

# Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2024

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

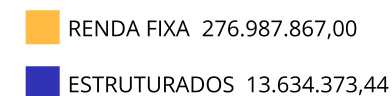
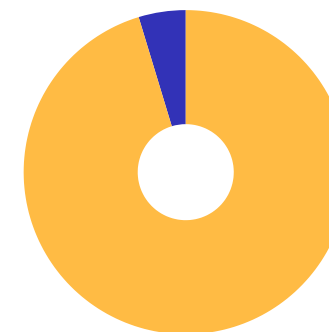
| Produto / Fundo                                     | Resgate    | Carência      | Saldo         | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                       |
|---|------------|---------------|---------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1        | Não há        | 21.010.073,15 | 7,23%              | 796      | 0,40%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1        | Não há        | 3.990.196,60  | 1,37%              | 652      | 0,07%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI... | D+1        | Não há        | 20.817.251,45 | 7,16%              | 101      | 3,38%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA     | D+0        | Não há        | 17.488.738,92 | 6,02%              | 250      | 2,25%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA      | D+0        | Não há        | 12.269.255,84 | 4,22%              | 801      | 0,23%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há        | 16.826.414,26 | 5,79%              | 910      | 0,22%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0        | Não há        | 15.737.265,41 | 5,42%              | 774      | 0,31%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há        | 12.638.993,07 | 4,35%              | 1.187    | 0,15%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | D+0        | Não há        | 26.411.072,99 | 9,09%              | 739      | 0,20%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1        | Não há        | 13.710.594,46 | 4,72%              | 221      | 0,57%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I         | D+1        | Não há        | 12.854.363,61 | 4,42%              | 93       | 0,83%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| ITAU INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA             | D+1        | Não há        | 10.128.535,58 | 3,49%              | 52       | 3,56%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| ITAU INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA            | D+0        | Não há        | 11.492.149,14 | 3,95%              | 76       | 2,13%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                | D+0        | Não há        | 3.883.268,45  | 1,34%              | 3.129    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0        | Não há        | 7.485.908,96  | 2,58%              | 1.141    | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA       | D+1        | Não há        | 18.898.858,45 | 6,50%              | 147      | 2,22%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI      | D+0        | Não há        | 18.661.043,29 | 6,42%              | 452      | 0,18%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR... | D+0        | Não há        | 21.215.508,02 | 7,30%              | 242      | 0,32%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI    | D+0        | Não há        | 10.038.036,49 | 3,45%              | 409      | 0,18%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1             | Não se ... | Não se aplica | 15.745,54     | 0,01%              | 58       | 1,20%            | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '   |

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

| Produto / Fundo                                    | Resgate    | Carência      | Saldo                 | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                     |
|--|------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------------------|
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                              | Não se ... | Não se aplica | 1.414.593,32          | 0,49%              | 98       | 4,86%            | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO      | D+1        | Não há        | 13.634.373,44         | 4,69%              | 20       | 9,64%            | Artigo 10º, Inciso I              |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b> |            |               | <b>290.622.240,44</b> |                    |          |                  |                                   |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                       |            |               | <b>95.243,02</b>      |                    |          |                  | Artigo 6º                         |
| <b>PL Total</b>                                    |            |               | <b>290.717.483,46</b> |                    |          |                  |                                   |

