

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023



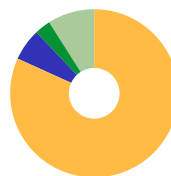
Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

| 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 | 1.652.039,63 | 9,66% | 694 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 1.559.669,79 | 9,12% | 788 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 2.266.447,50 | 13,26% | 850 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 2.322.439,75 | 13,58% | 914 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 900.823,40 | 5,27% | 76 | 0,18% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA... | D+1 | Não há | 2.266.682,13 | 13,26% | 216 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea b |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 1.042.571,70 | 6,10% | 442 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 420.289,66 | 2,46% | 395 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX... | D+1 | Não há | 1.548.070,88 | 9,06% | 224 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea a |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 269.823,22 | 1,58% | 18.137 | 0,02% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 783.534,60 | 4,58% | 65 | 0,29% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | D+3 du | Não há | 522.990,92 | 3,06% | 3.213 | 0,35% | Artigo 9º, Inciso III |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | D+4 | Não há | 764.949,78 | 4,47% | 175 | 0,23% | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+1 | Não há | 387.104,56 | 2,26% | 6.530 | 0,02% | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP | D+0 | Não há | 388.413,63 | 2,27% | 2.628 | 0,03% | Artigo 10º, Inciso I |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 17.095.851,15 | | | | |

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2023)

| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|---------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea a | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 32,00% | 71,95% | 12.300.464,90 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea b | 100,00% | 10.968.102,20 | 64,16% | 20,49% | 39,00% | 81,95% | 3.041.947,82 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea c | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 1.709.585,12 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea a | 60,00% | 3.010.932,24 | 17,61% | 20,89% | 16,00% | 60,00% | 7.246.578,45 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 3.419.170,23 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea b | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 854.792,56 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 13.979.034,44 | 81,77% | 41,38% | 87,00% | 248,90% | |

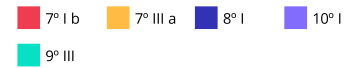
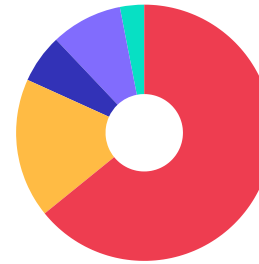


- RENDA FIXA 13.979.034,44
- RENDA VARIÁVEL 1.053.357,82
- EXTERIOR 522.990,92
- ESTRUTURADOS 1.540.467,97

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2023)

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|---|---------------|---------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|--------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 1.053.357,82 | 6,16% | 1,00% | 5,00% | 20,00% | 2.365.812,41 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 1.540.467,97 | 9,01% | 3,00% | 5,00% | 10,00% | 169.117,15 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 2.593.825,79 | 15,17% | 4,00% | 10,00% | 30,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2023 | | | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|-------------------|--------------|--|--------------|---------------|--------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 522.990,92 | 3,06% | 0,00% | 3,00% | 10,00% | 1.186.594,20 |
| Total Exterior | 10,00% | 522.990,92 | 3,06% | 0,00% | 3,00% | 10,00% | |



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2023 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|---------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea a | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 71,95 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea b | 10.968.102,20 | 64,16 | 20,49 | 81,95 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea c | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea a | 3.010.932,24 | 17,61 | 20,89 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea b | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 1.053.357,82 | 6,16 | 1,00 | 20,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 522.990,92 | 3,06 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 1.540.467,97 | 9,01 | 3,00 | 10,00 |

