

# Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

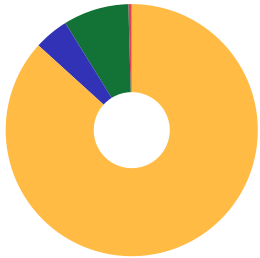
| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência   | Saldo        | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                   |
|-----------------------------------------------------|---------|------------|--------------|--------------------|----------|------------------|---------------------------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3     | Não há     | 8.461.375,39 | 8,90%              | 702      | 0,13%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1     | Não há     | 7.648.370,51 | 8,04%              | 883      | 0,13%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1     | Não há     | 4.873.019,13 | 5,13%              | 795      | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1     | Não há     | 3.254.606,84 | 3,42%              | 650      | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0     | Não há     | 7.181.190,70 | 7,55%              | 1.144    | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1     | Não há     | 1.872.028,42 | 1,97%              | 641      | 0,05%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P... | D+0     | 15/08/2024 | 4.551.473,55 | 4,79%              | 315      | 0,17%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P... | D+0     | 15/05/2027 | 718.089,91   | 0,76%              | 199      | 0,07%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | D+0     | 15/08/2024 | 521.531,52   | 0,55%              | 92       | 0,24%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | D+0     | 15/08/2024 | 2.984.036,54 | 3,14%              | 370      | 0,08%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | 15/08/2024 | 3.336.918,22 | 3,51%              | 305      | 0,08%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA      | D+0     | Não há     | 6.833.211,01 | 7,19%              | 791      | 0,13%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há     | 3.585.327,94 | 3,77%              | 1.190    | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0     | Não há     | 1.222.697,47 | 1,29%              | 450      | 0,05%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA                 | D+0     | 16/08/2024 | 1.786.326,57 | 1,88%              | 30       | 0,79%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA... | D+1     | Não há     | 2.176.576,00 | 2,29%              | 217      | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA       | D+0     | Não há     | 2.605.325,64 | 2,74%              | 1.696    | 0,12%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO      | D+0     | Não há     | 131.191,05   | 0,14%              | 1.003    | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0     | Não há     | 4.274.510,73 | 4,50%              | 1.134    | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA             | D+4     | Não há     | 3.410.792,65 | 3,59%              | 150      | 0,46%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

| Produto / Fundo                                     | Resgate    | Carência      | Saldo                | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                   |
|-----------------------------------------------------|------------|---------------|----------------------|--------------------|----------|------------------|---------------------------------|
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP       | D+0        | Não há        | 2.145.435,21         | 2,26%              | 989      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA         | D+1        | Não há        | 1.176.899,21         | 1,24%              | 433      | 0,14%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP        | D+1        | Não há        | 2.362.150,92         | 2,48%              | 675      | 0,33%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1                           | D+1601     | 29 dias       | 1.638.651,29         | 1,72%              | 33       | 1,32%            | Artigo 7º, Inciso V, Alínea a   |
| BB INFLAÇÃO FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO... | D+30 ou... | Não há        | 3.704.400,05         | 3,90%              | 48       | 1,21%            | Artigo 7º, Inciso V, Alínea b   |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                            | D+33       | Não há        | 378.328,97           | 0,40%              | 1.294    | 0,05%            | Artigo 8º, Inciso I             |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                       | D+3        | Não há        | 971.937,46           | 1,02%              | 17.732   | 0,07%            | Artigo 8º, Inciso I             |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                             | D+4        | Não há        | 679.526,72           | 0,71%              | 9.444    | 0,21%            | Artigo 8º, Inciso I             |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                   | D+25       | Não há        | 835.625,25           | 0,88%              | 918      | 0,13%            | Artigo 8º, Inciso I             |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES                 | D+4        | Não há        | 1.345.841,40         | 1,42%              | 4.446    | 0,61%            | Artigo 8º, Inciso I             |
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO          | D+5 du     | Não há        | 2.470.054,66         | 2,60%              | 88       | 1,98%            | Artigo 10º, Inciso I            |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP                | D+4        | Não há        | 1.482.628,27         | 1,56%              | 174      | 0,45%            | Artigo 10º, Inciso I            |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                      | D+4        | Não há        | 1.625.401,86         | 1,71%              | 5.060    | 0,30%            | Artigo 10º, Inciso I            |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA                              | Não se ... | Não se aplica | 2.416.906,83         | 2,54%              | 28       | 1,97%            | Artigo 10º, Inciso II           |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ... | Não se ... | Não se aplica | 408.772,56           | 0,43%              |          | 0,14%            | Artigo 11º                      |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>  |            |               | <b>95.071.160,45</b> |                    |          |                  |                                 |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                        |            |               | <b>2.055,63</b>      | Artigo 6º          |          |                  |                                 |
| <b>PL Total</b>                                     |            |               | <b>95.073.216,08</b> |                    |          |                  |                                 |

