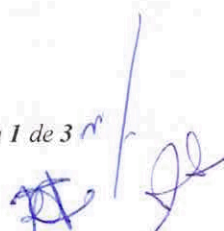


# **RELATORIO DE INVESTIMENTOS**

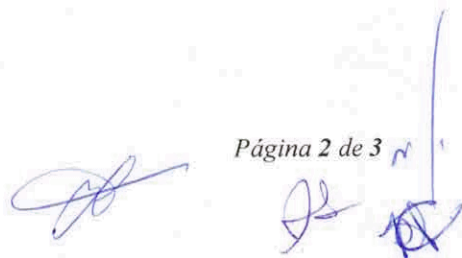
## **FEVEREIRO 2024**

Handwritten signature and initials in blue ink, located at the bottom right of the page.



## SUMÁRIO

|                                                 |   |
|-------------------------------------------------|---|
| 1. Apresentação .....                           | 3 |
| 2. Parecer do Comitê de Investimentos .....     | 3 |
| 3. Aprovação do Conselho de Administração ..... | 3 |

Three handwritten signatures in blue ink are located at the bottom right of the page. The first signature is a stylized 'J' or 'L' shape. The second is a more complex, cursive signature. The third is a signature that appears to be 'P' followed by a flourish.



## 1. APRESENTAÇÃO

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

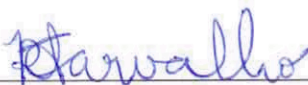
## 2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês FEVEREIRO/2024 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

## 3. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de fevereiro de 2024, em reunião realizada em 18 de junho de 2024.

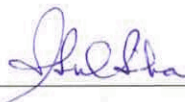
Rosana Teixeira de Carvalho



Lisete de Fátima Oliveira



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira







CRÉDITO  
& MERCADO

# Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2024



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência      | Saldo          | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                     |
|-----------------------------------------------------|---------|---------------|----------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                    |         |               | 219.854.761,80 | 45,63%             |          | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1     | Não há        | 16.121.769,46  | 3,35%              | 795      | 0,31%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1     | Não há        | 6.244.620,76   | 1,30%              | 650      | 0,12%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P... | D+0     | 4944          | 21.654.128,42  | 4,49%              | 44       | 3,42%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA      | D+0     | Não há        | 536.986,93     | 0,11%              | 798      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1     | Não há        | 3.097.035,04   | 0,64%              | 220      | 0,13%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP           | D+1     | Não há        | 10.367.016,16  | 2,15%              | 105      | 1,90%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA      | D+1     | Não há        | 5.262.382,22   | 1,09%              | 45       | 0,47%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO      | D+0     | Não há        | 81,14          | 0,00%              | 1.015    | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0     | Não há        | 15.569.500,93  | 3,23%              | 1.139    | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA         | D+1     | Não há        | 3.606.459,96   | 0,75%              | 98       | 0,68%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI      | D+0     | Não há        | 11.511.318,09  | 2,39%              | 449      | 0,11%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                | D+1     | Não há        | 966.726,68     | 0,20%              | 116      | 0,13%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI    | D+0     | Não há        | 7.686.305,38   | 1,60%              | 407      | 0,13%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| NOVIUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP               | D+4 du  | Não há        | 5.624.457,44   | 1,17%              | 143      | 1,00%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| LETRA FINANCEIRA BTG                                | S/Info  | Não se aplica | 96.186.746,27  | 19,96%             |          | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso IV              |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES                 | D+32    | Não há        | 5.350.575,46   | 1,11%              | 58       | 0,27%            | Artigo 8º, Inciso I               |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I              | D+5     | Não há        | 3.312.129,17   | 0,69%              | 9.869    | 0,46%            | Artigo 9º, Inciso III             |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I             | D+4     | Não há        | 3.369.098,07   | 0,70%              | 470      | 0,15%            | Artigo 9º, Inciso III             |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                          | D+3     | Não há        | 2.268.062,02   | 0,47%              | 1.688    | 2,23%            | Artigo 9º, Inciso III             |

