

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

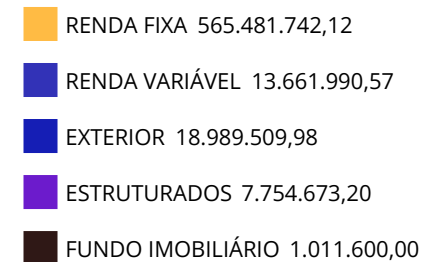
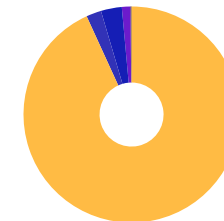
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	45.901.044,17	7,56%	702	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.088.198,35	2,16%	795	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	650.547,86	0,11%	1.144	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	440.460,98	0,07%	140	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	55.038.244,85	9,07%	315	2,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/05/2027	72.134.288,09	11,89%	199	6,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	624.572,64	0,10%	92	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	187.894.930,75	30,96%	370	5,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	566.509,88	0,09%	105	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	3.764.164,61	0,62%	38	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	102.019.105,10	16,81%	305	2,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	19.116.059,84	3,15%	207	1,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	3.148.735,17	0,52%	83	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	15.336.812,04	2,53%	50	6,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	21.130,65	0,00%	791	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.241.894,68	0,37%	728	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	3.135.954,91	0,52%	30	1,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.224.591,78	0,53%	68	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.107.803,45	0,35%	1.696	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	10.466.986,16	1,72%	1.134	0,06%	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
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.801.872,92	1,94%	116	1,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	7.876.217,33	1,30%	459	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.881.615,91	0,80%	433	0,59%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.789.604,19	0,29%	543	0,53%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.165.719,43	0,36%	1.294	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.306.705,76	0,87%	25.212	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.984.015,87	0,49%	2.261	1,19%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.415.945,32	0,23%	5.353	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	6.511.799,15	1,07%	9.842	0,97%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	12.477.710,83	2,06%	468	0,59%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	3.869.732,29	0,64%	88	3,11%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.429.043,77	0,40%	174	0,73%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.455.897,14	0,24%	5.060	0,27%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.011.600,00	0,17%		0,69%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			606.899.515,87				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			248.421,22				Artigo 6º
PL Total			607.147.937,09				

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%	0,00	0,00%	0,00%	0,80%	30,00%	182.069.854,76
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	530.455.049,80	87,40%	30,00%	80,00%	90,00%	15.754.514,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	35.026.692,32	5,77%	2,00%	7,00%	60,00%	329.113.017,20
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	60.689.951,59
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	18.206.985,48
Total Renda Fixa	100,00%	565.481.742,12	93,18%	32,00%	91,80%	193,00%	

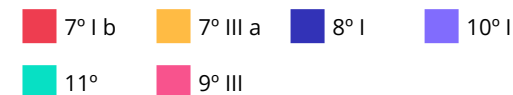
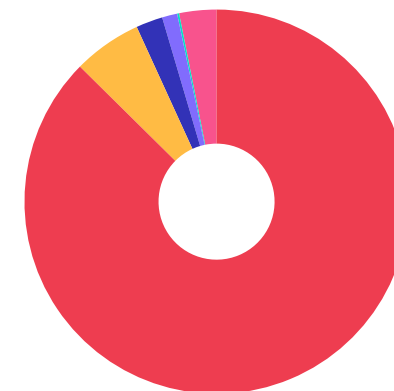


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	13.661.990,57	2,25%	0,00%	4,00%	20,00%	107.717.912,60
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	60.689.951,59
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	7.754.673,20	1,28%	0,00%	2,00%	10,00%	52.935.278,39
Artigo 11º	5,00%	1.011.600,00	0,17%	0,00%	0,20%	1,00%	5.057.395,16
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	22.428.263,77	3,70%	0,00%	6,20%	41,00%	

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%	60.689.951,59
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	18.989.509,98	3,13%	0,00%	2,00%	10,00%	41.700.441,61
Total Exterior	10,00%	18.989.509,98	3,13%	0,00%	2,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.344.975,79



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	530.455.049,80	87,40	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	35.026.692,32	5,77	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	13.661.990,57	2,25	0,00	20,00
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	18.989.509,98	3,13	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	7.754.673,20	1,28	0,00	10,00
Artigo 11º	1.011.600,00	0,17	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	408.311.878,44	67,28	-
CAIXA DTVM	177.361.454,05	29,22	0,70
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	11.100.809,11	1,83	0,00
SICREDI	6.989.419,36	1,15	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.135.954,91	0,52	0,00

