

# Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

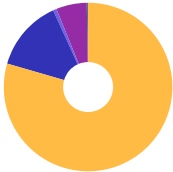
| Produto / Fundo                                     | Resgate    | Carência      | Saldo        | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                       |
|-----------------------------------------------------|------------|---------------|--------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3        | Não há        | 962.649,72   | 2,85%              | 702      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1        | Não há        | 764.583,87   | 2,26%              | 883      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2        | Não há        | 1.527.898,99 | 4,52%              | 291      | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1        | Não há        | 1.656.501,64 | 4,90%              | 650      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1        | Não há        | 1.365.455,09 | 4,04%              | 641      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P... | D+0        | 1795 dias     | 1.073.556,82 | 3,17%              | 199      | 0,10%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | 15/08/2024    | 1.433.740,84 | 4,24%              | 305      | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | Não Inf... | Não há        | 3.412.585,02 | 10,09%             | 207      | 0,18%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA    | D+0        | 16/05/2027    | 1.353.230,10 | 4,00%              | 83       | 0,31%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA      | D+0        | Não há        | 2.803.589,74 | 8,29%              | 791      | 0,05%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0        | Não há        | 1.630.095,18 | 4,82%              | 850      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há        | 1.141.092,39 | 3,37%              | 914      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0        | Não há        | 1.334.722,41 | 3,95%              | 284      | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0        | Não há        | 1.553.862,02 | 4,59%              | 771      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há        | 235.552,02   | 0,70%              | 1.190    | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0        | Não há        | 1.441.326,60 | 4,26%              | 251      | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO      | D+0        | Não há        | 457.402,77   | 1,35%              | 1.003    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA             | D+4        | Não há        | 860.128,42   | 2,54%              | 150      | 0,12%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP           | D+0        | Não há        | 1.836.752,61 | 5,43%              | 226      | 0,14%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                               | Não se ... | Não se aplica | 38.928,34    | 0,12%              | 98       | 0,13%            | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '   |

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

| Produto / Fundo                              | Resgate    | Carência      | Saldo         | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento         |
|----------------------------------------------|------------|---------------|---------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                   | D+4        | Não há        | 998.903,97    | 2,95%              | 543      | 0,29%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                     | D+33       | Não há        | 531.954,89    | 1,57%              | 1.294    | 0,06%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES              | D+4        | Não há        | 370.901,01    | 1,10%              | 2.611    | 0,07%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                   | D+3        | Não há        | 308.262,18    | 0,91%              | 25.212   | 0,04%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                | D+3        | Não há        | 427.028,89    | 1,26%              | 17.732   | 0,03%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES            | D+25       | Não há        | 339.702,84    | 1,00%              | 918      | 0,05%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                 | D+4        | Não há        | 638.475,52    | 1,89%              | 82       | 0,17%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES              | D+4        | Não há        | 156.666,19    | 0,46%              | 6.058    | 0,07%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES                | D+4        | Não há        | 248.414,84    | 0,73%              | 2.141    | 0,12%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES              | D+4        | Não há        | 614.899,66    | 1,82%              | 5.353    | 0,09%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I     | D+4        | Não há        | 229.670,69    | 0,68%              | 468      | 0,01%            | Artigo 9º, Inciso III |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP         | D+4        | Não há        | 483.949,98    | 1,43%              | 174      | 0,15%            | Artigo 10º, Inciso I  |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP     | D+4        | Não há        | 1.505.008,13  | 4,45%              | 4.948    | 0,10%            | Artigo 10º, Inciso I  |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | Não se ... | Não se aplica | 84.300,00     | 0,25%              |          | 0,06%            | Artigo 11º            |
| Total para cálculo dos limites da Resolução  |            |               | 33.821.793,38 |                    |          |                  |                       |

