

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 AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	565,41	0,00%	92.532	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	48.686.362,56	11,87%	880	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	67.764,83	0,02%	652	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.186.350,75	1,51%	88	1,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	41.561.888,36	10,14%	317	1,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	8.563.542,56	2,09%	370	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	40.757.225,96	9,94%	840	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.560.729,12	1,84%	910	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	653.839,08	0,16%	283	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.416.251,02	0,35%	774	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	39.860.437,27	9,72%	254	2,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.193.433,17	1,51%	454	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.406.188,73	0,83%	45	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.640.592,02	1,38%	1.013	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	166.531,02	0,04%	16	4,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.232.018,85	0,30%	39	0,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	5.069.173,98	1,24%	464	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.631.347,36	1,62%	442	0,75%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	S/Info	Não se aplica	10.139.214,36	2,47%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	23.466.685,92	5,72%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

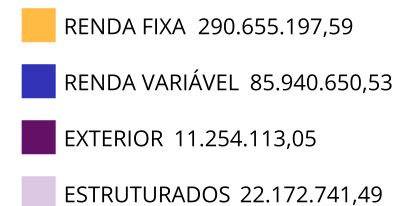
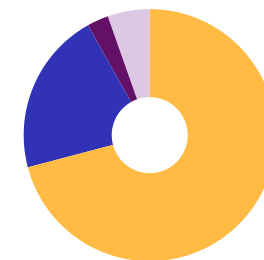
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	31.700.285,88	7,73%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	1.191.802,24	0,29%	70	1,68%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVA...	D+1 ou ...	Não há	502.967,14	0,12%	23	2,37%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	16.392.110,15	4,00%	2.652	2,53%	Artigo 8º, Inciso I
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	8.871.638,97	2,16%	5.403	4,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.993.488,25	0,49%	10.326	0,74%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	2.091.278,28	0,51%	147	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	18.648.468,30	4,55%	313	4,17%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+92	Não há	11.824.319,70	2,88%	118	2,77%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	20.361.049,23	4,97%	31	2,31%	Artigo 8º, Inciso I
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	D+31	Não há	5.758.297,65	1,40%	229	2,07%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	4.924.118,68	1,20%	3.656	0,76%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	6.329.994,37	1,54%	465	0,28%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	6.194.298,12	1,51%	583	3,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	3.832.681,19	0,93%	2.524	0,31%	Artigo 10º, Inciso I
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	7.996,61	0,00%	12	0,60%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.191.851,39	2,73%	13.114	3,27%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	945.914,18	0,23%	28	1,38%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			410.022.702,66				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.058.576,47				Artigo 6º
PL Total			412.081.279,13				

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

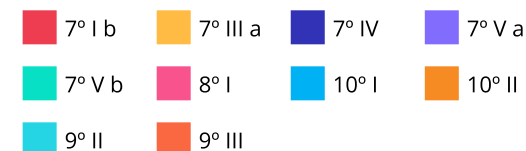
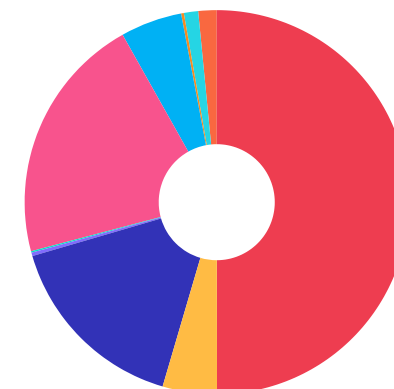
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	123.006.810,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	204.914.578,82	49,98%	10,00%	47,50%	90,00%	164.105.853,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	18.739.663,23	4,57%	0,50%	3,00%	60,00%	227.273.958,37
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	65.306.186,16	15,93%	10,00%	20,00%	20,00%	16.698.354,37
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.191.802,24	0,29%	0,00%	0,50%	5,00%	19.309.332,89
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	502.967,14	0,12%	0,00%	0,50%	5,00%	19.998.167,99
Total Renda Fixa	100,00%	290.655.197,59	70,89%	20,50%	72,50%	210,00%	



