

Relatório Analítico dos Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE BOA ESPERANÇA

em março e 1º trimestre de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

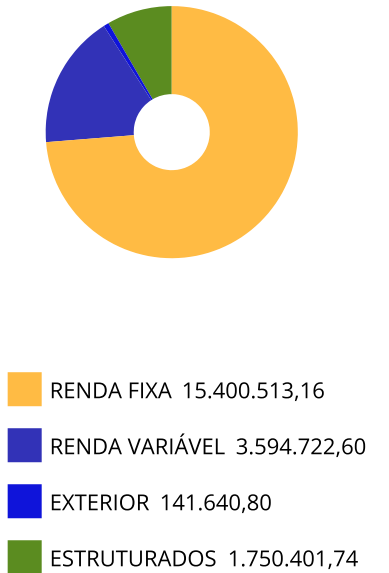
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	1.160.450,58	5,34%	880	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	D+1	Não há	1.039.829,26	4,78%	796	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA F...	D+0	15/08/2024	328.802,18	1,51%	317	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2024	1.031.686,05	4,75%	370	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF...	D+0	Não há	3.765.135,76	17,32%	242	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	343.611,48	1,58%	211	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA...	D+0	16/05/2027	511.260,72	2,35%	84	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	328.443,00	1,51%	801	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	78.534,57	0,36%	910	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	623.863,10	2,87%	1.187	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	619.763,61	2,85%	454	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	514.826,41	2,37%	30	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	692.759,97	3,19%	221	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	1.374.261,57	6,32%	1.013	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+1	Não há	583.735,58	2,68%	244	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	2.112.294,54	9,72%	1.141	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRDESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA RE...	D+0	Não há	45.178,63	0,21%	452	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0	Não há	234.346,34	1,08%	445	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃO...	D+4	Não há	476.331,73	2,19%	2.652	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+33	Não há	1.077.191,05	4,95%	1.248	0,14%	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
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA RESP LIMITADA F...	D+3	Não há	585.427,90	2,69%	24	0,36%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	D+25	Não há	491.042,22	2,26%	895	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3 du	Não há	149.387,96	0,69%	10.326	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	584.270,68	2,69%	5.220	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	231.071,06	1,06%	61	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	141.640,80	0,65%	465	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BB RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO...	D+4	Não há	304.915,81	1,40%	174	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE RESP LIMITADA FIF ...	D+15	Não há	870.443,68	4,00%	112	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF M...	D+1	Não há	111.700,35	0,51%	7.256	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTI...	D+0	Não há	463.341,90	2,13%	2.524	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
EMPRESTIMO CONSIGNADO	D+0		854.249,00	3,93%		0,00%	Artigo 12º
BB VOTORANTIM HIGHLAND INFRAESTRUTURA RESP LIMIT...	Não se ...	Não se aplica	11.729,81	0,05%	2.083	0,02%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			21.741.527,30				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,12%	100,00%	21.741.527,30
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	11.038.966,69	50,77%	0,00%	32,31%	100,00%	10.702.560,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	4.349.816,66	20,01%	0,00%	43,25%	65,00%	9.782.176,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	14.131.992,75
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,21%	20,00%	4.348.305,46
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,08%	5,00%	1.087.076,37
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,24%	5,00%	1.087.076,37
Desenquadrado - RF	0,00%	11.729,81	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-11.729,81
Total Renda Fixa	100,00%	15.400.513,16	70,83%	0,00%	79,21%	360,00%	



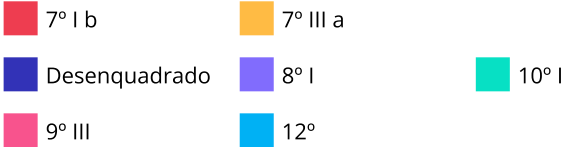
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.594.722,60	16,53%	0,00%	16,81%	35,00%	4.014.811,96
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	7.609.534,56
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.750.401,74	8,05%	0,00%	1,00%	10,00%	423.750,99
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,06%	5,00%	1.087.076,37
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,24%	5,00%	1.087.076,37
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	5.345.124,34	24,58%	0,00%	18,11%	90,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,06%	5,00%	1.087.076,37
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	141.640,80	0,65%	0,00%	1,68%	10,00%	2.032.511,93
Total Exterior	10,00%	141.640,80	0,65%	0,00%	1,74%	15,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	854.249,00	3,93%	0,00%	1,00%	10,00%	1.319.903,73



