

**REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE**  
**SORRISO - MT**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**  
**DE**  
**INVESTIMENTOS**

**1º TRIMESTRE**  
**2024**

**11 de abril de 2024**

## SUMÁRIO EXECUTIVO

O Sumário Executivo apresenta as principais informações do Relatório Mensal de Investimentos de 2024 do PREVISO.

**Índice Inflacionário:** IPCA – Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo

**Taxa de Juros (anual):** 5,06% a.a.

**Taxa de Juros (mensal):** 0,41%

**Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice):** 5,06% a.a. + IPCA a.a.

**Previsão da Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice):** 9,65%

Data Focal: 28/03/2024

MENSAL												
	JAN	FEV	MAR									
<b>RENTABILIDADE DA CARTEIRA</b>	0,02%	0,62%	0,43%									
TAXA DE JUROS	0,41%	0,41%	0,41%									
VARIAÇÃO IPCA	0,42%	0,83%	0,16%									
<b>META ATUARIAL</b>	0,83%	1,24%	0,57%									
<b>CDI</b>	0,97%	0,80%	0,83%									

ACUMULADO												
	JAN	FEV	MAR									
<b>RENTABILIDADE DA CARTEIRA</b>	0,02%	0,65%	1,08%									
TAXA DE JUROS	0,41%	0,83%	1,24%									
VARIAÇÃO IPCA	0,42%	1,25%	1,42%									
<b>META ATUARIAL</b>	0,83%	2,08%	2,67%									
<b>CDI</b>	0,97%	1,78%	2,62%									

## ÍNDICE

<b>1 – INTRODUÇÃO .....</b>	<b>4</b>
<b>2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS .....</b>	<b>5</b>
2.1 - Movimentação Financeira da Carteira .....	5
2.2 - PAI - Limite de Segmento .....	6
<b>3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO .....</b>	<b>7</b>
<b>4 – MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA .....</b>	<b>12</b>
<b>5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS .....</b>	<b>17</b>
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	19
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	20
<b>6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO .....</b>	<b>21</b>
<b>7 – CONCLUSÃO .....</b>	<b>22</b>
7.1 - Rentabilidade da Carteira Trimestral .....	22
7.2 - Meta Atuarial .....	23
7.3 - Riscos .....	23
7.3.1 - Risco de Mercado .....	23
7.3.2 - Risco de Crédito .....	25
7.3.2.1 - Fundo de Investimento .....	25
7.3.2.2 - Instituição Financeira .....	26
7.3.3 - Risco de Liquidez .....	26
7.4 - Aderência ao PAI .....	27
7.4.1 - Perfil de Risco (Mercado) .....	27
7.4.2 - Risco de Crédito .....	28
7.4.3 - Risco de Liquidez .....	28
7.4.3.1 - Obrigações Previdenciárias - Curto Prazo .....	28
7.4.3.2 - Obrigações Previdenciárias - Médio e Longo Prazo .....	29

## 1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Trimestral dos investimentos, referente ao 1º TRIMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do PREVISÃO.

Este relatório vem atender o **Art. 136º da Portaria MTP 1.467/2022**, que exige a elaboração de **Relatórios Trimestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

***Art. 136.** A unidade gestora deverá elaborar, no mínimo, trimestralmente, relatórios detalhados sobre a rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do regime e a aderência à política de investimentos, que deverão ser submetidos para avaliação e adoção de providências pelos órgãos responsáveis, conforme atribuições estabelecidas na forma do § 2º do art. 86.*

## 2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2024 - PREVISO

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	346.985.777,83	2.200.000,00	-	-	1.568.713,90	(1.492.205,45)	76.508,45	349.262.286,28
2	FEVEREIRO	349.262.286,28	-	-	-	2.178.461,57	-	2.178.461,57	351.440.747,85
3	MARÇO	351.440.747,85	4.062.814,67	-	-	1.758.003,40	(253.671,66)	1.504.331,74	357.007.894,26
4	ABRIL	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
5	MAIO	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
6	JUNHO	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
7	JULHO	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
8	AGOSTO	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
9	SETEMBRO	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
10	OUTUBRO	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
11	NOVEMBRO	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
12	DEZEMBRO	357.007.894,26	-	-	-	-	-	-	357.007.894,26
13	ANO	346.985.777,83	6.262.814,67	-	-	5.505.178,87	(1.745.877,11)	3.759.301,76	357.007.894,26

\*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

## 2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2024 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVISO

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
<b>RENDA FIXA</b>								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	87,3%	100,0%	87,9%	#####	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operação	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	8,6%	40,0%	8,2%	29.132.075,96	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (60%)	0,0%	0,0%	40,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de 'Crédito Privado'	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	<b>TOTAL - RENDA FIXA</b>					<b>96,1%</b>	<b>#####</b>	
<b>RENDA VARIÁVEL</b>								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	1,9%	12,0%	2,5%	8.971.875,86	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	1,0%	10,0%	0,0%	-	-
14	<b>TOTAL - RENDA VARIÁVEL</b>					<b>2,5%</b>	<b>8.971.875,86</b>	
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	0,8%	10,0%	0,9%	3.355.947,00	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	<b>TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>					<b>0,9%</b>	<b>3.355.947,00</b>	
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
20	<b>TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>					<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	0,3%	10,0%	0,4%	1.348.167,82	-
24	<b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>					<b>0,4%</b>	<b>1.348.167,82</b>	
<b>EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	<b>TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>					<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				0,1%	407.564,19	
29	<b>PATRIMÔNIO TOTAL</b>					<b>100,0%</b>	<b>357.415.458,45</b>	<b>6</b>

