

Relatório Analítico dos Investimentos

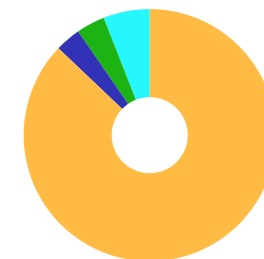
em março e 1º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.337.956,52	2,68%	711	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.371.953,14	4,76%	796	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.249.220,38	10,53%	652	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	8.560.099,19	17,17%	1.151	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.053.836,15	16,15%	651	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.944.232,04	11,92%	801	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.594.579,73	3,20%	910	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	36.960,09	0,07%	1.013	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	6.370.602,17	12,78%	1.141	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.768.480,34	5,55%	148	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRANCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA RE...	D+0	Não há	1.139.541,77	2,29%	452	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.635.256,28	3,28%	17.138	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	1.824.295,50	3,66%	140	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.167.312,26	2,34%	87	0,96%	Artigo 10º, Inciso I
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	1.801.293,55	3,61%	169.729	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			49.855.619,11				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			66.956,22				Artigo 6º
PL Total			49.922.575,33				

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

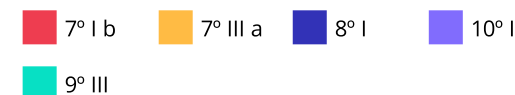
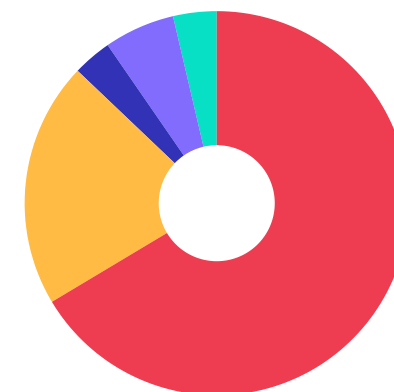
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	14.956.685,73
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	33.111.877,15	66,42%	20,00%	55,00%	90,00%	11.758.180,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	10.315.584,37	20,69%	10,00%	20,00%	50,00%	14.612.225,19
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.985.561,91
Total Renda Fixa	100,00%	43.427.461,52	87,11%	30,00%	85,00%	180,00%	



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%	1.635.256,28	3,28%	0,00%	4,00%	20,00%	8.335.867,54
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.968.605,81	5,95%	0,00%	7,00%	10,00%	2.016.956,10
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	4.603.862,09	9,23%	0,00%	11,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.824.295,50	3,66%	0,00%	4,00%	10,00%	3.161.266,41
Total Exterior	10,00%	1.824.295,50	3,66%	0,00%	4,00%	10,00%	



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	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	31.773.920,63	63,73	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	10.315.584,37	20,69	10,00	50,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I	1.635.256,28	3,28	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	1.824.295,50	3,66	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.968.605,81	5,95	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.408.785,23	77,04	-
CAIXA DTVM	7.538.811,77	15,12	0,03
BANCO BRADESCO	3.908.022,11	7,84	0,07

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%	-	-
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%
IMA-B (Benchmark)	0,08%	0,18%	0,18%	4,94%	11,81%	20,21%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	0,11%	0,11%	4,82%	11,56%	19,65%	1,09%	3,88%
IRF-M (Benchmark)	0,54%	1,68%	1,68%	6,13%	14,03%	27,20%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,61%	1,61%	6,00%	13,61%	26,42%	0,72%	2,21%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85%	2,65%	2,65%	5,55%	12,40%	27,30%	0,01%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	2,38%	2,38%	5,02%	11,27%	24,78%	0,01%	0,06%
BRANCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91%	2,92%	2,92%	6,02%	13,31%	28,84%	0,03%	0,09%
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%
IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,58%	1,80%	1,80%	4,77%	11,99%	25,10%	0,55%	1,35%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,49%	1,53%	1,53%	5,23%	12,96%	24,31%	0,51%	1,95%