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%	85.940.650,53	20,96%	10,00%	18,00%	40,00%	78.068.430,53
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	21.226.827,31	5,18%	2,00%	4,00%	10,00%	19.775.442,96
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	945.914,18	0,23%	0,00%	2,00%	5,00%	19.555.220,95
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	20.501.135,13
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	108.113.392,02	26,37%	12,00%	24,50%	60,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	4.924.118,68	1,20%	0,00%	0,50%	10,00%	36.078.151,59
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.329.994,37	1,54%	0,00%	0,50%	10,00%	34.672.275,90
Total Exterior	10,00%	11.254.113,05	2,74%	0,00%	1,00%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	204.914.578,82	49,98	10,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	18.739.663,23	4,57	0,50	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.191.802,24	0,29	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	502.967,14	0,12	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	85.940.650,53	20,96	10,00	40,00
Artigo 9º, Inciso II	4.924.118,68	1,20	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	6.329.994,37	1,54	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	21.226.827,31	5,18	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	945.914,18	0,23	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	135.970.815,61	33,16	-
CAIXA DTVM	116.883.655,83	28,51	-
BANCO DAYCOVAL	31.700.285,88	7,73	0,26
BANCO BTG PACTUAL	23.466.685,92	5,72	0,01
TRÍGONO CAPITAL	20.361.049,23	4,97	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	18.648.468,30	4,55	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	13.399.481,39	3,27	0,00
TARPON INVESTIMENTOS	11.824.319,70	2,88	-
NOVUS CAPITAL	11.191.851,39	2,73	0,24
SICREDI	6.631.347,36	1,62	0,01
VOKIN INVESTIMENTOS	5.758.297,65	1,40	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.232.018,85	0,30	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.199.798,85	0,29	1,39
KPTL	945.914,18	0,23	-
GENIAL GESTÃO LTDA	502.967,14	0,12	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	166.531,02	0,04	-

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	2,24%	2,24%	5,19%	9,48%	20,66%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,08%	2,08%	5,00%	9,45%	19,97%	0,52%	1,60%
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,70%	3,09%	3,15%	6,04%	11,20%	24,52%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,41%	-1,45%	-1,45%	-2,65%	-4,71%	-2,97%	0,08%	15,24%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,43%	1,37%	1,37%	6,49%	15,26%	28,03%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	1,24%	1,24%	6,29%	14,87%	26,94%	0,97%	3,21%
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%	-	-
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%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,58%	-1,60%	-1,60%	4,63%	13,00%	18,32%	1,70%	6,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,82%	2,54%	2,54%	5,54%	12,55%	27,32%	0,09%	0,28%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,77%	2,06%	2,06%	5,09%	9,62%	21,01%	-	-
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%

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 (Benchmark)	0,08%	0,18%	0,18%	4,94%	11,81%	20,21%	-	-
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%
BRA1 FI RENDA FIXA	-0,05%	0,10%	0,10%	0,41%	-20,80%	-57,24%	0,09%	23,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,06%	0,13%	0,13%	4,84%	11,64%	19,81%	1,08%	3,86%
IRF-M (Benchmark)	0,54%	1,68%	1,68%	6,13%	14,03%	27,20%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	1,59%	1,59%	6,01%	13,75%	26,52%	0,72%	2,23%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	1,62%	1,62%	6,01%	13,79%	26,76%	0,72%	2,22%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,63%	1,98%	1,98%	4,22%	9,54%	20,85%	0,01%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	2,38%	2,38%	5,02%	11,27%	24,78%	0,01%	0,06%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,69%	-1,71%	-1,71%	-3,33%	-5,80%	-78,86%	0,52%	3,47%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86%	2,79%	2,79%	5,80%	13,09%	28,17%	0,02%	0,09%
IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	2,81%	2,81%	5,06%	-	-	0,20%	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	2,78%	2,78%	5,01%	9,81%	20,12%	0,20%	0,94%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	-4,16%	-1,82%	-1,82%	12,75%	25,44%	-	9,63%	28,33%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,61%	1,63%	1,63%	4,90%	11,04%	26,99%	0,63%	1,11%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,70%	2,33%	2,33%	5,12%	11,68%	26,54%	0,27%	0,37%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,37%	-2,84%	-2,84%	-3,89%	-5,98%	-12,04%	0,00%	1,76%
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,03%
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	-0,60%	-1,68%	-1,68%	8,19%	20,53%	-	4,52%	8,58%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	4,89%	1,89%	1,89%	14,00%	29,58%	-	5,82%	18,02%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,72%	2,41%	2,41%	14,19%	66,20%	58,46%	4,41%	17,25%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,94%	-6,16%	-6,16%	-8,96%	12,00%	9,89%	6,80%	18,33%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,56%	-1,24%	-1,24%	13,54%	32,70%	16,26%	4,43%	15,24%
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	-0,81%	-4,82%	-4,82%	9,25%	24,18%	4,31%	4,99%	15,31%
IDIV (Benchmark)	-1,20%	-3,81%	-3,81%	10,25%	27,20%	19,02%	-	-