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|--------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM | 6.924.075,23 | 40,50 | 0,03 |
| ITAU ASSET MANAGEMENT | 6.442.391,59 | 37,68 | 0,00 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 2.686.812,63 | 15,72 | - |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT | 1.042.571,70 | 6,10 | 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 Dezembro/2023 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 1,45% | 12,13% | 2,89% | 5,00% | 12,13% | 22,60% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,40% | 11,90% | 2,86% | 4,97% | 11,90% | 22,02% | 0,43% | 1,99% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,46% | 12,13% | 2,97% | 4,75% | 12,13% | 23,09% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,44% | 11,96% | 2,92% | 4,64% | 11,96% | 22,79% | 0,48% | 1,97% |
| IMA-B (Benchmark) | 2,75% | 16,05% | 4,76% | 4,21% | 16,05% | 23,45% | - | - |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 2,84% | 15,65% | 4,53% | 3,50% | 15,65% | 21,36% | 1,58% | 4,77% |
| CDI (Benchmark) | 0,90% | 13,05% | 2,84% | 6,15% | 13,05% | 27,03% | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,95% | 14,99% | 2,92% | 5,73% | 14,99% | 25,68% | 0,06% | 1,59% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP | 1,13% | 12,69% | 3,08% | 5,22% | 12,69% | 26,00% | 0,25% | 0,83% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,94% | 13,63% | 3,01% | 6,66% | 13,63% | 28,40% | 0,01% | 0,07% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,95% | 13,57% | 3,03% | 6,68% | 13,57% | 28,48% | 0,02% | 0,10% |
| IPCA (Benchmark) | 0,56% | 4,62% | 1,08% | 1,70% | 4,62% | 10,67% | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 1,21% | 13,59% | 2,92% | 4,92% | 13,59% | 25,74% | 0,28% | 1,29% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ... | 1,61% | 15,84% | 4,04% | 5,04% | 15,84% | 24,91% | 0,78% | 3,29% |

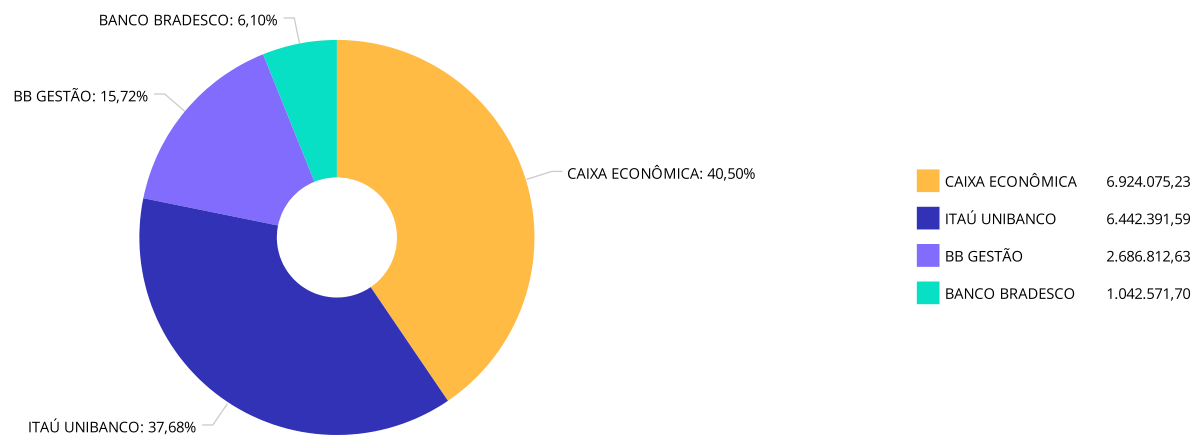
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark) | 0,90% | 13,05% | 2,84% | 6,15% | 13,05% | 27,03% | - | - |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP | 0,90% | 12,51% | 2,73% | 5,58% | 12,51% | 27,64% | 0,05% | 0,39% |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 1,13% | 13,22% | 3,63% | 6,24% | 13,22% | 26,55% | 0,33% | 1,19% |
| Ibovespa (Benchmark) | 5,38% | 22,28% | 15,12% | 13,63% | 22,28% | 28,01% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 5,47% | 7,41% | 9,14% | 3,37% | 7,41% | -2,64% | 7,40% | 19,62% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 5,22% | 18,94% | 13,89% | 13,09% | 18,94% | 18,04% | 6,39% | 16,78% |
| MSCI ACWI (Benchmark) | 2,70% | 11,43% | 7,01% | 6,95% | 11,43% | -16,44% | - | - |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 5,19% | 33,22% | 12,99% | 10,86% | 33,22% | 17,27% | 4,22% | 13,32% |

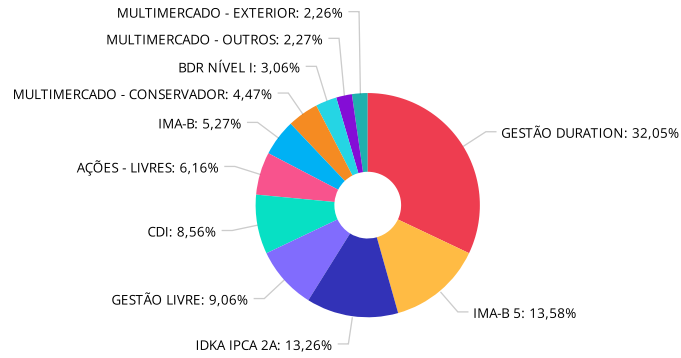
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|----------------------------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 2,84% | 26,33% | 7,77% | 9,72% | 26,33% | -9,11% | - | - |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 2,06% | 9,92% | 6,16% | 10,10% | 9,92% | -6,61% | 4,16% | 13,405% |