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Janeiro / 2024)

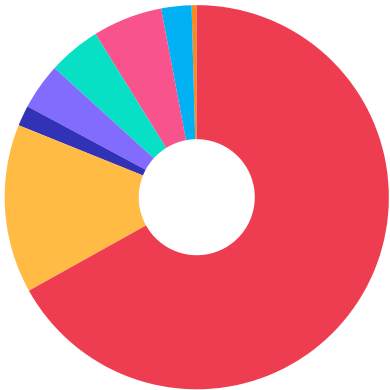
| Artigos - Renda Fixa            | Resolução | Carteira \$   | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 |        |         | GAP Superior  |
|---------------------------------|-----------|---------------|----------|-------------------------------|--------|---------|---------------|
|                                 |           |               |          | Inf                           | Alvo   | Sup     |               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea a   | 100,00%   | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 13,88% | 40,00%  | 38.028.464,18 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea b   | 100,00%   | 63.612.105,36 | 66,91%   | 0,00%                         | 13,89% | 90,00%  | 21.951.939,05 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea a | 60,00%    | 13.500.979,77 | 14,20%   | 0,00%                         | 13,89% | 40,00%  | 24.527.484,41 |
| Artigo 7º, Inciso IV            | 20,00%    | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 13,89% | 20,00%  | 19.014.232,09 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea a   | 5,00%     | 1.638.651,29  | 1,72%    | 0,00%                         | 1,83%  | 5,00%   | 3.114.906,73  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea b   | 5,00%     | 3.704.400,05  | 3,90%    | 0,00%                         | 3,91%  | 5,00%   | 1.049.157,97  |
| Total Renda Fixa                | 100,00%   | 82.456.136,47 | 86,73%   | 0,00%                         | 61,29% | 200,00% |               |



- RENDA FIXA 82.456.136,47
- RENDA VARIÁVEL 4.211.259,80
- ESTRUTURADOS 7.994.991,62
- FUNDO IMOBILIÁRIO 408.772,56

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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$   | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 |        |        | GAP Superior  |
|------------------------------------------------------|-----------|---------------|----------|-------------------------------|--------|--------|---------------|
|                                                      |           |               |          | Inf                           | Alvo   | Sup    |               |
| Artigo 8º, Inciso I                                  | 30,00%    | 4.211.259,80  | 4,43%    | 0,00%                         | 20,80% | 30,00% | 24.310.088,34 |
| Artigo 8º, Inciso II                                 | 30,00%    | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 30,00% | 28.521.348,14 |
| Artigo 10º, Inciso I                                 | 10,00%    | 5.578.084,79  | 5,87%    | 0,00%                         | 0,24%  | 10,00% | 3.929.031,26  |
| Artigo 10º, Inciso II                                | 5,00%     | 2.416.906,83  | 2,54%    | 0,00%                         | 4,71%  | 5,00%  | 2.336.651,19  |
| Artigo 11º                                           | 5,00%     | 408.772,56    | 0,43%    | 0,00%                         | 4,26%  | 5,00%  | 4.344.785,46  |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário     | 30,00%    | 12.615.023,98 | 13,27%   | 0,00%                         | 30,01% | 80,00% |               |



| 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%                                  | 7,70% | 10,00%   | 9.507.116,05 |
| Total Exterior        | 10,00%    | 0,00        | 0,00%    | 0,00%                                  | 7,70% | 10,00%   |              |

| Empréstimo Consignado | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2024 |       |          | GAP Superior |
|-----------------------|-----------|-------------|----------|----------------------------------------|-------|----------|--------------|
|                       |           |             |          | Inferior                               | Alvo  | Superior |              |
| Artigo 12º            | 5,00%     | 0,00        | 0,00%    | 0,00%                                  | 1,00% | 5,00%    | 4.753.558,02 |



