

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

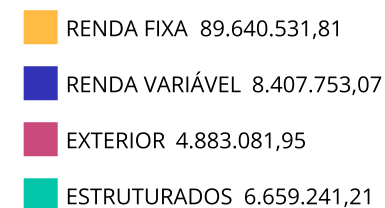
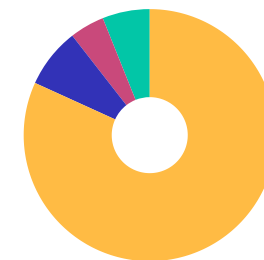
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|---------|---------------|--------------|--------------------|----------|------------------|---------------------------------------|
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 1.710.830,09 | 1,56% | 449 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' ' |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 483.348,89 | 0,44% | 116 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' ' |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 8.712.254,86 | 7,95% | 441 | 0,15% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' ' |
| ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 802.562,64 | 0,73% | 407 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' ' |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R... | D+0 | Não há | 4.787.460,84 | 4,37% | 461 | 0,17% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' ' |
| LETRA FINANCEIRA SANTANDER | S/Info | Não se aplica | 1.081.063,18 | 0,99% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | D+25 | Não há | 2.852.769,00 | 2,60% | 909 | 0,45% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 375.171,77 | 0,34% | 88 | 0,09% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES | D+4 | Não há | 138.436,36 | 0,13% | 5.997 | 0,06% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 160.117,29 | 0,15% | 5.988 | 0,14% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES | D+23 | Não há | 1.673.533,63 | 1,53% | 116 | 0,24% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 207.897,50 | 0,19% | 2.134 | 0,10% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 401.078,02 | 0,37% | 5.273 | 0,06% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 1.525.699,59 | 1,39% | 64 | 0,62% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAU MOMENTO 30 II FIC AÇÕES | D+23 du | Não há | 435.105,36 | 0,40% | 64 | 0,30% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAU SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 637.944,55 | 0,58% | 8.546 | 0,17% | Artigo 8º, Inciso I |
| BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+5 | Não há | 1.012.171,64 | 0,92% | 65 | 0,80% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 3.870.910,31 | 3,53% | 470 | 0,17% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | D+4 | Não há | 556.627,74 | 0,51% | 4.902 | 0,04% | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L... | D+15 | Não há | 1.808.949,41 | 1,65% | 112 | 0,32% | Artigo 10º, Inciso I |

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|---------|----------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|----------------------|
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | D+4 | Não há | 2.005.440,34 | 1,83% | 5.022 | 0,38% | Artigo 10º, Inciso I |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA... | D+1 | Não há | 1.515.301,37 | 1,38% | 33 | 1,56% | Artigo 10º, Inciso I |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 772.922,35 | 0,71% | 598 | 0,06% | Artigo 10º, Inciso I |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 109.590.608,04 | | | | |

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

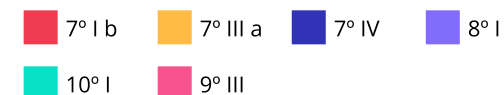
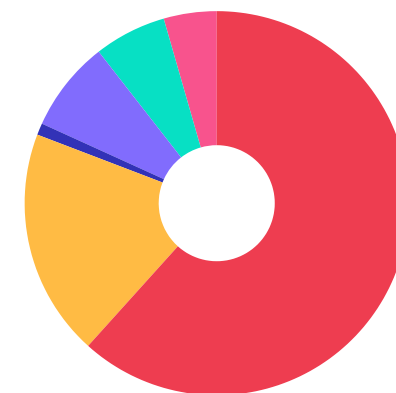
| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 15,37% | 40,00% | 43.836.243,22 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 67.589.265,99 | 61,67% | 0,00% | 15,92% | 95,00% | 36.521.811,65 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 20.970.202,64 | 19,14% | 0,00% | 15,39% | 45,00% | 28.345.570,98 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 1.081.063,18 | 0,99% | 0,00% | 15,39% | 20,00% | 20.837.058,43 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 89.640.531,81 | 81,80% | 0,00% | 62,07% | 200,00% | |