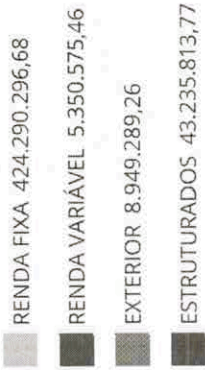
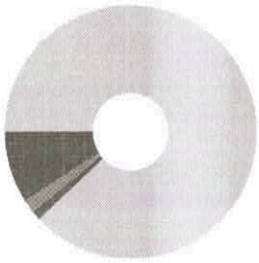


Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência | Saldo          | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento        |
|-----------------------------------------------------|---------|----------|----------------|--------------------|----------|------------------|----------------------|
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP            | D+0     | Não há   | 622.035,86     | 0,13%              | 2.570    | 0,05%            | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                      | D+4     | Não há   | 321.971,30     | 0,07%              | 5.022    | 0,06%            | Artigo 10º, Inciso I |
| ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC... | D+32    | Não há   | 4.315.900,26   | 0,90%              | 632      | 1,17%            | Artigo 10º, Inciso I |
| NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                | D+1     | Não há   | 37.975.906,35  | 7,88%              | 13.727   | 9,43%            | Artigo 10º, Inciso I |
| Total para cálculo dos limites da Resolução         |         |          | 481.825.975,17 |                    |          |                  |                      |

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

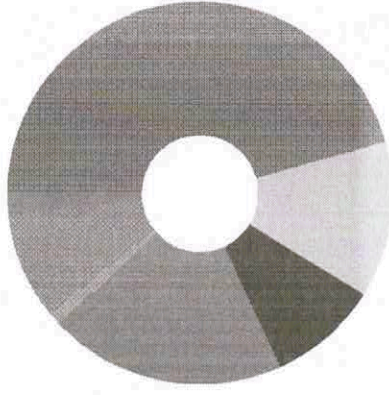
| Artigos - Renda Fixa              | Resolução | Carteira \$    | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 |        |         | GAP Superior   |
|-----------------------------------|-----------|----------------|----------|-------------------------------|--------|---------|----------------|
|                                   |           |                |          | Inf                           | Alvo   | Sup     |                |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'   | 100,00%   | 219.854.761,80 | 45,63%   | 20,00%                        | 40,50% | 80,00%  | 165.606.018,34 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   | 100,00%   | 63.283.938,99  | 13,13%   | 3,00%                         | 4,78%  | 60,00%  | 225.811.646,11 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 60,00%    | 44.964.849,62  | 9,33%    | 2,00%                         | 10,56% | 60,00%  | 244.130.735,48 |
| Artigo 7º, Inciso IV              | 20,00%    | 96.186.746,27  | 19,96%   | 15,00%                        | 19,91% | 20,00%  | 178.448,76     |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'   | 5,00%     | 0,00           | 0,00%    | 0,00%                         | 1,00%  | 5,00%   | 24.091.298,76  |
| Total Renda Fixa                  | 100,00%   | 424.290.296,68 | 88,06%   | 40,00%                        | 76,75% | 225,00% |                |





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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$   | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 |        |        | GAP Superior   |
|------------------------------------------------------|-----------|---------------|----------|-------------------------------|--------|--------|----------------|
|                                                      |           |               |          | Inf                           | Alvo   | Sup    |                |
| Artigo 8º, Inciso I                                  | 30,00%    | 5.350.575,46  | 1,11%    | 0,00%                         | 5,25%  | 30,00% | 139.197.217,09 |
| Artigo 8º, Inciso II                                 | 30,00%    | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 10,00% | 48.182.597,52  |
| Artigo 10º, Inciso I                                 | 10,00%    | 43.235.813,77 | 8,97%    | 0,00%                         | 9,00%  | 10,00% | 4.946.783,75   |
| Artigo 10º, Inciso II                                | 5,00%     | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 2,00%  | 5,00%  | 24.091.298,76  |
| Artigo 11º                                           | 5,00%     | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 1,00%  | 5,00%  | 24.091.298,76  |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário     | 30,00%    | 48.586.389,23 | 10,08%   | 0,00%                         | 17,25% | 60,00% |                |



| Artigos - Exterior    | Resolução | Carteira \$  | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2024 |       |          | GAP Superior  |
|-----------------------|-----------|--------------|----------|----------------------------------------|-------|----------|---------------|
|                       |           |              |          | Inferior                               | Alvo  | Superior |               |
| Artigo 9º, Inciso II  | 10,00%    | 0,00         | 0,00%    | 0,00%                                  | 0,00% | 10,00%   | 48.182.597,52 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00%    | 8.949.289,26 | 1,86%    | 0,00%                                  | 6,00% | 10,00%   | 39.233.308,26 |
| Total Exterior        | 10,00%    | 8.949.289,26 | 1,86%    | 0,00%                                  | 6,00% | 20,00%   |               |

