

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

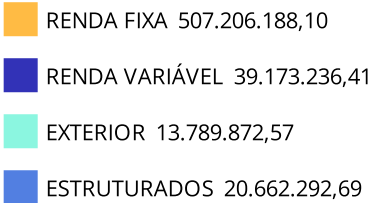
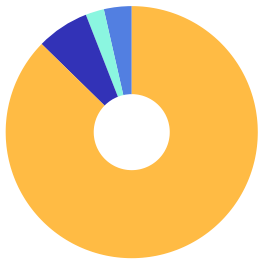
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	25.613.701,20	4,41%	702	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	34.653.308,80	5,97%	883	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	30.940.888,55	5,33%	795	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	23.581.090,26	4,06%	650	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	19.773.866,35	3,40%	96	7,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREV.I...	D+0	Não há	58.687.398,44	10,10%	1.144	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	11.348.247,34	1,95%	199	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	9.583.545,68	1,65%	370	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.562.152,85	1,65%	305	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	3.490.884,66	0,60%	83	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	26.086.048,13	4,49%	791	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	49.706.933,84	8,56%	850	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	28.444.498,94	4,90%	914	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.561.678,55	0,79%	284	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	9.846.006,66	1,70%	771	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	8.155.776,72	1,40%	158	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	32.718.333,01	5,63%	1.190	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.039.488,10	0,18%	217	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	57.862.241,00	9,96%	1.134	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.912.436,65	1,88%	116	1,45%	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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	27.407.938,03	4,72%	989	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.956.572,14	1,20%	226	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.299.112,76	1,26%	397	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	8.974.039,44	1,55%	459	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	D+3	Não há	9.802.170,81	1,69%	19.325	0,80%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	12.965.564,87	2,23%	1.294	1,54%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.744.939,35	0,30%	25.212	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	287.538,92	0,05%	17.732	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	4.652.612,08	0,80%	204	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	9.720.410,38	1,67%	117	1,42%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	9.464.141,37	1,63%	142	0,70%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.325.731,20	0,74%	468	0,21%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.998.913,93	0,86%	39.941	0,29%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.811.895,92	1,52%	4.948	0,61%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	6.851.482,84	1,18%	6.694	0,41%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			580.831.589,77				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			35.764,39				Artigo 6º
PL Total			580.867.354,16				

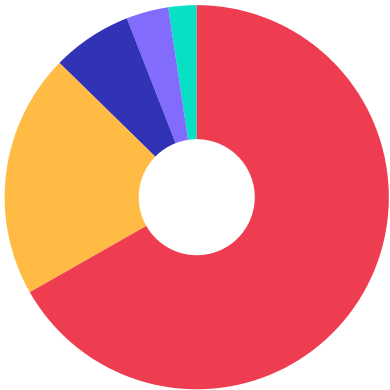
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2024)

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%	1,00%	20,00%	116.166.317,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	387.793.848,08	66,77%	15,00%	59,00%	90,00%	134.954.582,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	119.412.340,02	20,56%	5,00%	23,00%	60,00%	229.086.613,84
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	116.166.317,95
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	29.041.579,49
Total Renda Fixa	100,00%	507.206.188,10	87,32%	20,00%	87,00%	195,00%	



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%	39.173.236,41	6,74%	0,00%	8,00%	30,00%	135.076.240,52
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	58.083.158,98
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	20.662.292,69	3,56%	0,00%	3,00%	10,00%	37.420.866,29
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	11.616.631,80
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	11.616.631,80
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	59.835.529,10	10,30%	0,00%	11,00%	54,00%	



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%	5,00%	29.041.579,49
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	13.789.872,57	2,37%	0,00%	2,00%	10,00%	44.293.286,41
Total Exterior	10,00%	13.789.872,57	2,37%	0,00%	2,00%	15,00%	



