

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

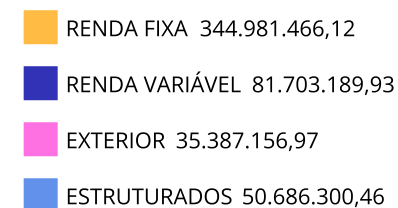
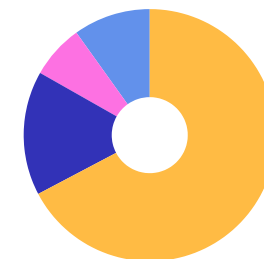
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	43.831.811,60	8,55%	641	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	10.312.353,09	2,01%	199	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	20.917.098,21	4,08%	207	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	184.981,66	0,04%	850	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	17.761.145,53	3,46%	771	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	52.399.612,09	10,22%	450	2,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	17.857.880,89	3,48%	9.307	6,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	15.327.833,05	2,99%	91	1,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	14.974.023,90	2,92%	1.896	7,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+0	Não há	25.714.969,75	5,02%	254	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	49.768.979,50	9,71%	41	4,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	65.638,30	0,01%	1.003	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	16.127.462,82	3,15%	1.134	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	1.162.699,65	0,23%	363	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	25.502.968,98	4,97%	989	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.027.701,87	0,79%	439	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	11.127.088,16	2,17%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	D+0	Não há	8.068.542,57	1,57%	212.983	0,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	9.848.674,50	1,92%	646	4,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	7.785.787,13	1,52%	147	5,19%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	6.703.330,65	1,31%	525	0,85%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.193.800,92	0,43%	2.370	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	14.510.376,59	2,83%	83	0,65%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	9.589.907,59	1,87%	1.081	1,07%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	15.412.889,91	3,01%	1.706	4,74%	Artigo 8º, Inciso I
SPX APACHE FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.223.034,68	0,43%	112	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.650.296,97	2,08%	55	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	D+4 du	Não há	7.479.246,49	1,46%	119	3,25%	Artigo 8º, Inciso I
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	5.154.519,00	1,01%	1.387	1,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	889.512,30	0,17%	51	0,24%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	2.428.391,92	0,47%	37	4,18%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	7.790.135,73	1,52%	7.468	1,10%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	10.153.043,41	1,98%	340	1,51%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	14.126.073,61	2,75%	59.573	0,98%	Artigo 9º, Inciso III
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	8.682.603,47	1,69%	29.828	1,37%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	10.069.012,29	1,96%	2.630	1,86%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	8.537.572,84	1,67%	645	2,51%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	5.808.655,11	1,13%	21	2,43%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	17.588.456,75	3,43%	491	2,62%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			512.758.113,48				

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

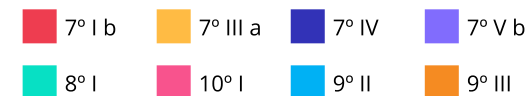
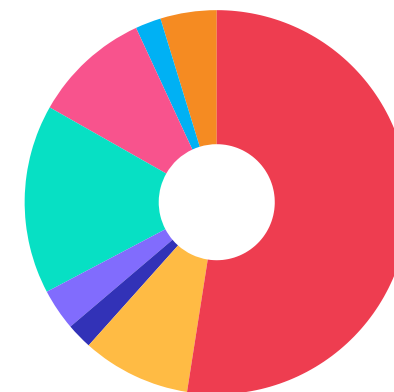
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	40,00%	205.103.245,39
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	269.050.689,27	52,47%	5,00%	43,00%	90,00%	192.431.612,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	46.886.471,62	9,14%	10,00%	15,00%	60,00%	260.768.396,47
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	11.127.088,16	2,17%	1,00%	4,00%	20,00%	91.424.534,54
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	17.917.217,07	3,49%	0,00%	2,00%	5,00%	7.720.688,60
Total Renda Fixa	100,00%	344.981.466,12	67,28%	16,00%	66,00%	215,00%	