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
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	0,85%	2,51%	4,53%	9,73%	21,87%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	0,56%	1,94%	0,89%	-	-	0,82%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	0,55%	4,88%	3,78%	12,92%	-	0,82%	3,05%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	0,55%	1,94%	0,87%	6,56%	-	0,82%	5,05%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,77%	5,92%	12,95%	27,12%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,93%	0,93%	2,92%	6,08%	13,21%	27,46%	0,11%	0,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	0,87%	2,74%	5,80%	12,67%	26,44%	0,12%	0,33%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,66%	0,66%	3,94%	4,32%	11,14%	23,30%	0,55%	1,87%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	1,06%	2,65%	2,39%	5,05%	11,51%	0,11%	3,78%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,84%	2,68%	4,90%	9,69%	0,33%	3,96%

CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,80%	27,43%	0,01%	0,09%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04%	1,04%	2,96%	6,45%	13,33%	28,24%	0,04%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,95%	2,78%	5,94%	12,79%	27,22%	0,02%	0,08%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,85%	2,34%	-	-	0,33%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,85%	2,92%	5,79%	15,22%	26,51%	0,07%	1,31%

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
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,97%	0,97%	2,79%	6,02%	12,84%	27,21%	0,01%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,84%	2,65%	4,87%	9,72%	0,33%	3,99%
IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	1,10%	2,83%	5,35%	10,82%	23,49%	0,33%	1,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	1,10%	2,83%	5,35%	10,83%	23,83%	0,33%	1,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,12%	2,87%	5,42%	-	-	0,33%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	2,84%	5,37%	10,86%	22,58%	0,33%	1,26%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,89%	0,89%	3,09%	4,56%	12,69%	25,05%	0,18%	1,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,32%	0,32%	3,88%	4,74%	12,69%	23,89%	0,63%	1,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,33%	4,67%	13,16%	25,72%	0,46%	1,30%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	1,12%	2,87%	2,45%	-	-	0,33%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,54%	0,54%	3,89%	4,97%	11,62%	24,41%	0,32%	1,49%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,68%	-0,68%	5,38%	5,54%	11,80%	24,08%	1,84%	4,67%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	0,76%	3,85%	5,98%	12,77%	26,37%	0,31%	1,17%
Global BDRX (Benchmark)	4,78%	4,78%	14,72%	12,57%	26,83%	5,62%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,56%	4,56%	14,16%	11,69%	25,21%	3,42%	5,69%	14,74%
Ibovespa (Benchmark)	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,57%	-4,57%	13,44%	3,06%	7,75%	3,66%	5,68%	16,19%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-5,18%	-5,18%	11,13%	3,37%	4,06%	-1,34%	6,01%	16,60%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-4,66%	-4,66%	11,47%	4,00%	11,17%	11,55%	5,48%	15,62%
IDIV (Benchmark)	-3,51%	-3,51%	14,18%	8,88%	15,58%	28,28%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,54%	-3,54%	13,62%	8,29%	14,09%	25,29%	4,60%	13,85%
IFIX (Benchmark)	0,67%	0,67%	5,63%	4,26%	18,16%	20,04%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	5,24%	5,24%	5,48%	5,27%	32,97%	23,07%	9,40%	23,73%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,67%	3,67%	13,51%	10,12%	14,54%	-3,02%	-	-

