

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
TÍTULOS PÚBLICOS			417.952.387,99	39,53%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	2.101.929,94	0,20%	711	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	18.152.719,05	1,72%	796	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	81.818,74	0,01%	1.151	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	956.751,22	0,09%	140	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	6.233.412,01	0,59%	101	1,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	18.644.099,11	1,76%	801	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	33.396.808,06	3,16%	910	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	73.610.154,27	6,96%	774	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	105.275,23	0,01%	1.187	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	45.245.605,76	4,28%	454	1,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	343.533,86	0,03%	221	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.849.677,30	0,84%	103	1,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.259.880,06	0,78%	22	6,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIX...	D+0	Não há	18.538.091,34	1,75%	746	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.712.945,56	0,63%	6.808	1,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.949.393,50	0,47%	244	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+3	Não há	2.509.653,07	0,24%	2.631	4,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	12.143.133,09	1,15%	164	7,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ...	Não há	7.408.817,33	0,70%	4.070	2,68%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	6.727.047,06	0,64%	181	3,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.433.070,53	0,23%	1.248	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.345.839,94	0,51%	17.138	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.658.056,59	0,91%	1.910	5,87%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	14.635.029,17	1,38%	5.555	6,42%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	7.664.793,86	0,73%	895	1,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	17.632.124,08	1,67%	147	1,74%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	11.736.696,81	1,11%	120	1,59%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	9.049.380,90	0,86%	2.277	0,60%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	20.432.964,07	1,93%	94	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.095.283,22	0,20%	1.983	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
INDIE FIC AÇÕES	D+32	Não há	11.905.075,11	1,13%	8.130	3,33%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.478.449,27	0,14%	1.017	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.017.049,41	0,19%	3.458	0,66%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	D+3 du	Não há	1.582.517,92	0,15%	105	1,58%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.046.274,56	0,19%	133	1,28%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	5.499.264,71	0,52%	33	3,94%	Artigo 8º, Inciso I
SPX APACHE FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	921.807,64	0,09%	117	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	29.923.061,64	2,83%	55	1,37%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	865.071,76	0,08%	22	0,10%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

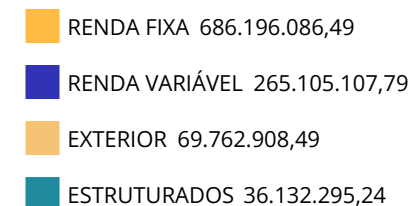
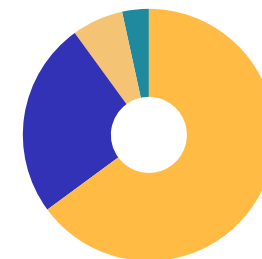
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	855.774,14	0,08%	31	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	D+7	Não há	11.764.848,58	1,11%	37	10,97%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	1.554.702,32	0,15%	132	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	27.006.607,02	2,55%	1.700	7,89%	Artigo 8º, Inciso I
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	D+3	Não há	25.469.649,68	2,41%	8.404	0,48%	Artigo 8º, Inciso II
IT NOW S&P500® TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11	D+3	Não há	31.943.082,44	3,02%	10.760	4,69%	Artigo 8º, Inciso II
TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENT...	D+2 du	Não há	2.861.585,36	0,27%	22.392	26,86%	Artigo 8º, Inciso II
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	D+5 du	Não há	16.838.478,66	1,59%	88	8,79%	Artigo 9º, Inciso II
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	5.690.714,90	0,54%	2.213	2,41%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	4.609.572,75	0,44%	125	3,42%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	25.539.658,56	2,42%	7.125	3,32%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	5.266.234,21	0,50%	465	0,23%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.492.076,75	0,42%	329	0,63%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.326.172,66	0,69%	59.349	0,47%	Artigo 9º, Inciso III
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	684.223,16	0,06%	20	0,48%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	16.737.926,25	1,58%	3.182	2,58%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	4.338.499,66	0,41%	9.175	1,49%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	14.371.646,17	1,36%	33.253	1,42%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.057.196.398,01				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.162.998,79				Artigo 6º
		PL Total	1.058.359.396,80				