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%	81.703.189,93	15,93%	5,00%	19,00%	30,00%	72.124.244,11
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	51.275.811,35
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	50.686.300,46	9,89%	5,00%	10,00%	10,00%	589.510,89
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	10.255.162,27
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	10.255.162,27
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	132.389.490,39	25,82%	10,00%	29,00%	54,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	11.108.039,95	2,17%	0,00%	2,00%	10,00%	40.167.771,40
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	24.279.117,02	4,74%	0,00%	3,00%	10,00%	26.996.694,33
Total Exterior	10,00%	35.387.156,97	6,90%	0,00%	5,00%	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 '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	269.050.689,27	52,47	5,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	46.886.471,62	9,14	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	17.917.217,07	3,49	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	81.703.189,93	15,93	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	11.108.039,95	2,17	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	24.279.117,02	4,74	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	50.686.300,46	9,89	5,00	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 ASSET	121.956.207,99	23,78	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	71.226.778,11	13,89	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	49.768.979,50	9,71	-
ICATU VANGUARDA	26.395.453,73	5,15	-
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	25.714.969,75	5,02	-
SOMMA INVESTIMENTOS	25.261.564,41	4,93	-
TARPON INVESTIMENTOS	18.129.543,46	3,54	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	17.588.456,75	3,43	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	15.327.833,05	2,99	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	14.974.023,90	2,92	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	14.510.376,59	2,83	-
WESTERN ASSET	14.126.073,61	2,75	-
BANCO DAYCOVAL	11.127.088,16	2,17	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	10.153.043,41	1,98	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	10.069.012,29	1,96	-
OCCAM BRASIL	9.589.907,59	1,87	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	8.682.603,47	1,69	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.068.542,57	1,57	-
XP ASSET MANAGEMENT	7.790.135,73	1,52	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	7.785.787,13	1,52	-

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CLARITAS INVESTIMENTOS	6.703.330,65	1,31	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.808.655,11	1,13	-
TRUXT INVESTIMENTOS	5.154.519,00	1,01	-
SPX CAPITAL	2.223.034,68	0,43	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.193.800,92	0,43	-

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)	0,60%	0,60%	5,55%	6,14%	18,37%	28,70%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,43%	0,43%	7,56%	6,26%	21,16%	28,54%	1,66%	0,06%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,66%	0,66%	3,94%	4,34%	11,12%	23,35%	0,55%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,45%	-0,45%	4,97%	2,91%	15,53%	23,80%	-	-
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,49%	-0,49%	4,88%	2,70%	15,31%	23,02%	1,27%	0,04%
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%
IRF-M (Benchmark)	0,67%	0,67%	4,68%	6,05%	16,31%	27,74%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,67%	0,67%	4,67%	5,95%	16,05%	27,00%	0,79%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,67%	0,67%	4,66%	5,95%	16,08%	27,41%	0,79%	0,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	0,66%	4,64%	5,92%	15,88%	27,01%	0,79%	0,02%
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%

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,80%	27,43%	0,01%	0,00%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,97%	0,97%	2,79%	6,04%	12,84%	27,30%	0,02%	0,00%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,39%	1,39%	3,53%	7,71%	12,99%	27,72%	0,12%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	2,96%	6,31%	13,28%	28,05%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,00%	1,00%	2,92%	6,34%	13,22%	27,95%	0,01%	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%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,99%	0,99%	2,89%	6,23%	13,20%	28,50%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	0,55%	4,88%	3,78%	12,92%	-	0,82%	0,03%
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
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,17%	1,17%	4,87%	6,94%	14,91%	-	1,02%	0,02%

CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	1,62%	1,62%	16,79%	8,42%	26,39%	24,43%	5,19%	0,13%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,74%	0,74%	2,63%	5,53%	11,75%	27,33%	0,21%	0,00%

Ibovespa (Benchmark)	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	-7,32%	-7,32%	7,65%	-0,52%	-	-	7,74%	-
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,18%	-4,18%	12,86%	-2,20%	2,55%	5,28%	7,14%	0,18%
OCCAM FIC AÇÕES	-3,79%	-3,79%	11,66%	3,54%	8,37%	9,26%	5,54%	0,15%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,43%	-3,43%	13,39%	1,79%	11,23%	13,48%	6,30%	0,14%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,49%	-1,49%	14,31%	8,75%	40,63%	37,57%	8,15%	0,19%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-4,59%	-4,59%	12,16%	3,29%	4,13%	0,56%	5,41%	0,16%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	-4,28%	-4,28%	13,55%	5,07%	20,10%	18,53%	6,66%	0,15%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-6,16%	-6,16%	11,40%	10,28%	42,45%	65,16%	10,56%	0,19%