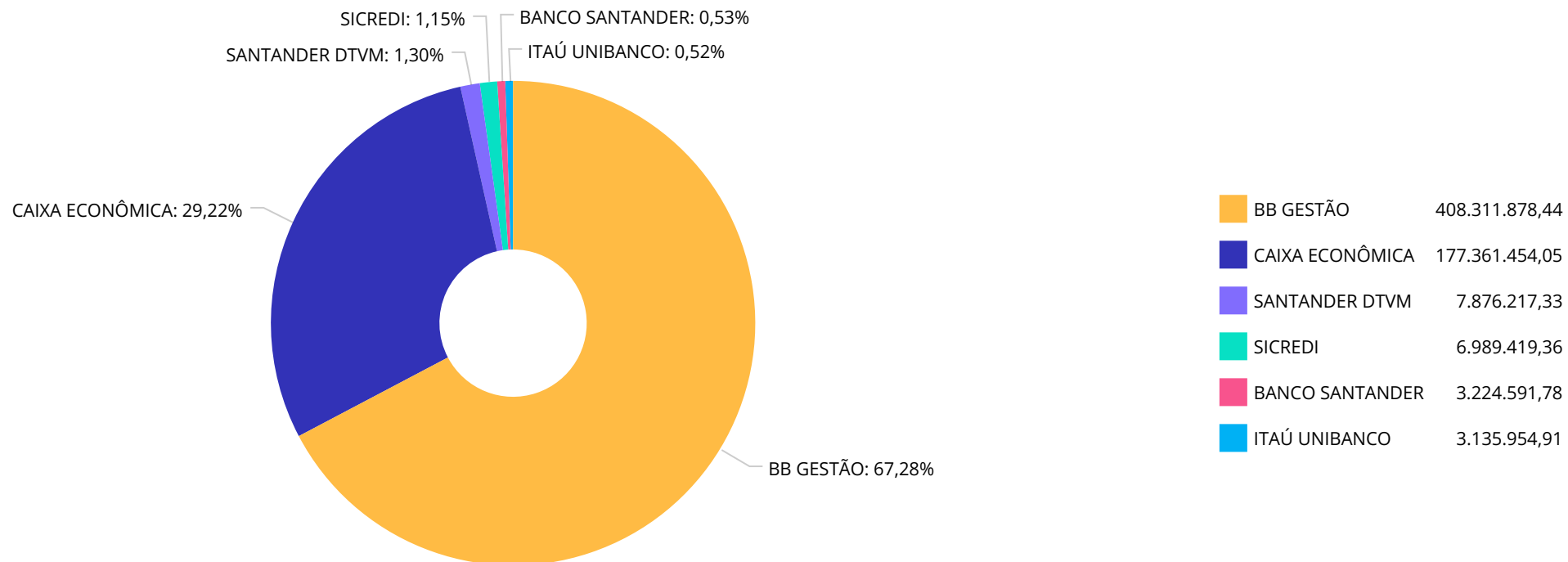
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,25%	4,25%	13,79%	11,10%	19,31%	0,78%	5,46%	13,43%
SMLL (Benchmark)	-6,55%	-6,55%	12,50%	-6,30%	6,34%	-10,11%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-6,59%	-6,59%	12,09%	-6,54%	5,31%	-11,42%	9,75%	21,65%

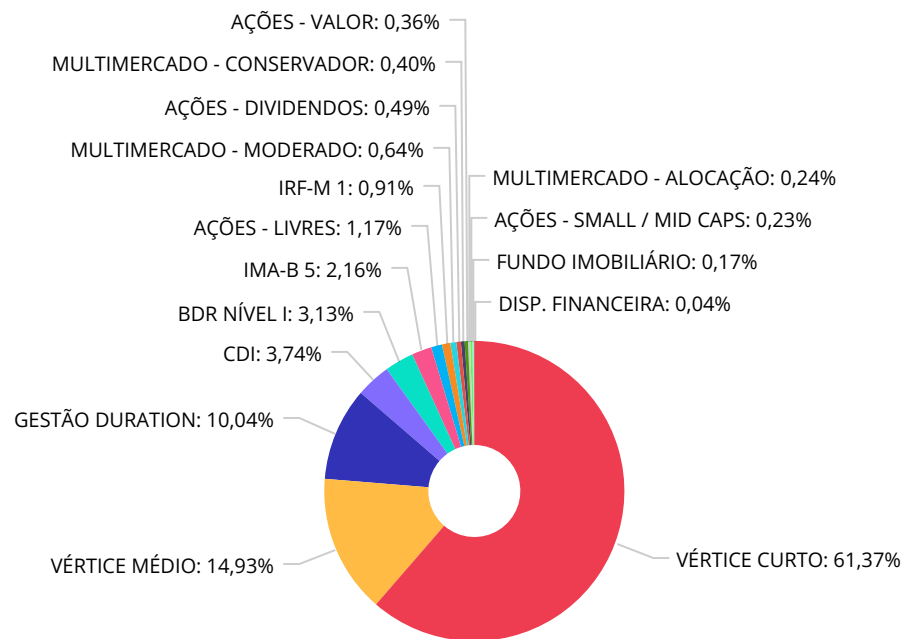
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,67%	3,67%	13,51%	10,12%	14,54%	-3,02%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,25%	4,25%	13,79%	11,09%	19,31%	0,78%	5,46%	13,425%
Global BDRX (Benchmark)	4,78%	4,78%	14,72%	12,57%	26,83%	5,62%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,56%	4,56%	14,15%	11,69%	25,21%	3,42%	5,69%	14,738%