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

| Artigos - Renda Fixa                | Resolução<br>Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$   | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 |        |         | GAP<br>Superior |
|-------------------------------------|-----------------------------------|---------------|----------|-------------------------------|--------|---------|-----------------|
|                                     |                                   |               |          | Inf                           | Alvo   | Sup     |                 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '   | 100,00%                           | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 2,00%  | 40,00%  | 13.528.717,35   |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 100,00%                           | 23.690.442,45 | 70,04%   | 20,00%                        | 50,00% | 90,00%  | 6.749.171,59    |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 65,00%                            | 3.154.283,80  | 9,33%    | 2,00%                         | 15,00% | 40,00%  | 10.374.433,55   |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 65,00%                            | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 5,00%   | 1.691.089,67    |
| Artigo 7º, Inciso IV                | 20,00%                            | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 4,85%  | 10,00%  | 3.382.179,34    |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '   | 5,00%                             | 38.928,34     | 0,12%    | 0,00%                         | 0,15%  | 2,00%   | 637.507,53      |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '   | 5,00%                             | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 3,00%  | 5,00%   | 1.691.089,67    |
| Total Renda Fixa                    | 100,00%                           | 26.883.654,59 | 79,49%   | 22,00%                        | 75,00% | 192,00% |                 |



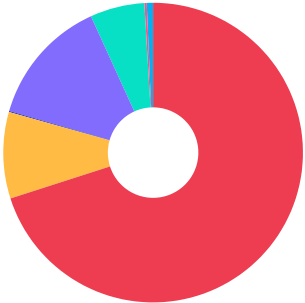
- RENDA FIXA 26.883.654,59
- RENDA VARIÁVEL 4.635.209,99
- EXTERIOR 229.670,69
- ESTRUTURADOS 1.988.958,11
- FUNDO IMOBILIÁRIO 84.300,00

**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 (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2024)

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução<br>Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$  | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 |        |        | GAP Superior |
|------------------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|----------|-------------------------------|--------|--------|--------------|
|                                                      |                                   |              |          | Inf                           | Alvo   | Sup    |              |
| Artigo 8º, Inciso I                                  | 35,00%                            | 4.635.209,99 | 13,70%   | 5,00%                         | 15,00% | 30,00% | 5.511.328,02 |
| Artigo 8º, Inciso II                                 | 35,00%                            | 0,00         | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 2,00%  | 676.435,87   |
| Artigo 10º, Inciso I                                 | 10,00%                            | 1.988.958,11 | 5,88%    | 0,00%                         | 4,50%  | 10,00% | 1.393.221,23 |
| Artigo 11º                                           | 5,00%                             | 84.300,00    | 0,25%    | 0,00%                         | 0,05%  | 5,00%  | 1.606.789,67 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário     | 35,00%                            | 6.708.468,10 | 19,83%   | 5,00%                         | 19,55% | 47,00% |              |

| Artigos - Exterior    | Resolução<br>Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2024 |       |          | GAP Superior |
|-----------------------|-----------------------------------|-------------|----------|----------------------------------------|-------|----------|--------------|
|                       |                                   |             |          | Inferior                               | Alvo  | Superior |              |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00%                            | 229.670,69  | 0,68%    | 0,00%                                  | 3,00% | 10,00%   | 3.152.508,65 |
| Total Exterior        | 10,00%                            | 229.670,69  | 0,68%    | 0,00%                                  | 3,00% | 10,00%   |              |



7º I b 7º III a 7º V a 8º I  
10º I 11º 9º III

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                | 40,00               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 23.690.442,45                 | 70,04      | 20,00               | 90,00               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 3.154.283,80                  | 9,33       | 2,00                | 40,00               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '   | 38.928,34                     | 0,12       | 0,00                | 2,00                |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I                 | 4.635.209,99                  | 13,70      | 5,00                | 30,00               |
| Artigo 8º, Inciso II                | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 2,00                |
| Artigo 9º, Inciso III               | 229.670,69                    | 0,68       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 10º, Inciso I                | 1.988.958,11                  | 5,88       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 11º                          | 84.300,00                     | 0,25       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 12º                          | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

| Gestão                     | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM                 | 21.993.686,80 | 65,03         | -              |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 10.929.049,82 | 32,31         | -              |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT  | 860.128,42    | 2,54          | -              |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS      | 38.928,34     | 0,12          | -              |

