

Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2024)

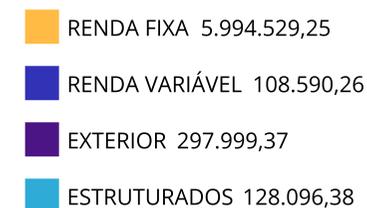
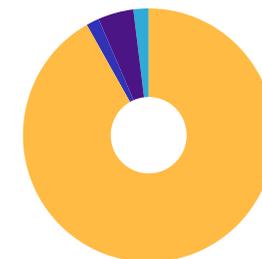
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	975.316,90	14,94%	711	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	122.346,63	1,87%	879	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	696.234,75	10,66%	652	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	206.861,57	3,17%	324	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	523.505,56	8,02%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	85.212,68	1,31%	669	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	328.608,70	5,03%	214	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	370.480,61	5,67%	799	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	362.005,30	5,54%	834	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	430.113,93	6,59%	1.183	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	276.955,58	4,24%	456	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.141.162,31	17,48%	1.144	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	34.262,34	0,52%	459	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	34.020,05	0,52%	98	0,12%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVA...	D+1 ou ...	Não há	173.249,96	2,65%	23	0,84%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	234.192,38	3,59%	14	2,12%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	108.590,26	1,66%	202	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	297.999,37	4,56%	454	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	128.096,38	1,96%	607	0,01%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			6.529.215,26				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			70,95				Artigo 6º
PL Total			6.529.286,21				

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

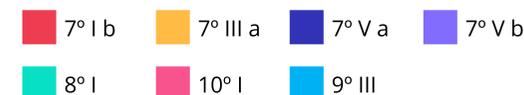
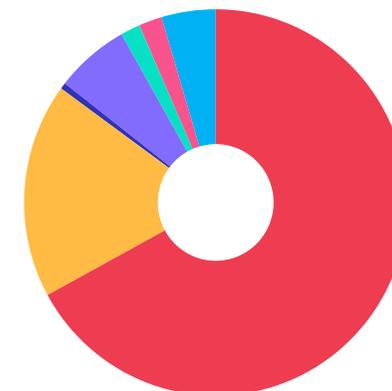
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	652.921,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.377.642,21	67,05%	20,00%	55,50%	90,00%	1.498.651,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.175.424,65	18,00%	10,00%	15,00%	60,00%	2.742.104,51
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	652.921,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	34.020,05	0,52%	0,00%	0,50%	5,00%	292.440,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	407.442,34	6,24%	0,00%	4,00%	5,00%	-80.981,58
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.305.843,05
Total Renda Fixa	100,00%	5.994.529,25	91,81%	30,00%	85,00%	200,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	108.590,26	1,66%	0,00%	5,00%	20,00%	1.197.252,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	128.096,38	1,96%	0,00%	0,00%	5,00%	198.364,38
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	326.460,76
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	236.686,64	3,63%	0,00%	5,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	297.999,37	4,56%	0,00%	5,00%	10,00%	354.922,16
Total Exterior	10,00%	297.999,37	4,56%	0,00%	5,00%	10,00%	



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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	4.377.642,21	67,05	20,00	55,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.175.424,65	18,00	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	34.020,05	0,52	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	108.590,26	1,66	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	297.999,37	4,56	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	128.096,38	1,96	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Abril / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB ASSET MANAGEMENT	3.665.427,72	56,14	-
CAIXA ASSET	2.174.753,75	33,31	-
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	234.192,38	3,59	-
GENIAL GESTÃO LTDA	173.249,96	2,65	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	128.096,38	1,96	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	119.475,02	1,83	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	34.020,05	0,52	-

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 Abril/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,29%	1,94%	1,12%	5,32%	8,39%	18,52%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,36%	1,71%	0,97%	4,92%	8,27%	17,88%	1,17%	1,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,26%	1,78%	1,06%	5,07%	8,22%	17,99%	1,04%	1,69%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,58%	3,05%	2,20%	5,03%	11,97%	26,87%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	3,07%	2,14%	5,00%	11,80%	26,43%	0,32%	0,31%
IMA-B (Benchmark)	-1,61%	-1,44%	-1,00%	3,93%	7,83%	17,30%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,63%	-1,53%	-1,05%	3,81%	7,58%	16,76%	1,64%	3,91%
IRF-M (Benchmark)	-0,52%	1,14%	0,47%	5,18%	12,20%	26,69%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,55%	1,05%	0,38%	5,06%	11,95%	26,28%	1,44%	2,30%
Selic (Benchmark)	0,89%	3,54%	2,54%	5,42%	12,33%	27,35%	-	-
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	3,45%	2,48%	5,28%	12,04%	26,72%	0,00%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,89%	3,54%	2,54%	5,42%	12,33%	27,35%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	2,70%	1,84%	4,81%	12,63%	25,48%	0,47%	0,91%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-3,11%	-4,77%	-4,09%	-5,53%	-8,41%	-55,80%	3,80%	4,20%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	3,90%	2,78%	5,91%	13,37%	28,95%	0,05%	0,10%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,57%	2,16%	1,54%	3,28%	7,69%	16,29%	0,08%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,88%	3,55%	2,56%	5,44%	12,40%	27,43%	0,01%	0,07%
IPCA (Benchmark)	0,38%	1,80%	1,38%	2,66%	3,69%	8,03%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,32%	1,47%	0,81%	4,17%	10,67%	23,58%	0,89%	1,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	3,60%	2,46%	5,38%	10,11%	19,57%	0,26%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	3,63%	2,49%	5,43%	-	-	0,26%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	0,63%	-0,48%	2,37%	-	-	0,26%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	1,55%	0,11%	0,86%	-5,16%	-13,48%	-61,40%	3,32%	8,04%

