

# 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	6.561.498,88	4,06%	711	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.804.812,99	5,44%	652	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.171.380,12	2,58%	1.151	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.667.182,63	2,27%	199	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	3.155.373,09	1,95%	306	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	8.906.564,36	5,51%	211	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.666.429,28	4,12%	910	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	3.862.445,39	2,39%	163	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	473.736,82	0,29%	1.187	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.369.291,56	4,56%	454	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.363.341,23	7,03%	221	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.985,19	0,00%	1.013	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	8.057.373,59	4,98%	1.141	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.740.244,74	6,64%	452	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.231.340,09	2,62%	445	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.070.289,02	1,90%	716	0,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	14.809.569,37	9,16%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	1.785.046,45	1,10%	102	0,79%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	1.906.746,48	1,18%	643	0,81%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.628.798,44	2,24%	1.248	0,46%	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
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.964.573,46	2,45%	2.652	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.670.920,66	3,51%	895	0,90%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	7.704.124,38	4,76%	202	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.904.241,94	1,18%	5.220	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
MAG BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.075.731,39	1,90%	1.625	0,99%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.007.073,18	1,24%	1.017	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	2.330.828,87	1,44%	3.887	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL...	D+2 du	Não há	799.912,30	0,49%	1.940	1,24%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.442.521,76	0,89%	9.905	0,20%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.412.676,13	1,49%	465	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5 du	Não há	2.258.951,82	1,40%	753	6,81%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	4.967.988,96	3,07%	174	1,47%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.780.986,69	2,34%	112	0,67%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	6.180.977,50	3,82%	2.524	0,50%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>161.734.958,76</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	13,95%	21,80%	35.258.221,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	65.002.056,35	40,19%	6,98%	13,97%	100,00%	96.732.902,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	26.101.232,63	16,14%	6,98%	13,97%	27,93%	19.071.341,35
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	14.809.569,37	9,16%	0,00%	13,97%	20,00%	17.537.422,38
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,27%	5,00%	8.086.747,94
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	3.691.792,93	2,28%	0,00%	2,28%	5,00%	4.394.955,01
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>109.604.651,28</b>	<b>67,77%</b>	<b>13,96%</b>	<b>58,41%</b>	<b>179,73%</b>	

**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	30.286.292,32	18,73%	0,00%	19,00%	35,00%	26.320.943,25
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	56.607.235,57
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	14.929.953,15	9,23%	0,00%	10,00%	10,00%	1.243.542,73
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.086.747,94
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,45%	5,00%	8.086.747,94
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>35,00%</b>	<b>45.216.245,47</b>	<b>27,96%</b>	<b>0,00%</b>	<b>32,45%</b>	<b>90,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,57%	10,00%	16.173.495,88
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.914.062,01	4,27%	0,00%	3,57%	10,00%	9.259.433,87
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>6.914.062,01</b>	<b>4,27%</b>	<b>0,00%</b>	<b>7,14%</b>	<b>20,00%</b>	

**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	21,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	65.002.056,35	40,19	6,98	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	26.101.232,63	16,14	6,98	27,93
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	3.691.792,93	2,28	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	30.286.292,32	18,73	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	10,00
Artigo 9º, Inciso III	6.914.062,01	4,27	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	14.929.953,15	9,23	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	0,00	0,00	0,00	10,00

**Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	64.104.154,34	39,64	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	46.068.028,32	28,48	-
ITAÚ UNIBANCO	14.809.569,37	9,16	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	11.363.341,23	7,03	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	10.740.244,74	6,64	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	4.982.477,87	3,08	-
GENIAL INVESTIMENTOS	4.589.780,69	2,84	-
SICREDI	3.070.289,02	1,90	0,00
OCCAM BRASIL	2.007.073,18	1,24	0,03

**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
<b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,62%	2,86%	2,90%	5,55%	10,16%	22,20%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,77%	2,01%	2,01%	5,11%	10,08%	21,94%	0,53%	1,80%
<b>IMA Geral (Benchmark)</b>	0,52%	1,64%	1,64%	5,51%	12,59%	24,78%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	1,60%	1,60%	5,44%	12,50%	24,64%	0,46%	1,71%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	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%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,47%	1,67%	1,67%	6,08%	13,93%	27,07%	0,71%	2,34%



**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
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,08%	3,56%	3,56%	6,98%	14,98%	28,04%	0,12%	0,36%
BRDESCO PREMIUM FI 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%
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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	2,70%	5,72%	12,96%	27,89%	0,05%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	-0,07%	-0,07%	2,09%	4,00%	7,21%	0,20%	3,88%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
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 VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	1,75%	1,75%	5,03%	9,99%	-	0,75%	2,71%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
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**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,52%	1,08%	1,08%	6,14%	12,84%	23,94%	1,07%	3,49%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,70%	2,33%	2,33%	5,12%	11,68%	26,54%	0,27%	0,37%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	2,29%	2,29%	6,00%	12,11%	25,87%	0,46%	1,16%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	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%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
MAG BRASIL FI AÇÕES	-0,20%	-4,33%	-4,33%	8,79%	21,69%	-2,17%	5,09%	14,83%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,36%	0,85%	0,85%	15,38%	36,06%	22,66%	5,49%	15,78%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,60%	-2,88%	-2,88%	7,26%	23,33%	1,91%	4,09%	15,08%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,23%	-4,19%	-4,19%	8,65%	22,87%	21,74%	4,58%	13,21%
OCCAM FIC AÇÕES	-1,50%	-4,14%	-4,14%	8,63%	18,73%	3,74%	5,20%	14,88%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,27%	-4,27%	-4,27%	9,48%	20,76%	-0,83%	5,21%	15,39%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-1,20%	-3,81%	-3,81%	10,25%	27,20%	19,02%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,25%	2,01%	2,01%	13,64%	33,00%	17,65%	4,69%	14,70%
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	3,34%	13,20%	13,20%	22,12%	24,96%	19,96%	-	-

**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
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,16%	13,66%	13,66%	22,00%	28,41%	21,95%	5,80%	13,28%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	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%

**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
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	3,34%	13,20%	13,20%	22,12%	24,96%	19,96%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,16%	13,65%	13,65%	22,00%	28,41%	21,95%	5,80%	13,276%
<b>MSCI AC Asia ex Japan (Benchmark)</b>	2,27%	4,98%	4,98%	7,71%	-0,43%	-5,00%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I FIC AÇÕES	2,59%	2,98%	2,98%	8,51%	4,28%	0,84%	5,24%	14,994%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	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%	14,034%
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,74%	18,59%	18,59%	25,73%	34,66%	22,26%	3,92%	12,827%

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

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