### 3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI
CNPJ	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	49.963.829/0001-89
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Renda Fixa Duração Livre Soberano
ÍNDICE	CDI	IRF - M 1	IDKA 2	IPCA + 5,00% a.a.
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Investidor Qualificado
ADMINISTRADOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
AUDITORIA	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	16/05/2023
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,10% a.a.	0,20% a.a.	0,10% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1000	1000	10000	100000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	0	100000
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	0,00	100.000,00
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0	100000
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Até o dia 15/05/2035
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO*	2 - Baixo	2 - Baixo	3 - Médio	3 - Médio
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

7

## Continuação....

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO
<b>CNPJ</b>	07.111.384/0001-69	07.861.554/0001-22	07.442.078/0001-05	03.737.206/0001-97
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
<b>ÍNDICE</b>	IRF - M	IMA - B	IMA - B	CDI
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
<b>ADMINISTRADOR</b>	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	42.040.639/0001-40
<b>CUSTODIANTE</b>	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOOPER S AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
<b>DATA DE INÍCIO</b>	08/12/2004	09/03/2006	24/07/2005	05/07/2006
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,30% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	10000	10000	10000	1000
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>0,01</b>	<b>0,01</b>	<b>0,01</b>	<b>0</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,01	0,01	0,01	0,00
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0,01	0,01	0,01	0
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	3 - Médio	4 - Alto	4 - Alto	1 - Muito Baixo
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## Continuação....

3

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP
<b>CNPJ</b>	14.386.926/0001-71	11.060.913/0001-10	50.569.054/0001-40	14.508.605/0001-00
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
<b>ÍNDICE</b>	IDKA 2	IMA - B 5	IPCA + 5,00% a.a.	IRF - M
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Investidor Qualificado	Público Geral
<b>ADMINISTRADOR</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES
<b>CNPJ</b>	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40
<b>CUSTODIANTE</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
<b>DATA DE INÍCIO</b>	16/08/2012	09/07/2010	05/05/2023	16/08/2012
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,15% a.a.	0,20% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1000	1000	300000	0,01
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0,01</b>	<b>0,01</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,00	0,00	0,01	0,01
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0	0	0,01	0,01
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Até o dia 16/05/2033	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	3 - Médio	3 - Médio	3 - Médio	3 - Médio
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## Continuação....

4

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES
<b>CNPJ</b>	10.740.658/0001-93	13.058.816/0001-18	15.154.220/0001-47	40.209.029/0001-00
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Variável</b>	<b>Renda Variável</b>	<b>Renda Variável</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Ações	Fundo de Ações	Fundo de Ações
<b>ÍNDICE</b>	IMA - B	IBOV	SMLL	IFNC
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
<b>ADMINISTRADOR</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES
<b>CNPJ</b>	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40
<b>CUSTODIANTE</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
<b>DATA DE INÍCIO</b>	08/03/2010	29/07/2011	01/11/2012	26/01/2021
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,50% a.a.	1,50% a.a.	0,80% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1000	1000	1000	100
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>0</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>100</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,00	100,00	100,00	100,00
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0	500	500	50
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	3 - Médio	4 - Alto	5 - Muito Alto	4 - Alto
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## Continuação....

5

INFORMAÇÕES	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		
<b>CNPJ</b>	30.036.235/0001-02	17.502.937/0001-68		
<b>SEGMENTO</b>	<b>Investimentos Estruturados</b>	<b>Investimento no Exterior</b>		
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo Multimercado	Fundo de Ações		
<b>ÍNDICE</b>	S&P500	BDR		
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral		
<b>ADMINISTRADOR</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04		
<b>GESTOR</b>	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES		
<b>CNPJ</b>	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40		
<b>CUSTODIANTE</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04		
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal		
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04		
<b>AUDITORIA</b>	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.		
<b>DATA DE INÍCIO</b>	16/10/2018	24/06/2013		
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,80% a.a.	0,70% a.a.		
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não Possui	Não Possui		
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	100	1000		
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>100</b>	<b>100</b>		
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	100,00	100,00		
<b>SALDO MÍNIMO</b>	50	500		
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui		
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)		
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	4 - Alto	4 - Alto		
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9, III (10%)		

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## 4.1 - MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	13.399.536,41	2.200.000,00	-	97.744,43	15.697.280,84	0,729%
FEVEREIRO	15.697.280,84	-	-	68.915,46	15.766.196,30	0,439%
MARÇO	15.766.196,30	-	-	141.587,67	15.907.783,97	0,898%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	6.706.455,96	-	-	31.202,07	6.675.253,89	-0,465%
FEVEREIRO	6.675.253,89	-	-	35.935,88	6.711.189,77	0,538%
MARÇO	6.711.189,77	-	-	3.800,24	6.714.990,01	0,057%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	26.670.084,72	-	-	124.083,74	26.546.000,98	-0,465%
FEVEREIRO	26.546.000,98	-	-	142.909,04	26.688.910,02	0,538%
MARÇO	26.688.910,02	-	-	15.112,69	26.704.022,71	0,057%

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP						
4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	54.839.382,38	-	-	364.070,70	55.203.453,08	0,664%
FEVEREIRO	55.203.453,08	-	-	318.362,97	55.521.816,05	0,577%
MARÇO	55.521.816,05	-	-	417.906,89	55.939.722,94	0,753%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP						
5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	26.979.136,22	-	-	181.209,05	27.160.345,27	0,672%
FEVEREIRO	27.160.345,27	-	-	117.997,01	27.278.342,28	0,434%
MARÇO	27.278.342,28	-	-	136.416,12	27.414.758,40	0,500%

FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO						
6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	6.910.578,73	-	-	69.320,51	6.979.899,24	1,003%
FEVEREIRO	6.979.899,24	-	-	57.564,83	7.037.464,07	0,825%
MARÇO	7.037.464,07	-	-	61.117,13	7.098.581,20	0,868%

FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF						
7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	15.560.246,50	-	-	114.983,04	15.445.263,46	-0,739%
FEVEREIRO	15.445.263,46	-	-	99.500,94	15.544.764,40	0,644%
MARÇO	15.544.764,40	-	-	44.467,20	15.500.297,20	-0,286%

BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI						
8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	26.297.309,85	-	-	187.192,68	26.484.502,53	0,712%
FEVEREIRO	26.484.502,53	-	-	117.815,15	26.602.317,68	0,445%
MARÇO	26.602.317,68	1.538.176,21	-	240.098,81	28.380.592,70	0,903%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI							
9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JANEIRO	1.037.884,90	-	-	5.115,00	1.032.769,90	-0,493%	
FEVEREIRO	1.032.769,90	-	-	5.353,71	1.038.123,61	0,518%	
MARÇO	1.038.123,61	-	-	449,88	1.038.573,49	0,043%	

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI							
10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JANEIRO	27.601.463,52	-	-	181.672,15	27.783.135,67	0,658%	
FEVEREIRO	27.783.135,67	-	-	121.655,80	27.904.791,47	0,438%	
MARÇO	27.904.791,47	-	-	140.488,37	28.045.279,84	0,503%	

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI							
11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JANEIRO	37.241.934,04	-	-	179.389,56	37.062.544,48	-0,482%	
FEVEREIRO	37.062.544,48	-	-	196.697,40	37.259.241,88	0,531%	
MARÇO	37.259.241,88	-	-	22.211,27	37.281.453,15	0,060%	

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI							
12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JANEIRO	13.645.544,65	-	-	117.979,13	13.763.523,78	0,865%	
FEVEREIRO	13.763.523,78	-	-	101.971,66	13.865.495,44	0,741%	
MARÇO	13.865.495,44	-	-	111.389,27	13.976.884,71	0,803%	

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI						
13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	9.471.264,28	-	-	67.419,49	9.538.683,77	0,712%
FEVEREIRO	9.538.683,77	-	-	42.432,42	9.581.116,19	0,445%
MARÇO	9.581.116,19	2.524.638,46	-	89.729,33	12.195.483,98	0,937%

BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI						
14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	20.453.798,81	-	-	197.734,38	20.651.533,19	0,967%
FEVEREIRO	20.651.533,19	-	-	165.856,42	20.817.389,61	0,803%
MARÇO	20.817.389,61	-	-	177.531,66	20.994.921,27	0,853%

BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI						
15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	46.597.495,96	-	-	556.605,69	46.040.890,27	-1,194%
FEVEREIRO	46.040.890,27	-	-	275.134,41	46.316.024,68	0,598%
MARÇO	46.316.024,68	-	-	177.466,67	46.138.558,01	-0,383%

FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO						
16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	2.229.949,46	-	-	146.930,02	2.083.019,44	-6,589%
FEVEREIRO	2.083.019,44	-	-	7.944,66	2.090.964,10	0,381%
MARÇO	2.090.964,10	-	-	43.791,09	2.134.755,19	2,094%

## MOVIMENTAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA

CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES						
17	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	2.469.531,38	-	-	112.387,57	2.357.143,81	-4,551%
FEVEREIRO	2.357.143,81	-	-	8.402,82	2.365.546,63	0,356%
MARÇO	2.365.546,63	-	-	882,95	2.366.429,58	0,037%

FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I						
18	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.172.513,63	-	-	53.476,47	1.225.990,10	4,561%
FEVEREIRO	1.225.990,10	-	-	76.865,89	1.302.855,99	6,270%
MARÇO	1.302.855,99	-	-	45.311,83	1.348.167,82	3,478%