**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   | 63.612.105,36                 | 66,91      | 0,00                | 90,00               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea a | 13.500.979,77                 | 14,20      | 0,00                | 40,00               |
| Artigo 7º, Inciso IV            | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 20,00               |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea a   | 1.638.651,29                  | 1,72       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea b   | 3.704.400,05                  | 3,90       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I             | 4.211.259,80                  | 4,43       | 0,00                | 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            | 5.578.084,79                  | 5,87       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 10º, Inciso II           | 2.416.906,83                  | 2,54       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 11º                      | 408.772,56                    | 0,43       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 12º                      | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

| Gestão                            | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM        | 56.158.300,42 | 59,07         | -              |
| CAIXA DTVM                        | 19.584.616,96 | 20,60         | 0,08           |
| SICREDI                           | 6.144.375,77  | 6,46          | 0,00           |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT             | 3.962.902,57  | 4,17          | 0,00           |
| BANCO BRADESCO                    | 3.410.792,65  | 3,59          | 0,06           |
| KPTL                              | 2.416.906,83  | 2,54          | 0,42           |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS             | 1.638.651,29  | 1,72          | 1,90           |
| SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT... | 1.345.841,40  | 1,42          | 0,01           |
| ZION INVEST                       | 408.772,56    | 0,43          | -              |

**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 Janeiro/2024 - RENDA FIXA**

|                                                               | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| <b>IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)</b>                        | 0,85%  | 0,85%  | 2,51%  | 4,53%  | 9,73%  | 21,87%  | -       | -                |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,55%  | 0,55%  | 4,88%  | 3,78%  | 12,92% | -       | 0,82%   | 3,05%            |
| <b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>                           | 0,81%  | 0,81%  | 4,15%  | 4,81%  | 11,43% | 23,53%  | -       | -                |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 0,71%  | 0,71%  | 3,96%  | 4,60%  | 10,93% | 23,00%  | 0,57%   | 1,88%            |
| <b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>                        | 1,01%  | 1,01%  | 2,99%  | 5,52%  | 11,82% | 26,56%  | -       | -                |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1                                     | -0,38% | -0,38% | -0,68% | -0,80% | -3,21% | -10,33% | 5,43%   | 3,55%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                    | 0,83%  | 0,83%  | 2,77%  | 5,92%  | 12,95% | 27,12%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 0,91%  | 0,91%  | 2,80%  | 5,87%  | 12,79% | 26,67%  | 0,11%   | 0,33%            |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                   | 0,93%  | 0,93%  | 2,92%  | 6,08%  | 13,21% | 27,46%  | 0,11%   | 0,33%            |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,87%  | 0,87%  | 2,74%  | 5,80%  | 12,67% | 26,44%  | 0,12%   | 0,33%            |
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                    | 0,68%  | 0,68%  | 3,99%  | 4,44%  | 11,33% | 23,79%  | -       | -                |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                   | 0,66%  | 0,66%  | 3,94%  | 4,32%  | 11,14% | 23,30%  | 0,55%   | 1,87%            |
| <b>IMA-B (Benchmark)</b>                                      | -0,45% | -0,45% | 4,97%  | 2,91%  | 15,53% | 23,80%  | -       | -                |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | -0,48% | -0,48% | 4,92%  | 2,78%  | 15,23% | 23,18%  | 1,28%   | 4,15%            |

