

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			7.639.614,63	2,09%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	17.205.866,70	4,71%	702	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	9.843.200,73	2,69%	315	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2032 FI RENDA FIXA P...	D+0	48442	9.367.439,90	2,56%	19	6,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	27.253.073,56	7,46%	370	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.219.073,55	0,33%	245	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	8.368.868,12	2,29%	305	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	2.494.827,30	0,68%	110	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	Não há	5.476.964,26	1,50%	11	1,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	39.096.665,89	10,70%	791	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	32.402.386,48	8,87%	850	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	24.677.647,94	6,75%	914	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	21.756.111,57	5,95%	771	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.675.083,55	0,46%	1.696	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	205.640,91	0,06%	1.003	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.726.848,00	3,21%	161	0,60%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.387.134,31	5,58%	447	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	7.324.492,07	2,00%	363	0,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.087.299,52	2,49%	439	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.298.528,68	2,54%	397	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

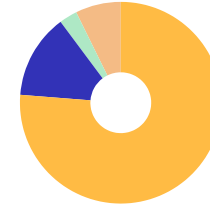
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	6.121.140,36	1,67%	6.095	1,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	6.051.041,95	1,66%	459	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.362.713,03	2,01%	1.294	0,88%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	12.514.826,39	3,42%	1.151	1,67%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.742.220,15	0,75%	17.732	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.382.636,44	0,93%	918	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	10.559.997,94	2,89%	82	2,74%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.309.961,74	0,91%	2.261	1,32%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.982.515,37	0,54%	83	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.804.853,95	1,04%	5.603	2,47%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.104.735,86	0,30%	28	0,44%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.775.176,11	0,76%	55	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	2.212.324,92	0,61%	19.739	0,65%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	2.056.109,01	0,56%	142	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	6.331.339,19	1,73%	65	5,27%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	4.115.082,08	1,13%	174.744	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	2.636.101,43	0,72%	506	1,55%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.334.186,20	1,73%	4.948	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	7.057.929,16	1,93%	2.597	0,53%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.505.644,28	1,78%	5.060	1,21%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			365.467.303,23				

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

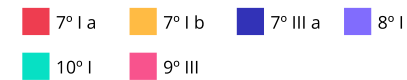
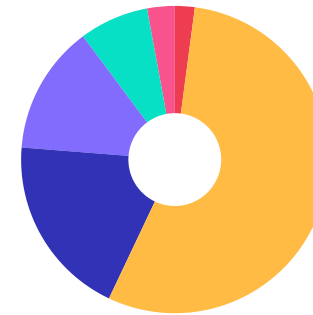
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	7.639.614,63	2,09%	1,00%	5,00%	50,00%	175.094.036,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	200.837.209,55	54,95%	30,00%	50,00%	90,00%	128.083.363,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	70.202.125,80	19,21%	10,00%	19,00%	60,00%	149.078.256,14
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	73.093.460,65
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	18.273.365,16
Total Renda Fixa	100,00%	278.678.949,98	76,25%	41,00%	80,00%	225,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	49.539.636,98	13,56%	0,00%	10,00%	30,00%	60.100.553,99
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	26.648.943,15	7,29%	0,00%	7,00%	10,00%	9.897.787,17
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	7.309.346,06
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	7.309.346,06
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	76.188.580,13	20,85%	0,00%	17,00%	44,00%	

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%	36.546.730,32
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	10.599.773,12	2,90%	0,00%	3,00%	10,00%	25.946.957,20
Total Exterior	10,00%	10.599.773,12	2,90%	0,00%	3,00%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	7.639.614,63	2,09	1,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	200.837.209,55	54,95	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70.202.125,80	19,21	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	49.539.636,98	13,56	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	10.599.773,12	2,90	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	26.648.943,15	7,29	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	2,00
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	187.835.618,91	51,40	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	106.605.345,38	29,17	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	30.573.648,48	8,37	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	10.960.631,76	3,00	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	9.298.528,68	2,54	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	7.639.614,63	2,09	-
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	6.121.140,36	1,67	-
TARPON INVESTIMENTOS	2.775.176,11	0,76	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	1.982.515,37	0,54	-
SICREDI	1.675.083,55	0,46	-