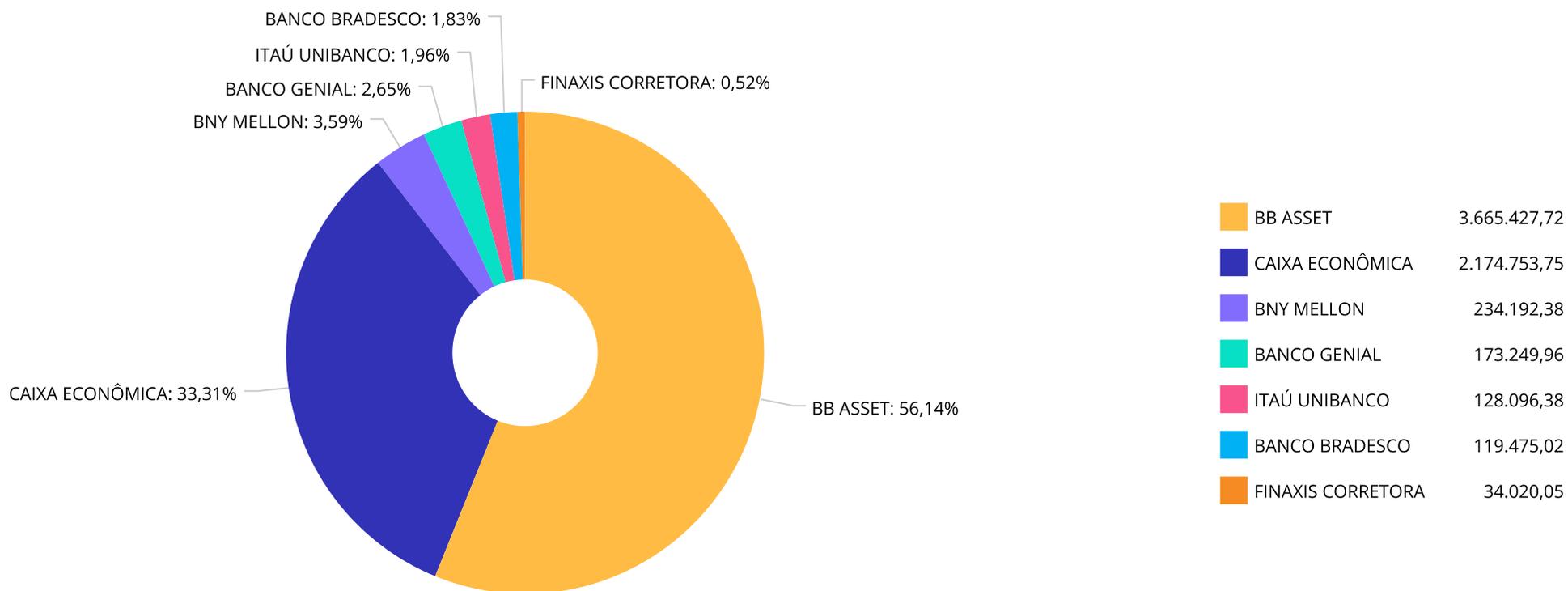
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,57%	16,54%	11,23%	27,60%	36,08%	41,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,80%	15,90%	10,85%	26,54%	34,38%	38,14%	8,29%	14,14%
Ibovespa (Benchmark)	-1,70%	-6,16%	-1,43%	11,30%	20,58%	16,73%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,35%	-4,55%	-1,87%	15,85%	25,16%	19,72%	7,93%	15,83%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-4,16%	5,57%	3,92%	20,07%	20,78%	21,87%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-3,81%	6,89%	5,13%	22,91%	28,16%	41,50%	6,09%	11,65%