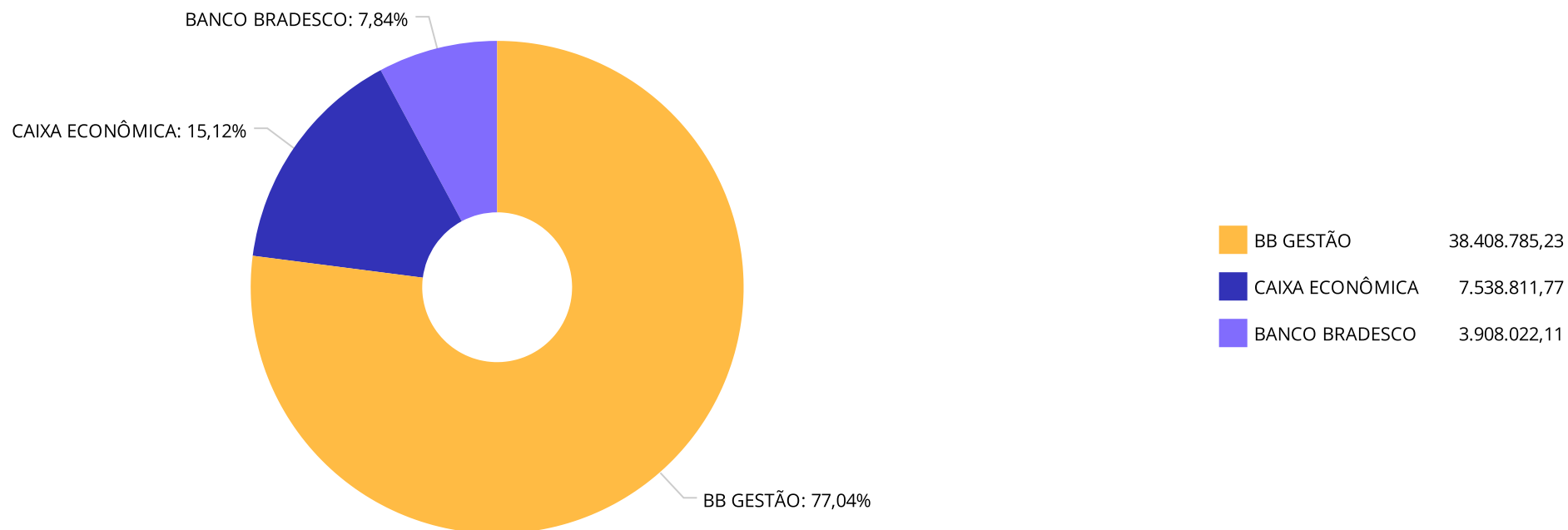
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,84%	2,54%	2,54%	5,74%	12,20%	25,83%	0,05%	0,51%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,72%	1,92%	1,92%	5,59%	10,49%	22,96%	0,53%	1,46%
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-1,58%	-7,45%	-7,45%	5,40%	19,61%	-2,03%	5,30%	15,27%

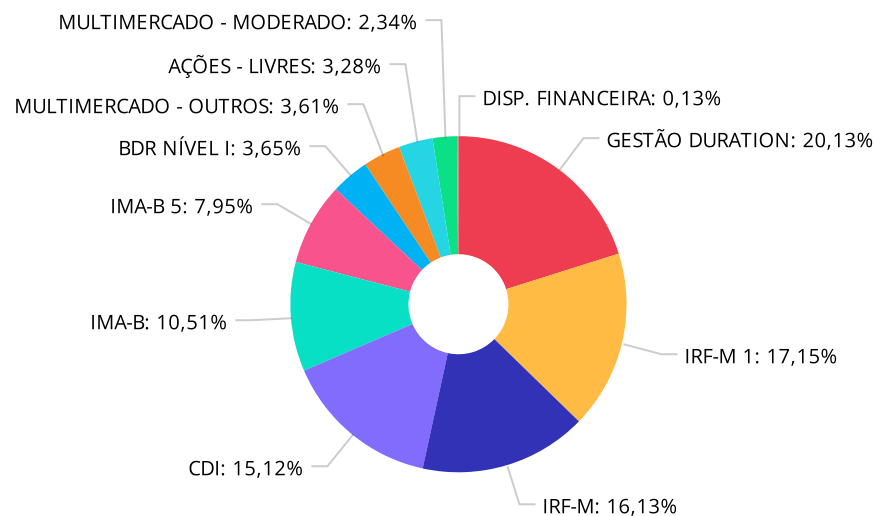
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,24%	13,93%	13,93%	22,60%	29,68%	24,40%	5,80%	13,276%