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%	-	-
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%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,77%	5,92%	12,95%	27,12%	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	0,87%	2,76%	5,85%	12,75%	26,62%	0,11%	0,00%
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%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,84%	2,65%	4,87%	9,72%	0,33%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,45%	-0,45%	4,97%	2,91%	15,53%	23,80%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,35%	-0,35%	4,71%	-0,23%	8,56%	9,03%	1,36%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,47%	-0,47%	4,92%	2,84%	15,36%	23,40%	1,27%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,88%	0,88%	2,56%	5,51%	11,76%	24,82%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,85%	2,92%	5,79%	15,22%	26,51%	0,07%	0,01%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	0,81%	0,81%	3,84%	6,33%	13,89%	26,11%	0,28%	0,01%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,03%	1,03%	3,02%	6,37%	12,98%	27,42%	0,02%	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,97%	0,97%	2,79%	6,02%	12,84%	27,21%	0,01%	0,00%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01%	1,01%	2,98%	6,53%	13,43%	28,71%	0,02%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04%	1,04%	2,96%	6,45%	13,33%	28,24%	0,04%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,88%	0,88%	2,55%	5,51%	11,49%	23,72%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	2,96%	6,31%	13,28%	28,05%	0,02%	0,00%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,04%	6,56%	13,58%	28,79%	0,07%	0,00%
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%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,12%	2,87%	5,42%	-	-	0,33%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2032 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,81%	-0,81%	4,42%	1,76%	-	-	1,50%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	2,84%	5,37%	10,86%	22,58%	0,33%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,81%	-0,81%	4,42%	-0,78%	-	-	1,50%	-

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,68%	-0,68%	5,38%	5,54%	11,80%	24,08%	1,84%	0,05%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,89%	0,89%	3,25%	5,86%	12,71%	25,87%	0,05%	0,01%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,93%	0,93%	2,81%	5,52%	12,33%	27,52%	0,09%	0,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,51%	0,51%	5,85%	5,53%	12,87%	25,14%	0,58%	0,03%
Global BDRX (Benchmark)	4,78%	4,78%	14,72%	12,57%	26,83%	5,62%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,72%	3,72%	12,95%	11,12%	17,75%	-0,14%	5,54%	0,13%
Ibovespa (Benchmark)	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,57%	-4,57%	13,44%	3,06%	7,75%	3,66%	5,68%	0,16%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-4,56%	-4,56%	12,95%	4,14%	10,74%	10,15%	5,69%	0,16%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-6,46%	-6,46%	9,72%	2,43%	6,50%	3,69%	5,99%	0,16%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,49%	-1,49%	14,31%	8,75%	40,63%	37,57%	8,15%	0,19%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-6,16%	-6,16%	11,40%	10,28%	42,45%	65,16%	10,56%	0,19%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,67%	-4,67%	13,48%	4,31%	12,27%	12,39%	5,39%	0,17%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-3,23%	-3,23%	14,55%	8,74%	15,59%	26,83%	4,87%	0,14%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,15%	-4,15%	11,76%	0,85%	8,47%	4,31%	6,58%	0,16%
IBX-50 (Benchmark)	-4,15%	-4,15%	13,07%	5,74%	11,32%	13,01%	-	-