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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 | | | GAP Superior |
|---|---------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 8.407.753,07 | 7,67% | 0,00% | 25,74% | 30,00% | 24.469.429,34 |
| Artigo 8º, Inciso II | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 30,00% | 32.877.182,41 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 6.659.241,21 | 6,08% | 0,00% | 2,58% | 10,00% | 4.299.819,59 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5.479.530,40 |
| Artigo 11º | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 1,68% | 5,00% | 5.479.530,40 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 15.066.994,28 | 13,75% | 0,00% | 30,00% | 80,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2024 | | | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|---------------------|--------------|--|--------------|---------------|--------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 4.883.081,95 | 4,46% | 0,00% | 6,93% | 10,00% | 6.075.978,85 |
| Total Exterior | 10,00% | 4.883.081,95 | 4,46% | 0,00% | 6,93% | 10,00% | |



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 | 40,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 67.589.265,99 | 61,67 | 0,00 | 95,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 20.970.202,64 | 19,14 | 0,00 | 45,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 8.407.753,07 | 7,67 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 4.883.081,95 | 4,46 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 6.659.241,21 | 6,08 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 11º | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 12º | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2024)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM | 59.612.784,92 | 54,40 | - |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT | 17.821.746,68 | 16,26 | - |
| SICREDI | 10.456.293,98 | 9,54 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 10.314.917,28 | 9,41 | - |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 5.704.992,16 | 5,21 | - |
| BRANCO ASSET MANAGEMENT | 4.598.809,84 | 4,20 | - |
| BANCO SANTANDER | 1.081.063,18 | 0,99 | - |

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 Fevereiro/2024 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 0,42% | 1,23% | 2,70% | 4,46% | 10,12% | 22,51% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,44% | 1,17% | 2,59% | 4,43% | 9,99% | 22,02% | 0,48% | 1,70% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,45% | 1,16% | 2,59% | 4,30% | 9,78% | 22,13% | 0,48% | 1,73% |
| IMA Geral (Benchmark) | 0,64% | 1,11% | 2,75% | 5,15% | 14,09% | 26,08% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 0,53% | 0,06% | 2,79% | 3,75% | 14,43% | 23,22% | 0,79% | 3,97% |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,63% | 1,08% | 2,70% | 5,06% | 14,00% | 25,93% | 0,40% | 1,76% |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,76% | 1,61% | 2,53% | 5,52% | 12,71% | 27,14% | - | - |
| SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA | 0,75% | 1,59% | 2,49% | 5,41% | 12,51% | 26,69% | 0,09% | 0,30% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,74% | 1,66% | 2,56% | 5,48% | 12,54% | 26,69% | 0,09% | 0,29% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 0,59% | 1,28% | 2,76% | 4,42% | 10,44% | 23,21% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 0,58% | 1,24% | 2,71% | 4,33% | 10,23% | 22,77% | 0,41% | 1,76% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,58% | 1,24% | 2,70% | 4,32% | 10,29% | 22,91% | 0,41% | 1,75% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -2,07% | -0,98% | -0,07% | 2,27% | 4,36% | 9,06% | 4,79% | 3,92% |
| IMA-B (Benchmark) | 0,55% | 0,10% | 2,85% | 3,87% | 14,70% | 23,81% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,54% | 0,07% | 2,80% | 3,78% | 14,54% | 23,41% | 0,79% | 3,95% |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark) | 0,80% | 1,78% | 2,69% | 5,69% | 12,74% | 27,40% | - | - |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,90% | 1,99% | 2,95% | 6,17% | 13,60% | 28,88% | 0,05% | 0,09% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,80% | 1,78% | 2,70% | 5,67% | 12,75% | 27,44% | 0,01% | 0,06% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,77% | 1,63% | 2,59% | 5,52% | 14,98% | 26,64% | 0,04% | 1,14% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,87% | 1,88% | 2,85% | 6,07% | 13,48% | 28,56% | 0,05% | 0,09% |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA | 0,80% | 1,78% | 2,69% | 5,65% | 12,70% | 27,23% | 0,01% | 0,06% |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,86% | 1,91% | 2,87% | 5,96% | 13,39% | 28,29% | 0,03% | 0,09% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,79% | 1,74% | 2,66% | 5,58% | 12,63% | 27,10% | 0,05% | 0,09% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 0,82% | 1,83% | 2,79% | 5,90% | 13,31% | 27,98% | 0,05% | 0,09% |
| IPCA (Benchmark) | 0,83% | 1,25% | 1,82% | 2,62% | 4,50% | 10,34% | - | - |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,57% | 1,03% | 2,60% | 4,86% | 14,72% | 25,46% | 0,47% | 2,04% |
| LETRA FINANCEIRA SANTANDER | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,56% | 1,04% | 2,66% | 4,80% | 15,14% | 24,39% | 0,49% | 2,86% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,56% | 1,21% | 2,44% | 4,59% | 12,70% | 25,41% | 0,42% | 1,32% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 0,65% | 1,54% | 2,54% | 4,59% | 12,31% | 24,71% | 0,49% | 1,02% |
| Não definido (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,58% | 1,13% | 2,85% | 1,06% | - | - | 0,65% | - |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -2,17% | -1,08% | -0,16% | 2,20% | - | - | 4,98% | - |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-------------------------------------|--------|--------|--------|-------|-----|-----|---------|------------------|
| ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA | -2,16% | -1,08% | -0,16% | 2,18% | - | - | 4,96% | - |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark) | 0,80% | 1,78% | 2,69% | 5,69% | 12,74% | 27,40% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 0,77% | 1,72% | 2,70% | 5,65% | 13,16% | 27,64% | 0,09% | 0,36% |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | 0,49% | -0,19% | 1,85% | 6,71% | 14,52% | 23,51% | 2,16% | 4,51% |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 0,34% | 0,56% | 2,10% | 6,49% | 13,16% | 25,99% | 0,90% | 3,54% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 0,56% | 1,07% | 2,91% | 6,54% | 13,66% | 24,79% | 0,47% | 3,09% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|
| Global BDRX (Benchmark) | 6,30% | 11,38% | 14,54% | 15,88% | 33,29% | 20,49% | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,27% | 11,12% | 13,99% | 15,34% | 32,07% | 18,33% | 8,72% | 14,39% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 5,06% | 8,97% | 12,09% | 13,00% | 23,72% | 12,07% | 7,84% | 13,09% |