IBX (Benchmark)	-4,51%	-4,51%	13,20%	5,15%	11,88%	12,72%	-	-
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	-3,21%	-3,21%	13,48%	2,02%	7,42%	14,37%	7,14%	0,18%
SPX APACHE FIC AÇÕES	-5,06%	-5,06%	12,05%	1,28%	17,96%	23,57%	6,61%	0,16%

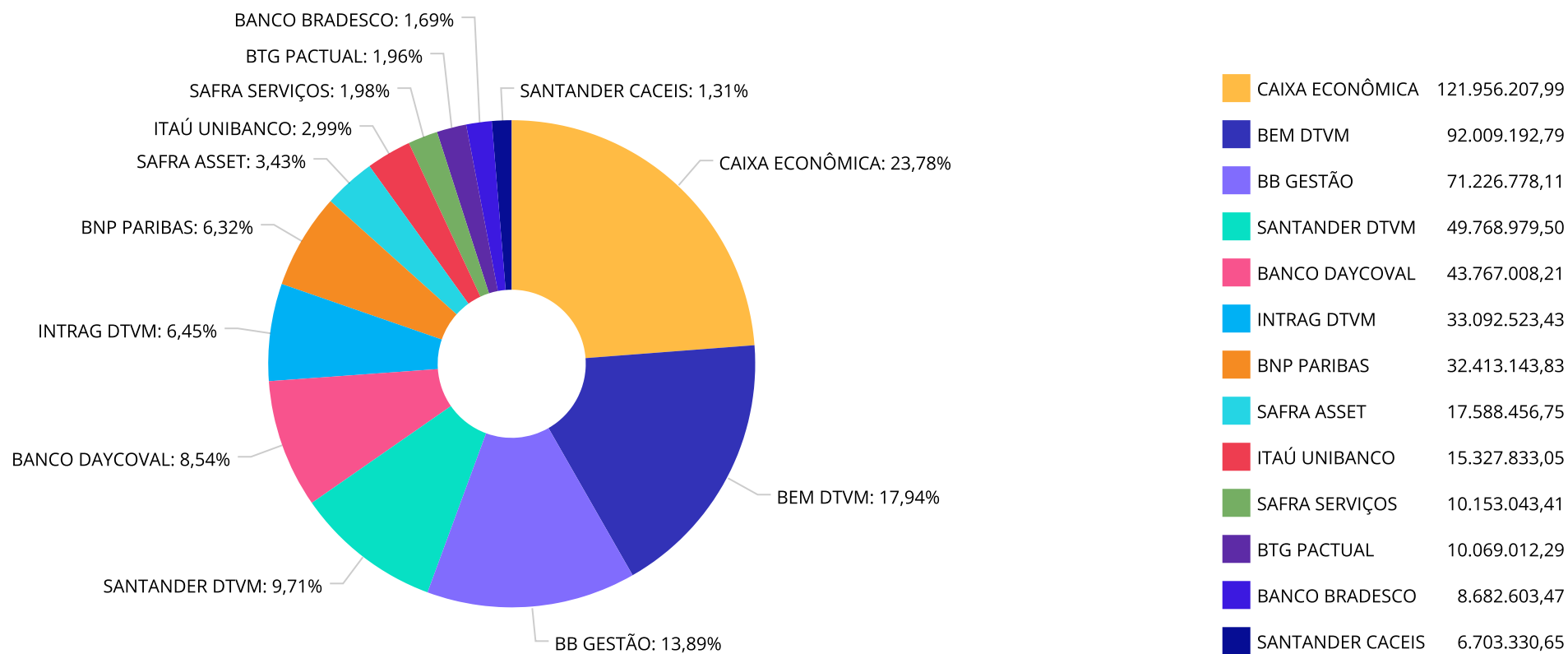
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	-0,96%	-0,96%	7,44%	4,87%	17,05%	34,50%	2,23%	0,05%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,59%	1,59%	15,54%	5,59%	18,86%	7,31%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1,72%	1,72%	17,05%	9,04%	27,92%	32,08%	5,17%	0,13%