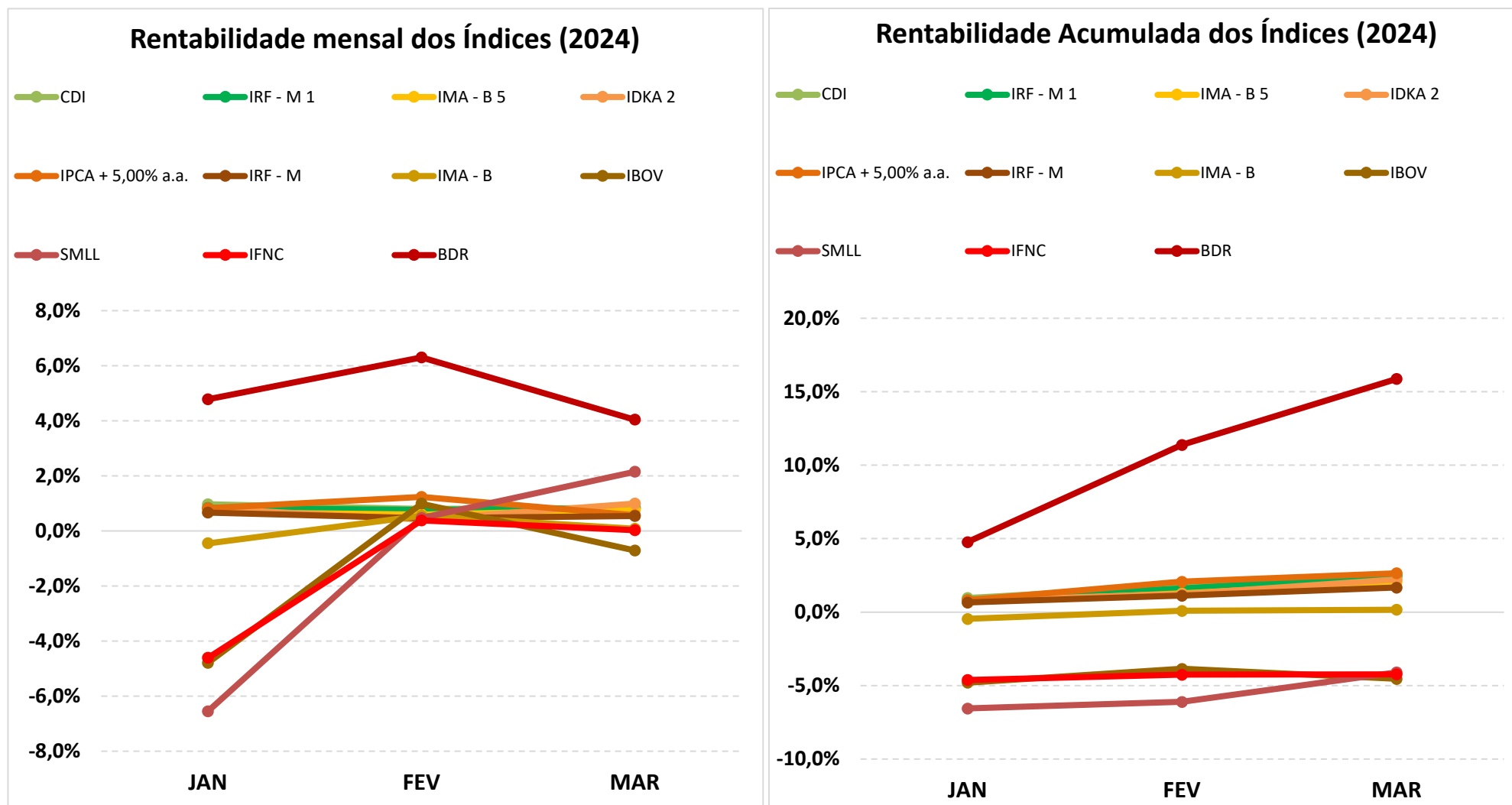
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP						
19	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	3.019.904,07	-	-	50.894,91	3.070.798,98	1,685%
FEVEREIRO	3.070.798,98	-	-	174.969,82	3.245.768,80	5,698%
MARÇO	3.245.768,80	-	-	110.178,20	3.355.947,00	3,395%

CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES						
20	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	4.681.762,36	-	-	221.508,76	4.460.253,60	-4,731%
FEVEREIRO	4.460.253,60	-	-	42.175,28	4.502.428,88	0,946%
MARÇO	4.502.428,88	-	-	31.737,79	4.470.691,09	-0,705%

## 5-TABELA DE RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

Nº	CNPJ	INVESTIMENTOS	SEGMENTO	JAN	FEV	MAR	ACUMULADO
1	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Renda Fixa	0,97%	0,80%	0,85%	<b>2,65%</b>
2	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	Renda Fixa	0,86%	0,74%	0,80%	<b>2,42%</b>
3	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	Renda Fixa	0,71%	0,44%	0,88%	<b>2,04%</b>
4	49.963.829/0001-89	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI	Renda Fixa	-1,19%	0,60%	-0,38%	<b>-0,98%</b>
5	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	Renda Fixa	0,66%	0,44%	0,50%	<b>1,61%</b>
6	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	Renda Fixa	-0,49%	0,52%	0,04%	<b>0,07%</b>
7	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	Renda Fixa	-0,48%	0,53%	0,06%	<b>0,11%</b>
8	03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	Renda Fixa	1,00%	0,82%	0,87%	<b>2,71%</b>
9	14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	Renda Fixa	0,73%	0,44%	0,90%	<b>2,08%</b>
10	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	Renda Fixa	0,66%	0,58%	0,75%	<b>2,01%</b>
11	50.569.054/0001-40	FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF	Renda Fixa	-0,74%	0,64%	-0,29%	<b>-0,39%</b>
12	14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	Renda Fixa	0,67%	0,43%	0,50%	<b>1,61%</b>
13	10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	Renda Fixa	-0,47%	0,54%	0,06%	<b>0,12%</b>
14	13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	Renda Variável	-4,73%	0,95%	-0,70%	<b>-4,50%</b>
15	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Renda Variável	-6,59%	0,38%	2,09%	<b>-4,27%</b>
16	40.209.029/0001-00	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	Renda Variável	-4,55%	0,36%	0,04%	<b>-4,17%</b>
17	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	Investimentos Estruturados	1,69%	5,70%	3,39%	<b>11,13%</b>
18	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Investimento no Exterior	4,56%	6,27%	3,48%	<b>14,98%</b>
1		<b>CDI</b>	-	<b>0,97%</b>	<b>0,80%</b>	<b>0,83%</b>	<b>2,62%</b>
2		<b>IRF - M 1</b>	-	<b>0,83%</b>	<b>0,77%</b>	<b>0,84%</b>	<b>2,46%</b>
3		<b>IMA - B 5</b>	-	<b>0,68%</b>	<b>0,59%</b>	<b>0,77%</b>	<b>2,06%</b>
4		<b>IDKA 2</b>	-	<b>0,81%</b>	<b>0,42%</b>	<b>0,99%</b>	<b>2,24%</b>
5		<b>IPCA + 5,00% a.a.</b>	-	<b>0,83%</b>	<b>1,24%</b>	<b>0,57%</b>	<b>2,65%</b>
6		<b>IRF - M</b>	-	<b>0,67%</b>	<b>0,46%</b>	<b>0,54%</b>	<b>1,68%</b>
7		<b>IMA - B</b>	-	<b>-0,45%</b>	<b>0,55%</b>	<b>0,08%</b>	<b>0,18%</b>
8		<b>IBOV</b>	-	<b>-4,79%</b>	<b>0,99%</b>	<b>-0,71%</b>	<b>-4,53%</b>
9		<b>SMLL</b>	-	<b>-6,55%</b>	<b>0,47%</b>	<b>2,15%</b>	<b>-4,09%</b>
10		<b>IFNC</b>	-	<b>-4,61%</b>	<b>0,38%</b>	<b>0,02%</b>	<b>-4,23%</b>
11		<b>BDR</b>	-	<b>4,78%</b>	<b>6,30%</b>	<b>4,04%</b>	<b>15,88%</b>

## GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES



## 5.1-MELHOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

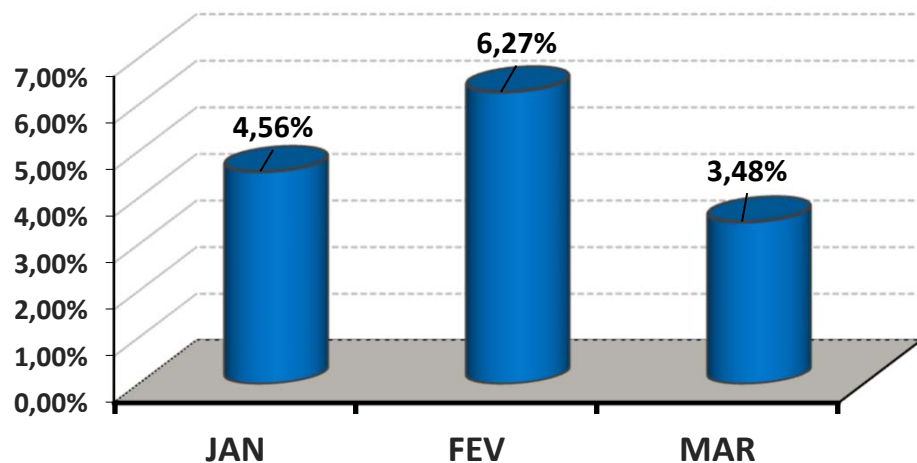
<b>FUNDO DE INVESTIMENTO</b>	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
<b>CNPJ</b>	17.502.937/0001-68
<b>SEGMENTO</b>	Investimento no Exterior

### COMPORTAMENTO MENSAL

JAN	FEV	MAR
4,56%	6,27%	3,48%

#### Comportamento MENSAL no Trimestre

■ FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

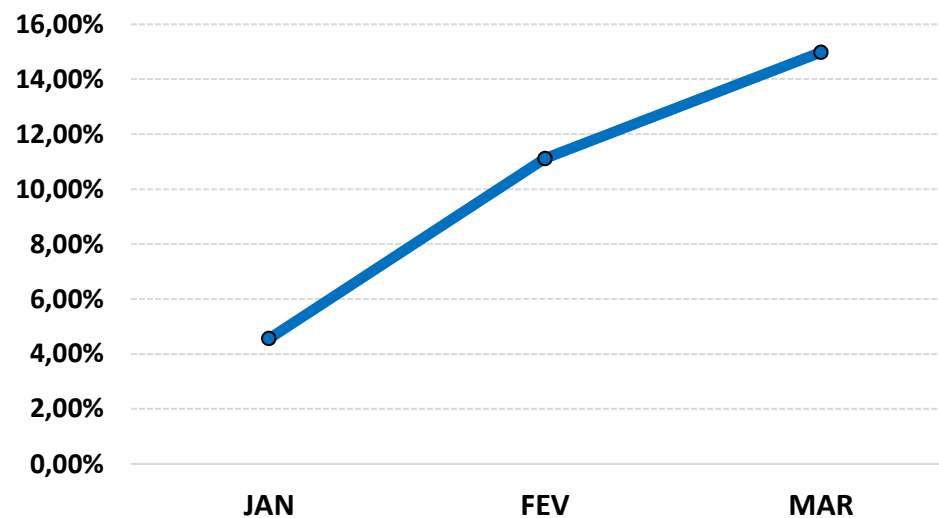


### COMPORTAMENTO ACUMULADO

JAN	FEV	MAR
4,56%	11,12%	14,98%

#### Comportamento ACUMULADO no Trimestre

● FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I



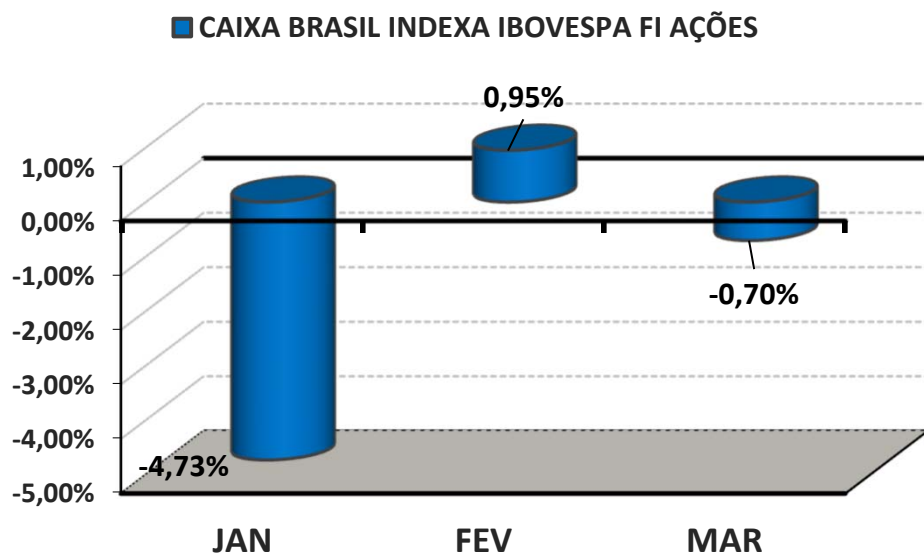
## 5.2-PIOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

