

# Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2024



**Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)**

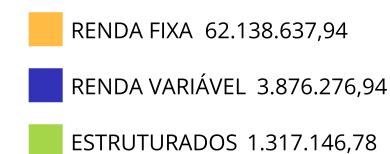
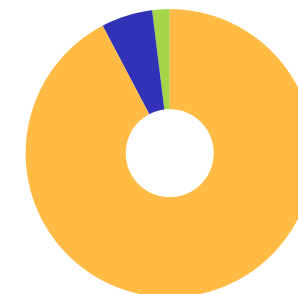
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	7.641.056,98	11,35%	711	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.036.625,82	8,97%	880	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.566.435,83	18,66%	796	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	4.272.472,85	6,35%	98	1,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	12.722.724,04	18,90%	651	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.942.813,24	4,37%	250	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.295.116,24	3,41%	801	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.178.555,75	1,75%	840	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.977.250,60	2,94%	910	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	627.849,17	0,93%	1.187	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	6.967.329,56	10,35%	221	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	805,97	0,00%	3.129	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.072.545,18	3,08%	1.013	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	837.056,71	1,24%	445	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	511.443,77	0,76%	1.248	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	122.238,06	0,18%	17.138	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.147.437,77	1,70%	895	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	715.109,10	1,06%	12.892	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.380.048,24	2,05%	61	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.317.146,78	1,96%	4.853	0,09%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>67.332.061,66</b>				

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

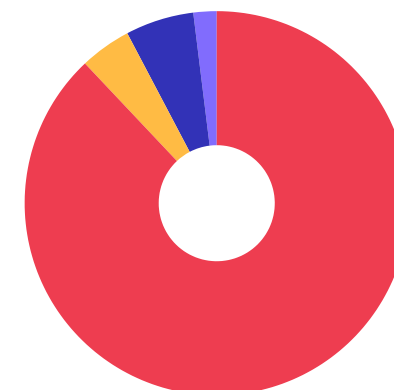
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	13.466.412,33
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	59.229.036,05	87,97%	30,00%	45,00%	100,00%	8.103.025,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	2.909.601,89	4,32%	10,00%	18,00%	60,00%	37.489.635,11
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	13.466.412,33
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.366.603,08
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>62.138.637,94</b>	<b>92,29%</b>	<b>40,00%</b>	<b>78,00%</b>	<b>205,00%</b>	



**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%	3.876.276,94	5,76%	3,00%	15,00%	30,00%	16.323.341,56
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.199.618,50
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.317.146,78	1,96%	0,00%	3,00%	10,00%	5.416.059,39
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.366.603,08
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>5.193.423,72</b>	<b>7,71%</b>	<b>3,00%</b>	<b>18,00%</b>	<b>75,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	6.733.206,17
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>2,00%</b>	<b>10,00%</b>	



7º I b    7º III a    8º I    10º 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 ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	59.229.036,05	87,97	30,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	2.909.601,89	4,32	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.876.276,94	5,76	3,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.317.146,78	1,96	0,00	10,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.945.542,53	68,24	-
CAIXA DTVM	9.380.413,02	13,93	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	9.063.292,87	13,46	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.942.813,24	4,37	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 Março/2024 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA Geral (Benchmark)</b>	0,52%	1,64%	1,64%	5,51%	12,59%	24,78%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,59%	1,59%	5,42%	12,40%	24,64%	0,46%	1,67%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
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%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,82%	2,46%	2,46%	5,34%	12,08%	26,55%	0,09%	0,25%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
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%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,54%	1,68%	1,68%	6,13%	14,03%	27,20%	-	-
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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	2,70%	5,72%	12,96%	27,89%	0,05%	0,10%