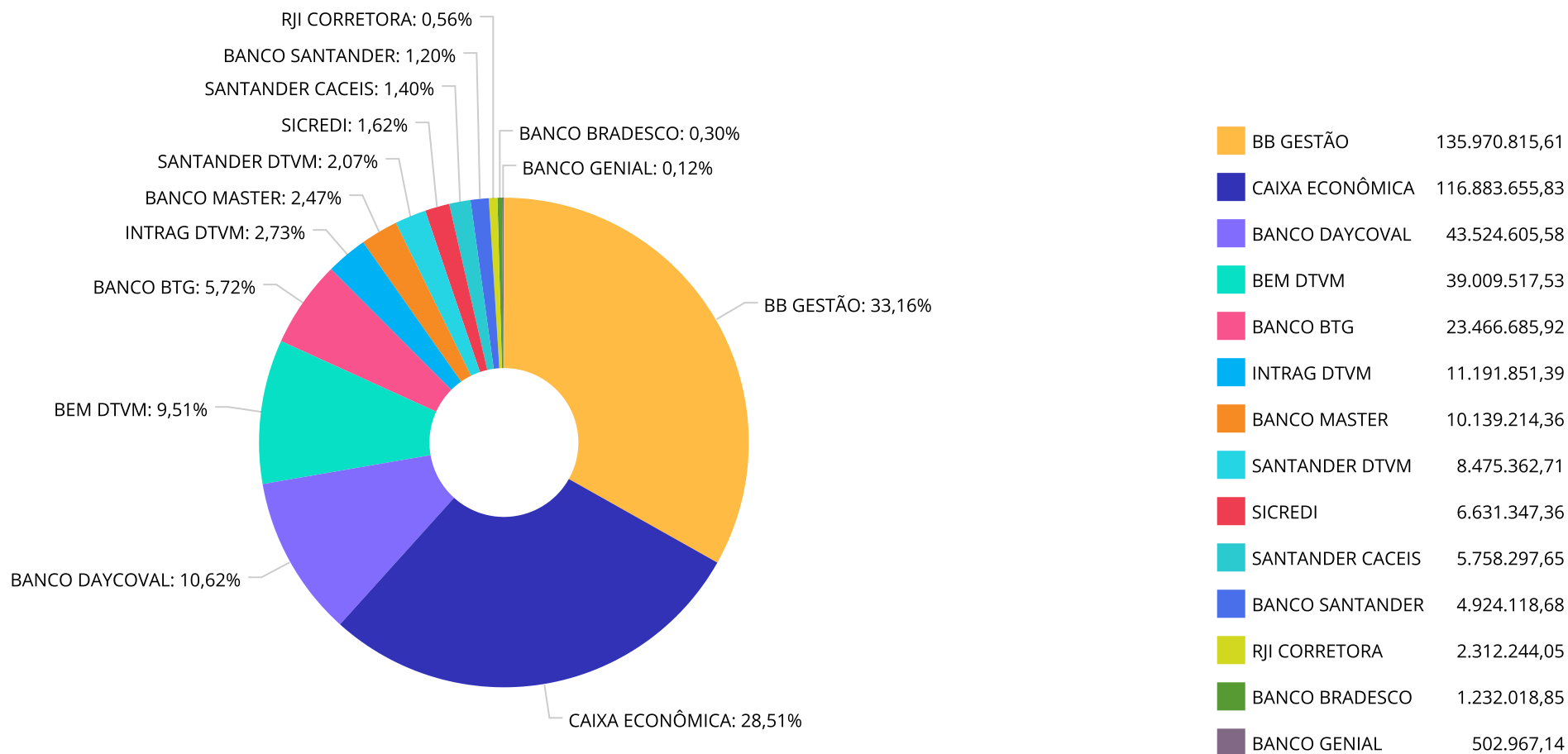
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,25%	2,01%	2,01%	13,64%	33,00%	17,65%	4,69%	14,70%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-1,01%	-2,33%	-2,33%	10,04%	26,46%	13,34%	4,06%	12,91%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,96%	3,90%	3,98%	7,76%	14,84%	32,80%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,13%	-43,95%	-43,95%	-44,19%	-44,68%	-49,52%	-	-