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	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	10.346.206,72	47,59	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	4.349.816,66	20,01	0,00	52,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.594.722,60	16,53	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	141.640,80	0,65	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.750.401,74	8,05	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	854.249,00	3,93	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.489.498,35	43,65	-
CAIXA DTVM S.A	9.316.786,17	42,85	0,04
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.207.586,38	5,55	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	585.427,90	2,69	0,00
ITAÚ UNIBANCO	231.071,06	1,06	0,00
BANCO BRADESCO	45.178,63	0,21	0,00
BV ASSET	11.729,81	0,05	-

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
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,55%	2,62%	2,66%	5,05%	9,12%	19,91%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,61%	1,75%	1,75%	2,08%	3,79%	-	0,75%	4,84%
IPCA + 5,50% ao ano (Benchmark)	0,59%	2,74%	2,78%	5,30%	9,64%	21,05%	-	-
BB VOTORANTIM HIGHLAND INFRAESTRUTURA RESP LIMITADA FIDC SÊNIOR 1	-13,54%	-28,08%	-28,08%	-26,57%	-49,00%	-65,73%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	2,24%	2,24%	5,19%	9,48%	20,66%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,88%	2,05%	2,05%	4,99%	9,24%	20,06%	0,47%	1,63%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,80%	2,47%	2,47%	5,37%	12,08%	26,60%	0,08%	0,24%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,77%	2,06%	2,06%	5,09%	9,62%	21,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,75%	2,01%	2,01%	4,98%	9,48%	20,72%	0,44%	1,68%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,75%	2,00%	2,00%	4,98%	9,44%	20,53%	0,44%	1,70%
IMA-B (Benchmark)	0,08%	0,18%	0,18%	4,94%	11,81%	20,21%	-	-
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF 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%	-	-

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
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,50%	1,62%	1,62%	6,01%	13,79%	26,76%	0,72%	2,22%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,85%	2,65%	2,65%	5,55%	12,40%	27,30%	0,01%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,85%	2,70%	2,70%	5,72%	12,96%	27,89%	0,05%	0,10%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CURTO...	0,82%	2,57%	2,57%	5,42%	12,11%	26,70%	0,01%	0,05%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,92%	-0,17%	-0,17%	2,00%	-	-	0,20%	-
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	2,38%	2,38%	5,02%	11,27%	24,78%	0,01%	0,06%
BRABESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91%	2,92%	2,92%	6,02%	13,31%	28,84%	0,03%	0,09%
IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,93%	2,81%	2,81%	5,06%	-	-	0,20%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,58%	1,80%	1,80%	4,77%	11,99%	25,10%	0,55%	1,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,55%	1,59%	1,59%	5,69%	13,03%	23,64%	0,42%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,92%	2,78%	2,78%	5,01%	9,81%	20,12%	0,20%	0,94%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	-0,17%	-0,17%	2,01%	-	-	0,20%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-4,16%	-1,82%	-1,82%	12,75%	25,44%	-	9,63%	28,33%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO ...	0,52%	1,08%	1,08%	6,14%	12,84%	23,94%	1,07%	3,49%
CAIXA JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	0,70%	2,33%	2,33%	5,12%	11,68%	26,54%	0,27%	0,37%
BB RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	2,29%	2,29%	6,00%	12,11%	25,87%	0,46%	1,16%
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,60%	-2,88%	-2,88%	7,26%	23,33%	1,91%	4,09%	15,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,83%	-5,43%	-5,43%	3,21%	12,93%	-17,12%	5,56%	18,19%
BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,27%	-4,27%	-4,27%	9,48%	20,76%	-0,83%	5,21%	15,39%
IBX (Benchmark)	-0,73%	-4,29%	-4,29%	10,02%	25,18%	5,09%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,94%	-4,56%	-4,56%	8,76%	21,27%	2,38%	5,29%	15,63%
IDIV (Benchmark)	-1,20%	-3,81%	-3,81%	10,25%	27,20%	19,02%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1,25%	2,01%	2,01%	13,64%	33,00%	17,65%	4,69%	14,70%
MSCI ACWI (Benchmark)	3,14%	11,17%	11,17%	18,97%	19,08%	16,07%	-	-