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

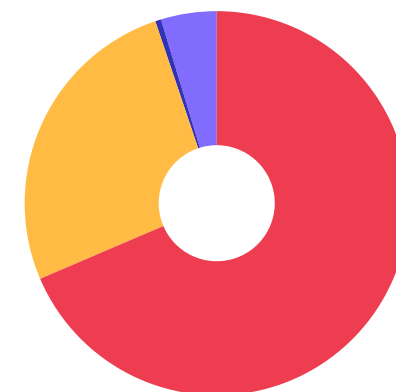
| Artigos - Renda Fixa                | Resolução      | Carteira \$           | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2024 |               |                | GAP Superior  |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
|                                     |                |                       |               | Inf                           | Alvo          | Sup            |               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '   | 100,00%        | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 30,00%         | 87.186.672,13 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 100,00%        | 199.258.172,93        | 68,56%        | 30,00%                        | 55,00%        | 100,00%        | 91.364.067,51 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00%         | 76.299.355,21         | 26,25%        | 0,00%                         | 30,00%        | 55,00%         | 83.542.877,03 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '   | 5,00%          | 1.430.338,86          | 0,49%         | 0,00%                         | 1,00%         | 3,00%          | 7.288.328,35  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '   | 5,00%          | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 14.531.112,02 |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b> | <b>276.987.867,00</b> | <b>95,31%</b> | <b>30,00%</b>                 | <b>86,00%</b> | <b>193,00%</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%        | 0,00                 | 0,00%        | 0,00%                         | 10,00%        | 20,00%        | 58.124.448,09 |
| Artigo 8º, Inciso II                                    | 30,00%        | 0,00                 | 0,00%        | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%         | 14.531.112,02 |
| Artigo 10º, Inciso I                                    | 10,00%        | 13.634.373,44        | 4,69%        | 0,00%                         | 3,00%         | 10,00%        | 15.427.850,60 |
| Artigo 11º  | 5,00%         | 0,00                 | 0,00%        | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%         | 14.531.112,02 |
| <b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b> | <b>30,00%</b> | <b>13.634.373,44</b> | <b>4,69%</b> | <b>0,00%</b>                  | <b>13,00%</b> | <b>40,00%</b> |               |

| 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%        | 5,00%         | 14.531.112,02 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 1,00%        | 5,00%         | 14.531.112,02 |
| <b>Total Exterior</b> | <b>10,00%</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00%</b> | <b>0,00%</b>                           | <b>1,00%</b> | <b>10,00%</b> |               |



7º I b    7º III a    7º V a    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                | 30,00               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 199.258.172,93                | 68,56      | 0,00                | 100,00              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 76.299.355,21                 | 26,25      | 0,00                | 50,00               |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '   | 1.430.338,86                  | 0,49       | 0,00                | 3,00                |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I                 | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 20,00               |
| Artigo 8º, Inciso II                | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| 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                | 13.634.373,44                 | 4,69       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 11º                          | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |

**Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)**

| Gestão                     | Valor          | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|----------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM                 | 105.098.509,59 | 36,16         | -              |
| BRDESCO ASSET MANAGEMENT   | 89.500.265,55  | 30,80         | 0,01           |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT      | 62.106.947,73  | 21,37         | 0,00           |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 32.486.178,71  | 11,18         | -              |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS      | 1.414.593,32   | 0,49          | 1,64           |
| GENIAL GESTÃO LTDA         | 15.745,54      | 0,01          | -              |

**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>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>                  | 1,11% | 3,48%  | 3,51%  | 7,37%   | 16,29%  | 36,35% | -       | -                |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1                | 0,50% | 14,67% | 14,67% | -80,73% | 811,71% | 23,14% | -       | -                |
| <b>IMA Geral (Benchmark)</b>                           | 0,52% | 1,64%  | 1,64%  | 5,51%   | 12,59%  | 24,78% | -       | -                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                | 0,06% | 0,12%  | 0,12%  | 4,82%   | 11,55%  | 19,65% | 1,08%   | 3,88%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                             | 0,84% | 2,46%  | 2,46%  | 5,42%   | 12,28%  | 27,08% | -       | -                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA               | 0,84% | 2,43%  | 2,43%  | 5,35%   | 12,09%  | 26,68% | 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%            |
| 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% | -       | -                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I            | 0,75% | 2,01%  | 2,01%  | 4,99%   | 9,42%   | 20,58% | 0,44%   | 1,69%            |
| 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%            |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA           | 0,74% | 1,97%  | 1,97%  | 4,93%   | 9,33%   | 20,23% | 0,44%   | 1,70%            |
| 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>IMA-B (Benchmark)</b>                               | 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%            |
| 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%            |