3





Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos                           | Estratégia de Alocação - 2024 |            | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-----------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
|                                   | Carteira \$                   | Carteira % |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alinea "a"   | 219.854.761,80                | 45,63      | 20,00               | 80,00               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"   | 63.283.938,99                 | 13,13      | 3,00                | 60,00               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alinea "a" | 44.984.849,62                 | 9,33       | 2,00                | 60,00               |
| Artigo 7º, Inciso IV              | 96.186.746,27                 | 19,96      | 15,00               | 20,00               |
| Artigo 7º, Inciso V, Alinea "b"   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I               | 5.350.575,46                  | 1,11       | 0,00                | 30,00               |
| Artigo 8º, Inciso II              | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 9º, Inciso II              | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 9º, Inciso III             | 8.949.289,26                  | 1,86       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 10º, Inciso I              | 43.235.813,77                 | 8,97       | 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                | 5,00                |



Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2024)

| Gestão                              | Valor          | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS) | 219.854.761,80 | 45,63         | -              |
| BANCO BTG PACTUAL                   | 96.186.746,27  | 19,96         | 0,03           |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM          | 62.902.229,88  | 13,05         | -              |
| NOVUS CAPITAL                       | 43.600.363,79  | 9,05          | 0,91           |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT   | 15.629.398,38  | 3,24          | 0,00           |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT           | 15.117.778,05  | 3,14          | 0,00           |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT               | 13.051.402,44  | 2,71          | 0,00           |
| CAIXA DTVM                          | 5.816.818,84   | 1,21          | -              |
| TARPON INVESTIMENTOS                | 5.350.575,46   | 1,11          | -              |
| ICATU VANGUARDA                     | 4.315.900,26   | 0,90          | 0,01           |

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

3  
2  
1

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

|                                                               | Mês   | Ano    | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------------------------------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                    |       |        |       |       |        |        |         |                  |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                   | 0,59% | 1,28%  | 2,76% | 4,42% | 10,44% | 23,21% | -       | -                |
|                                                               | 0,58% | 1,24%  | 2,70% | 4,31% | 10,24% | 22,71% | 0,41%   | 1,77%            |
| <b>IMA-B (Benchmark)</b>                                      |       |        |       |       |        |        |         |                  |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 0,55% | 0,10%  | 2,85% | 3,87% | 14,70% | 23,81% | -       | -                |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP                     | 0,53% | 0,05%  | 2,79% | 3,75% | 14,39% | 23,18% | 0,79%   | 3,97%            |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                   | 0,52% | 0,06%  | 2,78% | 3,55% | 14,46% | 23,04% | 0,82%   | 4,02%            |
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                                      |       |        |       |       |        |        |         |                  |
| SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                | 0,46% | 1,13%  | 2,63% | 5,74% | 15,85% | 27,58% | -       | -                |
|                                                               | 0,43% | 1,10%  | 2,58% | 5,64% | 15,60% | 26,81% | 0,75%   | 2,33%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                        |       |        |       |       |        |        |         |                  |
| NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP                          | 0,80% | 1,78%  | 2,69% | 5,69% | 12,74% | 27,40% | -       | -                |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP    | 0,33% | 1,01%  | 2,24% | 5,22% | 13,54% | 32,57% | 0,63%   | 1,86%            |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                | 0,80% | 1,78%  | 2,70% | 5,67% | 12,75% | 27,44% | 0,01%   | 0,06%            |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                | 0,73% | 1,61%  | 2,45% | 5,17% | 11,62% | 24,88% | 0,01%   | 0,05%            |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI              | 0,90% | 1,93%  | 2,95% | 6,17% | 13,60% | 28,88% | 0,05%   | 0,09%            |
|                                                               | 0,87% | 1,88%  | 2,85% | 6,07% | 13,48% | 28,56% | 0,05%   | 0,09%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                       |       |        |       |       |        |        |         |                  |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,83% | 1,25%  | 1,82% | 2,62% | 4,50%  | 10,34% | -       | -                |
|                                                               | 0,60% | -0,60% | 2,58% | 2,86% | -      | -      | 1,14%   | -                |

