07 | 240.000,00 | 0,00 | 3.663.934,38 | 17.349,31 | 0,48% | 0,50% | 0,72% |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP | 512.015,13 | 0,00 | 0,00 | 514.417,86 | 2.402,73 | 0,47% | 0,47% | 0,71% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 2.769.966,98 | 0,00 | 0,00 | 2.780.887,15 | 10.920,17 | 0,39% | 0,39% | 0,97% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 6.150.931,26 | 0,00 | 0,00 | 6.157.130,89 | 6.199,63 | 0,10% | 0,10% | 1,10% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 2.334.151,26 | 0,00 | 0,00 | 2.335.542,71 | 1.391,45 | 0,06% | 0,06% | 1,09% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | 51.737,32 | 0,00 | 0,00 | 51.481,16 | -256,16 | -0,50% | -0,50% | 0,73% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 4.798.978,77 | 0,00 | 0,00 | 4.772.146,03 | -26.832,74 | -0,56% | -0,56% | 1,68% |

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 2.109.048,71 | 0,00 | 0,00 | 2.096.683,09 | -12.365,62 | -0,59% | -0,59% | 1,71% |
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA | 295.571,22 | 0,00 | 0,00 | 239.199,39 | -56.371,83 | -19,07% | -19,07% | 33,27% |
| Total Renda Fixa | 69.740.728,86 | 2.140.000,00 | 1.150.000,00 | 71.052.406,38 | 321.677,52 | 0,45% | | 0,68% |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|--------------------------------------|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-----------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 1.180.971,52 | 0,00 | 0,00 | 1.192.464,43 | 11.492,91 | 0,97% | 0,97% | 5,29% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 1.003.781,32 | 0,00 | 0,00 | 1.012.135,94 | 8.354,62 | 0,83% | 0,83% | 5,56% |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES | 1.885.866,64 | 0,00 | 0,00 | 1.870.812,76 | -15.053,88 | -0,80% | -0,80% | 5,32% |
| Total Renda Variável | 4.070.619,48 | 0,00 | 0,00 | 4.075.413,13 | 4.793,65 | 0,12% | | 5,37% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|-------------|------------|
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO... | 5.810.215,90 | 5.770.000,00 | 2.850.000,00 | 8.916.866,03 | 186.650,13 | 1,61% | 2,57% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 5.566.145,90 | 0,00 | 0,00 | 5.713.402,97 | 147.257,07 | 2,65% | 2,65% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 6.127.437,47 | 0,00 | 0,00 | 6.252.837,89 | 125.400,42 | 2,05% | 2,05% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 4.186.089,14 | 0,00 | 118.158,54 | 4.183.057,05 | 115.126,45 | 2,75% | -0,07% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 4.606.989,47 | 0,00 | 0,00 | 4.720.803,56 | 113.814,09 | 2,47% | 2,47% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 3.950.004,13 | 0,00 | 0,00 | 4.029.260,15 | 79.256,02 | 2,01% | 2,01% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 3.519.053,90 | 0,00 | 0,00 | 3.589.452,06 | 70.398,16 | 2,00% | 2,00% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 3.369.555,15 | 240.000,00 | 0,00 | 3.663.934,38 | 54.379,23 | 1,51% | 1,61% |
| CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3.055.983,34 | 0,00 | 0,00 | 3.109.754,82 | 53.771,48 | 1,76% | 1,76% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 2.058.180,92 | 0,00 | 0,00 | 2.108.157,51 | 49.976,59 | 2,43% | 2,43% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | 1.729.920,62 | 0,00 | 48.804,99 | 1.728.684,58 | 47.568,95 | 2,75% | 2,78% |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | 2.422.128,16 | 0,00 | 0,00 | 2.460.918,17 | 38.790,01 | 1,60% | 1,60% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 2.745.197,30 | 0,00 | 0,00 | 2.780.887,15 | 35.689,85 | 1,30% | 1,30% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA... | 1.378.454,12 | 0,00 | 0,00 | 1.400.426,34 | 21.972,22 | 1,59% | 1,59% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 6.144.977,98 | 0,00 | 0,00 | 6.157.130,89 | 12.152,91 | 0,20% | 0,20% |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP | 505.970,79 | 0,00 | 0,00 | 514.417,86 | 8.447,07 | 1,67% | 1,67% |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 222.193,10 | 0,00 | 0,00 | 227.362,59 | 5.169,49 | 2,33% | 2,33% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 2.333.066,99 | 0,00 | 0,00 | 2.335.542,71 | 2.475,72 | 0,11% | 0,11% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | 52.222,84 | 0,00 | 0,00 | 51.481,16 | -741,68 | -1,42% | -1,42% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 2.131.035,78 | 0,00 | 0,00 | 2.096.683,09 | -34.352,69 | -1,61% | -1,61% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|---------------------|--------------|------------|
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA | 282.351,41 | 0,00 | 0,00 | 239.199,39 | -43.152,02 | -15,28% | -15,28% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 4.845.849,11 | 0,00 | 0,00 | 4.772.146,03 | -73.703,08 | -1,52% | -1,52% |
| Total Renda Fixa | 67.043.023,52 | 6.010.000,00 | 3.016.963,53 | 71.052.406,38 | 1.016.346,39 | 1,45% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|--------------------------------------|---------------------|-------------|-------------|---------------------|--------------------|---------------|------------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 1.175.547,49 | 0,00 | 0,00 | 1.192.464,43 | 16.916,94 | 1,44% | 1,44% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 1.070.240,73 | 0,00 | 0,00 | 1.012.135,94 | -58.104,79 | -5,43% | -5,43% |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES | 1.951.556,09 | 0,00 | 0,00 | 1.870.812,76 | -80.743,33 | -4,14% | -4,14% |
| Total Renda Variável | 4.197.344,31 | 0,00 | 0,00 | 4.075.413,13 | -121.931,18 | -2,90% | |

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.