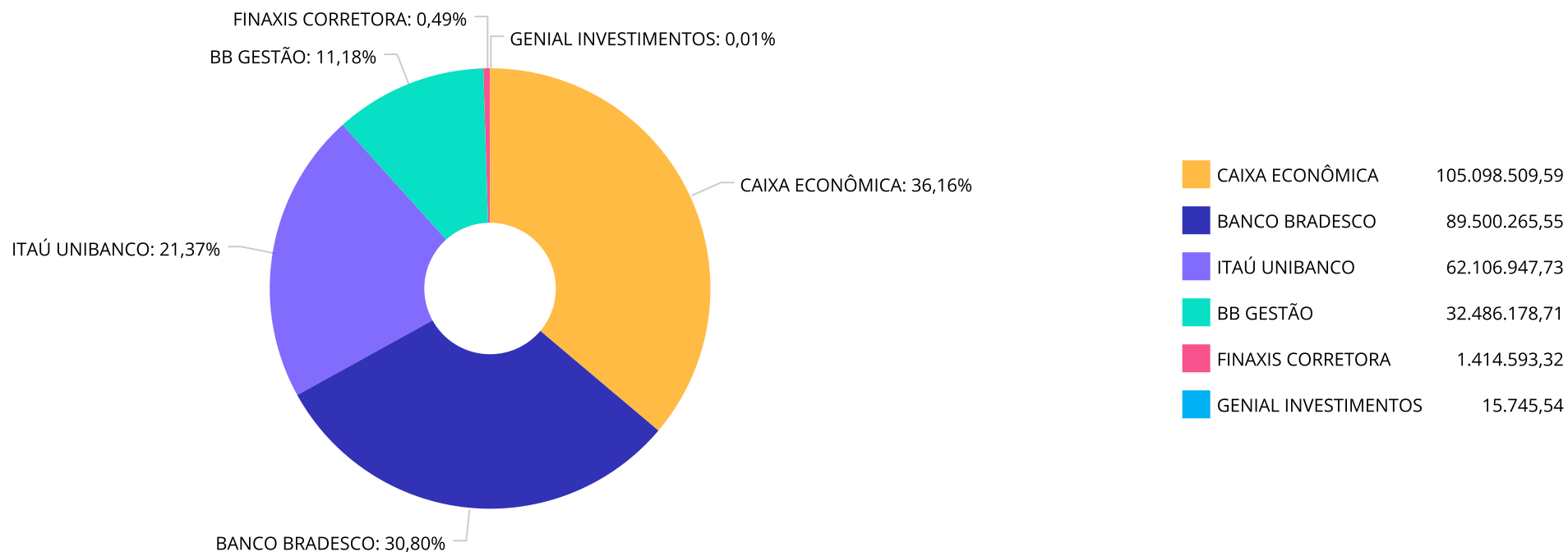
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA FIXA**

|  | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M     | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 0,05%  | 0,10%  | 0,10%  | 4,78%  | 11,47%  | 19,46%  | 1,08%   | 3,89%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                       | 0,83%  | 2,62%  | 2,62%  | 5,54%  | 12,36%  | 27,28%  | -       | -                |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI               | 0,91%  | 2,92%  | 2,92%  | 6,02%  | 13,31%  | 28,84%  | 0,03%   | 0,09%            |
| 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%            |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                         | 0,83%  | 2,61%  | 2,61%  | 5,48%  | 12,28%  | 27,05%  | 0,01%   | 0,06%            |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI             | 0,90%  | 2,80%  | 2,80%  | 5,92%  | 13,23%  | 28,55%  | 0,03%   | 0,09%            |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP               | 0,79%  | 2,55%  | 2,55%  | 5,41%  | 12,25%  | 26,99%  | 0,07%   | 0,11%            |
| 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%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                      | 0,16%  | 1,42%  | 1,42%  | 2,51%  | 3,93%   | 8,76%   | -       | -                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA          | 0,55%  | 1,59%  | 1,59%  | 5,69%  | 13,03%  | 23,64%  | 0,42%   | 2,70%            |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA               | 0,58%  | 1,80%  | 1,80%  | 4,77%  | 11,99%  | 25,10%  | 0,55%   | 1,35%            |
| <b>Não definido (Benchmark)</b>                              | -      | -      | -      | -      | -       | -       | -       | -                |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1  | -0,50% | -1,42% | -1,42% | -7,00% | -15,14% | -62,09% | 0,73%   | 7,76%            |