**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 Janeiro/2024 - RENDA FIXA

|                                                             | Mês    | Ano    | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-------------------------------------------------------------|--------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)                                | 0,81%  | 0,81%  | 4,15% | 4,81% | 11,43% | 23,53% | -       | -                |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,71%  | 0,71%  | 3,96% | 4,60% | 10,93% | 23,00% | 0,57%   | 1,88%            |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,73%  | 0,73%  | 3,91% | 4,78% | 11,15% | 22,88% | 0,53%   | 1,87%            |
| IRF-M 1+ (Benchmark)                                        | 0,60%  | 0,60%  | 5,55% | 6,14% | 18,37% | 28,70% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 0,59%  | 0,59%  | 5,52% | 6,01% | 18,02% | 27,84% | 1,08%   | 3,56%            |
| IMA-B 5+ (Benchmark)                                        | -1,47% | -1,47% | 5,89% | 1,54% | 19,03% | 23,38% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | -1,46% | -1,46% | 5,87% | 1,60% | 18,68% | 22,73% | 2,01%   | 6,40%            |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | -1,51% | -1,51% | 5,82% | 1,40% | 18,57% | 22,51% | 2,05%   | 6,48%            |
| IRF-M 1 (Benchmark)                                         | 0,83%  | 0,83%  | 2,77% | 5,92% | 12,95% | 27,12% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 0,91%  | 0,91%  | 2,80% | 5,87% | 12,79% | 26,67% | 0,11%   | 0,33%            |
| IMA-B 5 (Benchmark)                                         | 0,68%  | 0,68%  | 3,99% | 4,44% | 11,33% | 23,79% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 0,66%  | 0,66%  | 3,94% | 4,34% | 11,18% | 23,49% | 0,55%   | 1,85%            |
| CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA            | 0,55%  | 0,55%  | 1,94% | 0,87% | 6,56%  | -      | 0,82%   | 5,05%            |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 1,11%  | 1,11%  | 2,84% | 2,65% | 4,87%  | 9,72%  | 0,33%   | 3,99%            |
| IMA-B (Benchmark)                                           | -0,45% | -0,45% | 4,97% | 2,91% | 15,53% | 23,80% | -       | -                |



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA FIXA

|                                                               | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M     | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | -0,47% | -0,47% | 4,92%  | 2,84%  | 15,36%  | 23,40%  | 1,27%   | 4,14%            |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | -0,48% | -0,48% | 4,92%  | 2,78%  | 15,23%  | 23,18%  | 1,28%   | 4,15%            |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP                     | -0,49% | -0,49% | 5,00%  | 2,86%  | 15,52%  | 23,30%  | 1,31%   | 4,26%            |
|                                                               |        |        |        |        |         |         |         |                  |
| IRF-M (Benchmark)                                             | 0,67%  | 0,67%  | 4,68%  | 6,05%  | 16,31%  | 27,74%  | -       | -                |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 0,66%  | 0,66%  | 4,64%  | 5,92%  | 15,88%  | 27,01%  | 0,79%   | 2,43%            |
|                                                               |        |        |        |        |         |         |         |                  |
| CDI (Benchmark)                                               | 0,97%  | 0,97%  | 2,81%  | 6,04%  | 12,87%  | 27,33%  | -       | -                |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                                         | -0,75% | -0,75% | -5,97% | -7,21% | -14,74% | -61,85% | 0,31%   | 7,78%            |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                | 0,88%  | 0,88%  | 2,56%  | 5,51%  | 11,76%  | 24,82%  | 0,01%   | 0,05%            |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,85%  | 0,85%  | 2,92%  | 5,79%  | 15,22%  | 26,51%  | 0,07%   | 1,31%            |
|                                                               |        |        |        |        |         |         |         |                  |
| IPCA (Benchmark)                                              | 0,42%  | 0,42%  | 1,27%  | 2,01%  | 4,51%   | 10,54%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 0,66%  | 0,66%  | 3,33%  | 4,67%  | 13,16%  | 25,72%  | 0,46%   | 1,30%            |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                     | 0,46%  | 0,46%  | 3,82%  | 4,85%  | 15,10%  | 25,59%  | 0,57%   | 2,16%            |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,55%  | 0,55%  | 4,88%  | 3,78%  | 12,92%  | -       | 0,82%   | 3,05%            |
|                                                               |        |        |        |        |         |         |         |                  |
| Não definido (Benchmark)                                      | -      | -      | -      | -      | -       | -       | -       | -                |
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA            | 1,12%  | 1,12%  | 2,87%  | 2,45%  | -       | -       | 0,33%   | -                |