<b>FUNDO DE INVESTIMENTO</b>	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES
<b>CNPJ</b>	13.058.816/0001-18
<b>SEGMENTO</b>	Renda Variável

### COMPORTAMENTO MENSAL

JAN	FEV	MAR
-4,73%	0,95%	-0,70%

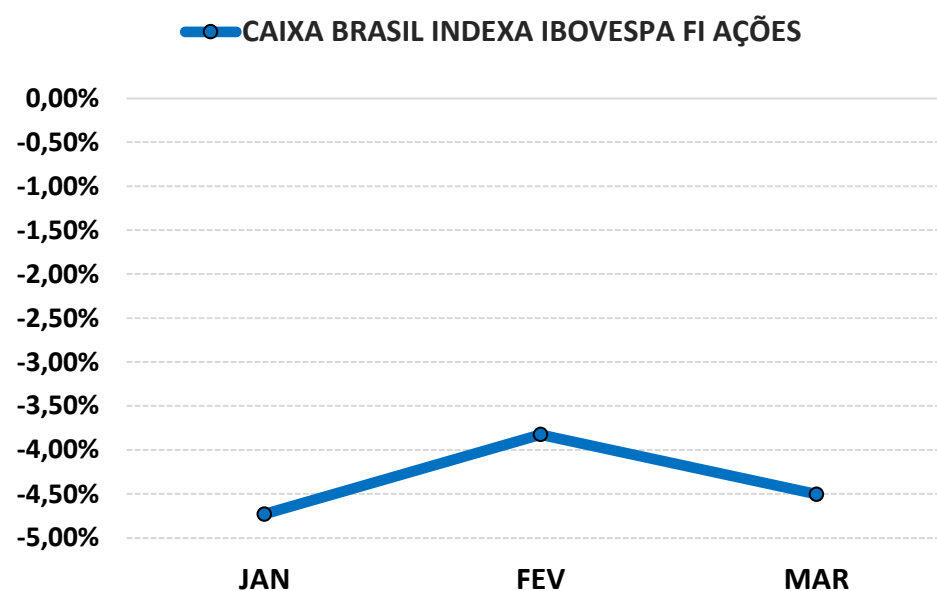
#### Comportamento MENSAL no Trimestre



### COMPORTAMENTO ACUMULADO

JAN	FEV	MAR
-4,73%	-3,82%	-4,50%

#### Comportamento ACUMULADO no Trimestre



## 6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 1º TRIMESTRE - 2024

	JAN	FEV	MAR
<b>MENSAL</b>	0,02%	0,62%	0,43%
<b>CDI</b>	0,97%	0,80%	0,83%
<b>IBOVESPA</b>	-4,79%	0,99%	-0,71%
<b>META ATUARIAL</b>	0,83%	1,24%	0,57%

	JAN	FEV	MAR
<b>ACUMULADO DO TRIMESTRE</b>	0,02%	0,65%	1,08%
<b>CDI</b>	0,97%	1,78%	2,62%
<b>IBOVESPA</b>	-4,79%	-3,85%	-4,53%
<b>META ATUARIAL</b>	0,83%	2,08%	2,67%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO TRIMESTRE do PREVISÃO: R\$ **3.759.301,76**

META ATUARIAL ACUMULADA DO TRIMESTRE: R\$ **9.237.016,43**

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ **(5.477.714,67)**

## 7-CONCLUSÃO

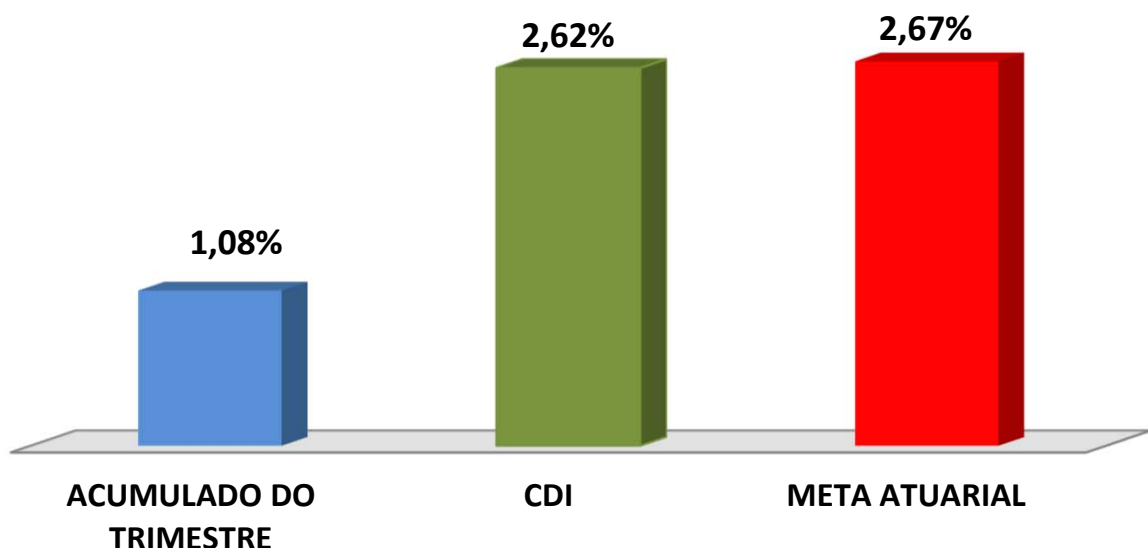
Atendendo o Art. 136º da Portaria MTP 1.467/2022, detalhado na página 3 deste relatório, segue abaixo uma análise da Carteira de Investimento PREVISÓ, no 1º Trimestre/2024, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2024.