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'	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	387.793.848,08	66,77	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	119.412.340,02	20,56	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	39.173.236,41	6,74	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	5,00
Artigo 9º, Inciso III	13.789.872,57	2,37	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	20.662.292,69	3,56	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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	311.307.556,87	53,60	-
CAIXA DTVM	252.211.392,60	43,42	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	8.974.039,44	1,55	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	8.338.600,86	1,44	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
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%	1,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	0,71%	3,96%	4,60%	10,93%	23,00%	0,57%	1,88%
IMA Geral (Benchmark)	0,47%	0,47%	3,98%	5,14%	14,53%	26,21%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	0,45%	3,90%	5,00%	14,31%	26,00%	0,56%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	0,45%	3,95%	5,01%	14,44%	26,03%	0,58%	1,84%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,47%	-1,47%	5,89%	1,54%	19,03%	23,38%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,46%	-1,46%	5,87%	1,60%	18,68%	22,73%	2,01%	6,40%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,77%	5,92%	12,95%	27,12%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,91%	2,80%	5,87%	12,79%	26,67%	0,11%	0,33%
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%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	0,55%	1,94%	0,87%	6,56%	-	0,82%	5,05%
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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	0,66%	3,94%	4,34%	11,18%	23,49%	0,55%	1,85%

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
IMA-B (Benchmark)	-0,45%	-0,45%	4,97%	2,91%	15,53%	23,80%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,48%	-0,48%	4,92%	2,78%	15,23%	23,18%	1,28%	4,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,47%	-0,47%	4,92%	2,84%	15,36%	23,40%	1,27%	4,14%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,49%	-0,49%	5,00%	2,86%	15,52%	23,30%	1,31%	4,26%

CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,00%	1,00%	2,92%	6,34%	13,22%	27,95%	0,01%	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01%	1,01%	2,98%	6,53%	13,43%	28,71%	0,02%	0,11%
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%
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%
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%

IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	0,55%	4,88%	3,78%	12,92%	-	0,82%	3,05%
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,33%	4,67%	13,16%	25,72%	0,46%	1,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,48%	0,48%	4,75%	4,60%	15,81%	24,85%	0,65%	3,04%

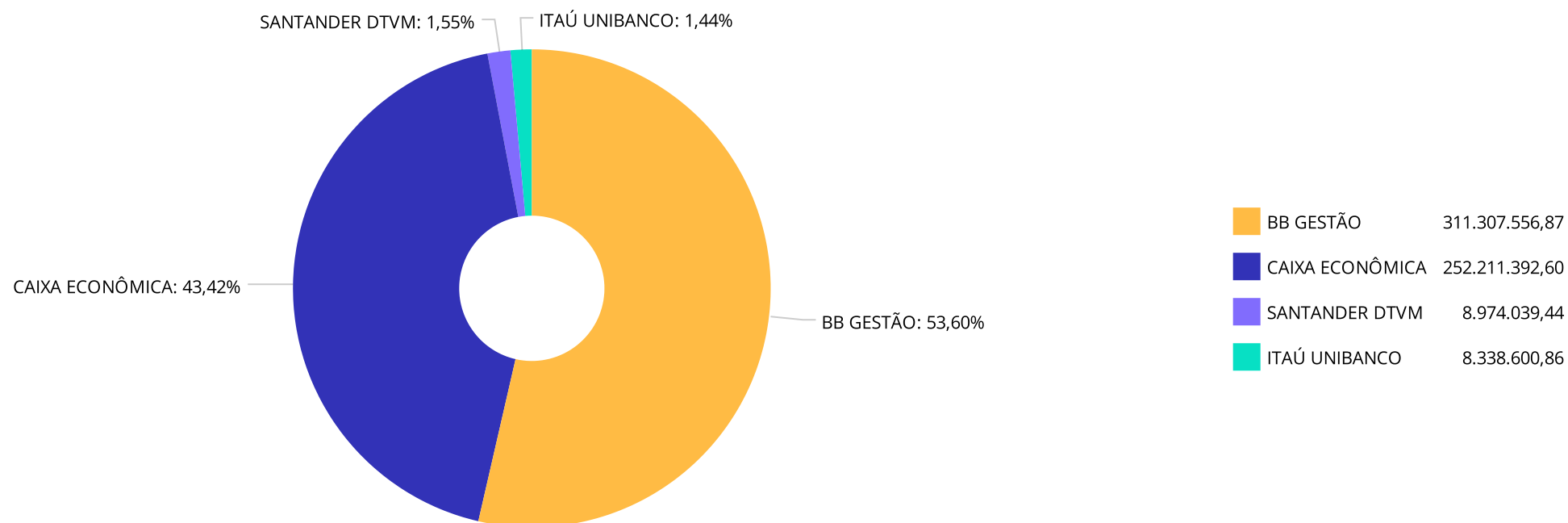
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	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 MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,02%	0,02%	5,03%	4,00%	9,38%	20,53%	0,69%	2,40%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,51%	0,51%	5,85%	5,53%	12,87%	25,14%	0,58%	3,32%
Global BDRX (Benchmark)	4,78%	4,78%	14,72%	12,57%	26,83%	5,62%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4,56%	4,56%	14,16%	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 SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	-6,46%	-6,46%	9,72%	2,43%	6,50%	3,69%	5,99%	16,12%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FICAÇÕES	-4,13%	-4,13%	14,09%	4,05%	12,06%	10,66%	5,62%	16,67%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	-2,73%	-2,73%	18,05%	7,36%	20,43%	25,73%	7,00%	16,49%
BB AÇÕES VALOR FICAÇÕES	-4,57%	-4,57%	13,44%	3,06%	7,75%	3,66%	5,68%	16,19%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	-5,18%	-5,18%	11,13%	3,37%	4,06%	-1,34%	6,01%	16,60%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,86%	2,86%	12,43%	7,98%	9,50%	-5,80%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,69%	1,69%	16,97%	8,77%	27,17%	25,92%	5,15%	12,84%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,59%	1,59%	15,54%	5,59%	18,86%	7,31%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FICAÇÕES	1,67%	1,67%	16,06%	7,88%	22,41%	18,81%	5,08%	12,38%