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

|                                          | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark)                          | 0,97%  | 0,97%  | 2,81%  | 6,04%  | 12,87% | 27,33% | -       | -                |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 0,51%  | 0,51%  | 5,85%  | 5,53%  | 12,87% | 25,14% | 0,58%   | 3,32%            |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP     | 0,76%  | 0,76%  | 3,85%  | 5,98%  | 12,77% | 26,37% | 0,31%   | 1,17%            |
|                                          |        |        |        |        |        |        |         |                  |
| Global BDRX (Benchmark)                  | 4,78%  | 4,78%  | 14,72% | 12,57% | 26,83% | 5,62%  | -       | -                |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 4,56%  | 4,56%  | 14,16% | 11,69% | 25,21% | 3,42%  | 5,69%   | 14,74%           |
|                                          |        |        |        |        |        |        |         |                  |
| Ibovespa (Benchmark)                     | -4,79% | -4,79% | 12,91% | 4,76%  | 12,63% | 13,92% | -       | -                |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES            | -3,70% | -3,70% | 12,67% | 4,98%  | 21,24% | 27,93% | 6,88%   | 16,81%           |
| CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES          | -8,52% | -8,52% | 13,58% | -4,79% | 28,00% | 10,04% | 10,75%  | 26,85%           |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES        | -4,15% | -4,15% | 11,76% | 0,85%  | 8,47%  | 4,31%  | 6,58%   | 16,00%           |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES            | -6,46% | -6,46% | 9,72%  | 2,43%  | 6,50%  | 3,69%  | 5,99%   | 16,12%           |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES               | -5,18% | -5,18% | 11,13% | 3,37%  | 4,06%  | -1,34% | 6,01%   | 16,60%           |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                 | -4,57% | -4,57% | 13,44% | 3,06%  | 7,75%  | 3,66%  | 5,68%   | 16,19%           |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES               | -4,66% | -4,66% | 11,47% | 4,00%  | 11,17% | 11,55% | 5,48%   | 15,62%           |
|                                          |        |        |        |        |        |        |         |                  |
| IBX-50 (Benchmark)                       | -4,15% | -4,15% | 13,07% | 5,74%  | 11,32% | 13,01% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES             | -4,17% | -4,17% | 12,72% | 3,55%  | 7,84%  | 7,15%  | 5,38%   | 16,04%           |
|                                          |        |        |        |        |        |        |         |                  |
| IDIV (Benchmark)                         | -3,51% | -3,51% | 14,18% | 8,88%  | 15,58% | 28,28% | -       | -                |

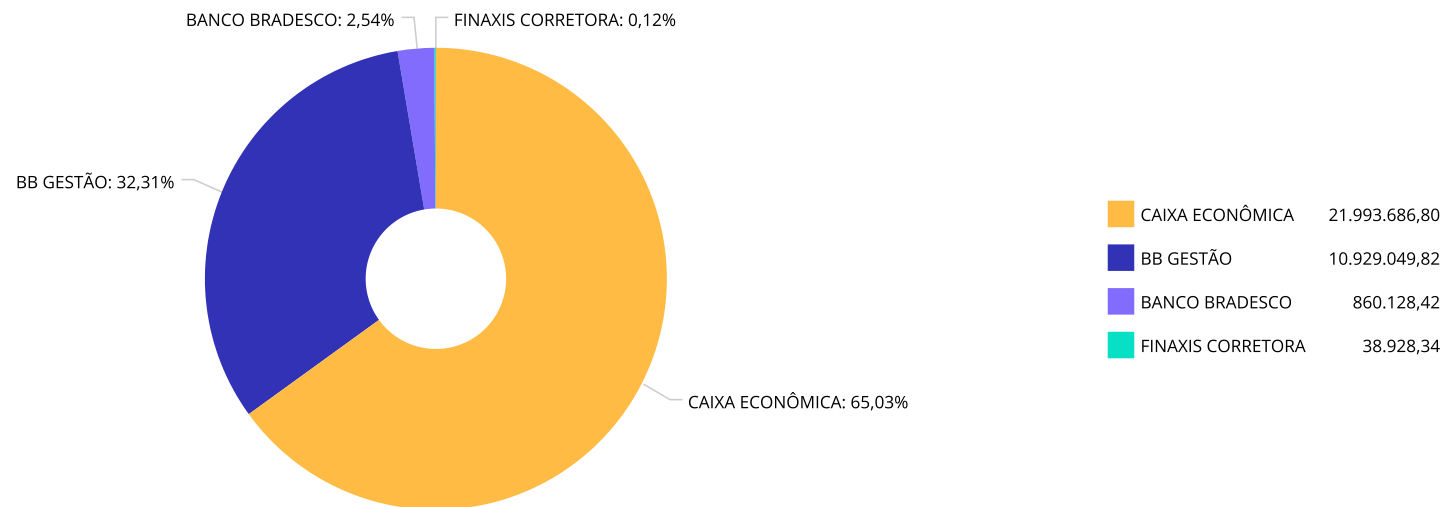
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