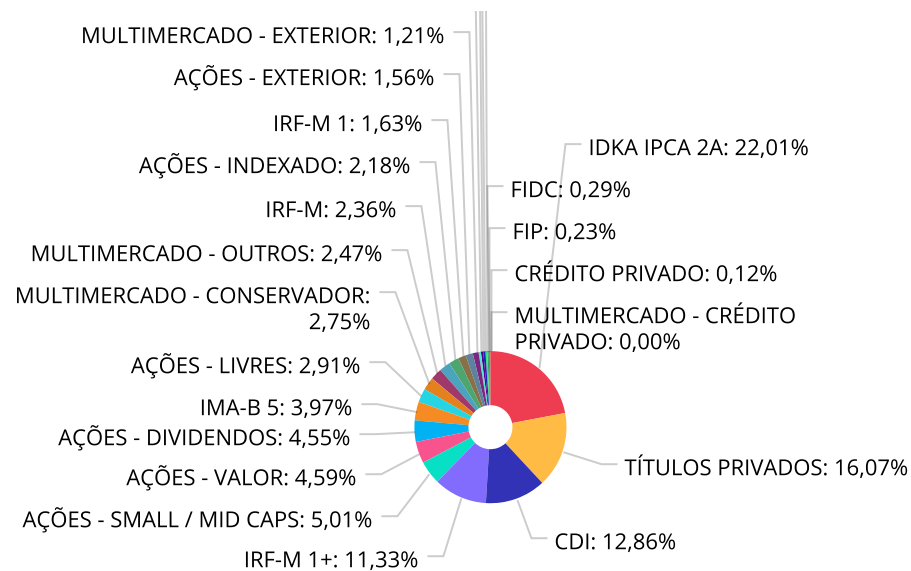
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,034%
MSCI WORLD (Benchmark)	3,25%	11,91%	11,91%	20,18%	21,08%	18,71%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3,86%	11,90%	11,90%	19,94%	21,29%	18,17%	4,16%	11,159%