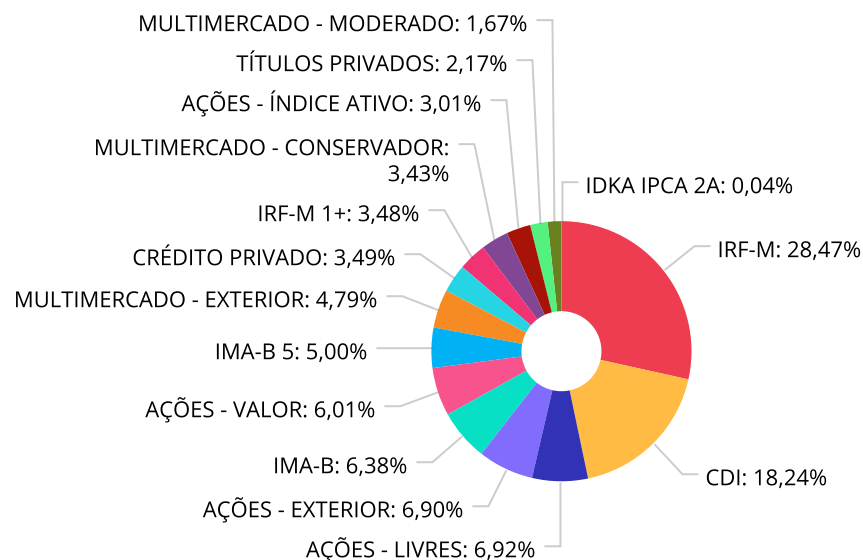
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,73%	2,73%	11,88%	10,53%	17,61%	-4,90%	6,29%	13,459%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,27%	6,27%	18,87%	16,73%	33,97%	2,43%	6,42%	15,851%
MSCI WORLD (Benchmark)	3,48%	3,48%	13,39%	9,28%	11,80%	-3,12%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	-0,75%	-0,75%	10,46%	1,79%	-0,20%	-9,53%	6,65%	14,327%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4,04%	4,04%	21,71%	13,90%	29,36%	-4,31%	9,69%	20,177%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,86%	2,86%	12,43%	7,98%	9,50%	-5,80%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	4,76%	4,76%	12,56%	10,46%	11,62%	-1,79%	5,30%	13,560%

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



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

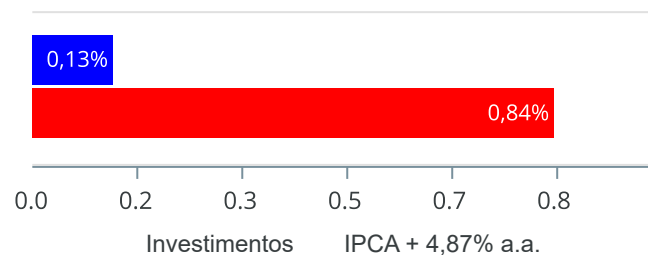


■ IRF-M	146.000.403,19	■ CDI	93.518.539,58	■ AÇÕES - LIVRES	35.486.685,19
■ AÇÕES - EXTERIOR	35.387.156,97	■ IMA-B	32.735.169,43	■ AÇÕES - VALOR	30.803.614,83
■ IMA-B 5	25.640.186,14	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	24.560.270,87	■ CRÉDITO PRIVADO	17.917.217,07
■ IRF-M 1+	17.857.880,89	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	17.588.456,75	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	15.412.889,91
■ TÍTULOS PRIVADOS	11.127.088,16	■ MULTIMERCADO - MODERADO	8.537.572,84	■ IDKA IPCA 2A	184.981,66