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

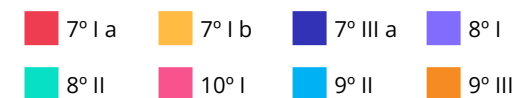
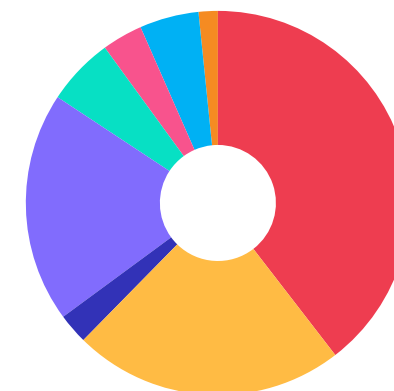
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	417.952.387,99	39,53%	20,00%	45,00%	70,00%	322.085.090,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	241.232.701,51	22,82%	5,00%	16,00%	70,00%	498.804.777,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	27.010.996,99	2,55%	0,00%	1,00%	60,00%	607.306.841,82
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	211.439.279,60
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	52.859.819,90
Total Renda Fixa	100,00%	686.196.086,49	64,91%	25,00%	74,00%	225,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	204.830.790,31	19,37%	10,00%	15,00%	30,00%	112.328.129,09
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	60.274.317,48	5,70%	1,00%	4,00%	20,00%	151.164.962,12
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	36.132.295,24	3,42%	1,00%	3,00%	10,00%	69.587.344,56
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	52.859.819,90
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	52.859.819,90
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	301.237.403,03	28,49%	12,00%	22,00%	70,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	52.678.424,87	4,98%	0,00%	3,00%	10,00%	53.041.214,93
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	17.084.483,62	1,62%	0,00%	1,00%	10,00%	88.635.156,18
Total Exterior	10,00%	69.762.908,49	6,60%	0,00%	4,00%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	417.952.387,99	39,53	20,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	241.232.701,51	22,82	5,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	27.010.996,99	2,55	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	204.830.790,31	19,37	10,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	60.274.317,48	5,70	1,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	52.678.424,87	4,98	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	17.084.483,62	1,62	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	36.132.295,24	3,42	1,00	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 (Março / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	417.952.387,99	39,53	-
CAIXA DTVM	213.301.791,39	20,18	-
ITAÚ UNIBANCO	57.412.732,12	5,43	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	43.641.217,49	4,13	0,06
WESTERN ASSET	40.553.897,48	3,84	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	35.647.648,70	3,37	0,01
XP GESTÃO DE RECURSOS	34.415.424,35	3,26	0,00
XP ASSET MANAGEMENT	34.091.958,82	3,22	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.021.522,92	3,22	-
TARPON INVESTIMENTOS	29.923.061,64	2,83	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	20.432.964,07	1,93	0,27
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	16.737.926,25	1,58	0,00
VINCI PARTNERS	13.319.550,90	1,26	-
INDIE CAPITAL	11.905.075,11	1,13	0,92
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	9.049.380,90	0,86	0,35
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	8.555.400,72	0,81	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.917.635,17	0,65	0,00
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	6.727.047,06	0,64	1,45
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.499.264,71	0,52	0,06
GENIAL INVESTIMENTOS	4.609.572,75	0,44	-

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
SICREDI	4.338.499,66	0,41	0,00
ICATU VANGUARDA	2.095.283,22	0,20	0,00
TRÍGONO CAPITAL	1.720.845,90	0,16	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.582.517,92	0,15	0,00
OCCAM BRASIL	1.478.449,27	0,14	0,02
SPX CAPITAL	921.807,64	0,09	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	343.533,86	0,03	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	0,81%	2,42%	2,42%	5,30%	12,08%	26,63%	0,09%	0,26%
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	2,43%	2,43%	5,30%	11,98%	26,36%	0,09%	0,25%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,77%	2,06%	2,06%	5,09%	9,62%	21,01%	-	-
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%
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%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,65%	1,56%	1,56%	4,97%	9,42%	18,38%	0,75%	2,61%

IMA-B (Benchmark)	0,08%	0,18%	0,18%	4,94%	11,81%	20,21%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	-0,04%	-0,29%	-0,29%	4,86%	11,64%	17,36%	1,35%	4,70%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,05%	0,10%	0,10%	4,80%	11,54%	19,61%	1,08%	3,89%
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	0,03%	0,01%	0,01%	4,60%	10,84%	17,57%	1,08%	3,86%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,05%	0,10%	0,10%	4,78%	11,47%	19,46%	1,08%	3,89%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	0,07%	0,07%	4,77%	11,57%	19,45%	1,09%	3,91%

IRF-M (Benchmark)	0,54%	1,68%	1,68%	6,13%	14,03%	27,20%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	1,62%	1,62%	6,01%	13,79%	26,76%	0,72%	2,22%

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
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	2,41%	2,41%	5,40%	13,73%	25,89%	0,08%	0,99%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83%	2,60%	2,60%	5,45%	12,21%	26,94%	0,01%	0,06%
IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,58%	1,80%	1,80%	4,77%	11,99%	25,10%	0,55%	1,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,55%	1,59%	1,59%	5,69%	13,03%	23,64%	0,42%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	2,77%	2,77%	4,98%	9,78%	21,57%	0,20%	0,94%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,50%	1,42%	1,42%	5,51%	11,65%	17,36%	0,84%	2,94%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	2,36%	15,54%	15,54%	27,88%	34,11%	27,66%	6,36%	16,71%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,59%	2,04%	2,04%	5,17%	11,62%	26,53%	0,36%	0,65%
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,03%
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,27%	-4,27%	-4,27%	9,48%	20,76%	-0,83%	5,21%	15,39%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,49%	2,88%	2,88%	15,76%	54,11%	41,79%	5,46%	16,87%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	-1,00%	-0,93%	-0,93%	12,44%	30,57%	23,43%	5,28%	14,37%
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	0,28%	-5,07%	-5,07%	8,12%	26,41%	-19,42%	9,52%	24,24%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	0,32%	-3,38%	-3,38%	9,36%	24,13%	5,20%	4,55%	15,46%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1,32%	-0,88%	-0,88%	11,87%	27,77%	2,05%	5,58%	16,94%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,34%	-5,19%	-5,19%	4,34%	15,88%	-3,26%	5,16%	15,70%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,94%	-6,16%	-6,16%	-8,96%	12,00%	9,89%	6,80%	18,33%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,06%	-1,63%	-1,63%	10,10%	24,24%	8,43%	3,85%	13,82%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	-0,69%	-4,50%	-4,50%	10,14%	26,35%	7,89%	5,01%	15,41%