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2023)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2023)

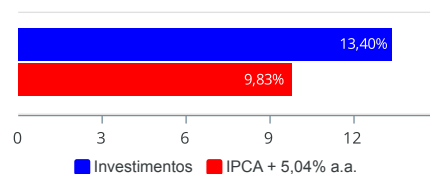


| | | | | | | | |
|-------------------|--------------|-------------------------|--------------|---------------------------|--------------|------------------------------|--------------|
| ■ GESTÃO DURATION | 5.478.391,55 | ■ IMA-B 5 | 2.322.439,75 | ■ IDKA IPCA 2A | 2.266.447,50 | ■ GESTÃO LIVRE | 1.548.070,88 |
| ■ CDI | 1.462.861,36 | ■ AÇÕES - LIVRES | 1.053.357,82 | ■ IMA-B | 900.823,40 | ■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 764.949,78 |
| ■ BDR NÍVEL I | 522.990,92 | ■ MULTIMERCADO - OUTROS | 388.413,63 | ■ MULTIMERCADO - EXTERIOR | 387.104,56 | | |

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|--------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 18.128.566,53 | 0,00 | 0,00 | 18.355.392,69 | 226.826,16 | 226.826,16 | 1,25% | 1,25% | 0,96% | 0,96% | 130,00% | 1,80% |
| Fevereiro | 18.355.392,69 | 0,00 | 0,00 | 18.442.802,10 | 87.409,41 | 314.235,57 | 0,48% | 1,73% | 1,19% | 2,17% | 79,92% | 1,62% |
| Março | 18.442.802,10 | 0,00 | 0,00 | 18.672.072,12 | 229.270,02 | 543.505,59 | 1,24% | 3,00% | 1,16% | 3,36% | 89,31% | 1,47% |
| Abril | 18.672.072,12 | 0,00 | 0,00 | 18.865.435,34 | 193.363,22 | 736.868,81 | 1,04% | 4,06% | 0,96% | 4,35% | 93,37% | 1,34% |
| Mai | 18.865.435,34 | 0,00 | 500.000,00 | 18.649.559,79 | 284.124,45 | 1.020.993,26 | 1,51% | 5,63% | 0,66% | 5,04% | 111,67% | 1,24% |
| Junho | 18.649.559,79 | 0,00 | 640.000,00 | 18.350.505,42 | 340.945,63 | 1.361.938,89 | 1,83% | 7,56% | 0,33% | 5,39% | 140,31% | 1,39% |
| Julho | 18.350.505,42 | 0,00 | 0,00 | 18.566.760,97 | 216.255,55 | 1.578.194,44 | 1,18% | 8,83% | 0,53% | 5,95% | 148,42% | 1,26% |
| Agosto | 18.566.760,97 | 1.071.181,69 | 1.421.000,00 | 18.243.787,11 | 26.844,45 | 1.605.038,89 | 0,14% | 8,99% | 0,68% | 6,67% | 134,73% | 1,40% |
| Setembro | 18.243.787,11 | 0,00 | 1.024.399,66 | 17.238.801,25 | 19.413,80 | 1.624.452,69 | 0,11% | 9,10% | 0,65% | 7,37% | 123,58% | 1,47% |
| Outubro | 17.238.801,25 | 0,00 | 515.000,00 | 16.676.919,47 | -46.881,78 | 1.577.570,91 | -0,27% | 8,81% | 0,65% | 8,07% | 109,19% | 1,89% |
| Novembro | 16.676.919,47 | 0,00 | 350.000,00 | 16.740.679,92 | 413.760,45 | 1.991.331,36 | 2,48% | 11,51% | 0,67% | 8,79% | 130,87% | 1,38% |
| Dezembro | 16.740.679,92 | 0,00 | 350.000,00 | 16.675.561,49 | 284.881,57 | 2.276.212,93 | 1,70% | 13,40% | 0,95% | 9,83% | 136,37% | 1,04% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