| | | | | | | | | |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|
| Ibovespa (Benchmark) | 0,99% | -3,85% | 1,33% | 11,47% | 22,96% | 14,03% | - | - |
| CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES | 1,10% | -7,52% | 0,26% | 4,27% | 35,84% | 19,67% | 10,69% | 26,62% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 0,95% | -3,83% | 1,32% | 11,26% | 22,43% | 13,93% | 6,85% | 15,61% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 0,73% | -3,45% | 1,76% | 6,61% | 17,41% | 6,48% | 6,41% | 15,70% |
| ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES | -0,07% | -6,31% | -1,30% | 1,54% | 5,47% | -14,31% | 7,85% | 18,80% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | -0,02% | -6,21% | -1,08% | 1,82% | 6,33% | -12,85% | 7,84% | 18,75% |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 0,24% | -3,47% | 1,09% | 9,05% | 31,48% | 28,06% | 7,22% | 16,39% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES | 1,03% | -3,15% | 2,54% | 10,82% | 21,59% | 10,73% | 6,76% | 16,22% |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | -0,03% | -8,46% | -3,00% | -1,70% | 4,35% | -28,34% | 9,06% | 23,28% |

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

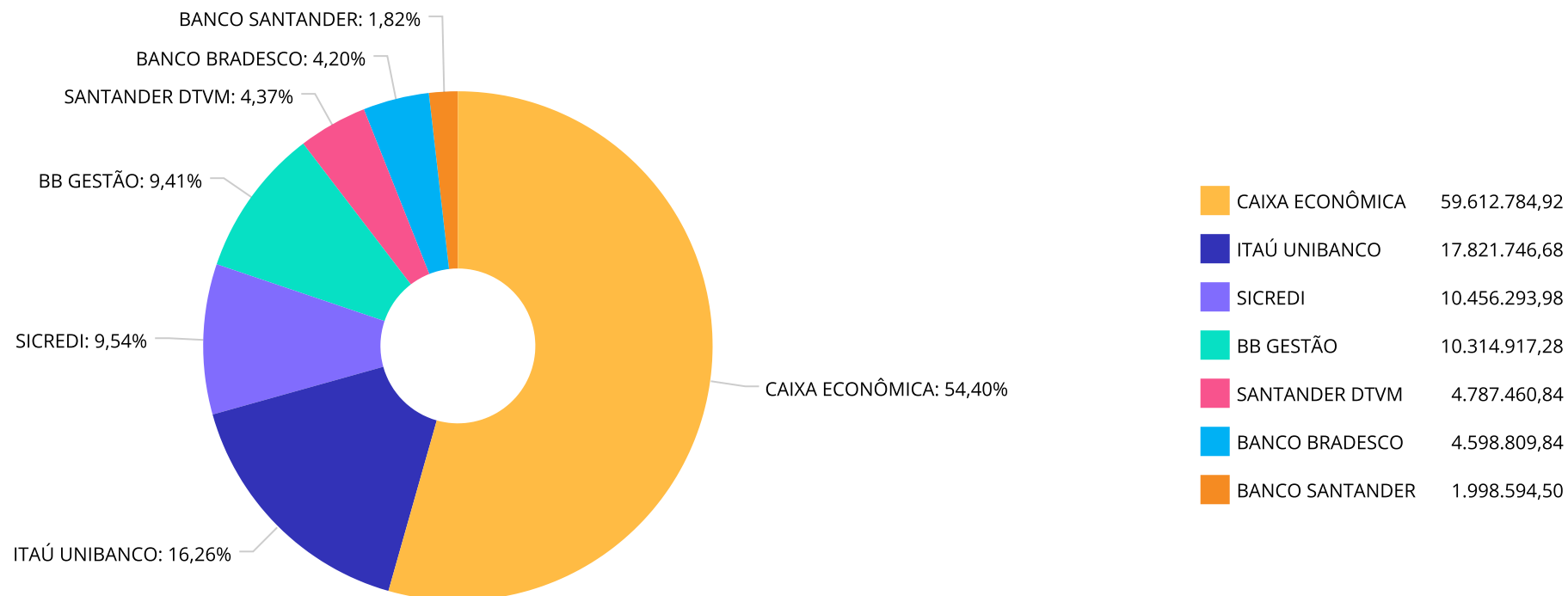
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark) | 5,17% | 6,84% | 11,57% | 13,06% | 28,36% | 16,23% | - | - |
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO | 5,68% | 7,44% | 13,00% | 16,00% | 36,71% | 35,93% | 5,25% | 12,33% |

| | | | | | | | | |
|------------------------------------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|
| SMLL (Benchmark) | 0,47% | -6,11% | 0,51% | 1,70% | 19,40% | -4,74% | - | - |
| ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES | 0,64% | -5,16% | 1,90% | 2,82% | 16,73% | -1,85% | 8,14% | 19,64% |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 0,38% | -6,23% | 0,26% | 1,15% | 18,13% | -6,20% | 8,55% | 21,41% |

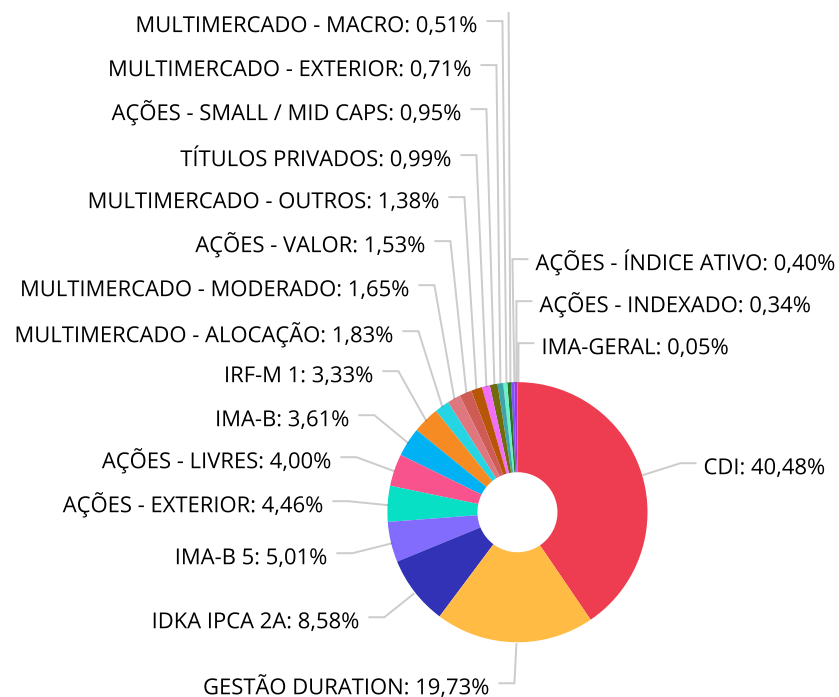
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 6,30% | 11,38% | 14,54% | 15,88% | 33,29% | 20,49% | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,27% | 11,12% | 13,99% | 15,34% | 32,07% | 18,33% | 8,72% | 14,393% |
| BRAPRES INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 5,06% | 8,97% | 12,09% | 13,00% | 23,72% | 12,07% | 7,84% | 13,090% |