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
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	1,04%	-1,02%	-1,02%	10,74%	35,04%	18,07%	4,83%	14,56%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-1,58%	-7,45%	-7,45%	5,40%	19,61%	-2,03%	5,30%	15,27%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	0,69%	-1,54%	-1,54%	11,50%	26,73%	0,96%	5,25%	16,25%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,30%	-5,66%	-5,66%	-8,63%	14,42%	24,94%	5,64%	18,16%
OCCAM FIC AÇÕES	-1,50%	-4,14%	-4,14%	8,63%	18,73%	3,74%	5,20%	14,88%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,60%	-2,88%	-2,88%	7,26%	23,33%	1,91%	4,09%	15,08%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	6,72%	2,39%	2,39%	14,21%	66,23%	58,97%	4,46%	17,28%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-0,44%	-3,57%	-3,57%	10,25%	25,42%	4,21%	5,22%	15,72%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	-0,33%	-3,34%	-3,34%	10,52%	26,64%	3,39%	5,35%	15,87%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	0,19%	-4,70%	-4,70%	9,74%	22,43%	7,24%	6,11%	15,56%

IBX (Benchmark)	-0,73%	-4,29%	-4,29%	10,02%	25,18%	5,09%	-	-
INDIE FIC AÇÕES	1,84%	-2,30%	-2,30%	7,33%	35,51%	2,36%	6,03%	19,19%
SPX APACHE FIC AÇÕES	1,22%	-2,16%	-2,16%	11,54%	30,84%	23,98%	4,25%	14,95%

IDIV (Benchmark)	-1,20%	-3,81%	-3,81%	10,25%	27,20%	19,02%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,84%	-4,10%	-4,10%	7,51%	20,05%	3,96%	4,48%	13,73%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-1,01%	-2,33%	-2,33%	10,04%	26,46%	13,34%	4,06%	12,91%

NASDAQ 100 Index (Benchmark)	1,43%	11,96%	11,96%	23,77%	36,19%	29,73%	-	-
-------------------------------------	-------	--------	--------	--------	--------	--------	---	---

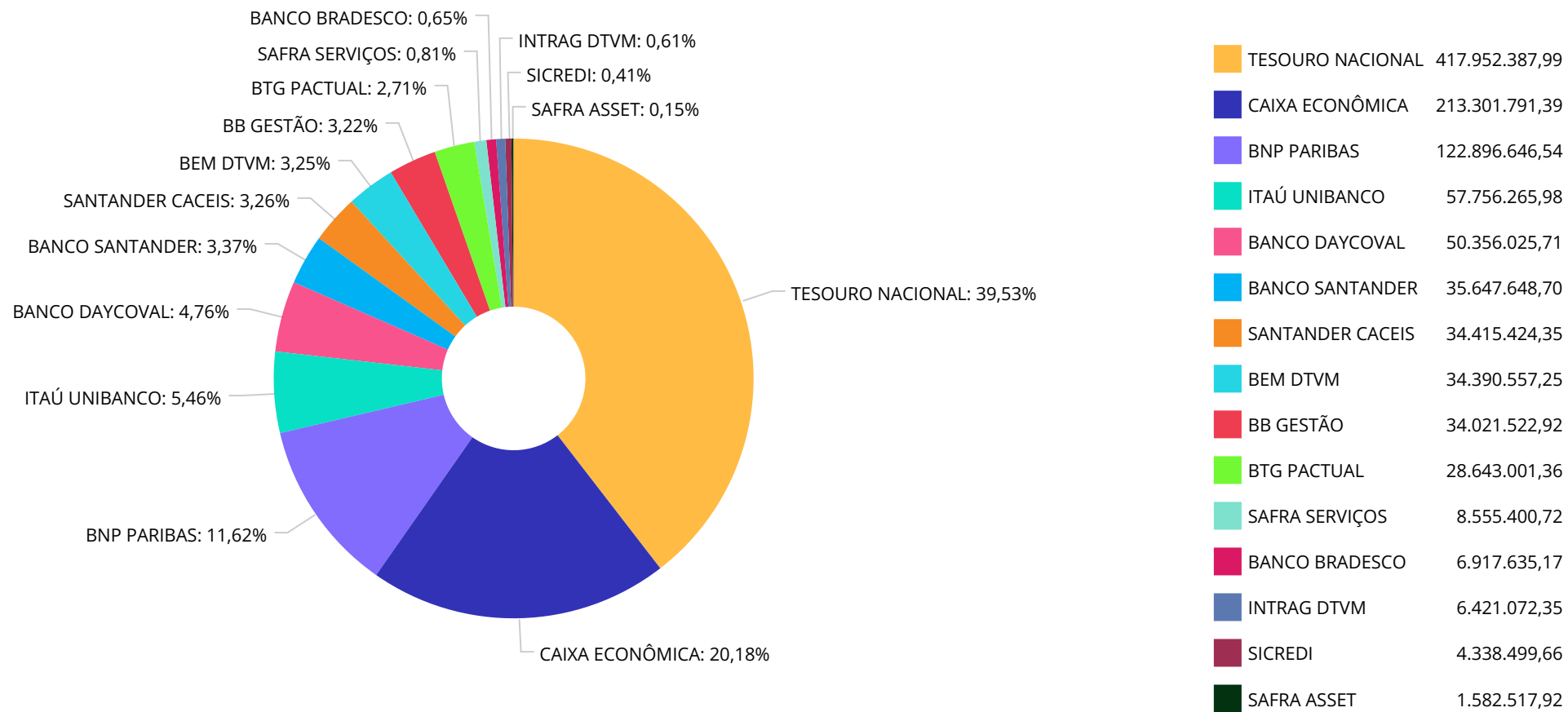
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENTO NO EXTERIOR - N...	1,97%	11,74%	11,74%	23,41%	36,55%	29,45%	6,60%	16,96%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,10%	10,16%	10,16%	22,53%	27,86%	15,98%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,42%	11,07%	11,07%	25,47%	35,83%	33,97%	4,60%	11,53%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3,44%	11,26%	11,26%	25,85%	36,73%	41,02%	4,58%	11,57%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	3,48%	11,26%	11,26%	25,88%	36,61%	35,41%	4,62%	11,55%
IT NOW S&P500® TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPX11	3,70%	13,38%	13,38%	22,00%	26,79%	23,93%	4,30%	12,87%
SMLL (Benchmark)	2,15%	-4,09%	-4,09%	6,93%	24,13%	-10,57%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	2,97%	-1,25%	-1,25%	8,28%	20,20%	-9,45%	5,94%	19,09%