|                                              | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|----------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES              | -1,73% | -1,73% | 16,81% | 3,51%  | 19,32% | 20,15%  | 7,01%   | 15,17%           |
| IFIX (Benchmark)                             | 0,67%  | 0,67%  | 5,63%  | 4,26%  | 18,16% | 20,04%  | -       | -                |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 5,24%  | 5,24%  | 5,48%  | 5,27%  | 32,97% | 23,07%  | 9,40%   | 23,73%           |
| SMLL (Benchmark)                             | -6,55% | -6,55% | 12,50% | -6,30% | 6,34%  | -10,11% | -       | -                |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES              | -6,59% | -6,59% | 12,09% | -6,54% | 5,31%  | -11,42% | 9,75%   | 21,65%           |

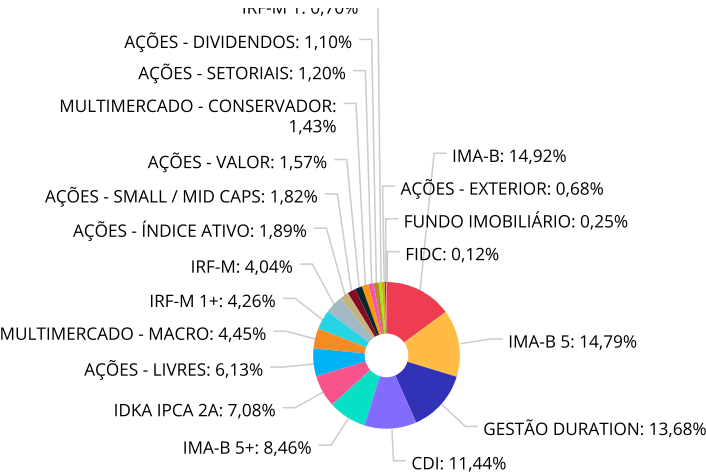
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

|                                         | Mês   | Ano   | 3M     | 6M     | 12M    | 24M   | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-----------------------------------------|-------|-------|--------|--------|--------|-------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark)                 | 4,78% | 4,78% | 14,72% | 12,57% | 26,83% | 5,62% | -       | -                |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 4,56% | 4,56% | 14,15% | 11,69% | 25,21% | 3,42% | 5,69%   | 14,738%          |

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



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

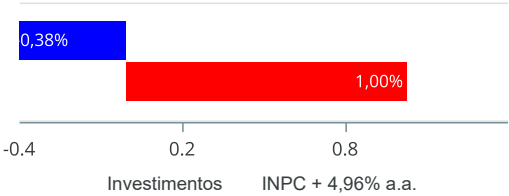


|                    |              |                            |              |                          |              |
|--------------------|--------------|----------------------------|--------------|--------------------------|--------------|
| IMA-B              | 5.047.116,27 | IMA-B 5                    | 5.001.620,15 | GESTÃO DURATION          | 4.626.367,88 |
| CDI                | 3.869.987,79 | IMA-B 5+                   | 2.862.621,40 | IDKA IPCA 2A             | 2.394.679,05 |
| AÇÕES - LIVRES     | 2.073.897,88 | MULTIMERCADO - MACRO       | 1.505.008,13 | IRF-M 1+                 | 1.441.326,60 |
| IRF-M              | 1.365.455,09 | AÇÕES - ÍNDICE ATIVO       | 638.475,52   | AÇÕES - SMALL / MID CAPS | 614.899,66   |
| AÇÕES - VALOR      | 531.954,89   | MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 483.949,98   | AÇÕES - SETORIAIS        | 405.081,03   |
| AÇÕES - DIVIDENDOS | 370.901,01   | IRF-M 1                    | 235.552,02   | AÇÕES - EXTERIOR         | 229.670,69   |
| FUNDO IMOBILIÁRIO  | 84.300,00    | FIDC                       | 38.928,34    |                          |              |