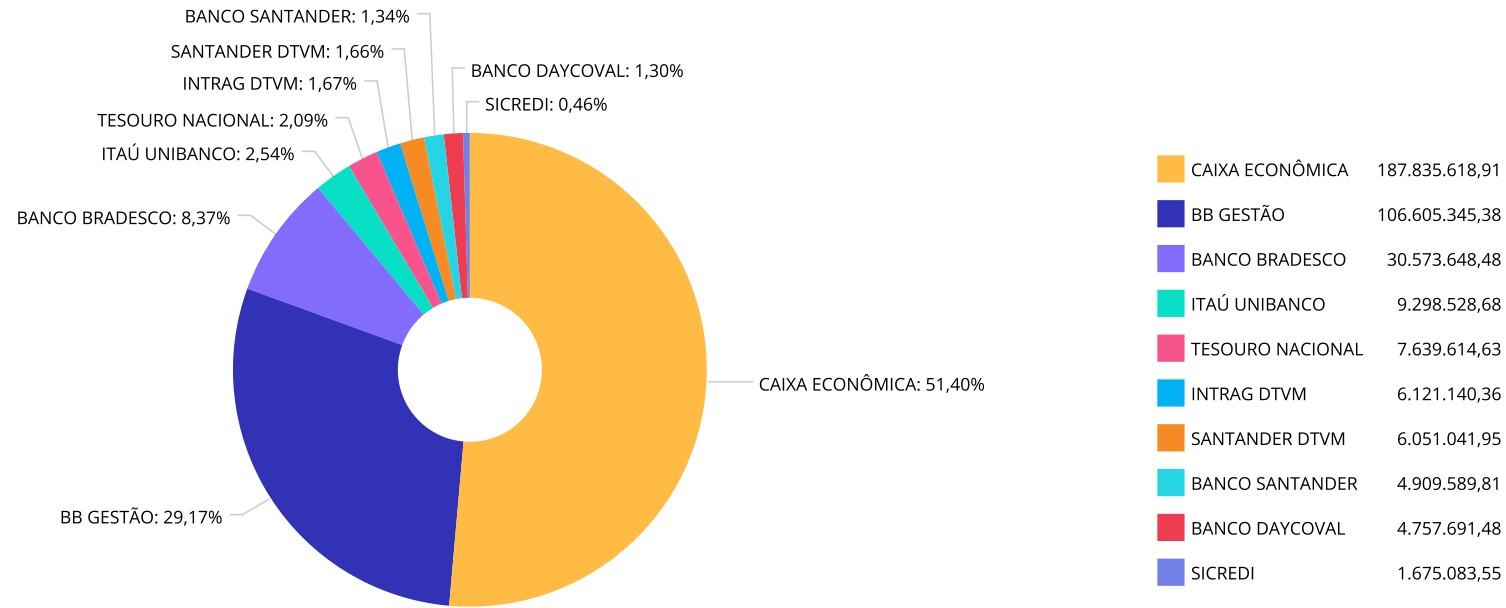
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IBX-50 FIAÇÕES	-4,17%	-4,17%	12,72%	3,55%	7,84%	7,15%	5,38%	0,16%
IDIV (Benchmark)	-3,51%	-3,51%	14,18%	8,88%	15,58%	28,28%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	-3,54%	-3,54%	13,62%	8,29%	14,09%	25,29%	4,60%	0,14%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,59%	1,59%	15,54%	5,59%	18,86%	7,31%	-	-
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	1,60%	1,60%	16,73%	8,28%	22,56%	20,30%	5,19%	0,13%

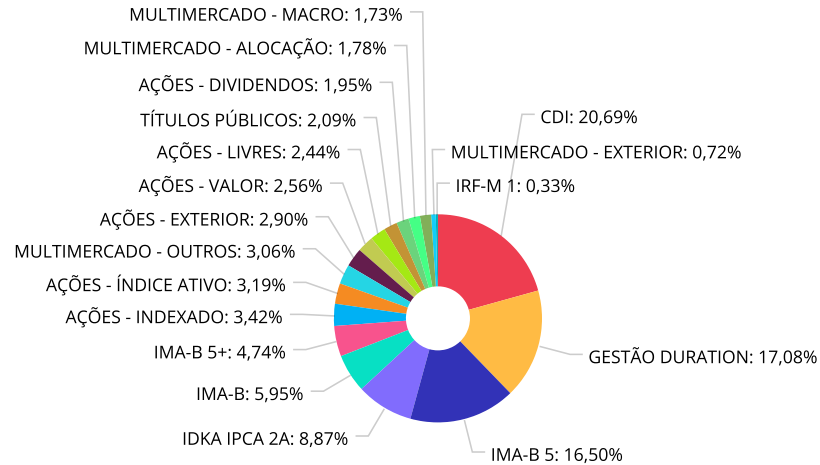
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,72%	3,72%	12,95%	11,12%	17,75%	-0,14%	5,54%	13,197%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,73%	0,73%	11,75%	3,69%	12,64%	8,83%	7,90%	14,481%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,34%	4,34%	14,07%	11,66%	20,51%	2,82%	5,46%	13,425%

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



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



■ CDI	75.599.269,72	■ GESTÃO DURATION	62.423.672,95	■ IMA-B 5	60.299.589,62	■ IDKA IPCA 2A	32.402.386,48
■ IMA-B	21.756.111,57	■ IMA-B 5+	17.339.231,46	■ AÇÕES - INDEXADO	12.514.826,39	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11.664.733,80
■ MULTIMERCADO - OUTROS	11.173.011,24	■ AÇÕES - EXTERIOR	10.599.773,12	■ AÇÕES - VALOR	9.345.228,40	■ AÇÕES - LIVRES	8.900.032,70
■ TÍTULOS PÚBLICOS	7.639.614,63	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	7.114.815,69	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	6.505.644,28	■ MULTIMERCADO - MACRO	6.334.186,20
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.636.101,43	■ IRF-M 1	1.219.073,55				