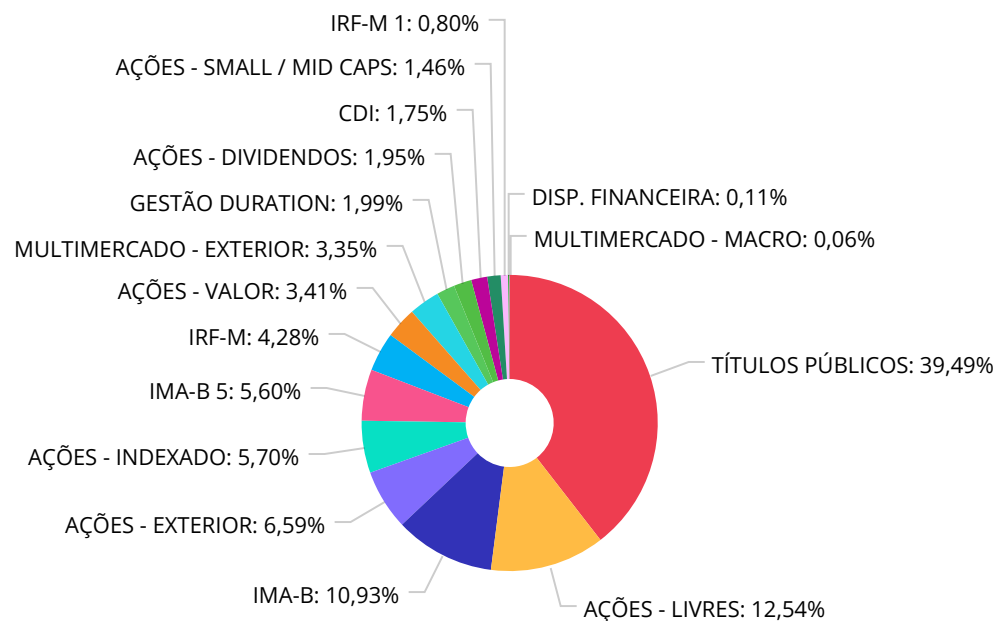
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,71%	10,30%	10,30%	17,65%	23,43%	15,35%	5,11%	12,854%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,57%	16,41%	16,41%	30,45%	37,79%	28,06%	6,00%	15,494%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,034%
MSCI WORLD (Benchmark)	3,25%	11,91%	11,91%	20,18%	21,08%	18,71%	-	-
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2,58%	8,83%	8,83%	25,67%	33,27%	-11,94%	14,11%	27,548%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2,16%	15,24%	15,24%	29,37%	37,99%	27,89%	8,83%	18,795%
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	0,28%	-5,07%	-5,07%	8,12%	26,41%	-19,42%	9,52%	24,244%
MSCI ACWI (Benchmark)	3,14%	11,17%	11,17%	18,97%	19,08%	16,07%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	-0,65%	5,12%	5,12%	21,06%	30,93%	10,02%	5,97%	15,727%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	2,36%	15,54%	15,54%	27,88%	34,11%	27,66%	6,36%	16,713%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	417.952.387,99	■ AÇÕES - LIVRES	132.666.327,26	■ IMA-B	115.704.240,57	■ AÇÕES - EXTERIOR	69.762.908,49
■ AÇÕES - INDEXADO	60.274.317,48	■ IMA-B 5	59.219.223,89	■ IRF-M	45.245.605,76	■ AÇÕES - VALOR	36.081.180,68
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	35.448.072,08	■ GESTÃO DURATION	21.089.562,91	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	20.592.479,06	■ CDI	18.538.091,34
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	15.490.803,31	■ IRF-M 1	8.446.974,03	■ DISP. FINANCEIRA	1.162.998,79	■ MULTIMERCADO - MACRO	684.223,16