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



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

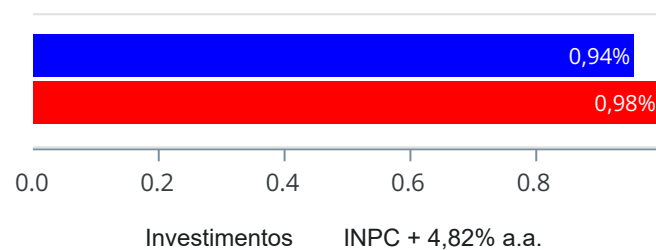


■ VÉRTICE CURTO	372.600.003,56	■ VÉRTICE MÉDIO	90.619.835,30	■ GESTÃO DURATION	60.948.639,52	■ CDI	22.692.901,62
■ BDR NÍVEL I	18.989.509,98	■ IMA-B 5	13.088.198,35	■ AÇÕES - LIVRES	7.096.309,95	■ IRF-M 1	5.532.163,77
■ MULTIMERCADO - MODERADO	3.869.732,29	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.984.015,87	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.429.043,77	■ AÇÕES - VALOR	2.165.719,43
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.455.897,14	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.415.945,32	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.011.600,00	■ DISP. FINANCEIRA	248.421,22

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

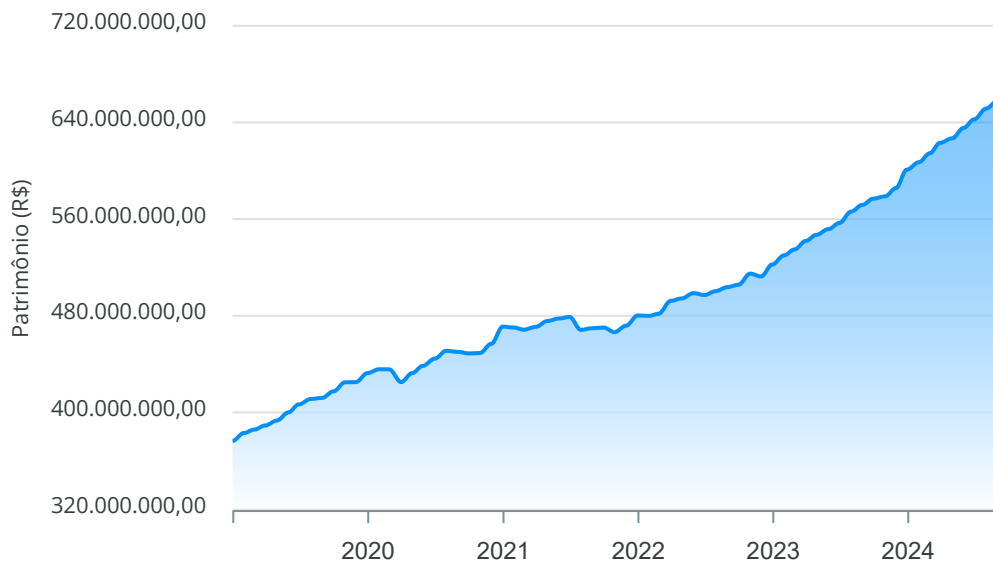
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	596.352.900,05	4.633.057,04	4.357.080,00	602.259.005,03	5.630.127,94	5.630.127,94	0,94%	0,94%	0,98%	0,98%	95,88%	0,68%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