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

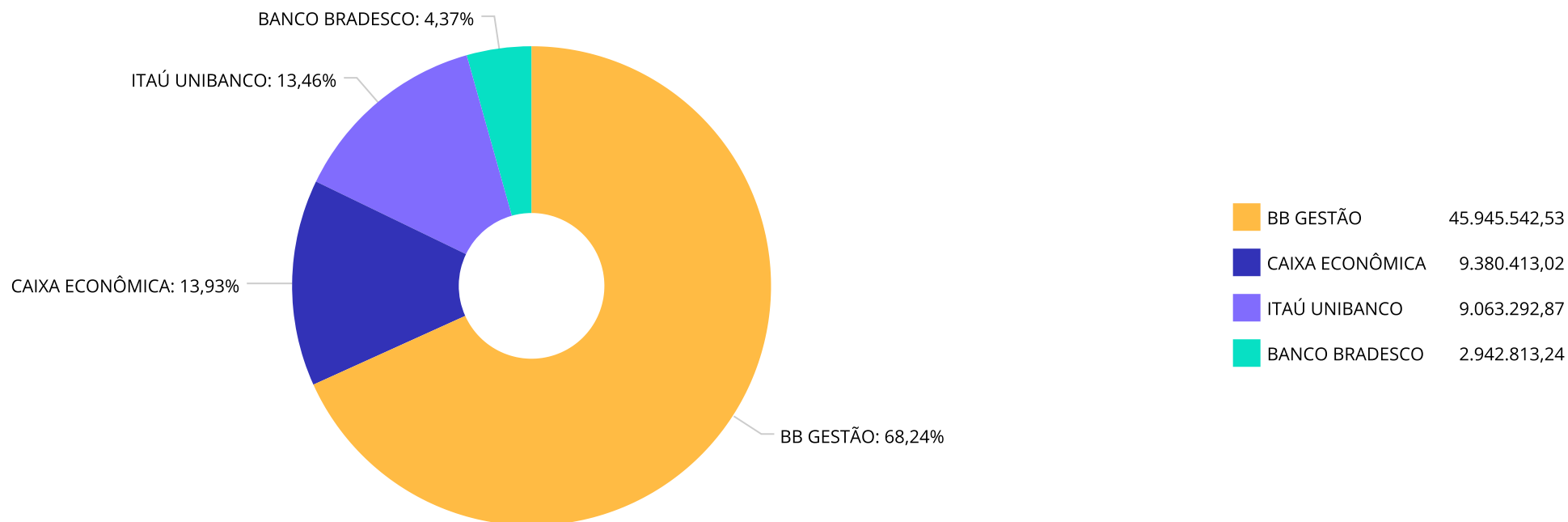
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,83%	2,61%	2,61%	5,48%	12,28%	27,05%	0,01%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	2,38%	2,38%	5,02%	11,27%	24,78%	0,01%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	2,41%	2,41%	5,40%	13,73%	25,89%	0,08%	0,99%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,58%	1,80%	1,80%	4,77%	11,99%	25,10%	0,55%	1,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,55%	1,59%	1,59%	5,69%	13,03%	23,64%	0,42%	2,70%

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

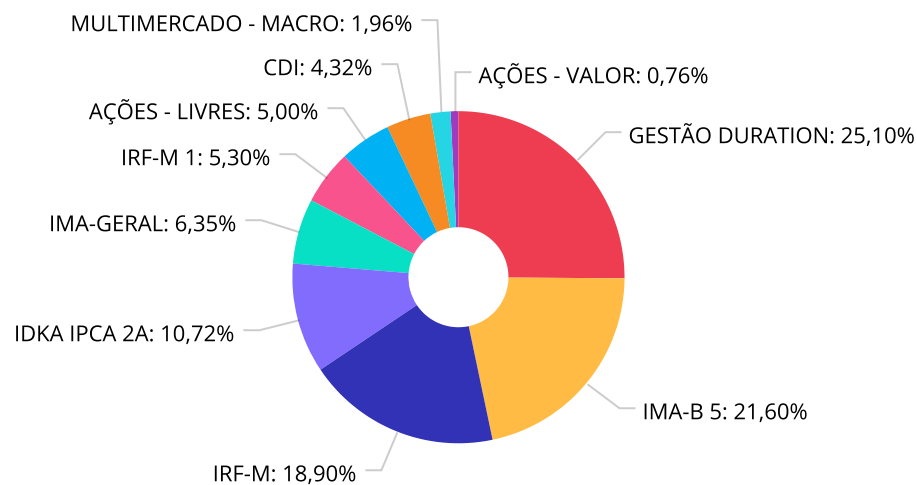
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,69%	1,77%	1,77%	6,74%	13,22%	23,30%	0,62%	3,00%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-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%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,27%	-4,27%	-4,27%	9,48%	20,76%	-0,83%	5,21%	15,39%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-1,58%	-7,45%	-7,45%	5,40%	19,61%	-2,03%	5,30%	15,27%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,60%	-2,88%	-2,88%	7,26%	23,33%	1,91%	4,09%	15,08%

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



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

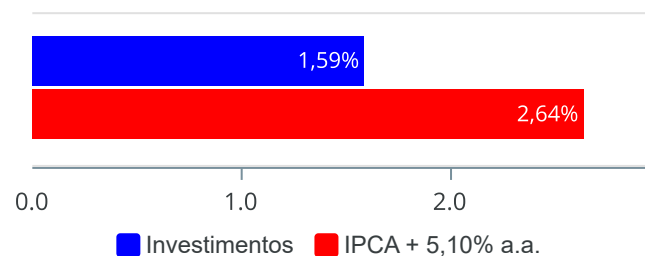


■ GESTÃO DURATION	16.903.502,78	■ IMA-B 5	14.543.686,43	■ IRF-M	12.722.724,04	■ IDKA IPCA 2A	7.215.181,57
■ IMA-GERAL	4.272.472,85	■ IRF-M 1	3.570.662,41	■ AÇÕES - LIVRES	3.364.833,17	■ CDI	2.910.407,86
■ MULTIMERCADO - MACRO	1.317.146,78	■ AÇÕES - VALOR	511.443,77				