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

|                                                     | Mês   | Ano   | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-----------------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| LETRA FINANCEIRA BTG                                | -     | -     | -     | -     | -      | -      | -       | -                |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                | 0,65% | 1,54% | 2,54% | 4,59% | 12,31% | 24,71% | 0,49%   | 1,02%            |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA      | 0,56% | 1,21% | 2,44% | 4,59% | 12,70% | 25,41% | 0,42%   | 1,32%            |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,56% | 1,04% | 2,66% | 4,80% | 15,14% | 24,39% | 0,49%   | 2,86%            |

3

1





CRÉDITO  
& MERCADO

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

|                                                     | Mês   | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-----------------------------------------------------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| Não Possui (Benchmark)                              | -     | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -                |
| ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO | 0,89% | -0,09% | 3,77%  | 6,88%  | 17,88% | 35,26% | 1,85%   | 5,25%            |
| CDI (Benchmark)                                     | 0,80% | 1,78%  | 2,69%  | 5,69%  | 12,74% | 27,40% | -       | -                |
| NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                | 0,45% | 1,01%  | 2,11%  | 4,83%  | 11,16% | 28,42% | 0,60%   | 1,09%            |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                      | 0,49% | -0,19% | 1,85%  | 6,71%  | 14,52% | 23,51% | 2,16%   | 4,51%            |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP            | 0,68% | 1,62%  | 2,54%  | 5,29%  | 12,17% | 26,98% | 0,27%   | 0,34%            |
| Global BDRX (Benchmark)                             | 6,30% | 11,38% | 14,54% | 15,88% | 33,29% | 20,49% | -       | -                |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I             | 6,27% | 11,12% | 13,99% | 15,34% | 32,07% | 18,33% | 8,72%   | 14,39%           |
| Ibovespa (Benchmark)                                | 0,99% | -3,85% | 1,33%  | 11,47% | 22,96% | 14,03% | -       | -                |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES                 | 2,24% | -4,06% | 5,39%  | 15,20% | 49,41% | 60,85% | 5,76%   | 18,38%           |
| MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)             | 5,66% | 9,55%  | 12,36% | 14,14% | 21,82% | 10,33% | -       | -                |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I              | 6,72% | 11,25% | 14,54% | 15,41% | 26,94% | 14,21% | 8,51%   | 13,58%           |