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



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

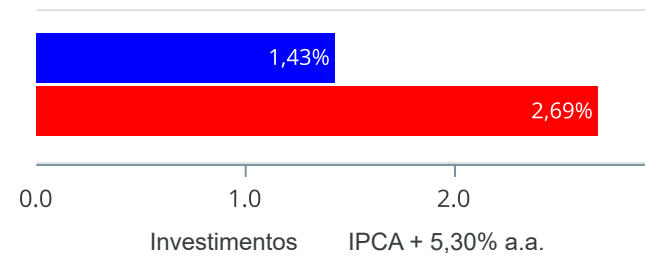


IDKA IPCA 2A	89.443.588,52	TÍTULOS PRIVADOS	65.306.186,16	CDI	52.272.219,77
IRF-M 1+	46.046.788,02	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	20.361.049,23	AÇÕES - VALOR	18.648.468,30
AÇÕES - DIVIDENDOS	18.483.388,43	IMA-B 5	16.124.271,68	AÇÕES - LIVRES	11.824.319,70
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	11.191.851,39	MULTIMERCADO - OUTROS	10.026.979,31	IRF-M	9.599.621,90
AÇÕES - INDEXADO	8.871.638,97	IRF-M 1	6.631.347,36	AÇÕES - EXTERIOR	6.329.994,37
MULTIMERCADO - EXTERIOR	4.924.118,68	DISP. FINANCEIRA	2.058.576,47	AÇÕES - SETORIAIS	1.993.488,25
IMA-B 5+	1.885.857,93	IMA-B	1.650.546,87	FIDC	1.191.802,24
FIP	945.914,18	CRÉDITO PRIVADO	502.967,14	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	7.996,61

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	402.536.489,89	2.061.372,20	121.253,63	402.501.613,46	-1.974.995,00	-1.974.995,00	-0,49%	-0,49%	0,87%	0,87%	-55,88%	2,46%
Fevereiro	402.501.613,46	4.654.450,41	6.083.195,10	404.484.332,23	3.411.463,46	1.436.468,46	0,85%	0,36%	1,22%	2,11%	16,85%	2,65%
Março	404.484.332,23	12.257.359,99	11.101.556,65	409.975.031,91	4.334.896,34	5.771.364,80	1,07%	1,43%	0,57%	2,69%	53,05%	1,93%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



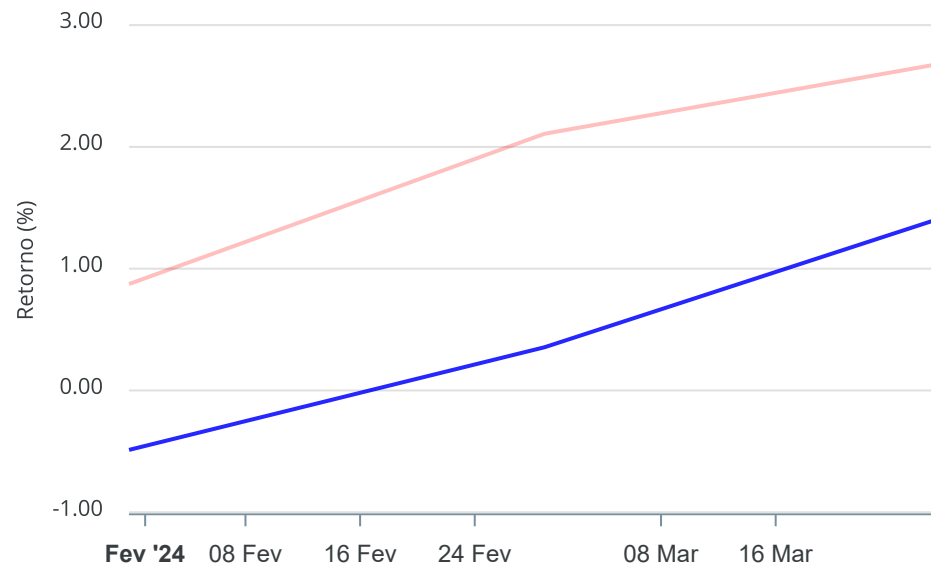
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	0,00	10.000.000,00	0,00	10.139.214,36	139.214,36	1,39%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	23.206.496,76	0,00	0,00	23.466.685,92	260.189,16	1,12%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	31.373.903,74	0,00	0,00	31.700.285,88	326.382,14	1,04%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	41.180.754,09	0,00	0,00	41.561.888,36	381.134,27	0,93%	0,93%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.485.689,97	0,00	0,00	8.563.542,56	77.852,59	0,92%	0,92%	0,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	48.263.320,65	0,00	0,00	48.686.362,56	423.041,91	0,88%	0,88%	0,47%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.577.704,44	0,00	0,00	6.631.347,36	53.642,92	0,82%	0,82%	0,09%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.750.720,85	270.404,10	1.000.000,00	5.069.173,98	48.049,03	0,80%	0,86%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.504.245,44	0,00	0,00	7.560.729,12	56.483,68	0,75%	0,75%	0,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	50.390.963,14	0,00	10.000.000,00	40.757.225,96	366.262,82	0,73%	0,90%	0,52%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.725.085,40	1.986.967,89	103.933,87	5.640.592,02	32.472,60	0,57%	0,75%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.162.614,58	0,00	0,00	6.193.433,17	30.818,59	0,50%	0,50%	0,72%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.389.713,88	0,00	0,00	3.406.188,73	16.474,85	0,49%	0,49%	0,72%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.262,16	0,00	702,13	565,41	5,38	0,43%	0,63%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	39.703.910,71	0,00	0,00	39.860.437,27	156.526,56	0,39%	0,39%	0,97%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.163.665,87	0,00	0,00	6.186.350,75	22.684,88	0,37%	0,37%	0,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	67.724,46	0,00	0,00	67.764,83	40,37	0,06%	0,06%	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.415.449,52	0,00	0,00	1.416.251,02	801,50	0,06%	0,06%	1,08%
BRA1 FI RENDA FIXA	166.610,60	0,00	0,00	166.531,02	-79,58	-0,05%	-0,05%	0,09%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.196.662,40	0,00	0,00	1.191.802,24	-4.860,16	-0,41%	-0,41%	0,08%