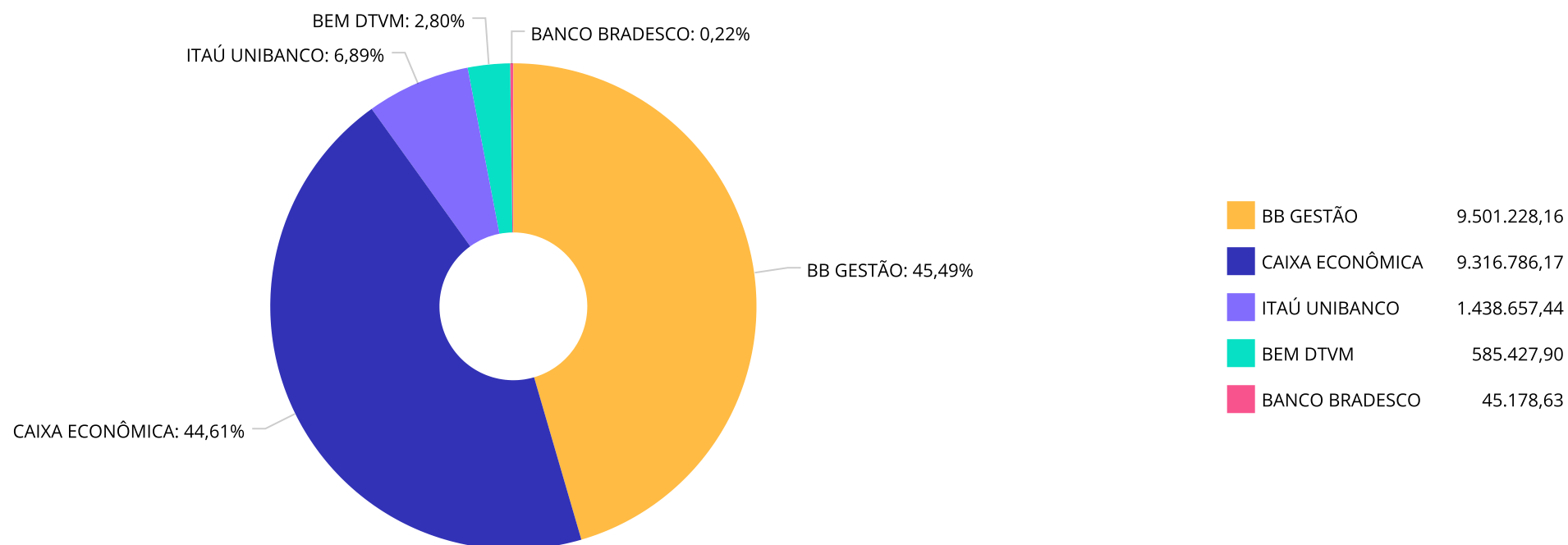
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	3,40%	11,13%	11,13%	25,56%	36,04%	34,42%	4,59%	11,56%
SMLL (Benchmark)	2,15%	-4,09%	-4,09%	6,93%	24,13%	-10,57%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	2,09%	-4,27%	-4,27%	6,32%	22,85%	-11,79%	6,29%	20,68%

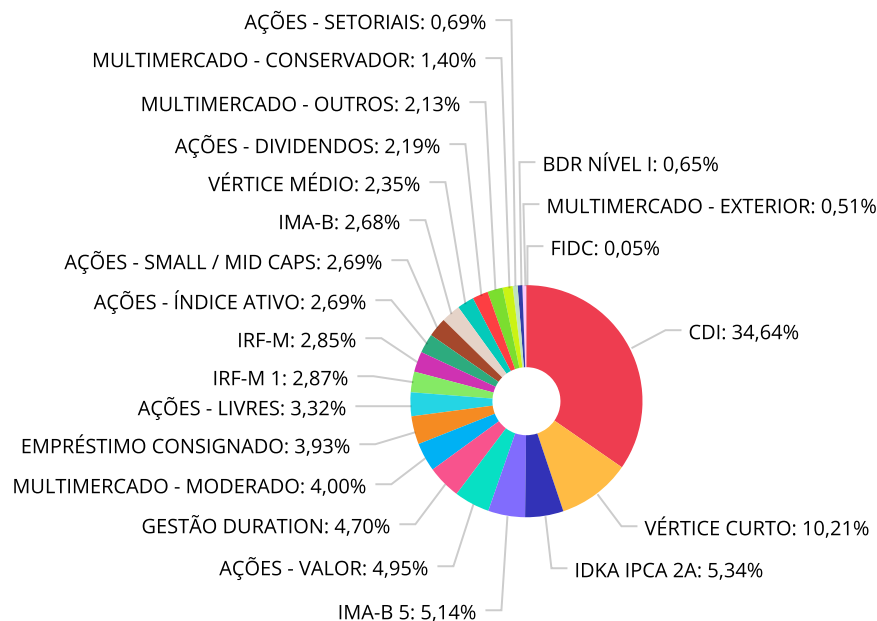
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,034%