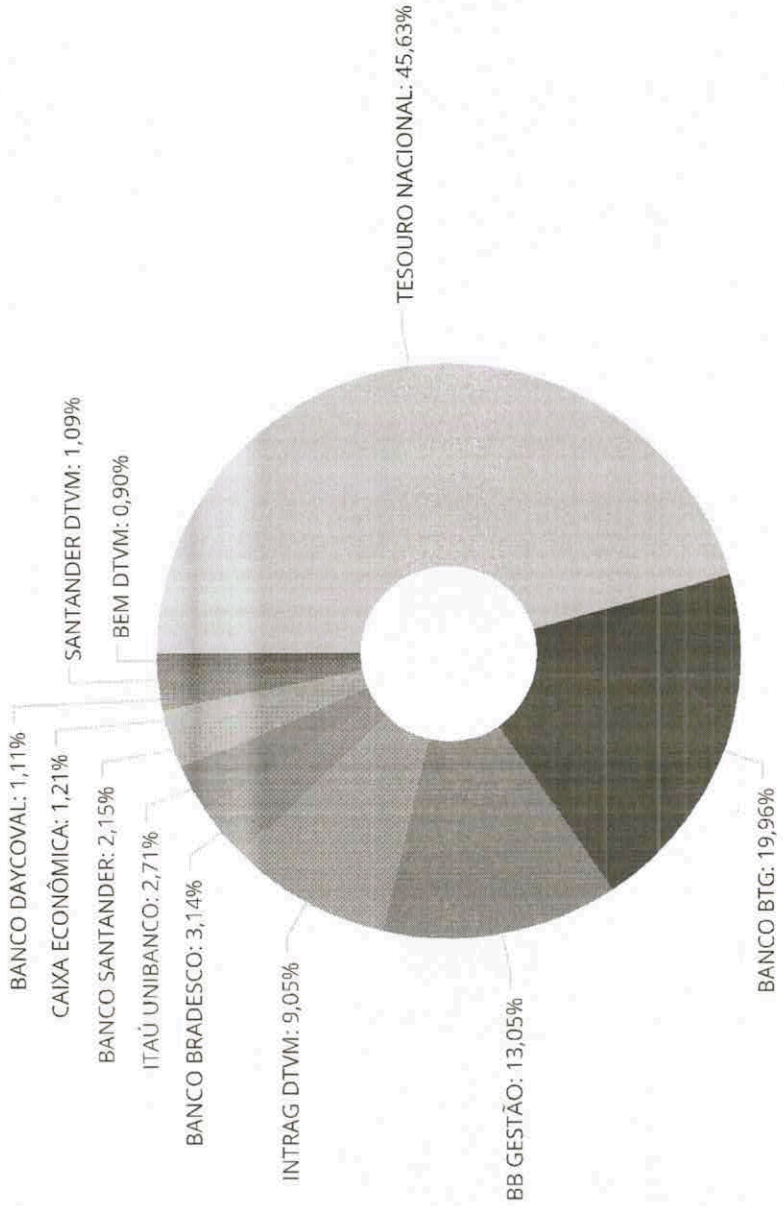


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

|                                         | Mês   | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-----------------------------------------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark) | 5,66% | 9,55%  | 12,36% | 14,14% | 21,82% | 10,33% | -       | -                |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I  | 6,72% | 11,25% | 14,54% | 15,41% | 26,94% | 14,21% | 8,51%   | 13,584%          |
| Global BDRX (Benchmark)                 | 6,30% | 11,38% | 14,54% | 15,88% | 33,29% | 20,49% | -       | -                |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 6,27% | 11,12% | 13,99% | 15,34% | 32,07% | 18,33% | 8,72%   | 14,393%          |
| ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I              | 3,74% | 8,79%  | 10,93% | 14,04% | 19,32% | 8,69%  | 6,70%   | 12,744%          |

3

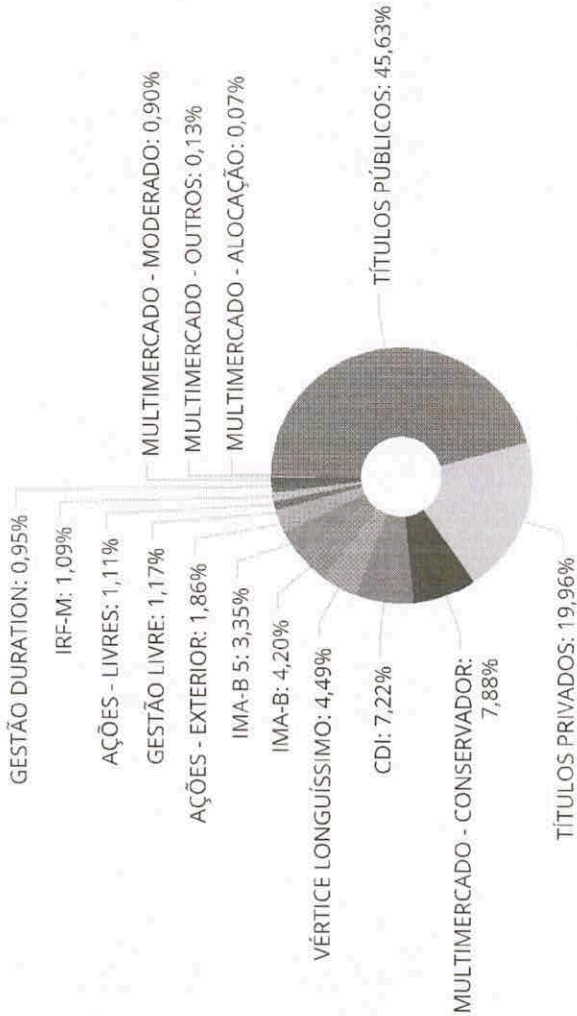
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2024)