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

|                                                        | Mês   | Ano   | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--------------------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                               | 0,67% | 0,67% | 4,68% | 6,05% | 16,31% | 27,74% | -       | -                |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,66% | 0,66% | 4,64% | 5,92% | 15,88% | 27,01% | 0,79%   | 2,43%            |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 0,67% | 0,67% | 4,66% | 5,95% | 16,08% | 27,41% | 0,79%   | 2,44%            |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP           | 0,73% | 0,73% | 4,87% | 6,04% | 16,30% | 28,15% | 0,78%   | 2,52%            |

|                                                               |       |       |       |       |        |        |       |       |
|---------------------------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                        | 0,97% | 0,97% | 2,81% | 6,04% | 12,87% | 27,33% | -     | -     |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,85% | 0,85% | 2,92% | 5,79% | 15,22% | 26,51% | 0,07% | 1,31% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP    | 0,97% | 0,97% | 2,81% | 6,04% | 12,80% | 27,43% | 0,01% | 0,09% |
| ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA                           | 1,11% | 1,11% | 2,85% | 2,34% | -      | -      | 0,33% | -     |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | 1,00% | 1,00% | 2,92% | 6,34% | 13,22% | 27,95% | 0,01% | 0,07% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 1,11% | 1,11% | 2,84% | 2,65% | 4,87%  | 9,72%  | 0,33% | 3,99% |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA                 | 0,97% | 0,97% | 2,79% | 6,02% | 12,84% | 27,21% | 0,01% | 0,06% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                | 0,88% | 0,88% | 2,56% | 5,51% | 11,76% | 24,82% | 0,01% | 0,05% |

|                                                                      |       |       |       |       |        |        |       |       |
|----------------------------------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                              | 0,42% | 0,42% | 1,27% | 2,01% | 4,51%  | 10,54% | -     | -     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ... | 0,48% | 0,48% | 4,75% | 4,60% | 15,81% | 24,85% | 0,65% | 3,04% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                       | 0,66% | 0,66% | 3,33% | 4,67% | 13,16% | 25,72% | 0,46% | 1,30% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 1,12% | 1,12% | 2,87% | 5,42% | -      | -      | 0,33% | -     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                   | 1,10% | 1,10% | 2,83% | 5,35% | 10,82% | 23,49% | 0,33% | 1,26% |
| BB INFLAÇÃO FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO             | 0,90% | 0,90% | 3,62% | 5,03% | 11,65% | 23,73% | 0,40% | 1,43% |

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

|                                                      | Mês   | Ano   | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|------------------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,11% | 1,11% | 2,84% | 5,37% | 10,86% | 22,58% | 0,33%   | 1,26%            |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA            | 0,46% | 0,46% | 3,82% | 4,85% | 15,10% | 25,59% | 0,57%   | 2,16%            |

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

|                                            | Mês    | Ano    | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--------------------------------------------|--------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>CDI (Benchmark)</b>                     | 0,97%  | 0,97%  | 2,81% | 6,04% | 12,87% | 27,33% | -       | -                |
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO | 0,54%  | 0,54%  | 3,89% | 4,97% | 11,62% | 24,41% | 0,32%   | 1,49%            |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP       | 0,76%  | 0,76%  | 3,85% | 5,98% | 12,77% | 26,37% | 0,31%   | 1,17%            |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP             | -0,68% | -0,68% | 5,38% | 5,54% | 11,80% | 24,08% | 1,84%   | 4,67%            |