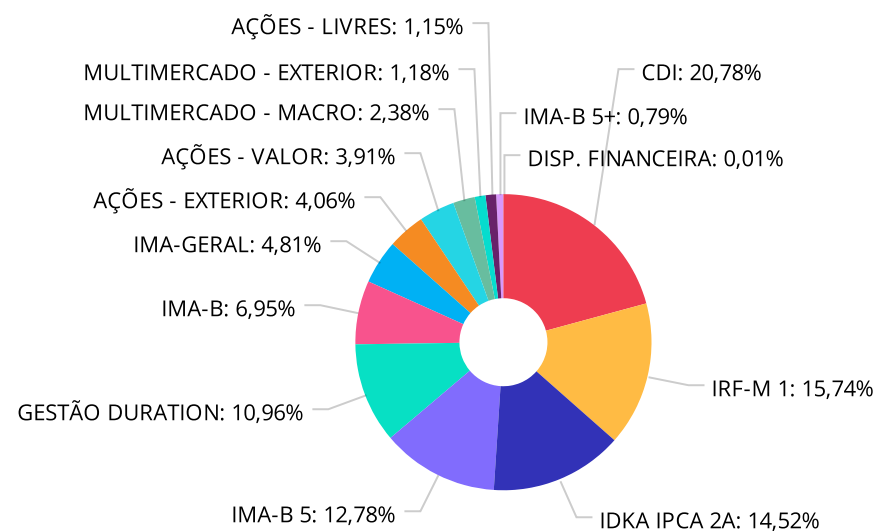
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4,34%	4,34%	14,07%	11,66%	20,51%	2,82%	5,46%	13,425%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4,56%	4,56%	14,15%	11,69%	25,21%	3,42%	5,69%	14,738%

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



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

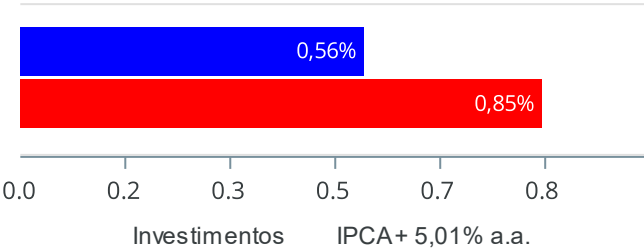


CDI	120.689.029,76	IRF-M 1	91.405.731,45	IDKA IPCA 2A	84.360.242,64	IMA-B 5	74.224.519,49
GESTÃO DURATION	63.651.674,08	IMA-B	40.383.669,06	IMA-GERAL	27.929.643,07	AÇÕES - EXTERIOR	23.592.043,38
AÇÕES - VALOR	22.685.975,25	MULTIMERCADO - MACRO	13.810.809,85	MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.851.482,84	AÇÕES - LIVRES	6.685.090,35
IMA-B 5+	4.561.678,55	DISP. FINANCEIRA	35.764,39				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