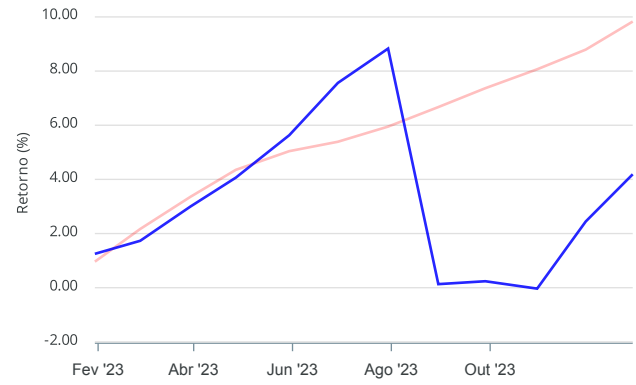
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Dezembro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|-------------|-------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 875.978,65 | 0,00 | 0,00 | 900.823,40 | 24.844,75 | 2,84% | 2,84% | 1,58% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA... | 2.230.756,03 | 0,00 | 0,00 | 2.266.682,13 | 35.926,10 | 1,61% | 1,61% | 0,78% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.289.504,50 | 0,00 | 0,00 | 2.322.439,75 | 32.935,25 | 1,44% | 1,44% | 0,48% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 2.235.114,95 | 0,00 | 0,00 | 2.266.447,50 | 31.332,55 | 1,40% | 1,40% | 0,43% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 1.541.062,78 | 0,00 | 0,00 | 1.559.669,79 | 18.607,01 | 1,21% | 1,21% | 0,28% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 1.877.755,02 | 0,00 | 350.000,00 | 1.548.070,88 | 20.315,86 | 1,08% | 1,13% | 0,25% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 416.336,35 | 0,00 | 0,00 | 420.289,66 | 3.953,31 | 0,95% | 0,95% | 0,02% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 1.636.521,25 | 0,00 | 0,00 | 1.652.039,63 | 15.518,38 | 0,95% | 0,95% | 0,06% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.032.886,16 | 0,00 | 0,00 | 1.042.571,70 | 9.685,54 | 0,94% | 0,94% | 0,01% |
| Total Renda Fixa | 14.135.915,69 | 0,00 | 350.000,00 | 13.979.034,44 | 193.118,75 | 1,37% | | 0,45% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|---------------------|-------------|-------------|---------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 742.891,45 | 0,00 | 0,00 | 783.534,60 | 40.643,15 | 5,47% | 5,47% | 7,40% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 256.437,57 | 0,00 | 0,00 | 269.823,22 | 13.385,65 | 5,22% | 5,22% | 6,39% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 368.003,24 | 0,00 | 0,00 | 387.104,56 | 19.101,32 | 5,19% | 5,19% | 4,22% |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 756.398,56 | 0,00 | 0,00 | 764.949,78 | 8.551,22 | 1,13% | 1,13% | 0,33% |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP | 384.942,74 | 0,00 | 0,00 | 388.413,63 | 3.470,89 | 0,90% | 0,90% | 0,05% |
| Total Renda Variável | 2.508.673,56 | 0,00 | 0,00 | 2.593.825,79 | 85.152,23 | 3,39% | | 3,64% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Dezembro / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|----------------------------|-------------------|-------------|-------------|-------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 512.427,02 | 0,00 | 0,00 | 522.990,92 | 10.563,90 | 2,06% | 2,06% | 4,16% |
| Total Exterior | 512.427,02 | 0,00 | 0,00 | 522.990,92 | 10.563,90 | 2,06% | | 4,16% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------------|-------------|---------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA... | 2.178.768,01 | 0,00 | 0,00 | 2.266.682,13 | 87.914,12 | 4,04% | 4,04% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.601.912,13 | 0,00 | 350.000,00 | 2.322.439,75 | 70.527,62 | 2,71% | 2,92% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 2.203.517,35 | 0,00 | 0,00 | 2.266.447,50 | 62.930,15 | 2,86% | 2,86% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 2.353.840,11 | 0,00 | 865.000,00 | 1.548.070,88 | 59.230,77 | 2,52% | 3,08% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 1.605.165,20 | 0,00 | 0,00 | 1.652.039,63 | 46.874,43 | 2,92% | 2,92% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 1.515.374,39 | 0,00 | 0,00 | 1.559.669,79 | 44.295,40 | 2,92% | 2,92% |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 861.815,89 | 0,00 | 0,00 | 900.823,40 | 39.007,51 | 4,53% | 4,53% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.012.099,88 | 0,00 | 0,00 | 1.042.571,70 | 30.471,82 | 3,01% | 3,01% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 407.927,33 | 0,00 | 0,00 | 420.289,66 | 12.362,33 | 3,03% | 3,03% |