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



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



CDI	7.531.216,84	VÉRTICE CURTO	2.218.926,12	IDKA IPCA 2A	1.160.450,58	IMA-B 5	1.118.363,83
AÇÕES - VALOR	1.077.191,05	GESTÃO DURATION	1.021.202,97	MULTIMERCADO - MODERADO	870.443,68	EMPRÉSTIMO CONSIGNADO	854.249,00
AÇÕES - LIVRES	722.113,28	IRF-M 1	623.863,10	IRF-M	619.763,61	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	585.427,90
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	584.270,68	IMA-B	583.735,58	VÉRTICE MÉDIO	511.260,72	AÇÕES - DIVIDENDOS	476.331,73
MULTIMERCADO - OUTROS	463.341,90	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	304.915,81	AÇÕES - SETORIAIS	149.387,96	BDR NÍVEL I	141.640,80
MULTIMERCADO - EXTERIOR	111.700,35	FIDC	11.729,81				

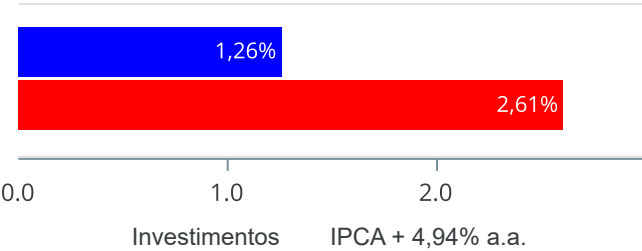
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Março / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

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	21.275.651,58	2.894.466,74	4.786.330,56	19.353.623,96	-30.163,80	-30.163,80	-0,14%	-0,14%	0,84%	0,84%	-16,81%	1,60%
Fevereiro	19.353.623,96	1.577.576,45	206.418,02	20.862.844,29	138.061,90	107.898,10	0,67%	0,52%	1,20%	2,05%	25,52%	1,81%
Março	20.862.844,29	1.325.712,66	1.320.034,72	21.021.298,58	152.776,35	260.674,45	0,73%	1,26%	0,54%	2,61%	48,32%	1,22%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