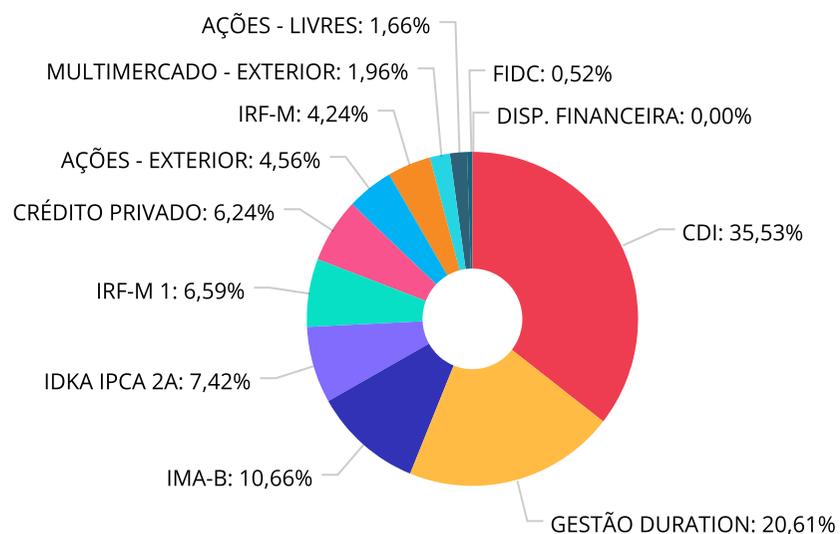
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,57%	16,54%	11,23%	27,60%	36,08%	41,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,80%	15,90%	10,85%	26,54%	34,38%	38,14%	8,29%	14,141%

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



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

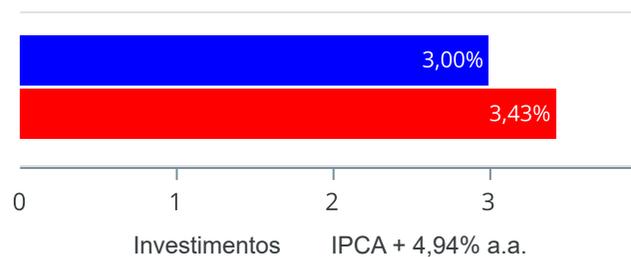


■ CDI	2.319.613,16	■ GESTÃO DURATION	1.345.797,51	■ IMA-B	696.234,75	■ IDKA IPCA 2A	484.351,93
■ IRF-M 1	430.113,93	■ CRÉDITO PRIVADO	407.442,34	■ AÇÕES - EXTERIOR	297.999,37	■ IRF-M	276.955,58
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	128.096,38	■ AÇÕES - LIVRES	108.590,26	■ FIDC	34.020,05	■ DISP. FINANCEIRA	70,95

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	6.468.771,26	3.220.681,28	1.906.123,63	7.864.978,89	81.649,98	81.649,98	1,05%	1,05%	0,84%	0,84%	124,35%	0,66%
Fevereiro	7.864.978,89	1.238.146,20	2.191.126,30	6.988.225,36	76.226,57	157.876,55	0,97%	2,03%	1,20%	2,05%	98,90%	1,01%
Março	6.988.225,36	1.534.414,83	804.515,26	7.779.052,54	60.927,61	218.804,16	0,79%	2,83%	0,54%	2,61%	108,74%	0,63%
Abril	7.779.052,54	985.225,58	2.247.689,97	6.529.215,26	12.627,11	231.431,27	0,16%	3,00%	0,80%	3,43%	87,47%	1,26%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