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



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

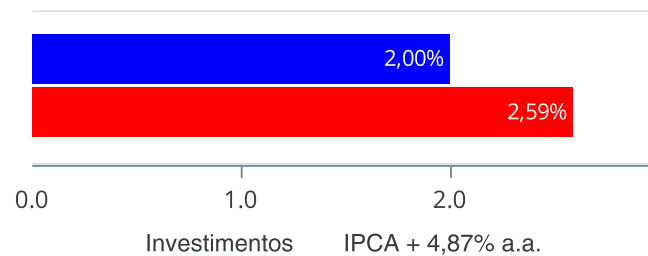


■ GESTÃO DURATION	10.050.668,90	■ IRF-M 1	8.560.099,19	■ IRF-M	8.053.836,15	■ CDI	7.547.104,03
■ IMA-B	5.249.220,38	■ IMA-B 5	3.966.532,87	■ BDR NÍVEL I	1.824.295,50	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.801.293,55
■ AÇÕES - LIVRES	1.635.256,28	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.167.312,26	■ DISP. FINANCEIRA	66.956,22		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

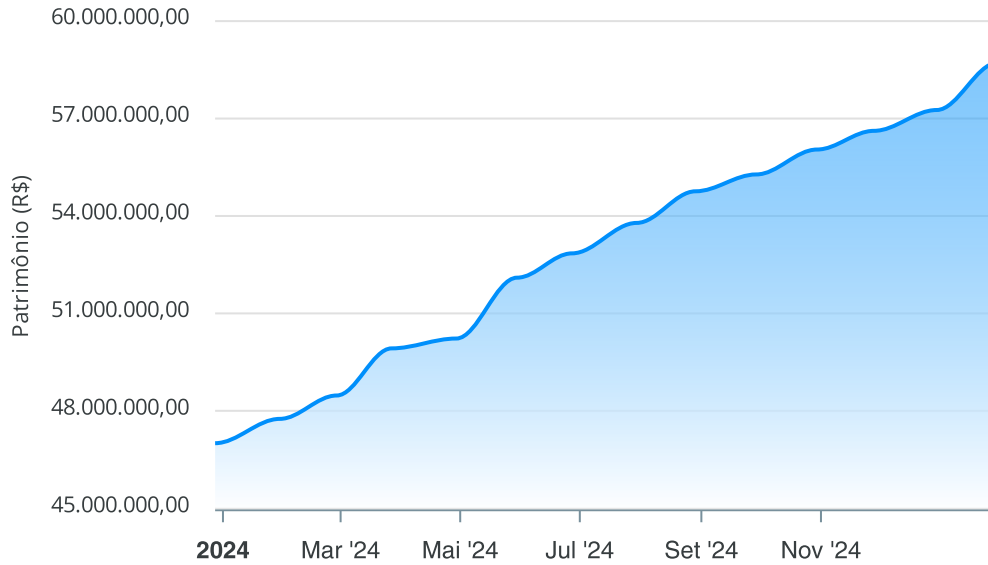
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	46.781.171,04	772.610,52	359.652,04	47.446.114,46	251.984,94	251.984,94	0,53%	0,53%	0,84%	0,84%	63,73%	0,79%
Fevereiro	47.446.114,46	900.785,56	357.230,52	48.394.798,36	405.128,86	657.113,80	0,84%	1,38%	1,19%	2,04%	67,78%	0,88%
Março	48.394.798,36	1.484.149,60	363.628,28	49.818.659,02	303.339,34	960.453,14	0,61%	2,00%	0,54%	2,59%	77,38%	0,78%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