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



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

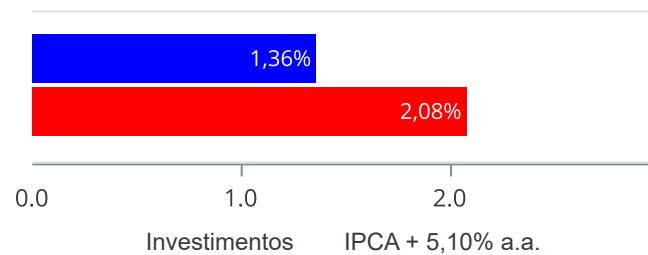


| | | | | | | | |
|---------------------------|---------------|----------------------------|---------------|---------------------------|--------------|-------------------------|--------------|
| ■ CDI | 44.365.408,32 | ■ GESTÃO DURATION | 21.626.234,54 | ■ IDKA IPCA 2A | 9.403.292,19 | ■ IMA-B 5 | 5.492.541,22 |
| ■ AÇÕES - EXTERIOR | 4.883.081,95 | ■ AÇÕES - LIVRES | 4.378.468,59 | ■ IMA-B | 3.958.398,91 | ■ IRF-M 1 | 3.654.682,58 |
| ■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO | 2.005.440,34 | ■ MULTIMERCADO - MODERADO | 1.808.949,41 | ■ AÇÕES - VALOR | 1.673.533,63 | ■ MULTIMERCADO - OUTROS | 1.515.301,37 |
| ■ TÍTULOS PRIVADOS | 1.081.063,18 | ■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS | 1.039.022,57 | ■ MULTIMERCADO - EXTERIOR | 772.922,35 | ■ MULTIMERCADO - MACRO | 556.627,74 |
| ■ AÇÕES - SETORIAIS | 506.451,15 | ■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 435.105,36 | ■ AÇÕES - INDEXADO | 375.171,77 | ■ IMA-GERAL | 58.910,87 |

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

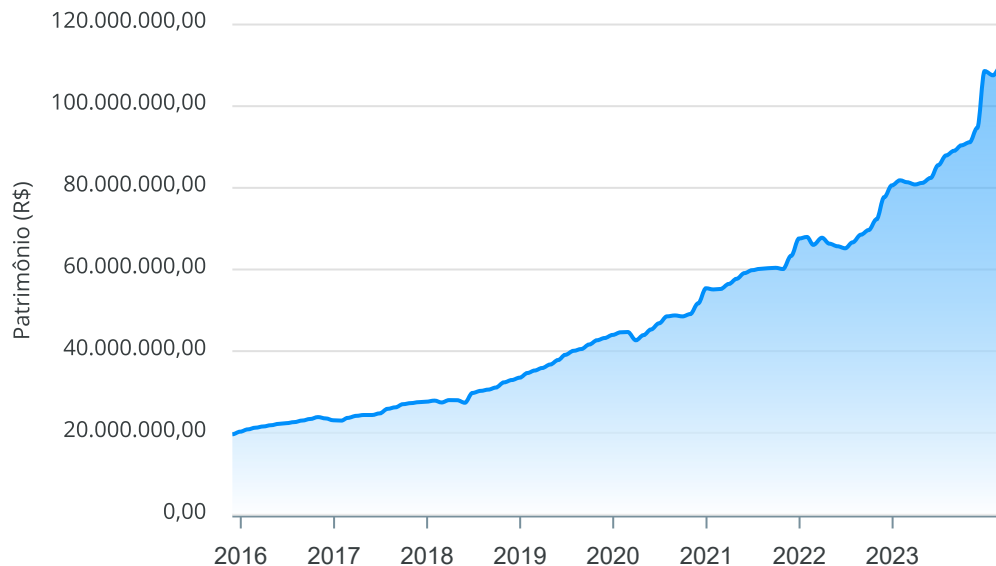
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|----------------|--------------|--------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 108.595.135,77 | 807.607,41 | 2.304.753,66 | 107.564.868,65 | 466.879,13 | 466.879,13 | 0,43% | 0,43% | 0,86% | 0,86% | 50,16% | 1,13% |
| Fevereiro | 107.564.868,65 | 2.182.020,34 | 1.161.734,92 | 109.590.608,04 | 1.005.453,97 | 1.472.333,10 | 0,93% | 1,36% | 1,21% | 2,08% | 65,50% | 1,46% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