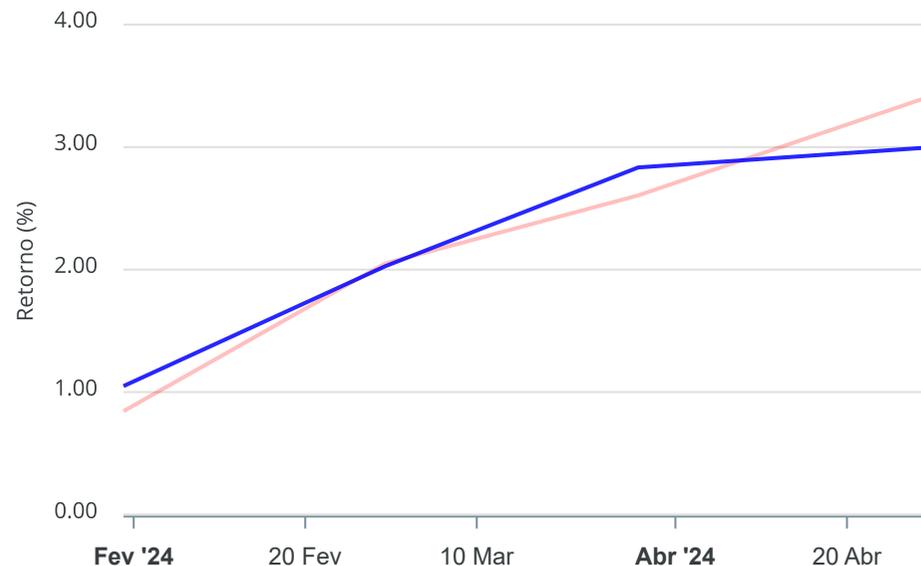
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Abril/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	33.499,92	0,00	0,00	34.020,05	520,13	1,55%	1,55%	3,32%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.225.433,21	64.513,27	159.372,67	1.141.162,31	10.588,50	0,82%	0,88%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	205.223,06	0,00	0,00	206.861,57	1.638,51	0,80%	0,80%	0,26%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	326.007,19	0,00	0,00	328.608,70	2.601,51	0,80%	0,80%	0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	519.402,77	0,00	0,00	523.505,56	4.102,79	0,79%	0,79%	0,26%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	472.075,61	9.462,36	400.000,00	85.212,68	3.674,71	0,76%	0,87%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	427.614,43	0,00	0,00	430.113,93	2.499,50	0,58%	0,58%	0,32%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	232.868,51	0,00	0,00	234.192,38	1.323,87	0,57%	0,57%	0,08%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	798.101,75	911.249,95	1.684.110,00	34.262,34	9.020,64	0,53%	0,95%	0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	972.545,83	0,00	0,00	975.316,90	2.771,07	0,28%	0,28%	0,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	122.664,66	0,00	0,00	122.346,63	-318,03	-0,26%	-0,26%	1,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	371.672,25	0,00	0,00	370.480,61	-1.191,64	-0,32%	-0,32%	0,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	363.320,82	0,00	0,00	362.005,30	-1.315,52	-0,36%	-0,36%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	278.495,94	0,00	0,00	276.955,58	-1.540,36	-0,55%	-0,55%	1,44%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	178.816,69	0,00	4.207,30	173.249,96	-1.359,43	-0,76%	-3,11%	3,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	707.789,46	0,00	0,00	696.234,75	-11.554,71	-1,63%	-1,63%	1,64%
Total Renda Fixa	7.235.532,10	985.225,58	2.247.689,97	5.994.529,25	21.461,54	0,30%		0,68%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	133.166,67	0,00	0,00	128.096,38	-5.070,29	-3,81%	-3,81%	6,09%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	114.724,55	0,00	0,00	108.590,26	-6.134,29	-5,35%	-5,35%	7,93%
Total Renda Variável	247.891,22	0,00	0,00	236.686,64	-11.204,58	-4,52%		6,94%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	295.629,22	0,00	0,00	297.999,37	2.370,15	0,80%	0,80%	8,29%
Total Exterior	295.629,22	0,00	0,00	297.999,37	2.370,15	0,80%		8,29%

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.

Relatório Analítico dos Investimentos

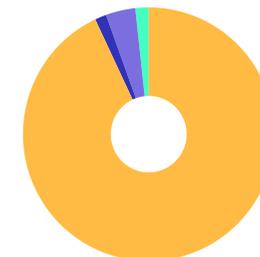
em março e 1º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			7.779.052,54				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			89.866,52				Artigo 6º
PL Total			7.868.919,06				

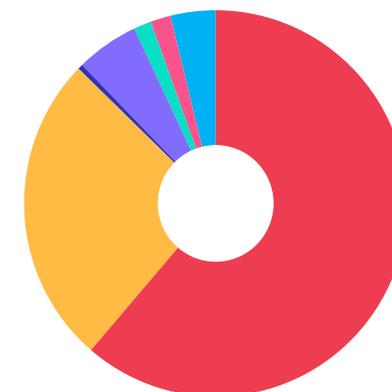
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Março / 2024)

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%	5,00%	10,00%	777.905,25
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.766.812,02	61,28%	20,00%	55,50%	90,00%	2.234.335,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	2.023.534,96	26,01%	10,00%	15,00%	60,00%	2.643.896,56
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	777.905,25
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	33.499,92	0,43%	0,00%	0,50%	5,00%	355.452,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	411.685,20	5,29%	0,00%	4,00%	5,00%	-22.732,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.555.810,51
Total Renda Fixa	100,00%	7.235.532,10	93,01%	30,00%	85,00%	200,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	114.724,55	1,47%	0,00%	5,00%	20,00%	1.441.085,96
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	133.166,67	1,71%	0,00%	0,00%	5,00%	255.785,96
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	388.952,63
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	247.891,22	3,19%	0,00%	5,00%	30,00%	
Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	295.629,22	3,80%	0,00%	5,00%	10,00%	482.276,03
Total Exterior	10,00%	295.629,22	3,80%	0,00%	5,00%	10,00%	