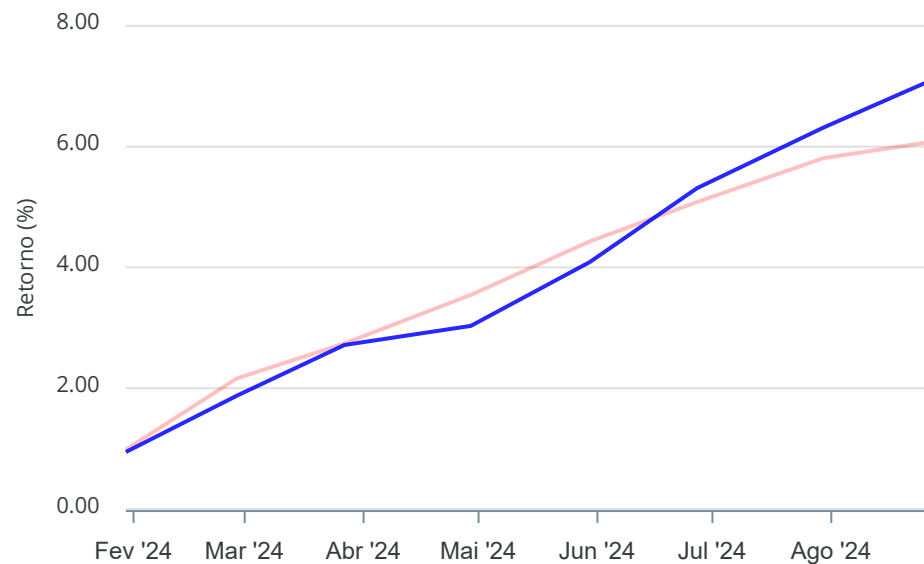
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	54.430.757,57	0,00	0,00	55.038.244,85	607.487,28	1,12%	1,12%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.905.205,24	0,00	0,00	19.116.059,84	210.854,60	1,12%	1,12%	0,33%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	3.101.552,78	0,00	0,00	3.135.954,91	34.402,13	1,11%	1,11%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	185.837.301,62	0,00	0,00	187.894.930,75	2.057.629,13	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	100.902.239,94	0,00	0,00	102.019.105,10	1.116.865,16	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	560.314,05	0,00	0,00	566.509,88	6.195,83	1,11%	1,11%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	617.751,08	0,00	0,00	624.572,64	6.821,56	1,10%	1,10%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	435.650,41	0,00	0,00	440.460,98	4.810,57	1,10%	1,10%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.724.555,59	0,00	0,00	3.764.164,61	39.609,02	1,06%	1,06%	0,11%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	7.795.099,73	0,00	0,00	7.876.217,33	81.117,60	1,04%	1,04%	0,04%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	2.087.610,07	0,00	0,00	2.107.803,45	20.193,38	0,97%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.220.787,48	0,00	0,00	2.241.894,68	21.107,20	0,95%	0,95%	0,02%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	4.836.499,94	0,00	0,00	4.881.615,91	45.115,97	0,93%	0,93%	0,11%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	11.698.376,63	0,00	0,00	11.801.872,92	103.496,29	0,88%	0,88%	0,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	644.971,45	0,00	0,00	650.547,86	5.576,41	0,86%	0,86%	0,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	45.514.550,81	0,00	0,00	45.901.044,17	386.493,36	0,85%	0,85%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	9.798.943,90	5.033.057,04	4.490.000,00	10.466.986,16	124.985,22	0,84%	0,97%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.002.354,75	0,00	0,00	13.088.198,35	85.843,60	0,66%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	20.993,13	0,00	0,00	21.130,65	137,52	0,66%	0,66%	0,46%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.252.174,23	0,00	0,00	15.336.812,04	84.637,81	0,55%	0,55%	0,82%

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 2027 FI RENDA FIXA PRE...	71.739.358,02	0,00	0,00	72.134.288,09	394.930,07	0,55%	0,55%	0,82%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.131.530,94	0,00	0,00	3.148.735,17	17.204,23	0,55%	0,55%	0,82%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.214.293,04	0,00	0,00	3.224.591,78	10.298,74	0,32%	0,32%	0,63%
Total Renda Fixa	559.472.872,40	5.033.057,04	4.490.000,00	565.481.742,12	5.465.812,68	0,98%		0,38%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	961.200,00	0,00	7.080,00	1.011.600,00	57.480,00	5,98%	6,03%	9,40%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.410.792,95	0,00	0,00	2.429.043,77	18.250,82	0,76%	0,76%	0,31%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.848.899,93	0,00	0,00	3.869.732,29	20.832,36	0,54%	0,54%	0,32%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.465.836,79	0,00	0,00	1.455.897,14	-9.939,65	-0,68%	-0,68%	1,84%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.093.442,72	0,00	0,00	2.984.015,87	-109.426,85	-3,54%	-3,54%	4,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.269.339,05	0,00	0,00	2.165.719,43	-103.619,62	-4,57%	-4,57%	5,68%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.877.127,32	0,00	0,00	1.789.604,19	-87.523,13	-4,66%	-4,66%	5,48%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5.596.594,35	0,00	0,00	5.306.705,76	-289.888,59	-5,18%	-5,18%	6,01%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.515.821,91	0,00	0,00	1.415.945,32	-99.876,59	-6,59%	-6,59%	9,75%
Total Renda Variável	23.039.055,02	0,00	7.080,00	22.428.263,77	-603.711,25	-2,62%		4,27%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.933.445,43	0,00	0,00	12.477.710,83	544.265,40	4,56%	4,56%	5,69%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6.246.503,67	0,00	0,00	6.511.799,15	265.295,48	4,25%	4,25%	5,46%
Total Exterior	18.179.949,10	0,00	0,00	18.989.509,98	809.560,88	4,45%		5,61%

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.