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Março / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	03/08/2022	170	3.977,335032	4.280,064312	676.146,96	727.610,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	15/08/2022	240	4.042,830139	4.348,014529	970.279,23	1.043.523,48	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	16/08/2022	368	4.053,223383	4.356,828796	1.491.586,20	1.603.312,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	11/11/2022	701	4.028,221339	4.289,129443	2.823.783,16	3.006.679,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	12/08/2022	1.268	4.160,660528	4.348,014529	5.275.717,55	5.513.282,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	13/09/2022	4.250	4.049,90807	4.350,217033	17.212.109,30	18.488.422,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	14/10/2022	4.501	4.052,45053	4.346,033126	18.240.079,84	19.561.495,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/08/2022	520	4.068,86026	4.365,664322	2.115.807,34	2.270.145,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/08/2022	564	4.029,667122	4.409,395502	2.272.732,26	2.486.899,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	12/08/2022	1.293	4.023,63576	4.399,267386	5.202.561,04	5.688.252,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	13/09/2022	3.709	4.017,096069	4.407,367328	14.899.409,32	16.346.925,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	14/10/2022	3.965	4.010,545468	4.413,422087	15.901.812,78	17.499.218,57	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	18/11/2022	4.183	3.949,154659	4.323,969821	16.519.313,94	18.087.165,76	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	15/12/2022	4.054	3.880,301353	4.225,652264	15.730.741,69	17.130.794,27	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/01/2023	2.808	3.981,78350	4.270,089266	11.180.848,07	11.990.410,65	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	10/02/2023	2.553	3.969,50631	4.233,067644	10.134.149,61	10.807.021,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	10/03/2023	4.130	4.030,827035	4.248,145015	16.647.315,65	17.544.838,91	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/08/2022	569	4.059,281709	4.372,463171	2.309.731,29	2.487.931,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	13/09/2022	3.749	4.051,669462	4.363,674415	15.189.708,81	16.359.415,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	14/10/2022	3.975	4.098,511687	4.403,867983	16.291.583,96	17.505.375,23	Curva

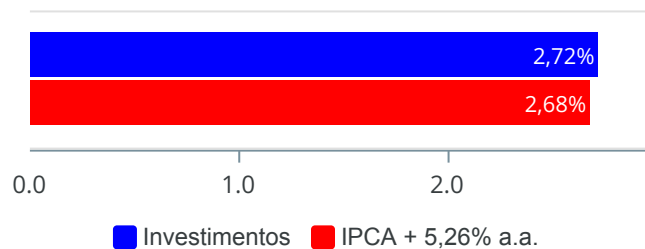
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Março / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/12/2022	3.997	4.098,511687	4.157,22583	16.381.751,21	16.616.431,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/11/2022	4.105	4.024,675706	4.279,24794	16.521.293,77	17.566.312,79	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/08/2022	1.276	4.018,020049	4.333,536681	5.126.993,58	5.529.592,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2023	2.795	3.981,78350	4.163,590981	11.129.084,88	11.637.236,79	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/02/2023	2.538	3.875,51702	4.130,072956	9.836.062,20	10.482.125,16	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/03/2023	4.255	3.917,444482	4.129,669022	16.668.726,27	17.571.741,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/10/2022	3.945	4.035,965324	4.446,132244	15.921.883,20	17.539.991,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/11/2022	4.208	3.926,721131	4.302,080845	16.523.642,52	18.103.156,19	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	15/12/2022	5.274	3.926,721131	4.169,024957	20.709.527,24	21.987.437,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/08/2022	1.305	3.985,130583	4.365,290152	5.200.595,41	5.696.703,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/01/2023	3.448	3.981,78350	4.209,086715	13.729.189,51	14.512.930,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/02/2023	1.065	3.940,959413	4.189,914728	4.197.121,77	4.462.259,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/03/2023	4.220	3.955,371187	4.169,484167	16.691.666,41	17.595.223,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/02/2023	3.277	3.901,91222	4.161,171628	12.786.566,34	13.636.159,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/08/2022	566	4.019,06785	4.405,186084	2.274.792,40	2.493.335,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	13/09/2022	3.721	4.081,965410	4.400,168797	15.188.993,29	16.373.028,09	Curva

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	1.011.626.590,10	13.279.000,00	7.836.000,00	1.016.072.356,83	-997.233,27	-997.233,27	-0,10%	-0,10%	0,87%	0,87%	-11,26%	4,43%
Fevereiro	1.016.072.356,83	17.143.000,00	14.150.730,40	1.036.528.024,29	17.463.397,86	16.466.164,59	1,71%	1,61%	1,22%	2,10%	76,80%	4,35%
Março	1.036.528.024,29	12.766.000,00	8.066.000,00	1.052.556.202,66	11.328.178,37	27.794.342,96	1,09%	2,72%	0,57%	2,68%	101,40%	3,47%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