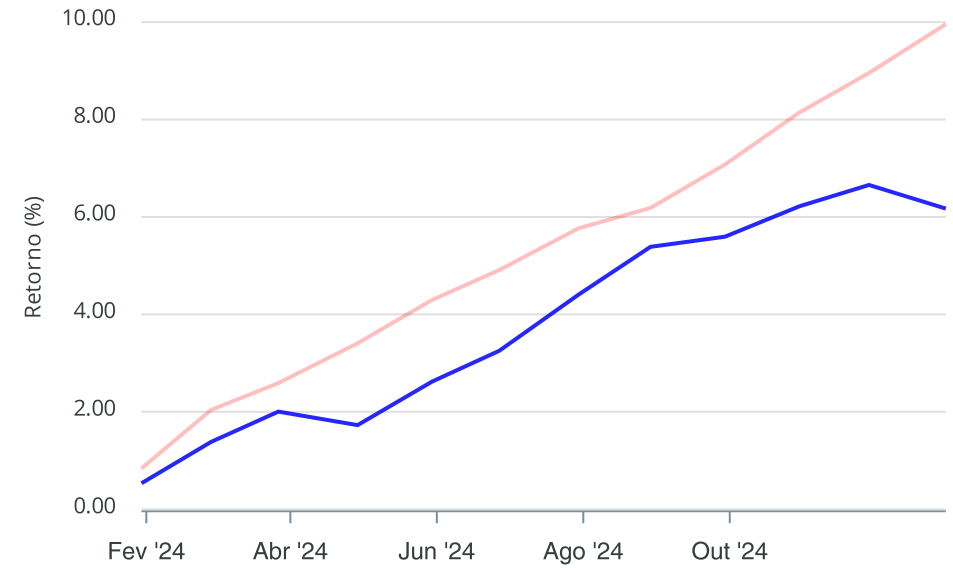
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BRDESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFE...	1.129.260,43	0,00	0,00	1.139.541,77	10.281,34	0,91%	0,91%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.312.159,53	27.521,79	22.913,36	6.370.602,17	53.834,21	0,85%	0,85%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.829.878,76	0,00	340.714,92	8.560.099,19	70.935,35	0,80%	0,80%	0,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.327.777,42	0,00	0,00	1.337.956,52	10.179,10	0,77%	0,77%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.582.667,15	0,00	0,00	1.594.579,73	11.912,58	0,75%	0,75%	0,44%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.354.260,89	0,00	0,00	2.371.953,14	17.692,25	0,75%	0,75%	0,44%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.910.082,28	0,00	0,00	5.944.232,04	34.149,76	0,58%	0,58%	0,55%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.013.491,74	0,00	0,00	8.053.836,15	40.344,41	0,50%	0,50%	0,72%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.754.912,62	0,00	0,00	2.768.480,34	13.567,72	0,49%	0,49%	0,51%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	12.459,35	49.919,25	25.722,46	36.960,09	303,95	0,49%	0,75%	0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.789.189,95	1.456.627,81	0,00	5.249.220,38	3.402,62	0,06%	0,06%	1,09%
Total Renda Fixa	42.016.140,12	1.534.068,85	389.350,74	43.427.461,52	266.603,29	0,62%		0,44%

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
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.786.301,04	0,00	0,00	1.801.293,55	14.992,51	0,84%	0,84%	0,05%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.158.931,52	0,00	0,00	1.167.312,26	8.380,74	0,72%	0,72%	0,53%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.661.574,00	0,00	0,00	1.635.256,28	-26.317,72	-1,58%	-1,58%	5,30%
Total Renda Variável	4.606.806,56	0,00	0,00	4.603.862,09	-2.944,47	-0,06%		2,04%