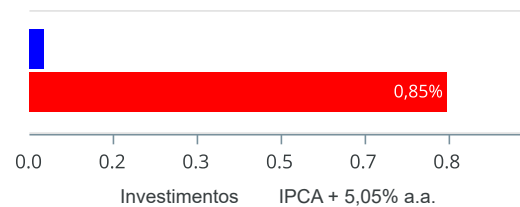
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2024)

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	29/08/2022	1.527	3.928,91437459	4.304,066006	5.999.452,25	6.572.308,79	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	26/05/2022	245	4.082,82995918	4.356,343541	1.000.293,34	1.067.304,16	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

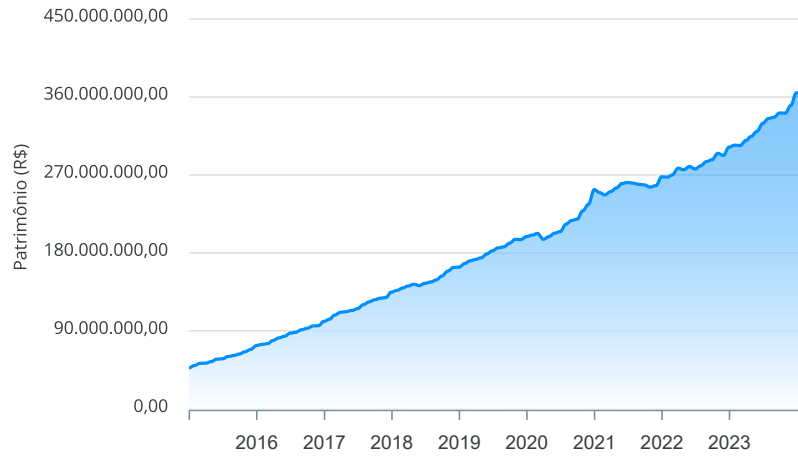
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	364.829.982,96	8.410.206,95	7.884.354,72	365.467.303,23	111.468,04	111.468,04	0,03%	0,03%	0,85%	0,85%	3,58%	1,43%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



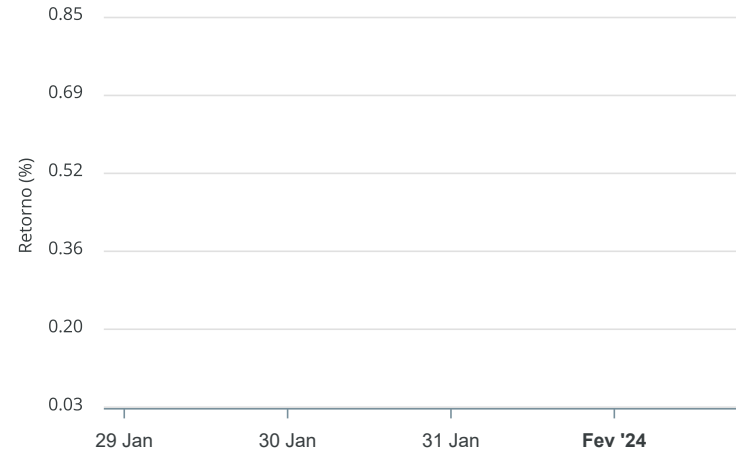
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	9.734.555,93	0,00	0,00	9.843.200,73	108.644,80	1,12%	1,12%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	26.954.626,35	0,00	0,00	27.253.073,56	298.447,21	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.277.249,04	0,00	0,00	8.368.868,12	91.619,08	1,11%	1,11%	0,33%
TÍTULOS PÚBLICOS	7.556.150,44	0,00	0,00	7.639.614,63	83.464,19	1,10%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.167.971,46	0,00	0,00	20.387.134,31	219.162,85	1,09%	1,09%	0,07%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.988.721,94	0,00	0,00	6.051.041,95	62.320,01	1,04%	1,04%	0,04%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	11.607.342,51	0,00	0,00	11.726.848,00	119.505,49	1,03%	1,03%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.205.782,15	0,00	0,00	9.298.528,68	92.746,53	1,01%	1,01%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	8.996.726,68	0,00	0,00	9.087.299,52	90.572,84	1,01%	1,01%	0,02%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1.659.035,75	0,00	0,00	1.675.083,55	16.047,80	0,97%	0,97%	0,01%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.208.594,28	0,00	0,00	1.219.073,55	10.479,27	0,87%	0,87%	0,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	17.060.990,84	0,00	0,00	17.205.866,70	144.875,86	0,85%	0,85%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	32.167.735,29	0,00	0,00	32.402.386,48	234.651,19	0,73%	0,73%	0,53%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	4.578.416,00	1.500.000,00	0,00	6.121.140,36	42.724,36	0,70%	0,81%	0,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	24.514.897,12	0,00	0,00	24.677.647,94	162.750,82	0,66%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	7.119.493,43	4.512.754,67	4.384.327,21	7.324.492,07	76.571,18	0,66%	0,88%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	38.842.221,09	0,00	0,00	39.096.665,89	254.444,80	0,66%	0,66%	0,46%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.286.250,10	397.452,28	3.500.027,51	205.640,91	21.966,04	0,60%	0,88%	0,01%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.503.566,95	0,00	0,00	2.494.827,30	-8.739,65	-0,35%	-0,35%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	21.857.805,96	0,00	0,00	21.756.111,57	-101.694,39	-0,47%	-0,47%	1,27%