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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	4.766.812,02	61,28	20,00	55,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	2.023.534,96	26,01	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	33.499,92	0,43	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	114.724,55	1,47	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	295.629,22	3,80	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	133.166,67	1,71	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.753.058,99	48,25	-
CAIXA ASSET	2.177.464,40	27,99	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.270.177,36	16,33	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	232.868,51	2,99	1,41
GENIAL GESTÃO LTDA	178.816,69	2,30	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	133.166,67	1,71	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	33.499,92	0,43	0,04

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 Março/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	2,24%	2,24%	5,19%	9,48%	20,66%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	2,05%	2,05%	4,99%	9,24%	20,06%	0,47%	1,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,08%	2,08%	5,00%	9,45%	19,97%	0,52%	1,60%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	2,47%	2,47%	5,37%	12,08%	26,60%	0,08%	0,24%
IMA-B (Benchmark)	0,08%	0,18%	0,18%	4,94%	11,81%	20,21%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	0,11%	0,11%	4,82%	11,56%	19,65%	1,09%	3,88%
IRF-M (Benchmark)	0,54%	1,68%	1,68%	6,13%	14,03%	27,20%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	1,62%	1,62%	6,01%	13,79%	26,76%	0,72%	2,22%
Selic (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,81%	2,56%	2,56%	5,37%	12,06%	26,52%	0,01%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85%	2,65%	2,65%	5,55%	12,40%	27,30%	0,01%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	2,41%	2,41%	5,40%	13,73%	25,89%	0,08%	0,99%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,69%	-1,71%	-1,71%	-3,33%	-5,80%	-78,86%	0,52%	3,47%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,49%	1,58%	1,58%	3,30%	7,63%	16,10%	0,04%	0,14%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91%	2,92%	2,92%	6,02%	13,31%	28,84%	0,03%	0,09%
IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	2,81%	2,81%	5,06%	-	-	0,20%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,58%	1,80%	1,80%	4,77%	11,99%	25,10%	0,55%	1,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	2,78%	2,78%	5,01%	9,81%	20,12%	0,20%	0,94%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,50%	-1,42%	-1,42%	-7,00%	-15,14%	-62,09%	0,73%	7,76%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	-0,17%	-0,17%	2,01%	-	-	0,20%	-

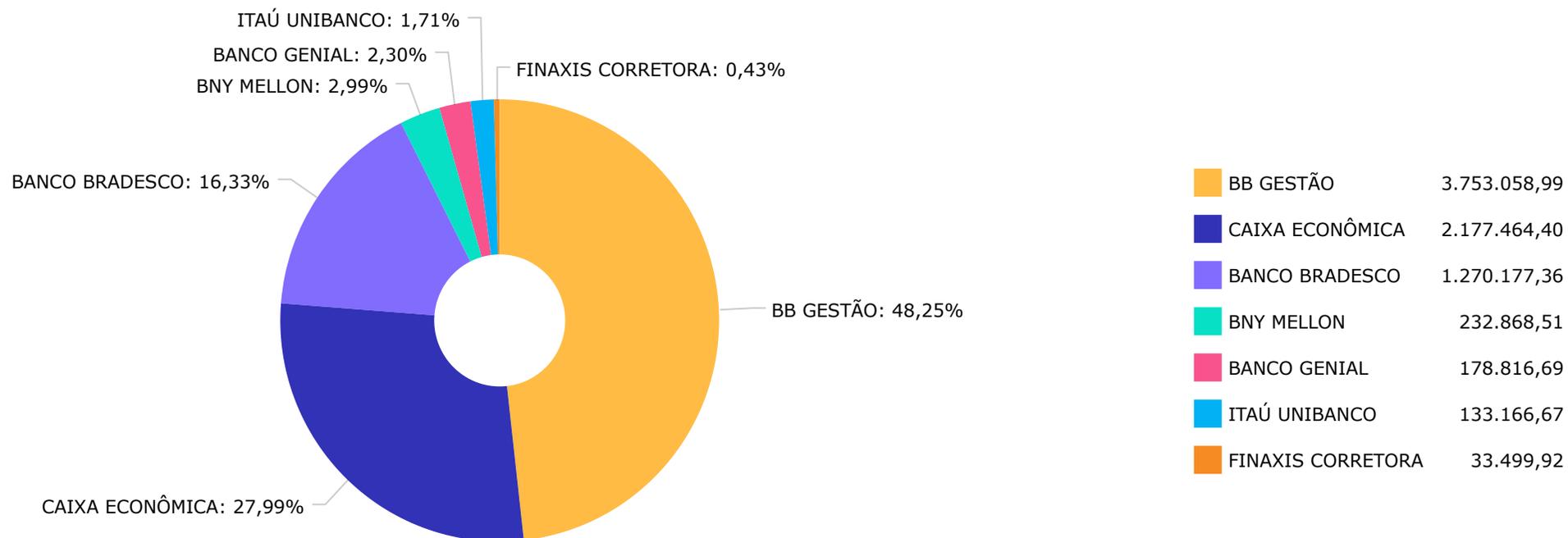
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,03%
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,36%	0,85%	0,85%	15,38%	36,06%	22,66%	5,49%	15,78%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,10%	10,16%	10,16%	22,53%	27,86%	15,98%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	3,42%	11,12%	11,12%	25,54%	35,91%	34,42%	4,59%	11,54%