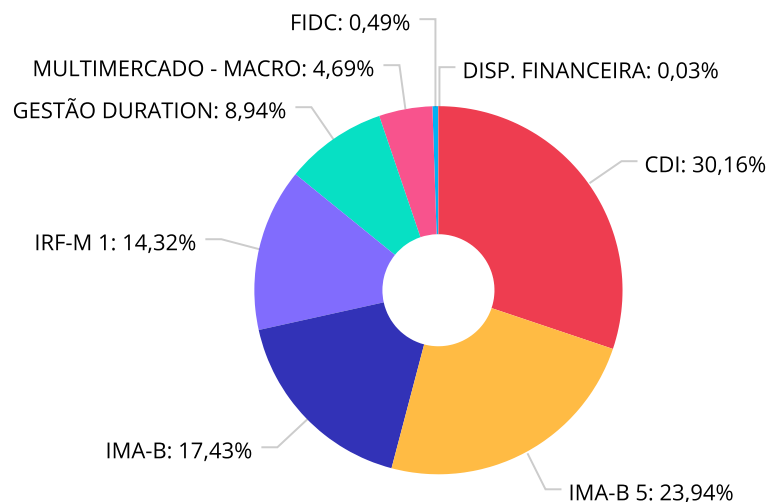
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL

|   | Mês   | Ano   | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark)                               | 0,83% | 2,62% | 2,62% | 5,54% | 12,36% | 27,28% | -       | -                |
| BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 0,59% | 2,04% | 2,04% | 5,17% | 11,62% | 26,53% | 0,36%   | 0,65%            |

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



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

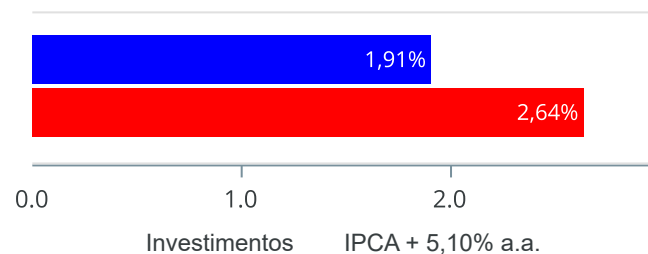


|                   |               |                        |               |         |               |                    |               |
|-------------------|---------------|------------------------|---------------|---------|---------------|--------------------|---------------|
| ■ CDI             | 87.694.838,20 | ■ IMA-B 5              | 69.589.709,47 | ■ IMA-B | 50.673.249,04 | ■ IRF-M 1          | 41.619.881,13 |
| ■ GESTÃO DURATION | 25.979.850,30 | ■ MULTIMERCADO - MACRO | 13.634.373,44 | ■ FIDC  | 1.430.338,86  | ■ DISP. FINANCEIRA | 95.243,02     |

**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   | 285.696.223,56 | 3.565.771,87 | 3.660.000,00 | 287.271.851,08 | 1.669.855,65 | 1.669.855,65 | 0,58%       | 0,58%        | 0,86%    | 0,86%     | 68,20%   | 0,42% |
| Fevereiro | 287.271.851,08 | 3.249.820,55 | 3.565.936,79 | 288.885.194,56 | 1.929.459,72 | 3.599.315,37 | 0,67%       | 1,26%        | 1,21%    | 2,08%     | 60,69%   | 0,31% |
| Março     | 288.885.194,56 | 2.044.579,11 | 2.155.255,80 | 290.622.240,44 | 1.847.722,57 | 5.447.037,94 | 0,64%       | 1,91%        | 0,56%    | 2,64%     | 72,15%   | 0,38% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



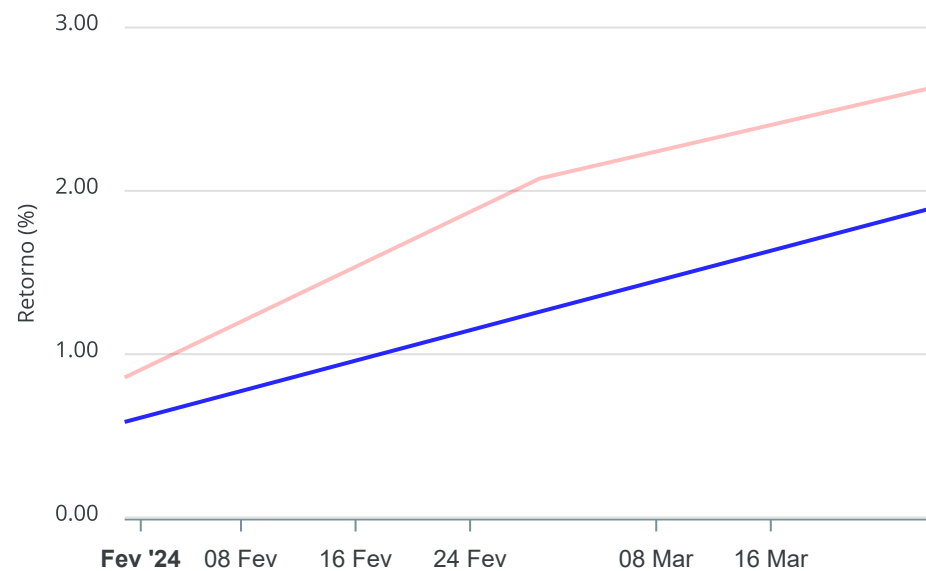
**Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores**