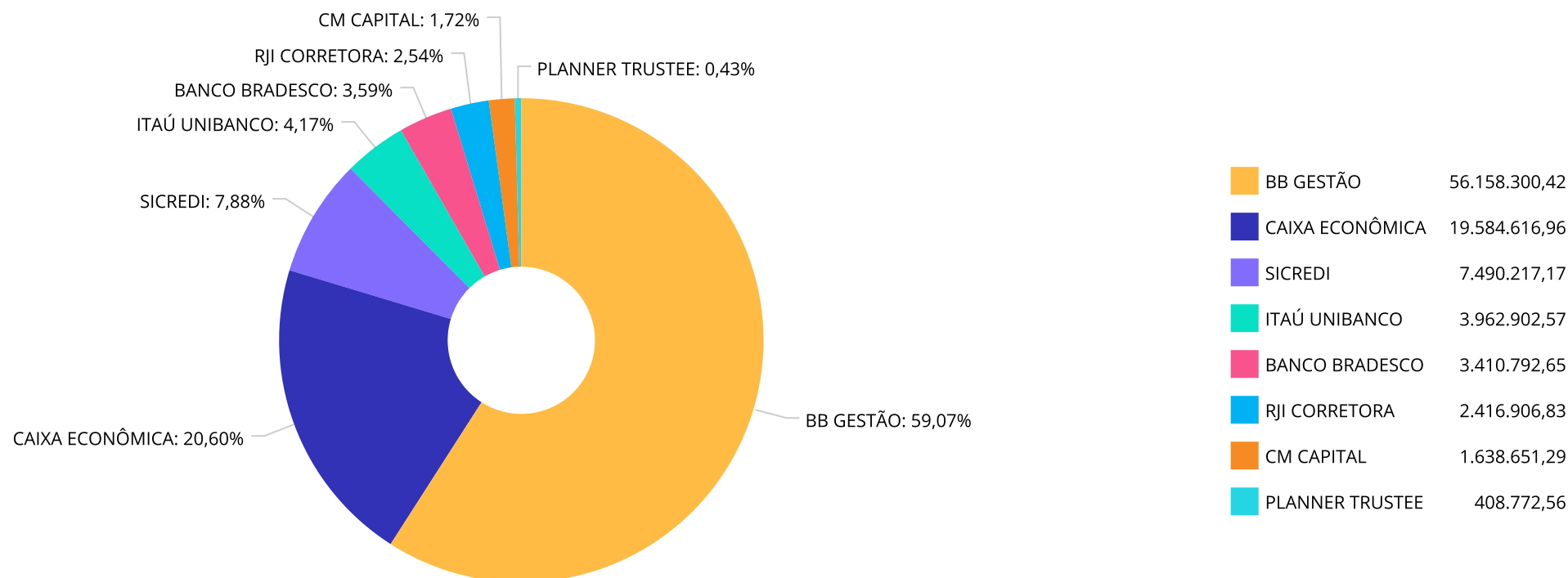
|                                     |        |        |        |       |        |        |       |        |
|-------------------------------------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|--------|
| <b>Ibovespa (Benchmark)</b>         | -4,79% | -4,79% | 12,91% | 4,76% | 12,63% | 13,92% | -     | -      |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES | -4,76% | -4,76% | 12,42% | 3,30% | 10,73% | 14,04% | 5,78% | 15,93% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES            | -4,57% | -4,57% | 13,44% | 3,06% | 7,75%  | 3,66%  | 5,68% | 16,19% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES       | -6,46% | -6,46% | 9,72%  | 2,43% | 6,50%  | 3,69%  | 5,99% | 16,12% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES   | -4,15% | -4,15% | 11,76% | 0,85% | 8,47%  | 4,31%  | 6,58% | 16,00% |

|                                                          |        |        |        |         |         |         |        |        |
|----------------------------------------------------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|--------|--------|
| <b>IFIX (Benchmark)</b>                                  | 0,67%  | 0,67%  | 5,63%  | 4,26%   | 18,16%  | 20,04%  | -      | -      |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | 22,63% | 22,63% | 23,53% | -15,58% | -33,86% | -19,23% | 15,80% | 38,82% |