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

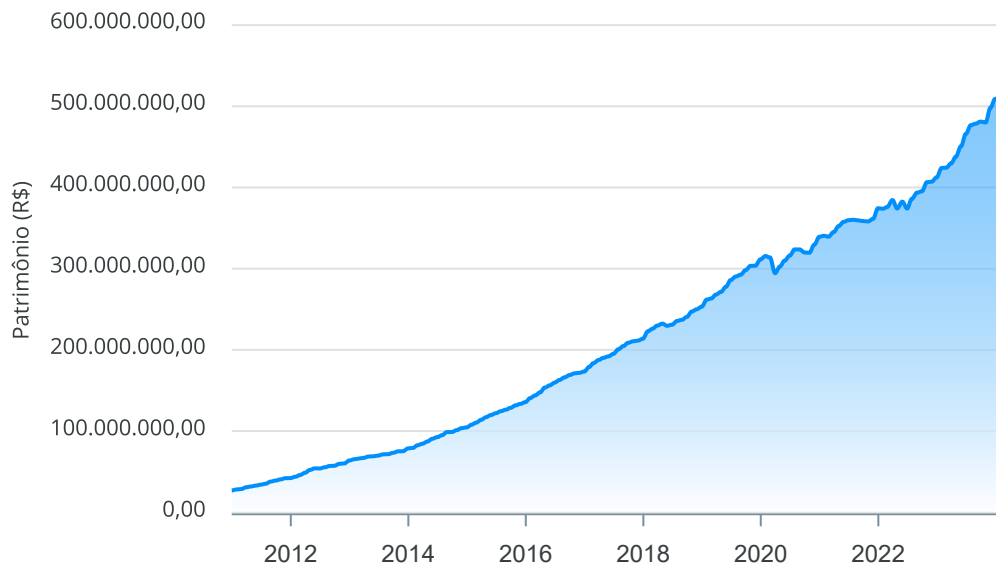
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	509.034.417,51	26.464.278,76	23.426.205,90	512.758.113,48	685.623,11	685.623,11	0,13%	0,13%	0,84%	0,84%	15,98%	2,35%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



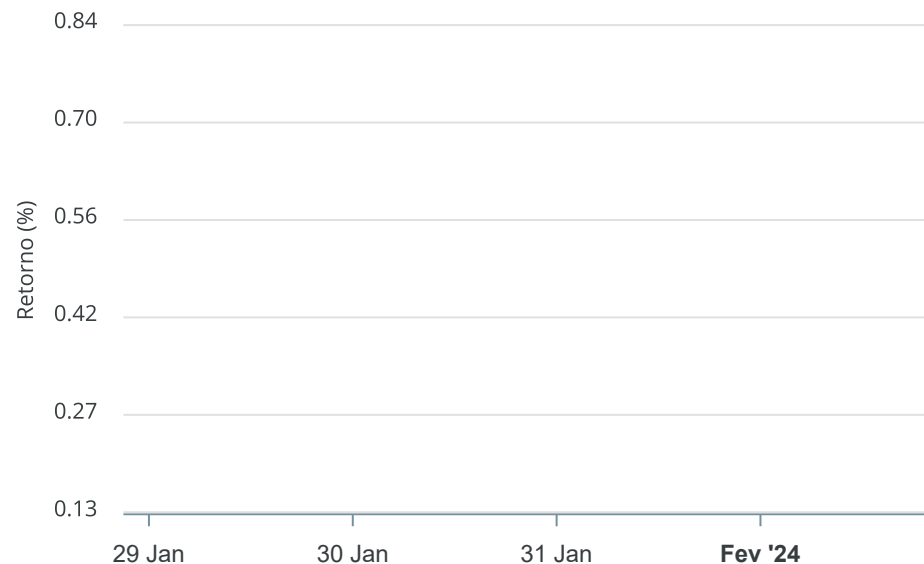
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	9.713.841,52	0,00	0,00	9.848.674,50	134.832,98	1,39%	1,39%	0,12%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	10.998.665,92	0,00	0,00	11.127.088,16	128.422,24	1,17%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.686.377,73	0,00	0,00	20.917.098,21	230.720,48	1,12%	1,12%	0,33%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.987.557,88	0,00	0,00	4.027.701,87	40.143,99	1,01%	1,01%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	25.249.687,55	0,00	0,00	25.502.968,98	253.281,43	1,00%	1,00%	0,01%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	25.469.207,68	0,00	0,00	25.714.969,75	245.762,07	0,96%	0,96%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	17.072.566,37	0,00	1.100.000,00	16.127.462,82	154.896,45	0,91%	0,97%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	55.917,97	9.151,32	0,00	65.638,30	569,01	0,87%	0,88%	0,01%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CR...	0,00	8.000.000,00	0,00	8.068.542,57	68.542,57	0,86%	0,99%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	183.642,06	0,00	0,00	184.981,66	1.339,60	0,73%	0,73%	0,53%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	52.050.011,09	0,00	0,00	52.399.612,09	349.601,00	0,67%	0,67%	0,79%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	49.439.574,62	0,00	0,00	49.768.979,50	329.404,88	0,67%	0,67%	0,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	15.227.061,92	0,00	0,00	15.327.833,05	100.771,13	0,66%	0,66%	0,55%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	43.545.198,19	0,00	0,00	43.831.811,60	286.613,41	0,66%	0,66%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	10.255.893,69	0,00	0,00	10.312.353,09	56.459,40	0,55%	0,55%	0,82%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	17.780.714,32	0,00	0,00	17.857.880,89	77.166,57	0,43%	0,43%	1,66%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	17.986.675,68	5.455.127,44	22.326.205,90	1.162.699,65	47.102,43	0,20%	0,88%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	17.844.166,29	0,00	0,00	17.761.145,53	-83.020,76	-0,47%	-0,47%	1,27%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	15.047.103,97	0,00	0,00	14.974.023,90	-73.080,07	-0,49%	-0,49%	1,27%
Total Renda Fixa	352.593.864,45	13.464.278,76	23.426.205,90	344.981.466,12	2.349.528,81	0,67%		0,64%