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

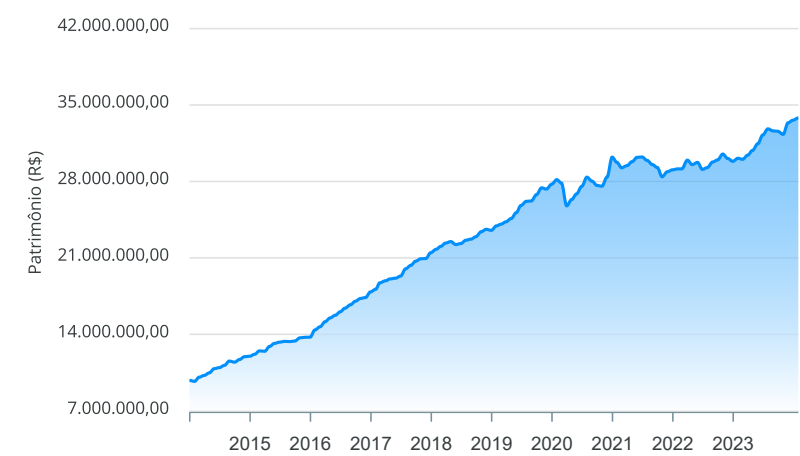
| Mês     | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates   | Saldo no Mês  | Retorno     | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR   |
|---------|----------------|--------------|------------|---------------|-------------|--------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 33.610.110,65  | 1.101.609,96 | 759.858,25 | 33.821.793,38 | -130.068,98 | -130.068,98  | -0,38%      | -0,38%       | 1,00%    | 1,00%     | -38,47%  | 1,66% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



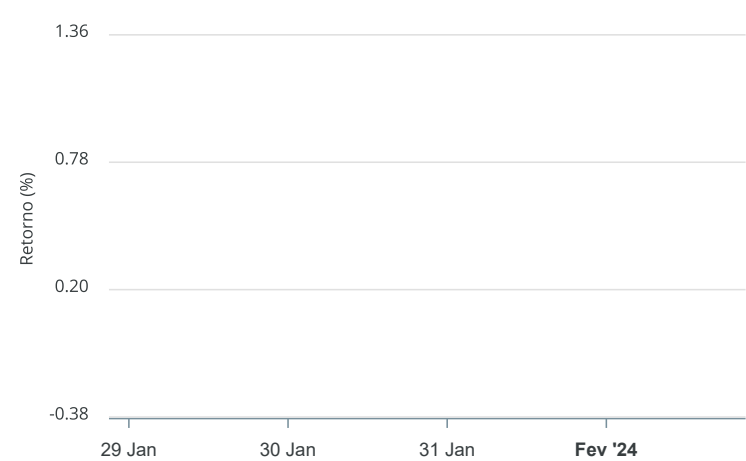
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- ☐ 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 Janeiro/2024****FUNDOS DE RENDA FIXA**

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates   | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|-------------------------------------------------------|----------------|------------|------------|--------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA    | 3.374.943,41   | 0,00       | 0,00       | 3.412.585,02 | 37.641,61     | 1,12%       | 1,12%      | 0,33%     |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.418.044,79   | 0,00       | 0,00       | 1.433.740,84 | 15.696,05     | 1,11%       | 1,11%      | 0,33%     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 233.423,46     | 0,00       | 0,00       | 235.552,02   | 2.128,56      | 0,91%       | 0,91%      | 0,11%     |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 954.544,07     | 0,00       | 0,00       | 962.649,72   | 8.105,65      | 0,85%       | 0,85%      | 0,07%     |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 1.618.290,38   | 0,00       | 0,00       | 1.630.095,18 | 11.804,80     | 0,73%       | 0,73%      | 0,53%     |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 759.179,79     | 0,00       | 0,00       | 764.583,87   | 5.404,08      | 0,71%       | 0,71%      | 0,57%     |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 1.356.526,46   | 0,00       | 0,00       | 1.365.455,09 | 8.928,63      | 0,66%       | 0,66%      | 0,79%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.238.728,42   | 0,00       | 105.744,65 | 1.141.092,39 | 8.108,62      | 0,65%       | 0,66%      | 0,55%     |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO        | 480.739,83     | 623.176,40 | 653.523,60 | 457.402,77   | 7.010,14      | 0,64%       | 0,88%      | 0,01%     |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 2.508.934,52   | 277.589,26 | 0,00       | 2.803.589,74 | 17.065,96     | 0,61%       | 0,66%      | 0,46%     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 1.432.907,46   | 0,00       | 0,00       | 1.441.326,60 | 8.419,14      | 0,59%       | 0,59%      | 1,08%     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE... | 1.067.679,18   | 0,00       | 0,00       | 1.073.556,82 | 5.877,64      | 0,55%       | 0,55%      | 0,82%     |
| CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA      | 1.345.836,25   | 0,00       | 0,00       | 1.353.230,10 | 7.393,85      | 0,55%       | 0,55%      | 0,82%     |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA             | 856.225,17     | 0,00       | 0,00       | 860.128,42   | 3.903,25      | 0,46%       | 0,46%      | 0,57%     |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 1.462.347,32   | 200.844,30 | 0,00       | 1.656.501,64 | -6.689,98     | -0,40%      | -0,48%     | 1,28%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.561.125,22   | 0,00       | 0,00       | 1.553.862,02 | -7.263,20     | -0,47%      | -0,47%     | 1,27%     |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP             | 1.845.790,91   | 0,00       | 0,00       | 1.836.752,61 | -9.038,30     | -0,49%      | -0,49%     | 1,31%     |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                                 | 39.221,43      | 0,00       | 0,00       | 38.928,34    | -293,09       | -0,75%      | -0,75%     | 0,31%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 1.354.461,18   | 0,00       | 0,00       | 1.334.722,41 | -19.738,77    | -1,46%      | -1,46%     | 2,01%     |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 1.551.375,19   | 0,00       | 0,00       | 1.527.898,99 | -23.476,20    | -1,51%      | -1,51%     | 2,05%     |