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	657.515,47	0,00	0,00	653.839,08	-3.676,39	-0,56%	-0,56%	1,68%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.239.256,50	0,00	0,00	1.232.018,85	-7.237,65	-0,58%	-0,58%	1,70%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	506.464,59	0,00	0,00	502.967,14	-3.497,45	-0,69%	-0,69%	0,52%
Total Renda Fixa	287.129.735,22	12.257.371,99	11.104.636,00	290.655.197,59	2.372.726,38	0,82%		0,51%

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
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.079.670,91	0,00	0,00	11.824.319,70	744.648,79	6,72%	6,72%	4,41%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	5.489.988,98	0,00	0,00	5.758.297,65	268.308,67	4,89%	4,89%	5,82%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	18.361.962,07	0,00	0,00	18.648.468,30	286.506,23	1,56%	1,56%	4,43%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	16.189.834,87	0,00	0,00	16.392.110,15	202.275,28	1,25%	1,25%	4,69%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	20.171.699,35	0,00	0,00	20.361.049,23	189.349,88	0,94%	0,94%	6,80%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.806.101,81	0,00	0,00	3.832.681,19	26.579,38	0,70%	0,70%	0,27%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	11.124.273,67	0,00	0,00	11.191.851,39	67.577,72	0,61%	0,61%	0,63%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	947.146,92	0,00	0,00	945.914,18	-1.232,74	-0,13%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	8.026,27	0,00	0,00	7.996,61	-29,66	-0,37%	-0,37%	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	6.231.574,03	0,00	0,00	6.194.298,12	-37.275,91	-0,60%	-0,60%	4,52%
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	8.943.594,18	0,00	0,00	8.871.638,97	-71.955,21	-0,80%	-0,80%	4,99%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.112.595,72	0,00	0,00	2.091.278,28	-21.317,44	-1,01%	-1,01%	4,06%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.079.961,29	0,00	0,00	1.993.488,25	-86.473,04	-4,16%	-4,16%	9,63%
Total Renda Variável	106.546.430,07	0,00	0,00	108.113.392,02	1.566.961,95	1,47%		4,59%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	4.741.286,37	0,00	0,00	4.924.118,68	182.832,31	3,86%	3,86%	4,16%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.117.243,68	0,00	0,00	6.329.994,37	212.750,69	3,48%	3,48%	5,89%
Total Exterior	10.858.530,05	0,00	0,00	11.254.113,05	395.583,00	3,64%		5,13%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	40.189.464,82	1.395.462,21	1.153.692,47	41.561.888,36	1.130.653,80	2,72%	2,81%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	30.711.807,47	0,00	0,00	31.700.285,88	988.478,41	3,22%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	47.709.959,45	0,00	0,00	48.686.362,56	976.403,11	2,05%	2,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	49.807.374,25	0,00	10.000.000,00	40.757.225,96	949.851,71	1,91%	2,08%
LETRA FINANCEIRA BTG	22.736.404,26	0,00	0,00	23.466.685,92	730.281,66	3,21%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	39.348.869,17	0,00	0,00	39.860.437,27	511.568,10	1,30%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.569.665,66	0,00	241.769,74	8.563.542,56	235.646,64	2,75%	2,78%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	7.850.055,40	1.782.792,45	4.760.335,00	5.069.173,98	196.661,13	2,04%	2,79%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.466.952,57	0,00	0,00	6.631.347,36	164.394,79	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.412.008,73	0,00	0,00	7.560.729,12	148.720,39	2,01%	2,01%
LETRA FINANCEIRA BANCO MASTER	0,00	10.000.000,00	0,00	10.139.214,36	139.214,36	1,39%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.095.019,14	0,00	0,00	6.193.433,17	98.414,03	1,61%	1,61%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.110.339,27	0,00	0,00	6.186.350,75	76.011,48	1,24%	1,24%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	960.799,90	5.842.573,72	1.218.751,42	5.640.592,02	55.969,82	0,82%	2,38%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.352.742,56	0,00	0,00	3.406.188,73	53.446,17	1,59%	1,59%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.414.451,12	0,00	0,00	1.416.251,02	1.799,90	0,13%	0,13%
BRA1 FI RENDA FIXA	166.359,55	0,00	0,00	166.531,02	171,47	0,10%	0,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	67.693,00	0,00	0,00	67.764,83	71,83	0,11%	0,11%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.817,88	0,00	4.287,89	565,41	35,42	0,74%	1,98%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	511.708,33	0,00	2.366,81	502.967,14	-6.374,38	-1,25%	-1,71%