**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 |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1               | 15.667,78      | 0,00         | 255,80       | 15.745,54     | 333,56        | 2,13%       | -          | -         |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI         | 18.492.677,03  | 0,00         | 0,00         | 18.661.043,29 | 168.366,26    | 0,91%       | 0,91%      | 0,03%     |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 7.420.859,74   | 1.758,56     | 0,00         | 7.485.908,96  | 63.290,66     | 0,85%       | 0,85%      | 0,01%     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI      | 12.090.334,89  | 0,00         | 2.155.000,00 | 10.038.036,49 | 102.701,60    | 0,85%       | 0,90%      | 0,03%     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA              | 11.396.115,38  | 0,00         | 0,00         | 11.492.149,14 | 96.033,76     | 0,84%       | 0,84%      | 0,09%     |
| BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA        | 17.346.259,83  | 0,00         | 0,00         | 17.488.738,92 | 142.479,09    | 0,82%       | 0,82%      | 0,09%     |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO... | 21.043.978,38  | 0,00         | 0,00         | 21.215.508,02 | 171.529,64    | 0,82%       | 0,82%      | 0,01%     |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                  | 3.722.072,04   | 130.000,00   | 0,00         | 3.883.268,45  | 31.196,41     | 0,81%       | 0,83%      | 0,01%     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 12.539.133,44  | 0,00         | 0,00         | 12.638.993,07 | 99.859,63     | 0,80%       | 0,80%      | 0,08%     |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 26.202.991,31  | 0,00         | 0,00         | 26.411.072,99 | 208.081,68    | 0,79%       | 0,79%      | 0,07%     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I           | 12.758.154,11  | 0,00         | 0,00         | 12.854.363,61 | 96.209,50     | 0,75%       | 0,75%      | 0,44%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 16.700.709,76  | 0,00         | 0,00         | 16.826.414,26 | 125.704,50    | 0,75%       | 0,75%      | 0,44%     |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 20.853.360,40  | 0,00         | 0,00         | 21.010.073,15 | 156.712,75    | 0,75%       | 0,75%      | 0,44%     |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA          | 18.760.340,92  | 0,00         | 0,00         | 18.898.858,45 | 138.517,53    | 0,74%       | 0,74%      | 0,44%     |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 12.198.768,66  | 0,00         | 0,00         | 12.269.255,84 | 70.487,18     | 0,58%       | 0,58%      | 0,55%     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 13.236.678,52  | 399.820,55   | 0,00         | 13.710.594,46 | 74.095,39     | 0,54%       | 0,55%      | 0,42%     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA               | 10.122.450,58  | 0,00         | 0,00         | 10.128.535,58 | 6.085,00      | 0,06%       | 0,06%      | 1,08%     |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 3.987.819,35   | 0,00         | 0,00         | 3.990.196,60  | 2.377,25      | 0,06%       | 0,06%      | 1,09%     |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...  | 19.292.346,36  | 1.513.000,00 | 0,00         | 20.817.251,45 | 11.905,09     | 0,06%       | 0,05%      | 1,08%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 15.728.359,17  | 0,00         | 0,00         | 15.737.265,41 | 8.906,24      | 0,06%       | 0,06%      | 1,08%     |