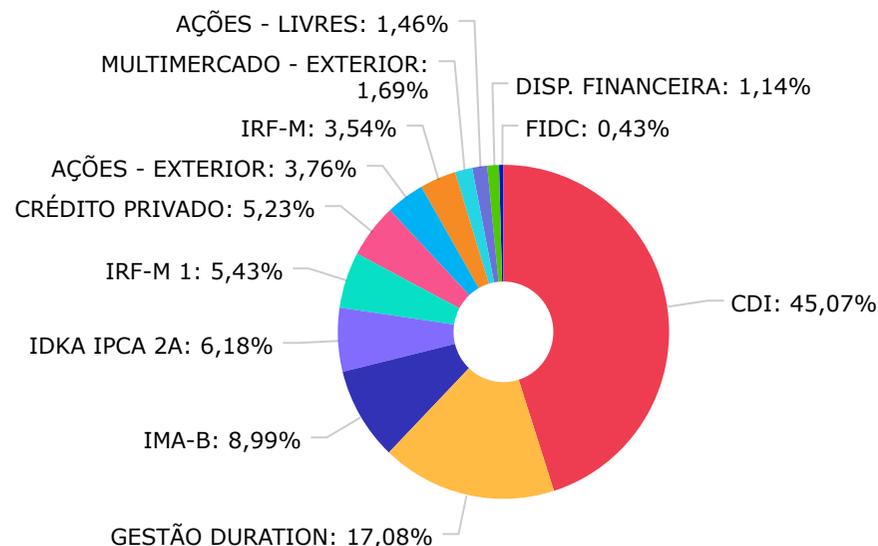
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,034%

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



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

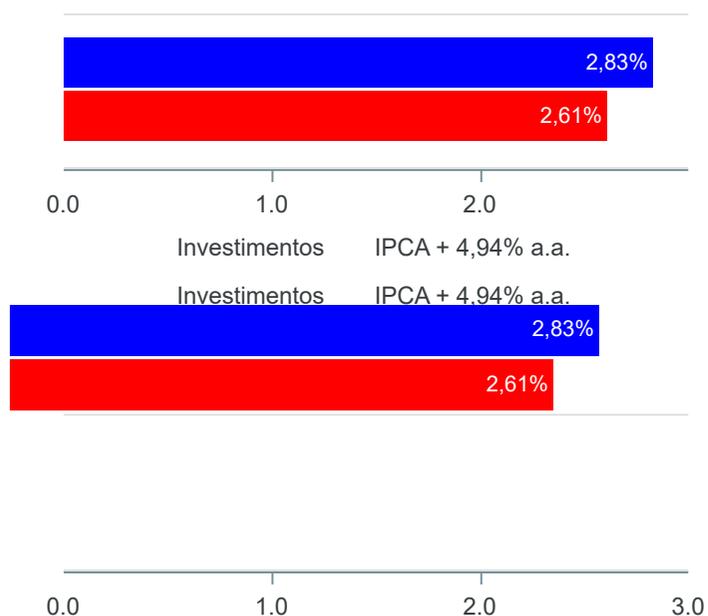


■ CDI	3.546.243,59	■ GESTÃO DURATION	1.344.218,08	■ IMA-B	707.789,46	■ IDKA IPCA 2A	485.985,48
■ IRF-M 1	427.614,43	■ CRÉDITO PRIVADO	411.685,20	■ AÇÕES - EXTERIOR	295.629,22	■ IRF-M	278.495,94
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	133.166,67	■ AÇÕES - LIVRES	114.724,55	■ DISP. FINANCEIRA	89.866,52	■ FIDC	33.499,92

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	6.468.771,26	3.220.681,28	1.906.123,63	7.864.978,89	81.649,98	81.649,98	1,05%	1,05%	0,84%	0,84%	124,35%	0,66%
Fevereiro	7.864.978,89	1.238.146,20	2.191.126,30	6.988.225,36	76.226,57	157.876,55	0,97%	2,03%	1,20%	2,05%	98,90%	1,01%
Março	6.988.225,36	1.534.414,83	804.515,26	7.779.052,54	60.927,61	218.804,16	0,79%	2,83%	0,54%	2,61%	108,74%	0,63%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