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 BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	663.937,25	0,00	0,00	653.839,08	-10.098,17	-1,52%	-1,52%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.209.351,77	0,00	0,00	1.191.802,24	-17.549,53	-1,45%	-1,45%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.252.055,43	0,00	0,00	1.232.018,85	-20.036,58	-1,60%	-1,60%
Total Renda Fixa	282.611.836,98	19.020.828,38	17.381.203,33	290.655.197,59	6.403.735,56	2,25%	

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
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	16.069.379,41	0,00	0,00	16.392.110,15	322.730,74	2,01%	2,01%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.546.184,60	0,00	0,00	11.824.319,70	278.135,10	2,41%	2,41%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	11.012.873,95	0,00	0,00	11.191.851,39	178.977,44	1,63%	1,63%
VOKIN GBV ACONCÁGUA 30 FIC AÇÕES	5.651.470,94	0,00	0,00	5.758.297,65	106.826,71	1,89%	1,89%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.745.437,93	0,00	0,00	3.832.681,19	87.243,26	2,33%	2,33%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	8.230,31	0,00	0,00	7.996,61	-233,70	-2,84%	-2,84%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.030.413,29	0,00	0,00	1.993.488,25	-36.925,04	-1,82%	-1,82%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.141.081,16	0,00	0,00	2.091.278,28	-49.802,88	-2,33%	-2,33%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	6.300.177,25	0,00	0,00	6.194.298,12	-105.879,13	-1,68%	-1,68%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	18.881.604,59	0,00	0,00	18.648.468,30	-233.136,29	-1,23%	-1,23%
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	9.320.553,84	0,00	0,00	8.871.638,97	-448.914,87	-4,82%	-4,82%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	1.687.735,45	0,00	0,00	945.914,18	-741.821,27	-43,95%	-43,95%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	21.698.368,17	0,00	0,00	20.361.049,23	-1.337.318,94	-6,16%	-6,16%
Total Renda Variável	110.093.510,89	0,00	0,00	108.113.392,02	-1.980.118,87	-1,80%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.505.252,78	0,00	0,00	6.329.994,37	824.741,59	14,98%	14,98%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	4.400.293,26	0,00	0,00	4.924.118,68	523.825,42	11,90%	11,90%
Total Exterior	9.905.546,04	0,00	0,00	11.254.113,05	1.348.567,01	13,61%	

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.