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
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9.898.484,64	0,00	0,00	10.069.012,29	170.527,65	1,72%	1,72%	5,17%
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	8.544.466,63	0,00	0,00	8.682.603,47	138.136,84	1,62%	1,62%	5,19%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	5.741.584,25	0,00	0,00	5.808.655,11	67.070,86	1,17%	1,17%	1,02%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	17.459.834,44	0,00	0,00	17.588.456,75	128.622,31	0,74%	0,74%	0,21%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	6.096.354,88	2.500.000,00	0,00	8.537.572,84	-58.782,04	-0,68%	-0,96%	2,23%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.729.893,96	0,00	0,00	14.510.376,59	-219.517,37	-1,49%	-1,49%	8,15%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,00	8.000.000,00	0,00	7.785.787,13	-214.212,87	-2,68%	-4,28%	6,66%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	6.925.366,54	0,00	0,00	6.703.330,65	-222.035,89	-3,21%	-3,21%	7,14%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.271.683,54	0,00	0,00	2.193.800,92	-77.882,62	-3,43%	-3,43%	6,30%
OCCAM FIC AÇÕES	9.967.981,76	0,00	0,00	9.589.907,59	-378.074,17	-3,79%	-3,79%	5,54%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.379.122,57	0,00	0,00	5.154.519,00	-224.603,57	-4,18%	-4,18%	7,14%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	16.153.497,06	0,00	0,00	15.412.889,91	-740.607,15	-4,58%	-4,58%	5,41%
SPX APACHE FIC AÇÕES	2.341.532,17	0,00	0,00	2.223.034,68	-118.497,49	-5,06%	-5,06%	6,61%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	11.349.040,37	0,00	0,00	10.650.296,97	-698.743,40	-6,16%	-6,16%	10,56%
TARPON INTERSECTION I FIC AÇÕES	8.070.338,84	0,00	0,00	7.479.246,49	-591.092,35	-7,32%	-7,32%	7,74%
Total Renda Variável	124.929.181,65	10.500.000,00	0,00	132.389.490,39	-3.039.691,26	-2,24%		5,41%

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
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.926.704,49	2.500.000,00	0,00	14.126.073,61	699.369,12	5,21%	6,27%	6,42%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.318.068,28	0,00	0,00	2.428.391,92	110.323,64	4,76%	4,76%	5,30%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	7.487.563,89	0,00	0,00	7.790.135,73	302.571,84	4,04%	4,04%	9,69%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.882.837,38	0,00	0,00	10.153.043,41	270.206,03	2,73%	2,73%	6,29%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	896.197,37	0,00	0,00	889.512,30	-6.685,07	-0,75%	-0,75%	6,65%
Total Exterior	31.511.371,41	2.500.000,00	0,00	35.387.156,97	1.375.785,56	4,05%		7,03%

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.