### 7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA TRIMESTRAL

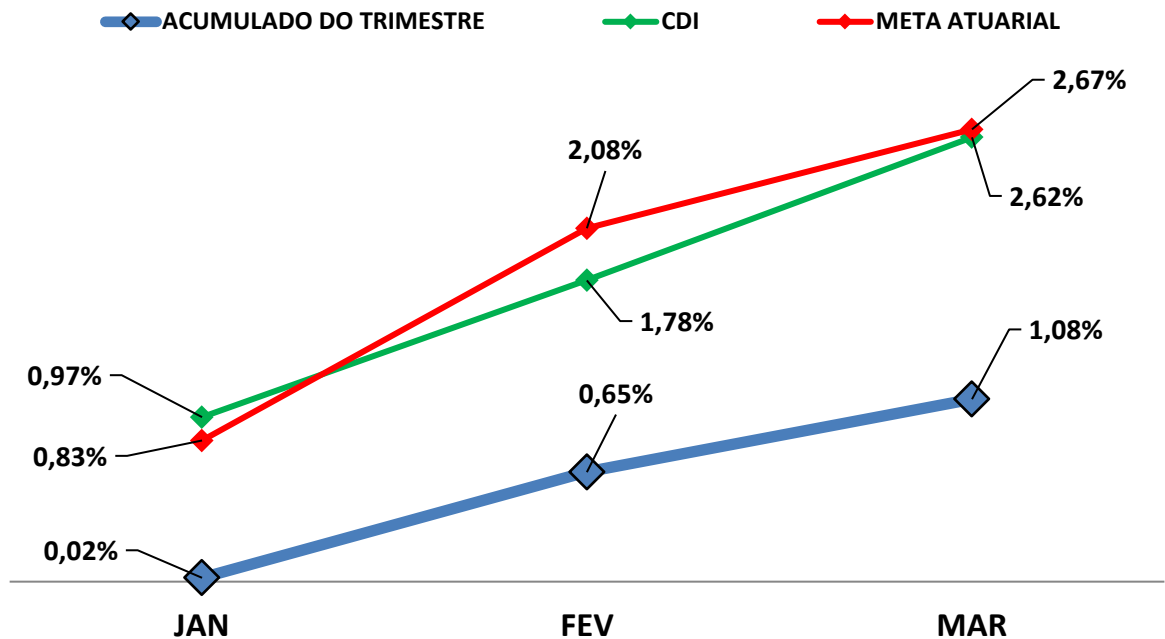
A Carteira de Investimentos do PREVISÓ, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no Trimestre de 1,08% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no Trimestre de 2,62% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 41,06% sobre o índice de referência do mercado.

#### **GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL**

#### **Rentabilidade Acumulada no Trimestre**



## Rentabilidade Acumulada no Trimestre



### 7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no trimestre do PREVISÓ é de 1,08% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 2,67%, representando 40,34% sobre a Meta Atuarial.

### 7.3-RISCOS

#### 7.3.1-RISCO DE MERCADO

É o risco de oscilações de preços dos ativos conforme o cenário macroeconômico. Este risco é voltado para a volatilidade dos papéis, sobretudo de Renda Fixa (Títulos Públicos e fundos atrelados à inflação) e Renda Variável (ações, dólar e etc..).

Conforme a tabela abaixo, o PREVISÓ aplica em alguns Fundos de Investimentos sensíveis às oscilações de mercado, conforme a classificação de Risco de Mercado, disponibilizado nas Lâminas de Informações Essenciais dos Fundos de Investimentos.

<b>Nº</b>	<b>FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>	<b>RISCO DE MERCADO*</b>
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2 - Baixo
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	2 - Baixo
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	3 - Médio
4	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI	3 - Médio
5	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	3 - Médio
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	4 - Alto
7	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	4 - Alto
8	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	1 - Muito Baixo
9	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	3 - Médio
10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	3 - Médio
11	FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF	3 - Médio
12	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	3 - Médio
13	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	3 - Médio
14	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	4 - Alto
15	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	5 - Muito Alto
16	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	4 - Alto
17	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	4 - Alto
18	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4 - Alto

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

### 7.3.2-RISCO DE CRÉDITO

É a possibilidade do devedor não honrar seus compromissos. Nesse caso, investimentos que possuem risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating.

#### 7.3.2.1-FUNDO DE INVESTIMENTO

Os Fundos de Investimentos em Renda Fixa, Renda Variável, Fundos Multimercados e Fundos Ações - BDR Nível I que o PREVISIO aplica, não necessitam de Análise de Rating. Os fundos de investimentos em ações são isentos de classificação de risco de crédito, mas, considerados de Alto Risco de mercado e os Fundos Multimercados podem possuir certa concentração de papéis privados em sua carteira de investimento que, por possuir risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating. Investimentos com potencial risco de mercado, necessitam de estratégias de longo prazo, já definidas e aprovadas no PAI - Política Anual de Investimentos/2024. Abaixo segue a Classificação de Rating destes Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDO DE INVESTIMENTO	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
3	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	Moodys América Latina	MQ1
4	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
5	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
7	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
8	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	Não Disponibilizado pela Instituição	-
9	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	Fitch Rating	Forte
10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	Fitch Rating	Forte
11	FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF	Não Disponibilizado pela Instituição	-
12	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	Não Disponibilizado pela Instituição	-
13	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	Fitch Rating	Forte

Nº	FUNDO DE INVESTIMENTO	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
14	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	Fitch Rating	"Forte"
15	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Fitch Rating	"Forte"
16	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	Não Disponibilizado pela Instituição	-
17	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	Não Disponibilizado pela Instituição	-
18	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Fitch Rating	"Forte"

### 7.3.2.2-*INSTITUIÇÃO FINANCEIRA*

Todos os envolvidos na gestão do Fundo de Investimento, incluindo as Instituições Financeiras, o Administrador, o Gestor e o Distribuidor necessitam de Análise de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating dos envolvidos na gestão e distribuição dos Fundos de Investimentos.