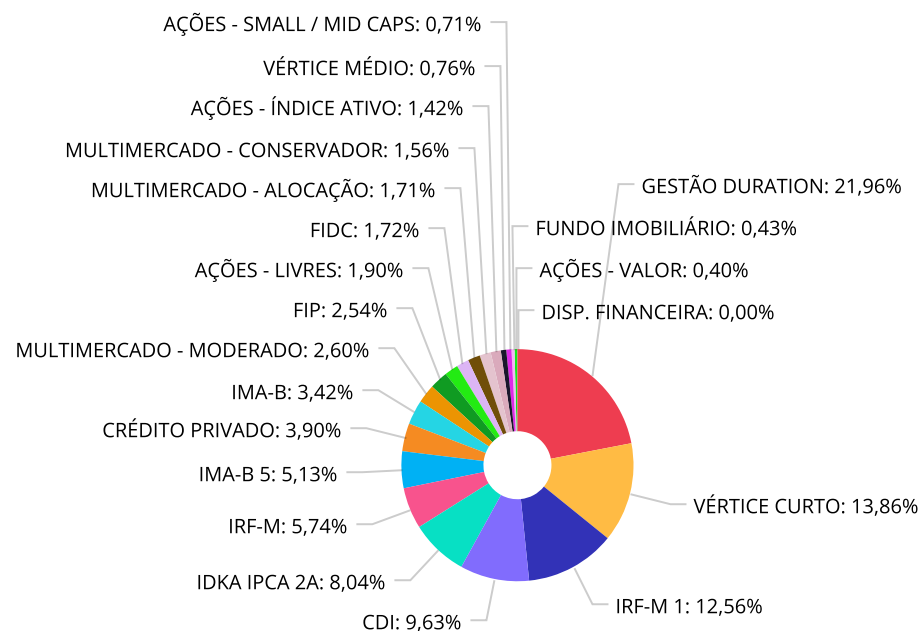
|                         |        |        |        |        |       |         |       |        |
|-------------------------|--------|--------|--------|--------|-------|---------|-------|--------|
| <b>SMLL (Benchmark)</b> | -6,55% | -6,55% | 12,50% | -6,30% | 6,34% | -10,11% | -     | -      |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES | -7,07% | -7,07% | 12,05% | -8,37% | 5,97% | -12,16% | 9,74% | 22,90% |

|                                         |        |        |        |        |        |         |   |   |
|-----------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---|---|
| <b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b> | 1,30%  | 1,30%  | 3,82%  | 7,23%  | 15,48% | 34,97%  | - | - |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA                  | -0,15% | -0,15% | -0,43% | -0,88% | -1,73% | -10,28% | - | - |

**Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2024)**



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

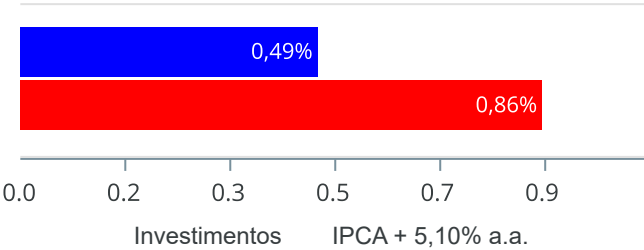


|                    |               |                            |               |                              |               |                        |              |
|--------------------|---------------|----------------------------|---------------|------------------------------|---------------|------------------------|--------------|
| ■ GESTÃO DURATION  | 20.881.955,05 | ■ VÉRTICE CURTO            | 13.180.286,40 | ■ IRF-M 1                    | 11.943.417,85 | ■ CDI                  | 9.156.462,63 |
| ■ IDKA IPCA 2A     | 7.648.370,51  | ■ IRF-M                    | 5.456.876,81  | ■ IMA-B 5                    | 4.873.019,13  | ■ CRÉDITO PRIVADO      | 3.704.400,05 |
| ■ IMA-B            | 3.254.606,84  | ■ MULTIMERCADO - MODERADO  | 2.470.054,66  | ■ FIP                        | 2.416.906,83  | ■ AÇÕES - LIVRES       | 1.807.562,71 |
| ■ FIDC             | 1.638.651,29  | ■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO  | 1.625.401,86  | ■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 1.482.628,27  | ■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 1.345.841,40 |
| ■ VÉRTICE MÉDIO    | 718.089,91    | ■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS | 679.526,72    | ■ FUNDO IMOBILIÁRIO          | 408.772,56    | ■ AÇÕES - VALOR        | 378.328,97   |
| ■ DISP. FINANCEIRA | 2.055,63      |                            |               |                              |               |                        |              |

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 | 95.055.609,28  | 730.139,98 | 1.179.953,58 | 95.071.160,45 | 465.364,77 | 465.364,77   | 0,49%       | 0,49%        | 0,86%    | 0,86%     | 57,12%   | 0,84% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