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    |
|-------------------------|-----------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1   | 1.421.632,12          | 0,00                | 0,00                | 1.414.593,32          | -7.038,80           | -0,50%       | -0,50%     | 0,73%        |
| <b>Total Renda Fixa</b> | <b>275.330.709,77</b> | <b>2.044.579,11</b> | <b>2.155.255,80</b> | <b>276.987.867,00</b> | <b>1.767.833,92</b> | <b>0,64%</b> |            | <b>0,38%</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    |
|---|----------------------|-------------|-------------|----------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 13.554.484,79        | 0,00        | 0,00        | 13.634.373,44        | 79.888,65        | 0,59%        | 0,59%      | 0,36%        |
| <b>Total Renda Variável</b>                   | <b>13.554.484,79</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>13.634.373,44</b> | <b>79.888,65</b> | <b>0,59%</b> |            | <b>0,36%</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 |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-------------|------------|
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 25.753.739,84  | 0,00         | 0,00         | 26.411.072,99 | 657.333,15    | 2,55%       | 2,55%      |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO... | 20.684.470,34  | 0,00         | 0,00         | 21.215.508,02 | 531.037,68    | 2,57%       | 2,57%      |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI        | 17.135.648,35  | 1.000.000,00 | 0,00         | 18.661.043,29 | 525.394,94    | 2,90%       | 2,92%      |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | 16.072.884,66  | 1.000.000,00 | 0,00         | 17.488.738,92 | 415.854,26    | 2,44%       | 2,45%      |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 20.598.012,87  | 0,00         | 0,00         | 21.010.073,15 | 412.060,28    | 2,00%       | 2,00%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI      | 15.216.615,86  | 100.930,02   | 5.660.000,04 | 10.038.036,49 | 380.490,65    | 2,48%       | 2,80%      |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA         | 17.581.313,99  | 957.000,00   | 0,00         | 18.898.858,45 | 360.544,46    | 1,94%       | 1,97%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 16.495.436,82  | 0,00         | 0,00         | 16.826.414,26 | 330.977,44    | 2,01%       | 2,01%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 12.334.278,93  | 0,00         | 0,00         | 12.638.993,07 | 304.714,14    | 2,47%       | 2,47%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA              | 10.821.837,36  | 399.820,55   | 0,00         | 11.492.149,14 | 270.491,23    | 2,41%       | 2,43%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I           | 12.601.442,30  | 0,00         | 0,00         | 12.854.363,61 | 252.921,31    | 2,01%       | 2,01%      |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 12.052.515,99  | 0,00         | 0,00         | 12.269.255,84 | 216.739,85    | 1,80%       | 1,80%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 12.704.673,02  | 799.641,10   | 0,00         | 13.710.594,46 | 206.280,34    | 1,53%       | 1,59%      |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 7.287.016,94   | 6.031,57     | 0,00         | 7.485.908,96  | 192.860,45    | 2,64%       | 2,65%      |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                  | 3.673.780,69   | 233.748,29   | 120.000,00   | 3.883.268,45  | 95.739,47     | 2,45%       | 2,61%      |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ... | 16.432.136,95  | 4.363.000,00 | 0,00         | 20.817.251,45 | 22.114,50     | 0,11%       | 0,10%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 15.717.265,00  | 0,00         | 0,00         | 15.737.265,41 | 20.000,41     | 0,13%       | 0,13%      |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 3.985.966,91   | 0,00         | 0,00         | 3.990.196,60  | 4.229,69      | 0,11%       | 0,11%      |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1               | 13.731,56      | 0,00         | 1.192,55     | 15.745,54     | 3.206,53      | 23,35%      | 14,67%     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA               | 13.736.649,16  | 0,00         | 3.600.000,00 | 10.128.535,58 | -8.113,58     | -0,06%      | 0,12%      |

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 |
|-------------------------|-----------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1   | 1.434.973,07          | 0,00                | 0,00                | 1.414.593,32          | -20.379,75          | -1,42%       | -1,42%     |
| <b>Total Renda Fixa</b> | <b>272.334.390,61</b> | <b>8.860.171,53</b> | <b>9.381.192,59</b> | <b>276.987.867,00</b> | <b>5.174.497,45</b> | <b>1,84%</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 |
|---|----------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|
| BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 13.361.832,95        | 0,00        | 0,00        | 13.634.373,44        | 272.540,49        | 2,04%        | 2,04%      |
| <b>Total Renda Variável</b>                   | <b>13.361.832,95</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>13.634.373,44</b> | <b>272.540,49</b> | <b>2,04%</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.