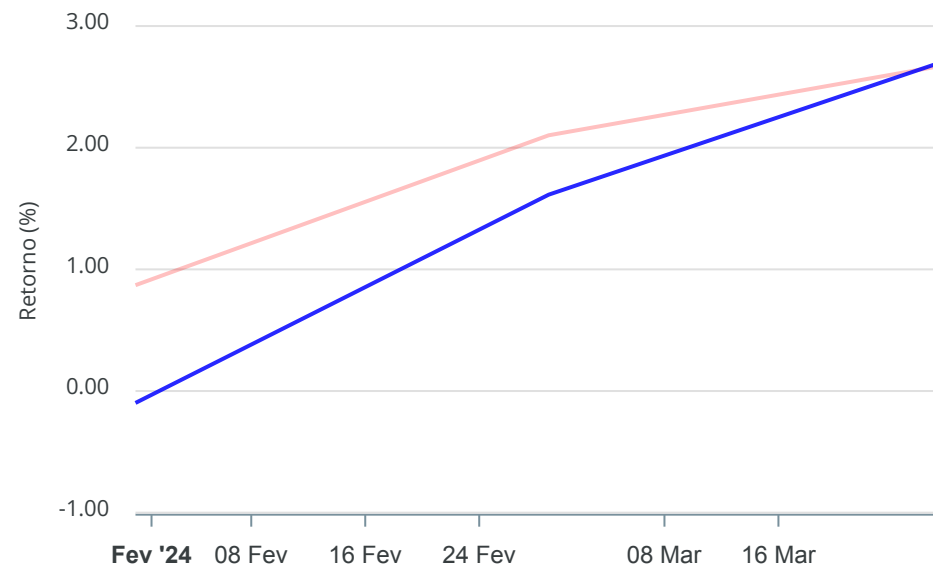
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
TÍTULOS PÚBLICOS	413.710.782,99	0,00	0,00	417.952.387,99	4.241.605,00	1,03%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	948.120,66	0,00	0,00	956.751,22	8.630,56	0,91%	0,91%	0,20%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	8.193.375,51	0,00	0,00	8.259.880,06	66.504,55	0,81%	0,81%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	81.166,69	0,00	0,00	81.818,74	652,05	0,80%	0,80%	0,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	104.443,46	0,00	0,00	105.275,23	831,77	0,80%	0,80%	0,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.085.938,56	0,00	0,00	2.101.929,94	15.991,38	0,77%	0,77%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	33.147.311,72	0,00	0,00	33.396.808,06	249.496,34	0,75%	0,75%	0,44%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.017.319,12	0,00	0,00	18.152.719,05	135.399,93	0,75%	0,75%	0,44%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	6.669.807,14	0,00	0,00	6.712.945,56	43.138,42	0,65%	0,65%	0,75%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	18.439.706,99	8.189.000,00	8.248.000,00	18.538.091,34	157.384,35	0,59%	0,82%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	18.536.988,29	0,00	0,00	18.644.099,11	107.110,82	0,58%	0,58%	0,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	341.646,34	0,00	0,00	343.533,86	1.887,52	0,55%	0,55%	0,42%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	7.372.336,88	0,00	0,00	7.408.817,33	36.480,45	0,49%	0,49%	0,84%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	42.460.425,10	2.566.000,00	0,00	45.245.605,76	219.180,66	0,49%	0,50%	0,72%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	8.844.937,96	0,00	0,00	8.849.677,30	4.739,34	0,05%	0,05%	1,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	71.005.190,48	2.566.000,00	0,00	73.610.154,27	38.963,79	0,05%	0,06%	1,08%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	6.230.137,29	0,00	0,00	6.233.412,01	3.274,72	0,05%	0,05%	1,08%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.947.249,58	0,00	0,00	4.949.393,50	2.143,92	0,04%	0,04%	1,09%
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	2.509.013,73	0,00	0,00	2.509.653,07	639,34	0,03%	0,03%	1,08%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	12.148.238,71	0,00	0,00	12.143.133,09	-5.105,62	-0,04%	-0,04%	1,35%

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
Total Renda Fixa	675.794.137,20	13.321.000,00	8.248.000,00	686.196.086,49	5.328.949,29	0,78%		0,74%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	28.037.989,50	0,00	0,00	29.923.061,64	1.885.072,14	6,72%	6,72%	4,46%
IT NOW S&P500® TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11	30.802.669,18	0,00	0,00	31.943.082,44	1.140.413,26	3,70%	3,70%	4,30%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	4.192.685,58	0,00	0,00	4.338.499,66	145.814,08	3,48%	3,48%	4,62%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	16.181.840,40	0,00	0,00	16.737.926,25	556.085,85	3,44%	3,44%	4,58%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.897.067,23	0,00	0,00	14.371.646,17	474.578,94	3,41%	3,41%	4,60%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	14.212.654,28	0,00	0,00	14.635.029,17	422.374,89	2,97%	2,97%	5,94%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	845.648,34	0,00	0,00	865.071,76	19.423,42	2,30%	2,30%	5,64%
TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENTO ...	2.806.405,01	0,00	0,00	2.861.585,36	55.180,35	1,97%	1,97%	6,60%
INDIE FIC AÇÕES	11.689.480,76	0,00	0,00	11.905.075,11	215.594,35	1,84%	1,84%	6,03%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	20.133.391,19	0,00	0,00	20.432.964,07	299.572,88	1,49%	1,49%	5,46%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.990.697,65	0,00	0,00	2.017.049,41	26.351,76	1,32%	1,32%	5,58%
SPX APACHE FIC AÇÕES	910.731,07	0,00	0,00	921.807,64	11.076,57	1,22%	1,22%	4,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8.954.888,11	0,00	0,00	9.049.380,90	94.492,79	1,06%	1,06%	3,85%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	6.658.114,90	0,00	0,00	6.727.047,06	68.932,16	1,04%	1,04%	4,83%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	847.815,77	0,00	0,00	855.774,14	7.958,37	0,94%	0,94%	6,80%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	2.032.169,04	0,00	0,00	2.046.274,56	14.105,52	0,69%	0,69%	5,25%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7.619.269,30	0,00	0,00	7.664.793,86	45.524,56	0,60%	0,60%	4,09%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	680.214,05	0,00	0,00	684.223,16	4.009,11	0,59%	0,59%	0,36%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	1.549.816,68	0,00	0,00	1.554.702,32	4.885,64	0,32%	0,32%	4,55%
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	1.578.107,60	0,00	0,00	1.582.517,92	4.410,32	0,28%	0,28%	9,52%