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates   | Saldo Atual   | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|-------------------|----------------|--------------|------------|---------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| Total Renda Fixa  | 26.460.324,44  | 1.101.609,96 | 759.268,25 | 26.883.654,59 | 80.988,44     | 0,30%       |            | 0,83%     |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável                        | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|----------------------------------------------|----------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 80.100,00      | 0,00       | 590,00   | 84.300,00    | 4.790,00      | 5,98%       | 6,03%      | 9,40%     |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP         | 480.313,78     | 0,00       | 0,00     | 483.949,98   | 3.636,20      | 0,76%       | 0,76%      | 0,31%     |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP     | 1.497.349,81   | 0,00       | 0,00     | 1.505.008,13 | 7.658,32      | 0,51%       | 0,51%      | 0,58%     |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES              | 377.446,12     | 0,00       | 0,00     | 370.901,01   | -6.545,11     | -1,73%      | -1,73%     | 7,01%     |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES                | 257.957,76     | 0,00       | 0,00     | 248.414,84   | -9.542,92     | -3,70%      | -3,70%     | 6,88%     |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES            | 354.403,95     | 0,00       | 0,00     | 339.702,84   | -14.701,11    | -4,15%      | -4,15%     | 6,58%     |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                 | 666.233,46     | 0,00       | 0,00     | 638.475,52   | -27.757,94    | -4,17%      | -4,17%     | 5,38%     |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                     | 557.406,46     | 0,00       | 0,00     | 531.954,89   | -25.451,57    | -4,57%      | -4,57%     | 5,68%     |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                   | 1.047.756,79   | 0,00       | 0,00     | 998.903,97   | -48.852,82    | -4,66%      | -4,66%     | 5,48%     |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                   | 325.101,57     | 0,00       | 0,00     | 308.262,18   | -16.839,39    | -5,18%      | -5,18%     | 6,01%     |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                | 456.526,90     | 0,00       | 0,00     | 427.028,89   | -29.498,01    | -6,46%      | -6,46%     | 5,99%     |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES              | 658.272,87     | 0,00       | 0,00     | 614.899,66   | -43.373,21    | -6,59%      | -6,59%     | 9,75%     |
| CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES              | 171.264,06     | 0,00       | 0,00     | 156.666,19   | -14.597,87    | -8,52%      | -8,52%     | 10,75%    |
| Total Renda Variável                         | 6.930.133,53   | 0,00       | 590,00   | 6.708.468,10 | -221.075,43   | -3,19%      |            | 4,83%     |

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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior                         | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|-----------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 219.652,68     | 0,00       | 0,00     | 229.670,69  | 10.018,01     | 4,56%       | 4,56%      | 5,69%     |
| Total Exterior                          | 219.652,68     | 0,00       | 0,00     | 229.670,69  | 10.018,01     | 4,56%       |            | 5,69%     |

## 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.

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.