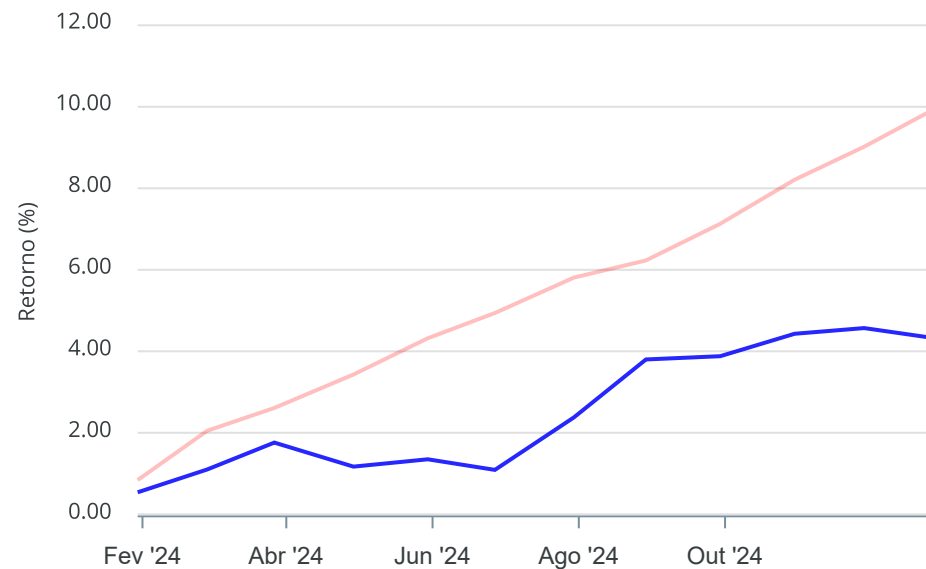
Evolução do Patrimônio



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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA FIF...	325.786,97	0,00	0,00	328.802,18	3.015,21	0,93%	0,93%	0,20%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	340.464,09	0,00	0,00	343.611,48	3.147,39	0,92%	0,92%	0,20%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	510.137,37	0,00	0,00	514.826,41	4.689,04	0,92%	0,92%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	1.022.306,82	0,00	0,00	1.031.686,05	9.379,23	0,92%	0,92%	0,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	1.150.367,28	0,00	0,00	1.160.450,58	10.083,30	0,88%	0,88%	0,47%
CAIXA BRASIL MATRIZ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	232.373,78	0,00	0,00	234.346,34	1.972,56	0,85%	0,85%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	618.934,01	0,00	0,00	623.863,10	4.929,09	0,80%	0,80%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	77.947,86	0,00	0,00	78.534,57	586,71	0,75%	0,75%	0,44%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	3.035.891,48	944.328,11	244.996,70	3.765.135,76	29.912,87	0,75%	0,82%	0,01%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	1.032.073,24	0,00	0,00	1.039.829,26	7.756,02	0,75%	0,75%	0,44%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	1.494.428,91	92,00	131.121,03	1.374.261,57	10.861,69	0,73%	0,75%	0,01%
BRDESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFE...	268.814,25	0,00	225.514,77	45.178,63	1.879,15	0,70%	0,91%	0,03%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	2.538.396,74	348.840,41	794.965,43	2.112.294,54	20.022,82	0,69%	0,85%	0,01%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA F...	508.141,51	0,00	0,00	511.260,72	3.119,21	0,61%	0,61%	0,75%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	326.556,09	0,00	0,00	328.443,00	1.886,91	0,58%	0,58%	0,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	688.953,63	0,00	0,00	692.759,97	3.806,34	0,55%	0,55%	0,42%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	616.679,66	0,00	0,00	619.763,61	3.083,95	0,50%	0,50%	0,72%
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	583.482,72	0,00	0,00	583.735,58	252,86	0,04%	0,04%	1,09%
BB VOTORANTIM HIGHLAND INFRAESTRUTURA RESP LIMITAD...	13.566,48	0,00	0,00	11.729,81	-1.836,67	-13,54%	-	-
Total Renda Fixa	15.385.302,89	1.293.260,52	1.396.597,93	15.400.513,16	118.547,68	0,77%		0,23%

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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MUL...	108.033,15	0,00	0,00	111.700,35	3.667,20	3,39%	3,39%	4,59%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	572.285,30	0,00	0,00	584.270,68	11.985,38	2,09%	2,09%	6,29%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	470.453,89	0,00	0,00	476.331,73	5.877,84	1,25%	1,25%	4,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	229.163,70	0,00	0,00	231.071,06	1.907,36	0,83%	0,83%	5,56%
BB RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO L...	302.506,55	0,00	0,00	304.915,81	2.409,26	0,80%	0,80%	0,46%
CAIXA JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	460.128,66	0,00	0,00	463.341,90	3.213,24	0,70%	0,70%	0,27%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃO...	488.125,71	0,00	0,00	491.042,22	2.916,51	0,60%	0,60%	4,09%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE RESP LIMITADA FIF CI...	865.942,40	0,00	0,00	870.443,68	4.501,28	0,52%	0,52%	1,07%
BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.080.085,69	0,00	0,00	1.077.191,05	-2.894,64	-0,27%	-0,27%	5,21%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA RESP LIMITADA FIF...	590.966,42	0,00	0,00	585.427,90	-5.538,52	-0,94%	-0,94%	5,29%
CAIXA ELETROBRAS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	155.868,07	0,00	0,00	149.387,96	-6.480,11	-4,16%	-4,16%	9,63%
Total Renda Variável	5.323.559,54	0,00	0,00	5.345.124,34	21.564,80	0,41%		3,94%