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
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	5.488.646,01	0,00	0,00	5.499.264,71	10.618,70	0,19%	0,19%	6,11%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.439.608,72	0,00	0,00	2.433.070,53	-6.538,19	-0,27%	-0,27%	5,21%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	11.804.305,30	0,00	0,00	11.764.848,58	-39.456,72	-0,33%	-0,33%	5,35%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9.690.878,87	0,00	0,00	9.658.056,59	-32.822,28	-0,34%	-0,34%	5,16%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	11.788.417,26	0,00	0,00	11.736.696,81	-51.720,45	-0,44%	-0,44%	5,22%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	25.645.860,15	0,00	0,00	25.469.649,68	-176.210,47	-0,69%	-0,69%	5,01%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.112.918,91	0,00	0,00	2.095.283,22	-17.635,69	-0,83%	-0,83%	4,48%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	27.280.447,34	0,00	0,00	27.006.607,02	-273.840,32	-1,00%	-1,00%	5,28%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	17.811.857,05	0,00	0,00	17.632.124,08	-179.732,97	-1,01%	-1,01%	4,06%
OCCAM FIC AÇÕES	1.500.915,21	0,00	0,00	1.478.449,27	-22.465,94	-1,50%	-1,50%	5,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	5.431.875,61	0,00	0,00	5.345.839,94	-86.035,67	-1,58%	-1,58%	5,30%
Total Renda Variável	296.617.386,07	0,00	0,00	301.237.403,03	4.620.016,96	1,56%		4,94%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.089.236,42	0,00	0,00	5.266.234,21	176.997,79	3,48%	3,48%	5,89%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.373.710,27	0,00	0,00	4.492.076,75	118.366,48	2,71%	2,71%	5,11%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	4.493.729,27	0,00	0,00	4.609.572,75	115.843,48	2,58%	2,58%	14,11%
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI A...	16.449.674,21	0,00	0,00	16.838.478,66	388.804,45	2,36%	2,36%	6,36%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	24.998.901,41	0,00	0,00	25.539.658,56	540.757,15	2,16%	2,16%	8,83%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.213.223,55	0,00	0,00	7.326.172,66	112.949,11	1,57%	1,57%	6,00%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	5.727.818,62	0,00	0,00	5.690.714,90	-37.103,72	-0,65%	-0,65%	5,97%
Total Exterior	68.346.293,75	0,00	0,00	69.762.908,49	1.416.614,74	2,07%		7,59%

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
TÍTULOS PÚBLICOS	410.001.113,13	0,00	4.891.424,79	417.952.387,99	12.842.699,65	3,13%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	41.994.692,36	2.566.000,00	0,00	45.245.605,76	684.913,40	1,54%	1,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	32.739.889,15	0,00	0,00	33.396.808,06	656.918,91	2,01%	2,01%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	21.482.326,01	21.796.000,00	25.231.000,00	18.538.091,34	490.765,33	1,13%	2,60%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.796.698,66	0,00	0,00	18.152.719,05	356.020,39	2,00%	2,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	18.314.745,87	0,00	0,00	18.644.099,11	329.353,24	1,80%	1,80%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	8.065.027,61	0,00	0,00	8.259.880,06	194.852,45	2,42%	2,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	61.030.045,05	12.471.000,00	0,00	73.610.154,27	109.109,22	0,15%	0,13%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	7.304.784,77	0,00	0,00	7.408.817,33	104.032,56	1,42%	1,42%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	6.609.904,62	0,00	0,00	6.712.945,56	103.040,94	1,56%	1,56%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.052.499,17	0,00	0,00	2.101.929,94	49.430,77	2,41%	2,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	958.430,92	0,00	27.898,95	956.751,22	26.219,25	2,74%	2,77%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	4.089.996,40	8.029.000,00	0,00	12.143.133,09	24.136,69	0,20%	-0,29%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	8.840.455,71	0,00	0,00	8.849.677,30	9.221,59	0,10%	0,10%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	6.227.387,88	0,00	0,00	6.233.412,01	6.024,13	0,10%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	338.143,93	0,00	0,00	343.533,86	5.389,93	1,59%	1,59%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.946.112,00	0,00	0,00	4.949.393,50	3.281,50	0,07%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	102.737,14	0,00	0,00	105.275,23	2.538,09	2,47%	2,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	79.879,13	0,00	0,00	81.818,74	1.939,61	2,43%	2,43%
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	2.509.325,22	0,00	0,00	2.509.653,07	327,85	0,01%	0,01%