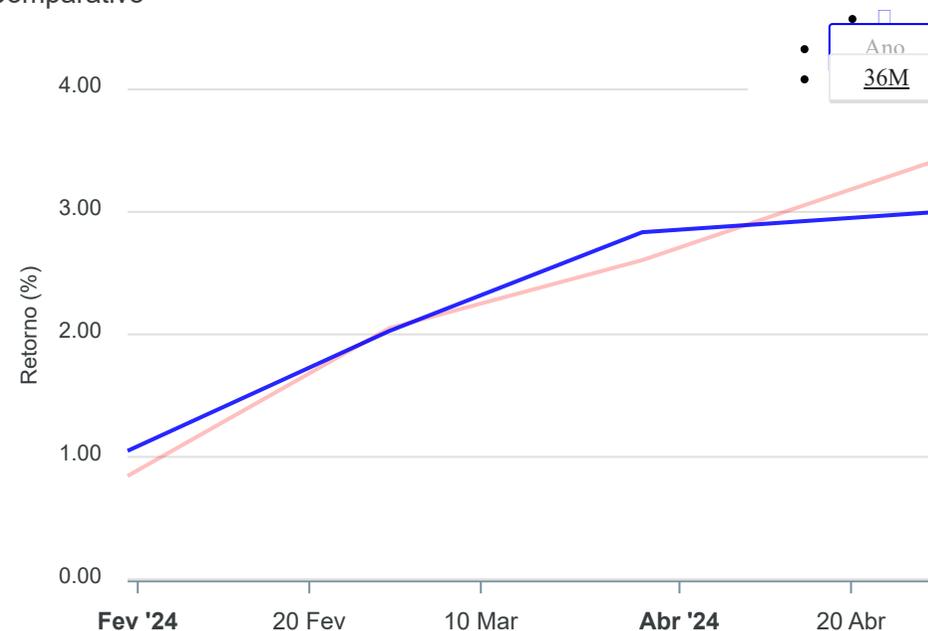


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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 Março/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...	203.341,11	0,00	0,00	205.223,06	1.881,95	0,93%	0,93%	0,20%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	323.021,05	0,00	0,00	326.007,19	2.986,14	0,92%	0,92%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	514.680,79	0,00	0,00	519.402,77	4.721,98	0,92%	0,92%	0,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	360.087,08	0,00	0,00	363.320,82	3.233,74	0,90%	0,90%	0,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	121.598,81	0,00	0,00	122.664,66	1.065,85	0,88%	0,88%	0,47%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	458.858,24	9.462,36	0,00	472.075,61	3.755,01	0,80%	0,81%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	424.235,89	0,00	0,00	427.614,43	3.378,54	0,80%	0,80%	0,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	965.146,75	0,00	0,00	972.545,83	7.399,08	0,77%	0,77%	0,08%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	395.133,45	526.382,47	128.910,00	798.101,75	5.495,83	0,60%	0,91%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	894.993,56	398.570,00	75.605,26	1.225.433,21	7.474,91	0,58%	0,85%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	369.536,97	0,00	0,00	371.672,25	2.135,28	0,58%	0,58%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	277.110,14	0,00	0,00	278.495,94	1.385,80	0,50%	0,50%	0,72%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	231.741,14	0,00	0,00	232.868,51	1.127,37	0,49%	0,49%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	707.367,78	600.000,00	600.000,00	707.789,46	421,68	0,03%	0,06%	1,09%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	33.666,61	0,00	0,00	33.499,92	-166,69	-0,50%	-0,50%	0,73%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	180.060,12	0,00	0,00	178.816,69	-1.243,43	-0,69%	-0,69%	0,52%
Total Renda Fixa	6.460.579,49	1.534.414,83	804.515,26	7.235.532,10	45.053,04	0,63%		0,27%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	128.764,01	0,00	0,00	133.166,67	4.402,66	3,42%	3,42%	4,59%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	113.188,72	0,00	0,00	114.724,55	1.535,83	1,36%	1,36%	5,49%
Total Renda Variável	241.952,73	0,00	0,00	247.891,22	5.938,49	2,45%		5,01%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	285.693,14	0,00	0,00	295.629,22	9.936,08	3,48%	3,48%	5,89%
Total Exterior	285.693,14	0,00	0,00	295.629,22	9.936,08	3,48%		5,89%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insttit
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	339.314,95	4.474.052,56	4.066.207,00	798.101,75	50.941,24	1,06%	2,92%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.006.903,42	398.570,00	204.556,48	1.225.433,21	24.516,27	1,74%	2,65%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	949.674,62	0,00	0,00	972.545,83	22.871,21	2,41%	2,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	519.774,15	0,00	14.664,01	519.402,77	14.292,63	2,75%	2,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	372.838,74	45.000,00	0,00	427.614,43	9.775,69	2,34%	2,47%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	326.554,64	0,00	9.599,32	326.007,19	9.051,87	2,77%	-0,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	355.916,83	0,00	0,00	363.320,82	7.403,99	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	365.106,55	0,00	0,00	371.672,25	6.565,70	1,80%	1,80%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	10.678,43	455.058,82	0,00	472.075,61	6.338,36	1,36%	2,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	205.422,28	0,00	5.896,92	205.223,06	5.697,70	2,77%	2,81%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	274.070,62	0,00	0,00	278.495,94	4.425,32	1,61%	1,61%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	229.238,64	0,00	0,00	232.868,51	3.629,87	1,58%	1,58%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	120.204,62	0,00	0,00	122.664,66	2.460,04	2,05%	2,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	686.451,29	620.560,93	600.000,00	707.789,46	777,24	0,06%	0,11%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	33.982,54	0,00	0,00	33.499,92	-482,62	-1,42%	-1,42%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	181.924,39	0,00	841,46	178.816,69	-2.266,24	-1,25%	-1,71%
Total Renda Fixa	5.978.056,71	5.993.242,31	4.901.765,19	7.235.532,10	165.998,27	2,35%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	119.843,00	0,00	0,00	133.166,67	13.323,67	11,12%	11,12%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	113.760,17	0,00	0,00	114.724,55	964,38	0,85%	0,85%
Total Renda Variável	233.603,17	0,00	0,00	247.891,22	14.288,05	6,12%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	257.111,38	0,00	0,00	295.629,22	38.517,84	14,98%	14,98%
Total Exterior	257.111,38	0,00	0,00	295.629,22	38.517,84	14,98%	

