

Relatório Analítico dos Investimentos

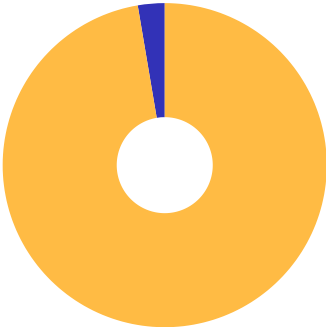
em março e 1º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	264.422,01	7,22%	242	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	436.657,21	11,93%	801	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	401.747,91	10,98%	840	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	411.904,54	11,25%	910	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	808.322,00	22,08%	1.187	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	267.162,36	7,30%	454	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	238.949,31	6,53%	739	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	327.249,09	8,94%	995	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	406.258,52	11,10%	445	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	9.505,79	0,26%	5.931	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	16.481,71	0,45%	2.303	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	21.565,72	0,59%	16.031	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	8.332,64	0,23%	5.220	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	41.762,59	1,14%	46	0,06%	Artigo 8º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			3.660.321,40				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.868,49	Artigo 6º			
PL Total			3.662.189,89				

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%	15,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	2.829.165,34	77,29%	0,00%	45,00%	0,00%	-2.829.165,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	733.507,61	20,04%	0,00%	20,00%	0,00%	-733.507,61
Total Renda Fixa	100,00%	3.562.672,95	97,33%	0,00%	80,00%	0,00%	



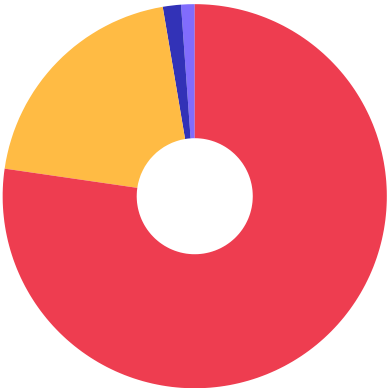
RENTA FIXA 3.562.672,95

RENTA VARIÁVEL 97.648,45

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	55.885,86	1,53%	0,00%	5,00%	0,00%	-55.885,86
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	41.762,59	1,14%	0,00%	7,00%	0,00%	-41.762,59
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	0,00%	0,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	97.648,45	2,67%	0,00%	15,00%	0,00%	

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



7º I b

7º III a

8º I

8º II

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	3.660.321,40	100,00	0,01

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	2,24%	2,24%	5,19%	9,48%	20,66%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,08%	2,08%	5,00%	9,45%	19,97%	0,52%	1,60%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,77%	2,06%	2,06%	5,09%	9,62%	21,01%	-	-
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%
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%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,82%	2,57%	2,57%	5,42%	12,11%	26,70%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	2,55%	2,55%	5,41%	12,25%	26,99%	0,07%	0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	2,70%	5,72%	12,96%	27,89%	0,05%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,87%	2,72%	2,72%	5,74%	12,93%	27,88%	0,01%	0,07%
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%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