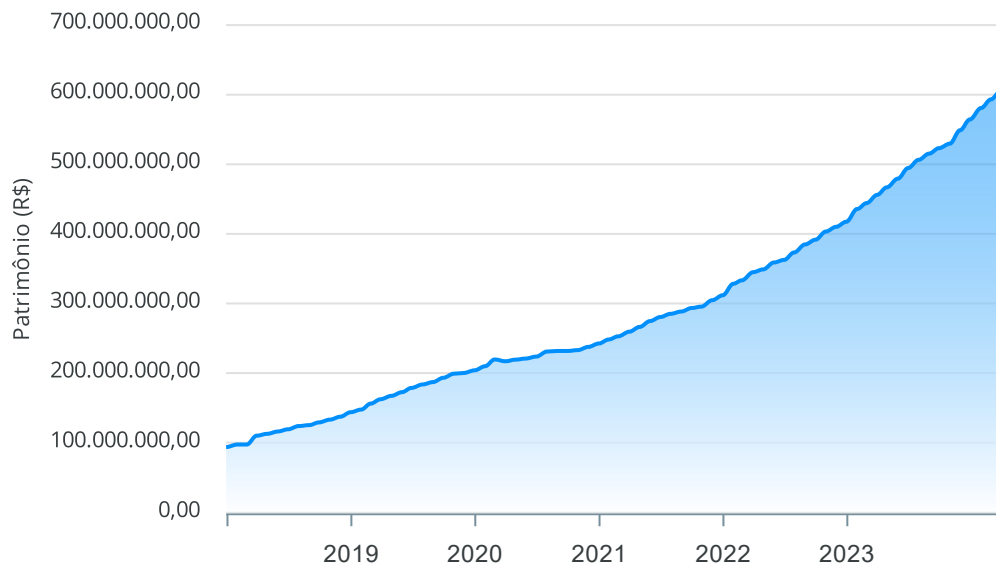
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	556.606.390,92	15.469.314,35	2.365.370,12	572.890.441,38	3.180.106,23	3.180.106,23	0,56%	0,56%	0,85%	0,85%	65,71%	0,94%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



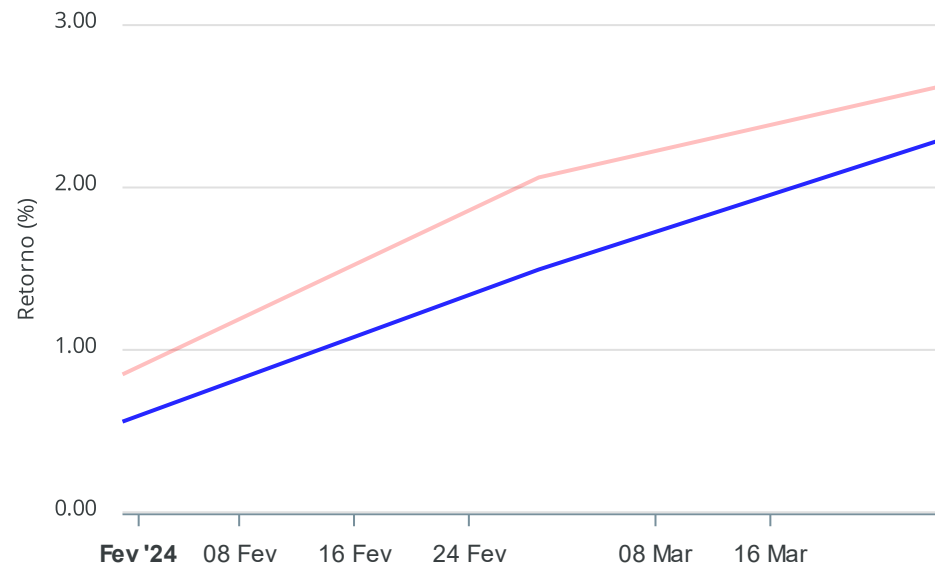
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.478.596,69	0,00	0,00	9.583.545,68	104.948,99	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.457.470,15	0,00	0,00	9.562.152,85	104.682,70	1,11%	1,11%	0,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	7.226.309,05	0,00	0,00	7.299.112,76	72.803,71	1,01%	1,01%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI LP	27.188.934,27	0,00	53.361,84	27.407.938,03	272.365,60	1,00%	1,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENC...	57.832.660,98	0,00	525.816,13	57.862.241,00	555.396,15	0,96%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	32.427.654,60	0,00	5.000,00	32.718.333,01	295.678,41	0,91%	0,91%	0,11%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	10.665.397,00	0,00	1.786.192,15	8.974.039,44	94.834,59	0,89%	1,04%	0,04%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.816.740,27	0,00	0,00	10.912.436,65	95.696,38	0,88%	0,88%	0,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	57.968.829,27	230.000,00	13.399,84	58.687.398,44	501.969,01	0,86%	0,86%	0,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	25.398.030,17	0,00	0,00	25.613.701,20	215.671,03	0,85%	0,85%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	49.346.966,81	0,00	0,00	49.706.933,84	359.967,03	0,73%	0,73%	0,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	34.408.378,93	0,00	0,00	34.653.308,80	244.929,87	0,71%	0,71%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	28.256.905,45	0,00	0,00	28.444.498,94	187.593,49	0,66%	0,66%	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	30.737.951,73	0,00	0,00	30.940.888,55	202.936,82	0,66%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	25.916.277,68	0,00	0,00	26.086.048,13	169.770,45	0,66%	0,66%	0,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	11.286.116,50	0,00	0,00	11.348.247,34	62.130,84	0,55%	0,55%	0,82%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.471.810,98	0,00	0,00	3.490.884,66	19.073,68	0,55%	0,55%	0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.034.568,50	0,00	0,00	1.039.488,10	4.919,60	0,48%	0,48%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	8.119.315,24	0,00	0,00	8.155.776,72	36.461,48	0,45%	0,45%	0,58%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	19.686.118,48	0,00	0,00	19.773.866,35	87.747,87	0,45%	0,45%	0,56%