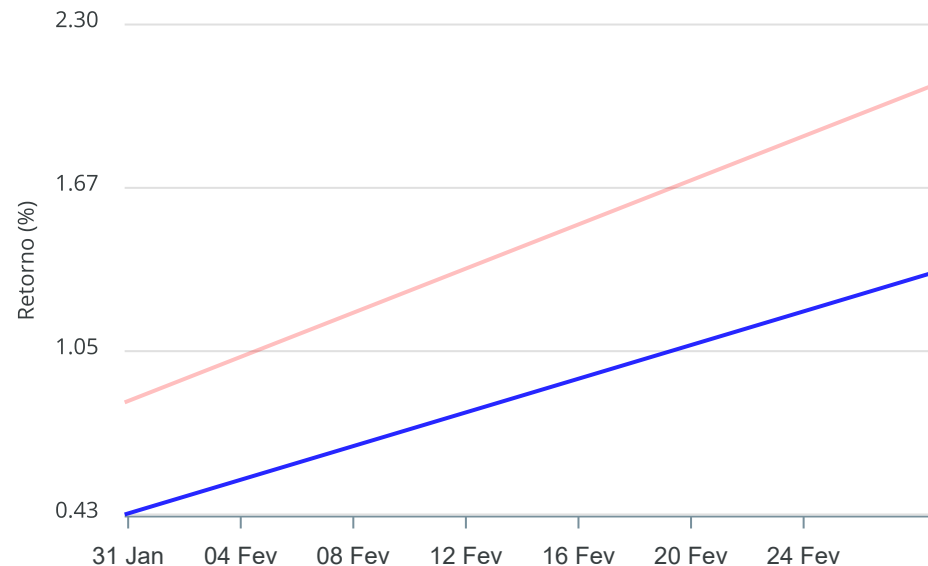
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Fevereiro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------|------------|--------------|---------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.695.636,55 | 0,00 | 0,00 | 1.710.830,09 | 15.193,54 | 0,90% | 0,90% | 0,05% |
| LETRA FINANCEIRA SANTANDER | 1.071.820,60 | 0,00 | 0,00 | 1.081.063,18 | 9.242,58 | 0,86% | - | - |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF... | 4.746.554,92 | 0,00 | 0,00 | 4.787.460,84 | 40.905,92 | 0,86% | 0,86% | 0,03% |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA | 10.373.060,69 | 0,00 | 0,00 | 10.456.293,98 | 83.233,29 | 0,80% | 0,80% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.044.987,96 | 0,00 | 0,00 | 10.123.991,77 | 79.003,81 | 0,79% | 0,79% | 0,05% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 3.317.417,47 | 30.906,71 | 0,00 | 3.374.010,16 | 25.685,98 | 0,77% | 0,77% | 0,04% |
| SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA | 910.707,52 | 0,00 | 0,00 | 917.531,32 | 6.823,80 | 0,75% | 0,75% | 0,09% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.716.985,64 | 0,00 | 0,00 | 2.737.151,26 | 20.165,62 | 0,74% | 0,74% | 0,09% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 9.641.018,48 | 0,00 | 1.000.000,00 | 8.712.254,86 | 71.236,38 | 0,74% | 0,82% | 0,05% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 2.343.042,79 | 235.953,84 | 0,00 | 2.597.937,21 | 18.940,58 | 0,73% | 0,80% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2.191.690,45 | 0,00 | 63.715,73 | 2.144.061,31 | 16.086,59 | 0,73% | -2,17% | 4,98% |
| ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA | 1.625.768,77 | 0,00 | 46.987,54 | 1.590.612,32 | 11.831,09 | 0,73% | -2,16% | 4,96% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.469.748,46 | 0,00 | 41.031,65 | 1.439.403,30 | 10.686,49 | 0,73% | -2,06% | 4,79% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 480.220,16 | 0,00 | 0,00 | 483.348,89 | 3.128,73 | 0,65% | 0,65% | 0,49% |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | 58.541,96 | 0,00 | 0,00 | 58.910,87 | 368,91 | 0,63% | 0,63% | 0,40% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 1.969.708,23 | 0,00 | 0,00 | 1.981.092,88 | 11.384,65 | 0,58% | 0,58% | 0,41% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.566.752,55 | 0,00 | 0,00 | 2.581.555,23 | 14.802,68 | 0,58% | 0,58% | 0,41% |
| CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 924.570,37 | 0,00 | 0,00 | 929.893,11 | 5.322,74 | 0,58% | 0,58% | 0,65% |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1.865.112,29 | 0,00 | 0,00 | 1.875.808,11 | 10.695,82 | 0,57% | 0,57% | 0,47% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 5.717.840,03 | 46.987,54 | 0,00 | 5.796.762,26 | 31.934,69 | 0,55% | 0,56% | 0,49% |