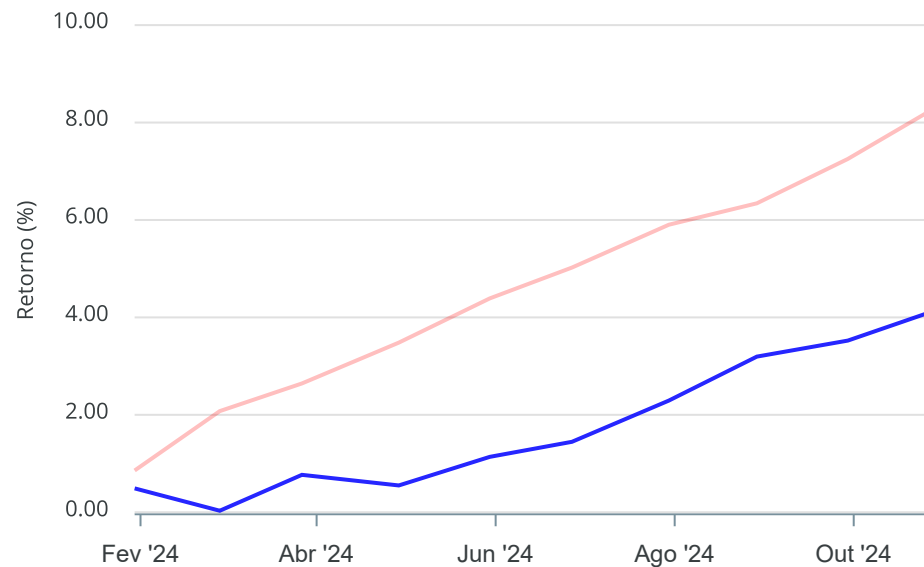
Evolução do Patrimônio



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 Janeiro/2024

## FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates   | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|-------------------------------------------------------|----------------|------------|------------|--------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE... | 4.501.236,44   | 0,00       | 0,00       | 4.551.473,55 | 50.237,11     | 1,12%       | 1,12%      | 0,33%     |
| ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA                   | 1.766.730,17   | 0,00       | 0,00       | 1.786.326,57 | 19.596,40     | 1,11%       | 1,11%      | 0,33%     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | 2.951.358,49   | 0,00       | 0,00       | 2.984.036,54 | 32.678,05     | 1,11%       | 1,11%      | 0,33%     |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 3.300.386,95   | 0,00       | 0,00       | 3.336.918,22 | 36.531,27     | 1,11%       | 1,11%      | 0,33%     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 515.835,37     | 0,00       | 0,00       | 521.531,52   | 5.696,15      | 1,10%       | 1,10%      | 0,33%     |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP         | 2.124.127,93   | 0,00       | 0,00       | 2.145.435,21 | 21.307,28     | 1,00%       | 1,00%      | 0,01%     |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA         | 2.580.365,84   | 0,00       | 0,00       | 2.605.325,64 | 24.959,80     | 0,97%       | 0,97%      | 0,01%     |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA           | 1.166.022,29   | 0,00       | 0,00       | 1.176.899,21 | 10.876,92     | 0,93%       | 0,93%      | 0,11%     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 3.552.929,44   | 0,00       | 0,00       | 3.585.327,94 | 32.398,50     | 0,91%       | 0,91%      | 0,11%     |
| BB INFLAÇÃO FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P... | 3.671.226,79   | 0,00       | 0,00       | 3.704.400,05 | 33.173,26     | 0,90%       | 0,90%      | 0,40%     |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 7.119.634,47   | 0,00       | 0,00       | 7.181.190,70 | 61.556,23     | 0,86%       | 0,86%      | 0,12%     |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 8.390.129,40   | 0,00       | 0,00       | 8.461.375,39 | 71.245,99     | 0,85%       | 0,85%      | 0,07%     |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 4.471.291,67   | 730.139,98 | 970.000,00 | 4.274.510,73 | 43.079,08     | 0,83%       | 0,97%      | 0,01%     |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP          | 2.345.090,80   | 0,00       | 0,00       | 2.362.150,92 | 17.060,12     | 0,73%       | 0,73%      | 0,78%     |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 7.594.311,77   | 0,00       | 0,00       | 7.648.370,51 | 54.058,74     | 0,71%       | 0,71%      | 0,57%     |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.214.539,85   | 0,00       | 0,00       | 1.222.697,47 | 8.157,62      | 0,67%       | 0,67%      | 0,79%     |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 4.841.057,70   | 0,00       | 0,00       | 4.873.019,13 | 31.961,43     | 0,66%       | 0,66%      | 0,55%     |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 1.859.787,35   | 0,00       | 0,00       | 1.872.028,42 | 12.241,07     | 0,66%       | 0,66%      | 0,79%     |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 6.788.739,83   | 0,00       | 0,00       | 6.833.211,01 | 44.471,18     | 0,66%       | 0,66%      | 0,46%     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE... | 714.158,42     | 0,00       | 0,00       | 718.089,91   | 3.931,49      | 0,55%       | 0,55%      | 0,82%     |