| Total Renda Fixa | 14.740.420,29 | 0,00 | 1.215.000,00 | 13.979.034,44 | 453.614,15 | 3,08% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|--------------|------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 717.927,57 | 0,00 | 0,00 | 783.534,60 | 65.607,03 | 9,14% | 9,14% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 342.600,15 | 0,00 | 0,00 | 387.104,56 | 44.504,41 | 12,99% | 12,99% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 236.912,41 | 0,00 | 0,00 | 269.823,22 | 32.910,81 | 13,89% | 13,89% |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 738.141,71 | 0,00 | 0,00 | 764.949,78 | 26.808,07 | 3,63% | 3,63% |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP | 378.088,56 | 0,00 | 0,00 | 388.413,63 | 10.325,07 | 2,73% | 2,73% |
| Total Renda Variável | 2.413.670,40 | 0,00 | 0,00 | 2.593.825,79 | 180.155,39 | 7,46% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|----------------------------|-------------------|-------------|-------------|-------------------|------------------|--------------|------------|
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 492.637,89 | 0,00 | 0,00 | 522.990,92 | 30.353,03 | 6,16% | 6,16% |
| Total Exterior | 492.637,89 | 0,00 | 0,00 | 522.990,92 | 30.353,03 | 6,16% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------------|---------------------|--------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 3.462.834,74 | 0,00 | 2.286.000,00 | 1.548.070,88 | 371.236,14 | 12,49% | 12,69% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA... | 1.893.269,19 | 71.181,69 | 0,00 | 2.266.682,13 | 302.231,25 | 15,79% | 15,84% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.391.715,53 | 0,00 | 350.000,00 | 2.322.439,75 | 280.724,22 | 11,95% | 11,96% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 2.450.571,13 | 0,00 | 1.140.000,00 | 1.559.669,79 | 249.098,66 | 12,82% | 13,59% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 2.025.417,66 | 0,00 | 0,00 | 2.266.447,50 | 241.029,84 | 11,89% | 11,90% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 1.436.733,20 | 0,00 | 0,00 | 1.652.039,63 | 215.306,43 | 14,99% | 14,99% |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 778.946,34 | 0,00 | 0,00 | 900.823,40 | 121.877,06 | 15,66% | 15,65% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 945.536,09 | 0,00 | 1.024.399,66 | 0,00 | 78.863,57 | 8,34% | 11,72% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 370.070,22 | 0,00 | 0,00 | 420.289,66 | 50.219,44 | 13,57% | 13,57% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,00 | 1.000.000,00 | 0,00 | 1.042.571,70 | 42.571,70 | 4,26% | 13,63% |
| Total Renda Fixa | 15.755.094,10 | 1.000.000,00 | 0,00 | 16.915.338,19 | 160.244,09 | 0,96% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|---------------------|-------------|-------------|---------------------|------------------|--------------|------------|
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 290.579,75 | 0,00 | 0,00 | 387.104,56 | 96.524,81 | 33,21% | 33,22% |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 675.622,27 | 0,00 | 0,00 | 764.949,78 | 89.327,51 | 13,20% | 13,22% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 729.464,46 | 0,00 | 0,00 | 783.534,60 | 54.070,14 | 7,41% | 7,41% |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP | 345.222,35 | 0,00 | 0,00 | 388.413,63 | 43.191,28 | 12,51% | 12,51% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 226.862,50 | 0,00 | 0,00 | 269.823,22 | 42.960,72 | 18,93% | 18,94% |
| Total Renda Variável | 2.267.751,33 | 0,00 | 0,00 | 2.339.390,85 | 71.639,52 | 3,16% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|----------------------------|-------------------|-------------|-------------|-------------------|---------------|--------------|------------|
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 475.791,32 | 0,00 | 0,00 | 522.990,92 | 47.199,60 | 9,92% | 9,92% |
| Total Exterior | 475.791,32 | 0,00 | 0,00 | 476.508,46 | 717,14 | 0,15% | |

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 & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