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,00 | 798.172,25 | 0,00 | 802.562,64 | 4.390,39 | 0,55% | 0,86% | 0,05% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 8.981.465,35 | 1.070.000,00 | 10.000,00 | 10.096.305,12 | 54.839,77 | 0,55% | 0,55% | 0,42% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.188.258,63 | 0,00 | 0,00 | 1.194.655,55 | 6.396,92 | 0,54% | 0,54% | 0,79% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 2.749.156,29 | 0,00 | 0,00 | 2.763.743,36 | 14.587,07 | 0,53% | 0,53% | 0,79% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 4.323.735,96 | 0,00 | 0,00 | 4.342.969,91 | 19.233,95 | 0,44% | 0,44% | 0,48% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 5.038.203,15 | 0,00 | 0,00 | 5.060.322,28 | 22.119,13 | 0,44% | 0,44% | 0,48% |
| Total Renda Fixa | 88.012.005,27 | 2.182.020,34 | 1.161.734,92 | 89.640.531,81 | 608.241,12 | 0,68% | | 0,51% |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|--|----------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 731.390,30 | 0,00 | 0,00 | 772.922,35 | 41.532,05 | 5,68% | 5,68% | 5,25% |
| CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES | 136.936,45 | 0,00 | 0,00 | 138.436,36 | 1.499,91 | 1,10% | 1,10% | 10,69% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES | 1.656.480,01 | 0,00 | 0,00 | 1.673.533,63 | 17.053,62 | 1,03% | 1,03% | 6,76% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 371.657,45 | 0,00 | 0,00 | 375.171,77 | 3.514,32 | 0,95% | 0,95% | 6,85% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 1.503.699,52 | 0,00 | 0,00 | 1.515.301,37 | 11.601,85 | 0,77% | 0,77% | 0,09% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 2.832.248,80 | 0,00 | 0,00 | 2.852.769,00 | 20.520,20 | 0,72% | 0,72% | 6,41% |
| ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES | 633.891,82 | 0,00 | 0,00 | 637.944,55 | 4.052,73 | 0,64% | 0,64% | 8,14% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 553.529,16 | 0,00 | 0,00 | 556.627,74 | 3.098,58 | 0,56% | 0,56% | 0,47% |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | 1.995.594,33 | 0,00 | 0,00 | 2.005.440,34 | 9.846,01 | 0,49% | 0,49% | 2,16% |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 399.554,12 | 0,00 | 0,00 | 401.078,02 | 1.523,90 | 0,38% | 0,38% | 8,55% |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 1.802.851,28 | 0,00 | 0,00 | 1.808.949,41 | 6.098,13 | 0,34% | 0,34% | 0,90% |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 207.408,35 | 0,00 | 0,00 | 207.897,50 | 489,15 | 0,24% | 0,24% | 7,22% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 1.526.041,99 | 0,00 | 0,00 | 1.525.699,59 | -342,40 | -0,02% | -0,02% | 7,84% |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | 160.170,89 | 0,00 | 0,00 | 160.117,29 | -53,60 | -0,03% | -0,03% | 9,06% |
| ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES | 435.420,22 | 0,00 | 0,00 | 435.105,36 | -314,86 | -0,07% | -0,07% | 7,85% |
| Total Renda Variável | 14.946.874,69 | 0,00 | 0,00 | 15.066.994,28 | 120.119,59 | 0,80% | | 4,71% |

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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 3.642.534,38 | 0,00 | 0,00 | 3.870.910,31 | 228.375,93 | 6,27% | 6,27% | 8,72% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 963.454,31 | 0,00 | 0,00 | 1.012.171,64 | 48.717,33 | 5,06% | 5,06% | 7,84% |
| Total Exterior | 4.605.988,69 | 0,00 | 0,00 | 4.883.081,95 | 277.093,26 | 6,02% | | 8,54% |

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.