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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.953.619,73	4.997.000,00	0,00	6.956.572,14	5.952,41	0,09%	-0,49%	1,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.093.701,67	3.472.314,35	0,00	4.561.678,55	-4.337,47	-0,09%	-1,46%	2,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	17.646.384,05	6.000.000,00	0,00	23.581.090,26	-65.293,79	-0,28%	-0,48%	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.892.029,75	0,00	0,00	9.846.006,66	-46.023,09	-0,47%	-0,47%	1,27%
Total Renda Fixa	491.310.767,95	14.699.314,35	2.383.769,96	507.206.188,10	3.579.875,76	0,71%		0,40%

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 INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.737.927,50	0,00	0,00	6.851.482,84	113.555,34	1,69%	1,69%	5,15%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	9.640.907,55	0,00	0,00	9.802.170,81	161.263,26	1,67%	1,67%	5,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.767.056,05	0,00	0,00	8.811.895,92	44.839,87	0,51%	0,51%	0,58%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.997.908,27	0,00	0,00	4.998.913,93	1.005,66	0,02%	0,02%	0,69%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	4.783.219,28	0,00	0,00	4.652.612,08	-130.607,20	-2,73%	-2,73%	7,00%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FICAÇÕES	9.618.796,48	500.000,00	0,00	9.720.410,38	-398.386,10	-3,94%	-4,13%	5,62%
BB AÇÕES VALOR FICAÇÕES	13.055.405,53	500.000,00	0,00	12.965.564,87	-589.840,66	-4,35%	-4,57%	5,68%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	1.840.259,89	0,00	0,00	1.744.939,35	-95.320,54	-5,18%	-5,18%	6,01%
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	307.401,33	0,00	0,00	287.538,92	-19.862,41	-6,46%	-6,46%	5,99%
Total Renda Variável	59.748.881,88	1.000.000,00	0,00	59.835.529,10	-913.352,78	-1,50%		4,46%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4.137.047,08	0,00	0,00	4.325.731,20	188.684,12	4,56%	4,56%	5,69%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL ...	9.070.599,73	0,00	0,00	9.464.141,37	393.541,64	4,34%	4,34%	5,46%
Total Exterior	13.207.646,81	0,00	0,00	13.789.872,57	582.225,76	4,41%		5,53%

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.