**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024**

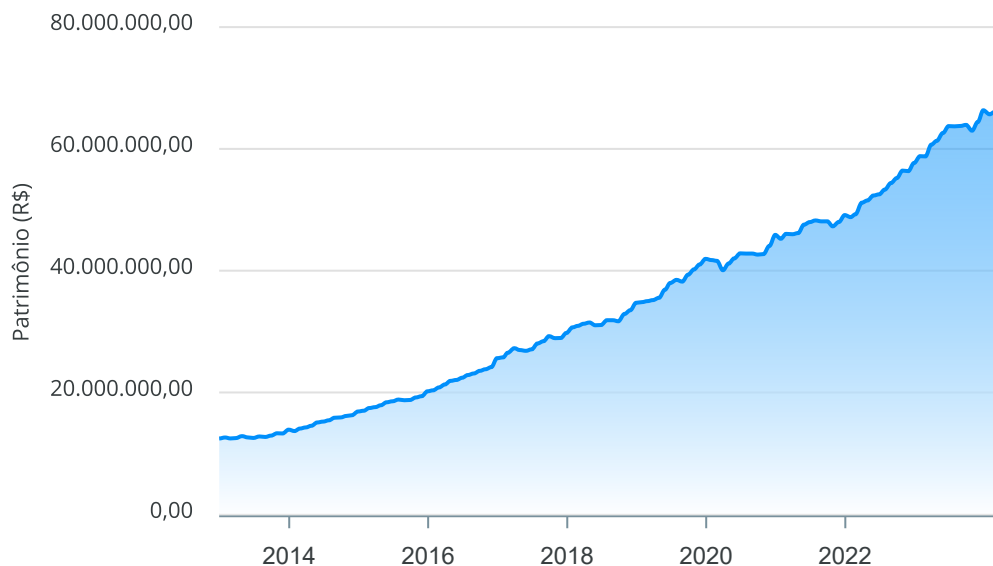
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	64.098.295,09	0,00	832.902,70	63.476.100,59	210.708,20	210.708,20	0,33%	0,33%	0,86%	0,86%	38,36%	0,87%
Fevereiro	63.476.100,59	842.994,63	838.329,79	63.853.378,64	372.613,21	583.321,41	0,59%	0,92%	1,21%	2,08%	44,20%	0,79%
Março	63.853.378,64	1.722.739,96	875.782,48	65.132.252,28	431.916,16	1.015.237,57	0,67%	1,59%	0,56%	2,64%	60,19%	0,69%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



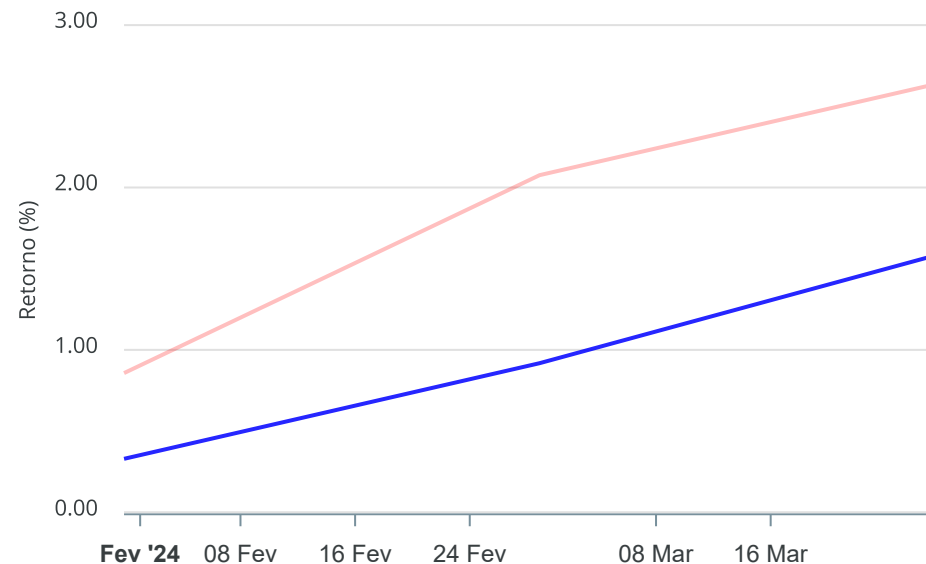
**Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores**