Nº	INSTITUIÇÃO FINANCEIRA / ADMINISTRADOR / GESTOR / DISTRIBUIDOR	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	Fitch Ratings	AA
2	CAIXA ASSET DTVM	Fitch Ratings	Excelente (Nota Máxima em uma escala de 5 níveis)

### 7.3.3-*RISCO DE LIQUIDEZ*

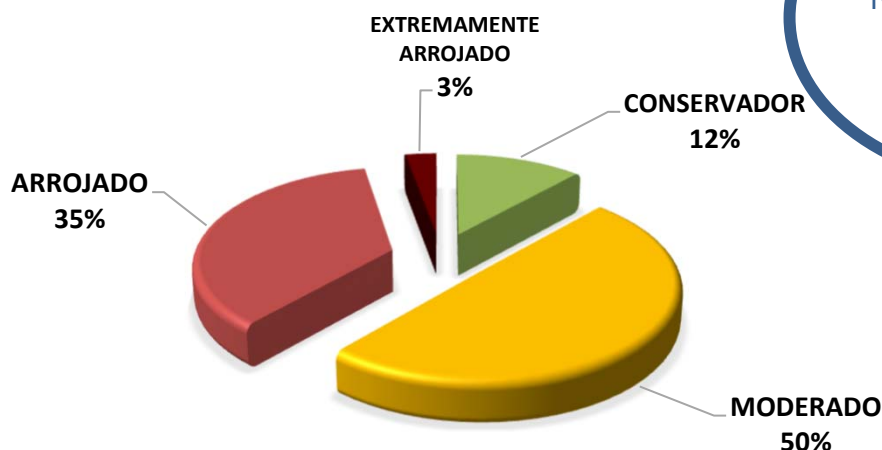
É o risco de o investidor não conseguir dar liquidez ao ativo financeiro (vender) ou conseguir liquidez abaixo do preço de mercado ou abaixo do preço de aquisição (compra).

O PREVISÓ possui 16 Fundos de Investimento Aberto sem Carência, e possui 2 Fundos de Investimento Aberto com Carência. Nesse caso, só poderá resgatar as cotas, após o término do prazo de carência, sendo opcional o resgate total ou parcial das cotas. Investimentos que possuem prazo para resgate, necessitam estar aderentes as obrigações financeiras do investidor.

## 7.4-ADERÊNCIA AO PAI

### 7.4.1-PERFIL DE RISCO (MERCADO)

#### PERFIL DOS INVESTIMENTOS



**PERFIL 6**  
 MODERADO COM  
 TENDÊNCIA  
 ARROJADA

#### Descrição do Perfil de Investidor

##### Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados, mas busca investir um pouco em ativos arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é o perfil mais indicado.

##### Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo é o perfil mais indicado, pois os investimentos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil é o mais equilibrado, entre cumprir a Meta Atuarial e se proteger um pouco das oscilações de mercado.

#### Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

<b>CONSERVADOR</b>	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
<b>MODERADO</b>	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
<b>ARROJADO</b>	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO

O atual perfil de risco do PREVISÓ (PERFIL 6 - MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA), se encontra aderente ao Perfil de Risco proposto na Política Anual de Investimentos/2024.

### *7.4.2-RISCO DE CRÉDITO*

A Política Anual de Investimentos/2024 do PREVISÓ, determina que fundos de investimentos e Instituições Financeiras que necessitem de Análise de Rating, só receberão recursos do PREVISÓ, caso sejam classificados, no mínimo, como MUITO BAIXO RISCO DE CRÉDITO (A+).

As Análises de Ratings encontradas dos Fundos de Investimentos, assim como das Instituições Financeiras, dos Administradores, dos Gestores e dos Distribuidores dos fundos, se encontram aderentes à Política Anual de Investimentos/2024 do PREVISÓ.

### *7.4.3-RISCO DE LIQUIDEZ*

#### *7.4.3.1-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - CURTO PRAZO*

Para resguardar o PREVISÓ e minimizar o risco de liquidez no Curto Prazo foi definido na Política de Investimentos/2024, uma Separação de Recursos Financeiros, intitulada como RECURSOS DE CURTO PRAZO (RISCO DE MERCADO E LIQUIDEZ).

Na Política Anual de Investimentos/2024 do PREVISÓ foi definido um valor de RECURSOS DE CURTO PRAZO (RISCO DE MERCADO E LIQUIDEZ) de R\$ 22.550.000,00 Milhões de reais. Atualmente, a necessidade de RECURSOS DE CURTO PRAZO do PREVISÓ é de R\$ 17.346.153,85 e o Saldo financeiro em Fundos para RECURSOS DE CURTO PRAZO está em R\$ 28.093.502,47 Milhões de reais.

As Obrigações Previdenciárias no Curto Prazo, ou seja, a necessidade financeira do PREVISÓ estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2024 e a sua capacidade financeira no Curto Prazo.

#### *7.4.3.2-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - MÉDIO e LONGO PRAZO*

O investimento com prazo de duração mais longo que o PREVISÓ possui na sua carteira de investimento, tem liquidez à partir de 2035, representando 12,92% de seus recursos financeiros.

De acordo com o Estudo de Duration do Fluxo de Caixa do Plano Previdenciário, informado na Política Anual de Investimentos/2024, o PREVISÓ irá começar a consumir os seus recursos, à partir do ano de 2035.

As Obrigações Previdenciárias a Médio e Longo Prazo do PREVISÓ estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2024 e a sua capacidade e necessidade financeira a Médio e Longo prazo.

As análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

**É o Relatório.**



Igor França Garcia

Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA

Consultor de Investimentos credenciado pela CVM