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 RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	136.880,26	0,00	0,00	141.640,80	4.760,54	3,48%	3,48%	5,89%
Total Exterior	136.880,26	0,00	0,00	141.640,80	4.760,54	3,48%		5,89%

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

EMPRÉSTIMO CONSIGNADO

Consignado	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
EMPRESTIMO CONSIGNADO	830.176,02	32.452,14	22.124,69	854.249,00	13.745,53	1,59%	-	-
Total Consignado	830.176,02	32.452,14	22.124,69	854.249,00	13.745,53	1,59%		0,00%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	3.032.220,79	1.523.513,91	872.112,14	3.765.135,76	81.513,20	1,79%	2,57%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	1.537.048,79	1.654.912,33	1.132.053,57	2.112.294,54	52.386,99	1,64%	2,65%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	782.038,28	1.438.920,05	876.338,92	1.374.261,57	29.642,16	1,33%	2,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	1.032.423,72	0,00	29.127,02	1.031.686,05	28.389,35	2,75%	2,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	1.514.180,75	0,00	379.326,98	1.160.450,58	25.596,81	1,69%	2,05%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	1.019.435,59	0,00	0,00	1.039.829,26	20.393,67	2,00%	2,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	608.822,35	0,00	0,00	623.863,10	15.040,75	2,47%	2,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	2.373.902,60	0,00	1.692.297,85	692.759,97	11.155,22	0,47%	1,59%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	609.915,53	0,00	0,00	619.763,61	9.848,08	1,61%	1,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA FIF...	329.121,37	0,00	9.447,87	328.802,18	9.128,68	2,77%	2,81%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFE...	17.307,21	1.528.129,87	1.509.257,09	45.178,63	8.998,64	0,58%	2,92%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA F...	502.485,01	0,00	0,00	511.260,72	8.775,71	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL MATRIZ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	228.188,84	0,00	0,00	234.346,34	6.157,50	2,70%	2,70%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	322.640,97	0,00	0,00	328.443,00	5.802,03	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	76.989,79	0,00	0,00	78.534,57	1.544,78	2,01%	2,01%
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	583.348,56	0,00	0,00	583.735,58	387,02	0,07%	0,07%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	344.188,49	0,00	0,00	343.611,48	-577,01	-0,17%	-0,17%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	515.692,65	0,00	0,00	514.826,41	-866,24	-0,17%	-0,17%
BB VOTORANTIM HIGHLAND INFRAESTRUTURA RESP LIMITAD...	16.309,60	0,00	0,00	11.729,81	-4.579,79	-28,08%	-28,08%
Total Renda Fixa	15.446.260,89	6.145.476,16	6.499.961,44	15.400.513,16	308.737,55	1,43%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MUL...	100.515,40	0,00	0,00	111.700,35	11.184,95	11,13%	11,13%
CAIXA JUROS E MOEDAS RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	452.794,86	0,00	0,00	463.341,90	10.547,04	2,33%	2,33%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	466.953,62	0,00	0,00	476.331,73	9.378,11	2,01%	2,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE RESP LIMITADA FIF CI...	861.165,27	0,00	0,00	870.443,68	9.278,41	1,08%	1,08%
BB RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO L...	298.103,22	0,00	0,00	304.915,81	6.812,59	2,29%	2,29%
CAIXA ELETROBRAS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	152.155,04	0,00	0,00	149.387,96	-2.767,08	-1,82%	-1,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	244.336,41	0,00	0,00	231.071,06	-13.265,35	-5,43%	-5,43%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃO...	505.586,95	0,00	0,00	491.042,22	-14.544,73	-2,88%	-2,88%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	610.324,83	0,00	0,00	584.270,68	-26.054,15	-4,27%	-4,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA RESP LIMITADA FIF...	613.410,20	0,00	0,00	585.427,90	-27.982,30	-4,56%	-4,56%
BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.125.198,72	0,00	0,00	1.077.191,05	-48.007,67	-4,27%	-4,27%
Total Renda Variável	5.430.544,52	0,00	0,00	5.345.124,34	-85.420,18	-1,57%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	123.186,27	0,00	0,00	141.640,80	18.454,53	14,98%	14,98%
Total Exterior	123.186,27	0,00	0,00	141.640,80	18.454,53	14,98%	

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.

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.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

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.