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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.168.065,98	0,00	0,00	1.178.555,75	10.489,77	0,90%	0,90%	0,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.984.172,82	0,00	0,00	6.036.625,82	52.453,00	0,88%	0,88%	0,47%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	830.010,94	0,00	0,00	837.056,71	7.045,77	0,85%	0,85%	0,05%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	799,35	0,00	0,00	805,97	6,62	0,83%	0,83%	0,01%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.918.838,43	0,00	0,00	2.942.813,24	23.974,81	0,82%	0,82%	0,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	622.888,58	0,00	0,00	627.849,17	4.960,59	0,80%	0,80%	0,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	7.582.924,22	0,00	0,00	7.641.056,98	58.132,76	0,77%	0,77%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.962.479,23	0,00	0,00	1.977.250,60	14.771,37	0,75%	0,75%	0,44%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.472.703,61	0,00	0,00	12.566.435,83	93.732,22	0,75%	0,75%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.275.149,77	1.724.048,45	944.497,65	2.072.545,18	17.844,61	0,59%	0,75%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.281.930,74	0,00	0,00	2.295.116,24	13.185,50	0,58%	0,58%	0,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	6.929.047,91	0,00	0,00	6.967.329,56	38.281,65	0,55%	0,55%	0,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	12.658.991,57	0,00	0,00	12.722.724,04	63.732,47	0,50%	0,50%	0,72%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	4.251.161,58	0,00	0,00	4.272.472,85	21.311,27	0,50%	0,50%	0,46%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>60.939.164,73</b>	<b>1.724.048,45</b>	<b>944.497,65</b>	<b>62.138.637,94</b>	<b>419.922,41</b>	<b>0,68%</b>		<b>0,42%</b>

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	708.216,91	0,00	0,00	715.109,10	6.892,19	0,97%	0,97%	5,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.368.656,72	0,00	0,00	1.380.048,24	11.391,52	0,83%	0,83%	5,56%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.308.143,02	0,00	0,00	1.317.146,78	9.003,76	0,69%	0,69%	0,62%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.140.622,63	0,00	0,00	1.147.437,77	6.815,14	0,60%	0,60%	4,09%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	512.818,13	0,00	0,00	511.443,77	-1.374,36	-0,27%	-0,27%	5,21%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	124.205,35	0,00	0,00	122.238,06	-1.967,29	-1,58%	-1,58%	5,30%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>5.162.662,76</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>5.193.423,72</b>	<b>30.760,96</b>	<b>0,60%</b>		<b>3,90%</b>



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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.319.976,47	0,00	0,00	12.566.435,83	246.459,36	2,00%	2,00%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	12.521.387,03	0,00	0,00	12.722.724,04	201.337,01	1,61%	1,61%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	7.461.363,39	0,00	0,00	7.641.056,98	179.693,59	2,41%	2,41%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.915.561,52	0,00	0,00	6.036.625,82	121.064,30	2,05%	2,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	6.858.014,49	0,00	0,00	6.967.329,56	109.315,07	1,59%	1,59%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.872.301,11	0,00	0,00	2.942.813,24	70.512,13	2,45%	2,45%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	4.205.633,78	0,00	0,00	4.272.472,85	66.839,07	1,59%	1,59%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.102.915,31	2.645.585,64	2.726.029,46	2.072.545,18	50.073,69	1,05%	2,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.254.572,37	0,00	0,00	2.295.116,24	40.543,87	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.938.357,86	0,00	0,00	1.977.250,60	38.892,74	2,01%	2,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.154.538,35	0,00	0,00	1.178.555,75	24.017,40	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	815.062,86	0,00	0,00	837.056,71	21.993,85	2,70%	2,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	612.712,32	0,00	0,00	627.849,17	15.136,85	2,47%	2,47%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	785,48	0,00	0,00	805,97	20,49	2,61%	2,61%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>61.033.182,34</b>	<b>2.645.585,64</b>	<b>2.726.029,46</b>	<b>62.138.637,94</b>	<b>1.185.899,42</b>	<b>1,86%</b>	

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
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.294.241,46	0,00	0,00	1.317.146,78	22.905,32	1,77%	1,77%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	704.964,17	0,00	0,00	715.109,10	10.144,93	1,44%	1,44%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	132.080,58	0,00	0,00	122.238,06	-9.842,52	-7,45%	-7,45%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	534.237,52	0,00	0,00	511.443,77	-22.793,75	-4,27%	-4,27%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.181.425,02	0,00	0,00	1.147.437,77	-33.987,25	-2,88%	-2,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.459.274,18	0,00	0,00	1.380.048,24	-79.225,94	-5,43%	-5,43%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>5.306.222,93</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>5.193.423,72</b>	<b>-112.799,21</b>	<b>-2,13%</b>	

## 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.