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
Total Renda Fixa	655.484.194,73	44.862.000,00	30.150.323,74	686.196.086,49	16.000.215,50	2,39%	

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
IT NOW S&P500@ TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11	28.174.662,12	0,00	0,00	31.943.082,44	3.768.420,32	13,38%	13,38%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	15.044.442,32	0,00	0,00	16.737.926,25	1.693.483,93	11,26%	11,26%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12.939.177,69	0,00	0,00	14.371.646,17	1.432.468,48	11,07%	11,07%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	29.223.485,75	0,00	0,00	29.923.061,64	699.575,89	2,39%	2,39%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	19.861.214,25	0,00	0,00	20.432.964,07	571.749,82	2,88%	2,88%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	3.899.598,74	0,00	0,00	4.338.499,66	438.900,92	11,26%	11,26%
TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENTO ...	2.560.916,96	0,00	0,00	2.861.585,36	300.668,40	11,74%	11,74%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	670.546,07	0,00	0,00	684.223,16	13.677,09	2,04%	2,04%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	365.341,36	0,00	349.406,66	0,00	-15.934,70	-4,36%	-5,72%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	2.034.905,69	0,00	0,00	2.017.049,41	-17.856,28	-0,88%	-0,88%
SPX APACHE FIC AÇÕES	942.158,29	0,00	0,00	921.807,64	-20.350,65	-2,16%	-2,16%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	2.078.203,68	0,00	0,00	2.046.274,56	-31.929,12	-1,54%	-1,54%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	916.991,99	0,00	0,00	865.071,76	-51.920,23	-5,66%	-5,66%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	1.609.122,82	0,00	0,00	1.554.702,32	-54.420,50	-3,38%	-3,38%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	911.981,60	0,00	0,00	855.774,14	-56.207,46	-6,16%	-6,16%
OCCAM FIC AÇÕES	1.542.338,27	0,00	0,00	1.478.449,27	-63.889,00	-4,14%	-4,14%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	6.796.317,35	0,00	0,00	6.727.047,06	-69.270,29	-1,02%	-1,02%
SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES	1.667.048,87	0,00	0,00	1.582.517,92	-84.530,95	-5,07%	-5,07%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.184.960,36	0,00	0,00	2.095.283,22	-89.677,14	-4,10%	-4,10%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.541.506,32	0,00	0,00	2.433.070,53	-108.435,79	-4,27%	-4,27%

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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	9.199.262,20	0,00	0,00	9.049.380,90	-149.881,30	-1,63%	-1,63%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	14.820.893,51	0,00	0,00	14.635.029,17	-185.864,34	-1,25%	-1,25%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7.891.826,02	0,00	0,00	7.664.793,86	-227.032,16	-2,88%	-2,88%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	27.260.638,14	0,00	0,00	27.006.607,02	-254.031,12	-0,93%	-0,93%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	5.770.233,95	0,00	0,00	5.499.264,71	-270.969,24	-4,70%	-4,70%
INDIE FIC AÇÕES	12.185.225,50	0,00	0,00	11.905.075,11	-280.150,39	-2,30%	-2,30%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	12.170.769,40	0,00	0,00	11.764.848,58	-405.920,82	-3,34%	-3,34%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	18.052.025,39	0,00	0,00	17.632.124,08	-419.901,31	-2,33%	-2,33%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	5.776.283,10	0,00	0,00	5.345.839,94	-430.443,16	-7,45%	-7,45%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	12.171.419,06	0,00	0,00	11.736.696,81	-434.722,25	-3,57%	-3,57%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	10.186.370,43	0,00	0,00	9.658.056,59	-528.313,84	-5,19%	-5,19%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	26.670.225,43	0,00	0,00	25.469.649,68	-1.200.575,75	-4,50%	-4,50%
Total Renda Variável	298.120.092,63	0,00	349.406,66	301.237.403,03	3.466.717,06	1,16%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	22.162.063,22	0,00	0,00	25.539.658,56	3.377.595,34	15,24%	15,24%
ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI A...	14.573.248,07	0,00	0,00	16.838.478,66	2.265.230,59	15,54%	15,54%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.293.495,43	0,00	0,00	7.326.172,66	1.032.677,23	16,41%	16,41%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.580.091,05	0,00	0,00	5.266.234,21	686.143,16	14,98%	14,98%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.072.524,13	0,00	0,00	4.492.076,75	419.552,62	10,30%	10,30%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	4.235.727,29	0,00	0,00	4.609.572,75	373.845,46	8,83%	8,83%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	5.413.682,88	0,00	0,00	5.690.714,90	277.032,02	5,12%	5,12%
Total Exterior	61.330.832,07	0,00	0,00	69.762.908,49	8.432.076,42	13,75%	

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.