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

## FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior       | Aplicações        | Resgates            | Saldo Atual          | Retorno (R\$)     | Retorno (%)  | (%) Instit | Var - Mês    |
|-------------------------------------------------------|----------------------|-------------------|---------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA... | 2.166.274,90         | 0,00              | 0,00                | 2.176.576,00         | 10.301,10         | 0,48%        | 0,48%      | 0,65%        |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO        | 339.579,56           | 0,00              | 209.953,58          | 131.191,05           | 1.565,07          | 0,46%        | 0,88%      | 0,01%        |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA             | 3.395.314,50         | 0,00              | 0,00                | 3.410.792,65         | 15.478,15         | 0,46%        | 0,46%      | 0,57%        |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1                             | 1.644.862,47         | 0,00              | 0,00                | 1.638.651,29         | -6.211,18         | -0,38%       | -0,38%     | 5,43%        |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 3.270.359,74         | 0,00              | 0,00                | 3.254.606,84         | -15.752,90        | -0,48%       | -0,48%     | 1,28%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>82.285.352,14</b> | <b>730.139,98</b> | <b>1.179.953,58</b> | <b>82.456.136,47</b> | <b>620.597,93</b> | <b>0,75%</b> |            | <b>0,48%</b> |

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

## FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável                                 | Saldo Anterior       | Aplicações  | Resgates    | Saldo Atual          | Retorno (R\$)      | Retorno (%)   | (%) Instit | Var - Mês    |
|-------------------------------------------------------|----------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------------|---------------|------------|--------------|
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ... | 333.344,29           | 0,00        | 0,00        | 408.772,56           | 75.428,27          | 22,63%        | 22,63%     | 15,80%       |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP                  | 1.471.488,42         | 0,00        | 0,00        | 1.482.628,27         | 11.139,85          | 0,76%         | 0,76%      | 0,31%        |
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO            | 2.456.757,34         | 0,00        | 0,00        | 2.470.054,66         | 13.297,32          | 0,54%         | 0,54%      | 0,32%        |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA                                | 2.420.615,14         | 0,00        | 0,00        | 2.416.906,83         | -3.708,31          | -0,15%        | -          | -            |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                        | 1.636.498,75         | 0,00        | 0,00        | 1.625.401,86         | -11.096,89         | -0,68%        | -0,68%     | 1,84%        |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                     | 871.788,10           | 0,00        | 0,00        | 835.625,25           | -36.162,85         | -4,15%        | -4,15%     | 6,58%        |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                              | 396.430,25           | 0,00        | 0,00        | 378.328,97           | -18.101,28         | -4,57%        | -4,57%     | 5,68%        |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES                   | 1.413.047,71         | 0,00        | 0,00        | 1.345.841,40         | -67.206,31         | -4,76%        | -4,76%     | 5,78%        |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                         | 1.039.076,27         | 0,00        | 0,00        | 971.937,46           | -67.138,81         | -6,46%        | -6,46%     | 5,99%        |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                               | 731.210,87           | 0,00        | 0,00        | 679.526,72           | -51.684,15         | -7,07%        | -7,07%     | 9,74%        |
| <b>Total Renda Variável</b>                           | <b>12.770.257,14</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>12.615.023,98</b> | <b>-155.233,16</b> | <b>-1,22%</b> |            | <b>3,78%</b> |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 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%     |

## 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.