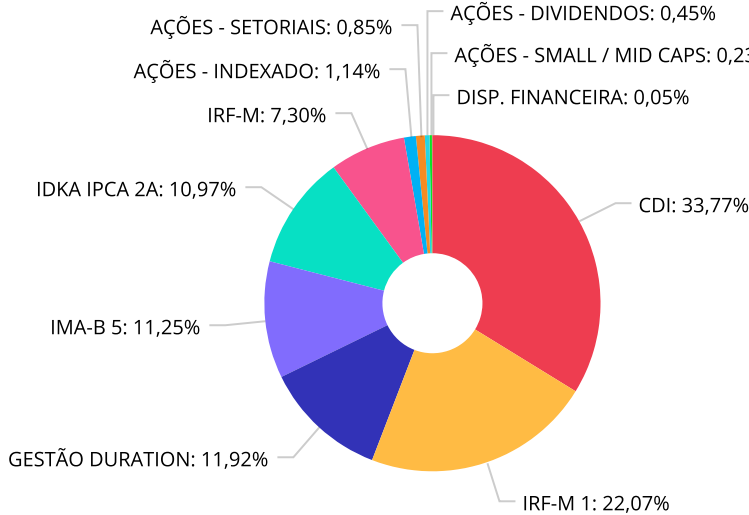
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1,12%	-7,43%	-7,43%	3,63%	12,30%	-31,34%	7,81%	22,21%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-0,65%	-4,44%	-4,44%	9,73%	25,09%	6,86%	5,18%	16,13%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	-7,02%	-2,18%	-2,18%	3,70%	73,35%	106,83%	20,49%	30,35%
IDIV (Benchmark)	-1,20%	-3,81%	-3,81%	10,25%	27,20%	19,02%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,24%	-3,98%	-3,98%	9,56%	25,38%	16,39%	4,38%	12,88%
SMLL (Benchmark)	2,15%	-4,09%	-4,09%	6,93%	24,13%	-10,57%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2,09%	-4,27%	-4,27%	6,32%	22,85%	-11,79%	6,29%	20,68%

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



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

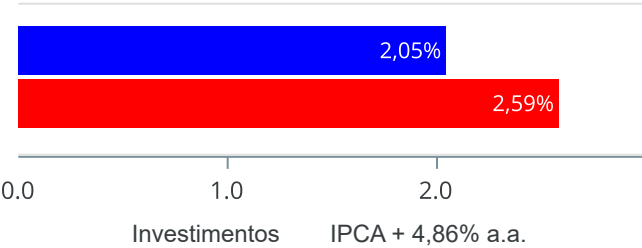


CDI	1.236.878,93	IRF-M 1	808.322,00	GESTÃO DURATION	436.657,21	IMA-B 5	411.904,54
IDKA IPCA 2A	401.747,91	IRF-M	267.162,36	AÇÕES - INDEXADO	41.762,59	AÇÕES - SETORIAIS	31.071,51
AÇÕES - DIVIDENDOS	16.481,71	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	8.332,64	DISP. FINANCEIRA	1.868,49		

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	3.194.736,68	115.500,00	0,00	3.334.084,49	23.847,81	23.847,81	0,72%	0,72%	0,84%	0,84%	86,08%	0,44%
Fevereiro	3.334.084,49	229.106,96	128.690,57	3.456.400,62	21.899,74	45.747,55	0,64%	1,36%	1,19%	2,04%	66,85%	0,45%
Março	3.456.400,62	17.404,81	147.012,12	3.350.249,35	23.456,04	69.203,59	0,68%	2,05%	0,54%	2,59%	79,26%	0,49%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