|                  |                |
|------------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL | 219.854.761,80 |
| BANCO BTG        | 96.186.746,27  |
| BB GESTÃO        | 62.902.229,88  |
| INTRAG DTVM      | 43.600.363,79  |
| BANCO BRADESCO   | 15.117.778,05  |
| ITAÚ UNIBANCO    | 13.051.402,44  |
| BANCO SANTANDER  | 10.367.016,16  |
| CAIXA ECONÔMICA  | 5.816.818,84   |
| BANCO DAYCOVAL   | 5.350.575,46   |
| SANTANDER DTVM   | 5.262.382,22   |
| BEM DTVM         | 4.315.900,26   |



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



|                           |                |                         |               |                              |               |
|---------------------------|----------------|-------------------------|---------------|------------------------------|---------------|
| ■ TÍTULOS PÚBLICOS        | 219.854.761,80 | ■ TÍTULOS PRIVADOS      | 96.186.746,27 | ■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 37.975.906,35 |
| ■ CDI                     | 34.767.205,54  | ■ VÉRTICE LONGUISSIMO   | 21.654.128,42 | ■ IMA-B                      | 20.218.096,88 |
| ■ IMA-B 5                 | 16.121.769,46  | ■ AÇÕES - EXTERIOR      | 8.949.289,26  | ■ GESTÃO LIVRE               | 5.624.457,44  |
| ■ AÇÕES - LIVRES          | 5.350.575,46   | ■ IRF-M                 | 5.262.382,22  | ■ GESTÃO DURATION            | 4.600.748,65  |
| ■ MULTIMERCADO - MODERADO | 4.315.900,26   | ■ MULTIMERCADO - OUTROS | 622.035,86    | ■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO    | 321.971,30    |

Handwritten signatures and initials.

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 2024)

| Títulos Públicos                           | Vencimento | Compra     | Qtde   | P.U. Compra     | P.U. Atual   | \$ Pago       | \$ Atual      | Marcação |
|--------------------------------------------|------------|------------|--------|-----------------|--------------|---------------|---------------|----------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 30/06/2022 | 19.713 | 4058,06717400   | 4.233,307629 | 79.996.678,20 | 83.451.193,29 | Curva    |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 04/11/2022 | 12.236 | 4.086,264032100 | 4.316,238872 | 49.999.526,70 | 52.813.498,83 | Curva    |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 03/03/2023 | 10.032 | 3.987,19898800  | 4.174,547045 | 39.999.580,25 | 41.879.055,95 | Curva    |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 20/11/2023 | 1.000  | 4.352,820989    | 4.501,675535 | 4.352.820,99  | 4.501.675,53  | Curva    |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 23/11/2023 | 8.300  | 4.339,115559    | 4.483,052794 | 36.014.659,14 | 37.209.338,19 | Curva    |

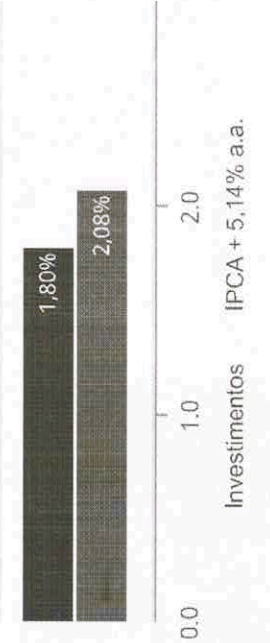
*[Handwritten signature]*



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   | 467.376.655,34 | 3.971.877,17 | 6.323.338,57 | 468.727.859,94 | 3.702.666,00 | 3.702.666,00 | 0,79%       | 0,79%        | 0,86%    | 0,86%     | 92,08%   | 1,32% |
| Fevereiro | 468.727.859,94 | 7.476.358,11 | 6.872.203,35 | 474.036.452,55 | 4.704.437,85 | 8.407.103,85 | 1,00%       | 1,80%        | 1,21%    | 2,08%     | 86,55%   | 1,17% |