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 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.521.702,92	0,00	0,00	5.476.964,26	-44.738,66	-0,81%	-0,81%	1,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2032 FI RENDA FIXA PRE...	9.444.123,51	0,00	0,00	9.367.439,90	-76.683,61	-0,81%	-0,81%	1,50%
Total Renda Fixa	278.253.959,74	6.410.206,95	7.884.354,72	278.678.949,98	1.899.138,01	0,68%		0,45%

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
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	2.594.673,76	0,00	0,00	2.636.101,43	41.427,67	1,60%	1,60%	5,19%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	6.992.904,09	0,00	0,00	7.057.929,16	65.025,07	0,93%	0,93%	0,09%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	4.078.875,56	0,00	0,00	4.115.082,08	36.206,52	0,89%	0,89%	0,05%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.301.954,31	0,00	0,00	6.334.186,20	32.231,89	0,51%	0,51%	0,58%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.550.059,39	0,00	0,00	6.505.644,28	-44.415,11	-0,68%	-0,68%	1,84%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.982.515,37	-17.484,63	-0,87%	-1,49%	8,15%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3.931.818,43	0,00	0,00	3.804.853,95	-126.964,48	-3,23%	-3,23%	4,87%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.431.341,35	0,00	0,00	3.309.961,74	-121.379,61	-3,54%	-3,54%	4,60%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.529.024,76	0,00	0,00	3.382.636,44	-146.388,32	-4,15%	-4,15%	6,58%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	11.019.097,62	0,00	0,00	10.559.997,94	-459.099,68	-4,17%	-4,17%	5,38%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	13.112.630,18	0,00	0,00	12.514.826,39	-597.803,79	-4,56%	-4,56%	5,69%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7.714.984,65	0,00	0,00	7.362.713,03	-352.271,62	-4,57%	-4,57%	5,68%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.158.804,60	0,00	0,00	1.104.735,86	-54.068,74	-4,67%	-4,67%	5,39%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.957.249,52	0,00	0,00	2.775.176,11	-182.073,41	-6,16%	-6,16%	10,56%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.931.645,30	0,00	0,00	2.742.220,15	-189.425,15	-6,46%	-6,46%	5,99%
Total Renda Variável	76.305.063,52	2.000.000,00	0,00	76.188.580,13	-2.116.483,39	-2,70%		4,25%

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
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.970.611,08	0,00	0,00	2.056.109,01	85.497,93	4,34%	4,34%	5,46%
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.104.105,14	0,00	0,00	6.331.339,19	227.234,05	3,72%	3,72%	5,54%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	2.196.243,48	0,00	0,00	2.212.324,92	16.081,44	0,73%	0,73%	7,90%
Total Exterior	10.270.959,70	0,00	0,00	10.599.773,12	328.813,42	3,20%		6,02%

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.