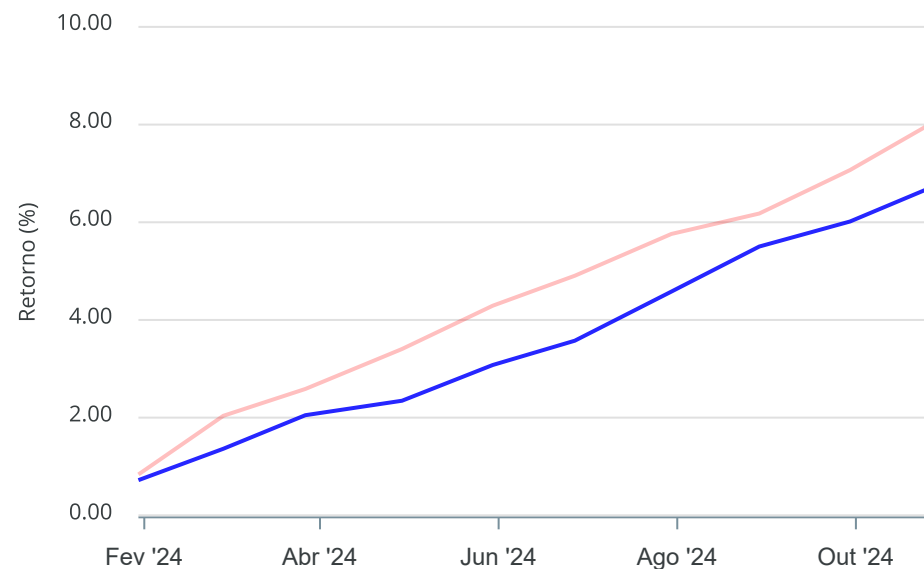
Evolução do Patrimônio



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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	398.172,14	0,00	0,00	401.747,91	3.575,77	0,90%	0,90%	0,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	324.431,55	0,00	0,00	327.249,09	2.817,54	0,87%	0,87%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	402.838,92	0,00	0,00	406.258,52	3.419,60	0,85%	0,85%	0,05%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	262.284,14	0,00	0,00	264.422,01	2.137,87	0,82%	0,82%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	237.066,73	0,00	0,00	238.949,31	1.882,58	0,79%	0,79%	0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	408.827,33	0,00	0,00	411.904,54	3.077,21	0,75%	0,75%	0,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	937.415,84	17.404,81	153.527,12	808.322,00	7.028,47	0,74%	0,80%	0,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	434.148,60	0,00	0,00	436.657,21	2.508,61	0,58%	0,58%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	265.832,96	0,00	0,00	267.162,36	1.329,40	0,50%	0,50%	0,72%
Total Renda Fixa	3.671.018,21	17.404,81	153.527,12	3.562.672,95	27.777,05	0,76%		0,26%

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	8.161,71	0,00	0,00	8.332,64	170,93	2,09%	2,09%	6,29%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	9.400,21	0,00	0,00	9.505,79	105,58	1,12%	1,12%	7,81%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	42.037,61	0,00	0,00	41.762,59	-275,02	-0,65%	-0,65%	5,18%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	16.687,93	0,00	0,00	16.481,71	-206,22	-1,24%	-1,24%	4,38%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	23.193,53	0,00	0,00	21.565,72	-1.627,81	-7,02%	-7,02%	20,49%
Total Renda Variável	99.480,99	0,00	0,00	97.648,45	-1.832,54	-1,84%		8,78%

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 BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	728.580,17	226.057,90	166.895,19	808.322,00	20.579,12	2,16%	2,47%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	395.583,99	0,00	0,00	406.258,52	10.674,53	2,70%	2,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	318.582,06	0,00	0,00	327.249,09	8.667,03	2,72%	2,72%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	384.711,28	0,00	128.690,57	264.422,01	8.401,30	2,18%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	403.802,33	0,00	0,00	411.904,54	8.102,21	2,01%	2,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	428.943,54	0,00	0,00	436.657,21	7.713,67	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	228.872,23	166.430,21	0,00	401.747,91	6.445,47	1,63%	2,08%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	233.002,21	0,00	0,00	238.949,31	5.947,10	2,55%	2,55%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	262.917,14	0,00	0,00	267.162,36	4.245,22	1,61%	1,61%
Total Renda Fixa	3.384.994,95	392.488,11	295.585,76	3.562.672,95	80.775,65	2,32%	

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	8.704,21	0,00	0,00	8.332,64	-371,57	-4,27%	-4,27%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	22.045,68	0,00	0,00	21.565,72	-479,96	-2,18%	-2,18%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.165,11	0,00	0,00	16.481,71	-683,40	-3,98%	-3,98%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	10.269,18	0,00	0,00	9.505,79	-763,39	-7,43%	-7,43%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	43.702,69	0,00	0,00	41.762,59	-1.940,10	-4,44%	-4,44%
Total Renda Variável	101.886,87	0,00	0,00	97.648,45	-4.238,42	-4,16%	

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 SERCONPREV - SERVIÇOS E CONSULTORIA EM PREVIDÊNCIA S/S LTDA.. 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.