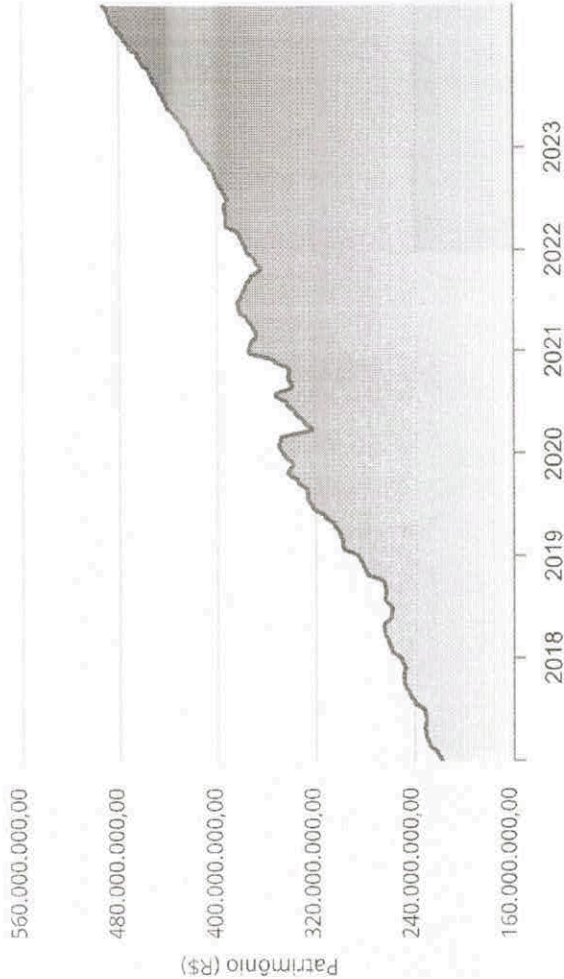
Investimentos x Meta de Rentabilidade



3  
—  
X

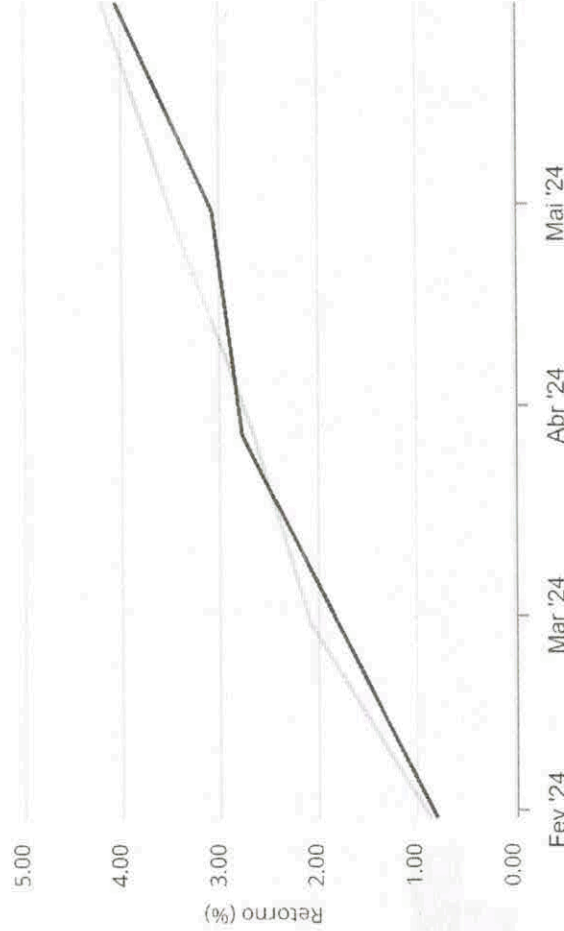
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual    | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|-------------------------------------------------------|----------------|--------------|--------------|----------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| LETRA FINANCEIRA BTG                                  | 95.177.421,67  | 0,00         | 0,00         | 96.186.746,27  | 1.009.324,60  | 1,06%       | -          | -         |
| TÍTULOS PÚBLICOS                                      | 221.575.718,99 | 0,00         | 3.978.820,44 | 219.854.761,80 | 2.257.863,25  | 1,02%       | -          | -         |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI        | 11.409.088,34  | 0,00         | 0,00         | 11.511.318,09  | 102.229,75    | 0,90%       | 0,90%      | 0,05%     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI      | 7.620.393,15   | 0,00         | 0,00         | 7.686.305,38   | 65.912,23     | 0,86%       | 0,86%      | 0,05%     |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                  | 960.469,04     | 0,00         | 0,00         | 966.726,68     | 6.257,64      | 0,65%       | 0,65%      | 0,49%     |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 10.961.891,12  | 7.468.050,50 | 2.978.585,36 | 15.569.500,93  | 118.144,67    | 0,64%       | 0,80%      | 0,01%     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE... | 21.525.494,85  | 0,00         | 0,00         | 21.654.128,42  | 128.633,57    | 0,60%       | 0,60%      | 1,14%     |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 16.029.494,98  | 0,00         | 0,00         | 16.121.769,46  | 92.274,48     | 0,58%       | 0,58%      | 0,41%     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 3.079.861,75   | 0,00         | 0,00         | 3.097.035,04   | 17.173,29     | 0,56%       | 0,56%      | 0,49%     |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 534.024,41     | 0,00         | 0,00         | 536.986,93     | 2.962,52      | 0,55%       | 0,55%      | 0,42%     |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 6.211.654,42   | 0,00         | 0,00         | 6.244.620,76   | 32.966,34     | 0,53%       | 0,53%      | 0,79%     |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP             | 10.312.436,24  | 0,00         | 0,00         | 10.367.016,16  | 54.579,92     | 0,53%       | 0,53%      | 0,79%     |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA           | 3.587.989,54   | 0,00         | 0,00         | 3.606.459,96   | 18.470,42     | 0,51%       | 0,51%      | 0,82%     |
| SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA        | 5.239.665,52   | 0,00         | 0,00         | 5.262.382,22   | 22.716,70     | 0,43%       | 0,43%      | 0,75%     |
| NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP                  | 5.605.930,63   | 0,00         | 0,00         | 5.624.457,44   | 18.526,81     | 0,33%       | 0,33%      | 0,63%     |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO        | 0,00           | 8.307,61     | 8.230,06     | 81,14          | 3,59          | 0,04%       | 0,73%      | 0,01%     |
| Total Renda Fixa                                      | 419.831.534,65 | 7.476.358,11 | 6.965.635,86 | 424.290.296,68 | 3.948.039,78  | 0,94%       |            | 0,54%     |

3





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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável                                 | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|-------------------------------------------------------|----------------|------------|----------|---------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES                   | 5.233.451,67   | 0,00       | 0,00     | 5.350.575,46  | 117.123,79    | 2,24%       | 2,24%      | 5,76%     |
| ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD... | 4.277.986,89   | 0,00       | 0,00     | 4.315.900,26  | 37.913,37     | 0,89%       | 0,89%      | 1,85%     |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP              | 617.813,43     | 0,00       | 0,00     | 622.035,86    | 4.222,43      | 0,68%       | 0,68%      | 0,27%     |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                        | 320.390,54     | 0,00       | 0,00     | 321.971,30    | 1.580,76      | 0,49%       | 0,49%      | 2,16%     |
| NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                  | 37.806.773,62  | 0,00       | 0,00     | 37.975.906,35 | 169.132,73    | 0,45%       | 0,45%      | 0,60%     |
| Total Renda Variável                                  | 48.256.416,15  | 0,00       | 0,00     | 48.586.389,23 | 329.973,08    | 0,68%       |            | 1,29%     |





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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior                         | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|-----------------------------------------|----------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I  | 3.103.559,10   | 0,00       | 0,00     | 3.312.129,17 | 208.570,07    | 6,72%       | 6,72%      | 8,51%     |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 3.170.328,04   | 0,00       | 0,00     | 3.369.098,07 | 198.770,03    | 6,27%       | 6,27%      | 8,72%     |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I              | 2.186.360,77   | 0,00       | 0,00     | 2.268.062,02 | 81.701,25     | 3,74%       | 3,74%      | 6,70%     |
| Total Exterior                          | 8.460.247,91   | 0,00       | 0,00     | 8.949.289,26 | 489.041,35    | 5,78%       |            | 8,13%     |

31



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.