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.

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

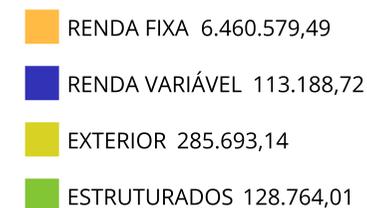
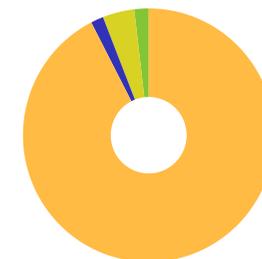
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	965.146,75	13,81%	709	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	121.598,81	1,74%	884	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	707.367,78	10,12%	650	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	203.341,11	2,91%	315	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	514.680,79	7,36%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	458.858,24	6,57%	678	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	323.021,05	4,62%	209	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	369.536,97	5,29%	798	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	360.087,08	5,15%	843	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	424.235,89	6,07%	1.191	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	277.110,14	3,97%	452	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	894.993,56	12,81%	1.139	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	395.133,45	5,65%	449	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	33.666,61	0,48%	98	0,12%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVA...	D+1 ou ...	Não há	180.060,12	2,58%	23	0,84%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	231.741,14	3,32%	14	2,12%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	113.188,72	1,62%	202	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	285.693,14	4,09%	470	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	128.764,01	1,84%	598	0,01%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			6.988.225,36				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.518,74				Artigo 6º
PL Total			6.989.744,10				

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

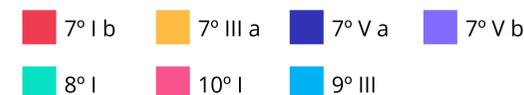
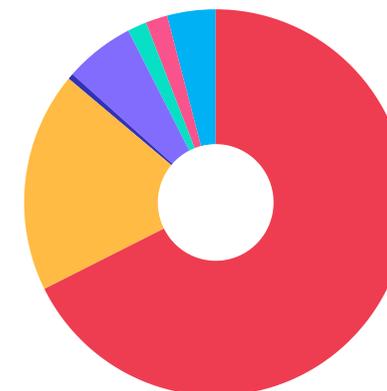
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	698.822,54
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.724.984,61	67,61%	20,00%	55,50%	90,00%	1.564.418,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.290.127,01	18,46%	10,00%	15,00%	60,00%	2.902.808,21
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	698.822,54
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	33.666,61	0,48%	0,00%	0,50%	5,00%	315.744,66
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	411.801,26	5,89%	0,00%	4,00%	5,00%	-62.389,99
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.397.645,07
Total Renda Fixa	100,00%	6.460.579,49	92,45%	30,00%	85,00%	200,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	113.188,72	1,62%	0,00%	5,00%	20,00%	1.284.456,35
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	128.764,01	1,84%	0,00%	0,00%	5,00%	220.647,26
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	349.411,27
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	241.952,73	3,46%	0,00%	5,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	285.693,14	4,09%	0,00%	5,00%	10,00%	413.129,40
Total Exterior	10,00%	285.693,14	4,09%	0,00%	5,00%	10,00%	



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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	4.724.984,61	67,61	20,00	55,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.290.127,01	18,46	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	33.666,61	0,48	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	113.188,72	1,62	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	285.693,14	4,09	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	128.764,01	1,84	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.407.128,80	48,76	-
CAIXA DTVM	2.152.872,99	30,81	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	853.991,69	12,22	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	231.741,14	3,32	1,41
GENIAL GESTÃO LTDA	180.060,12	2,58	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	128.764,01	1,84	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	33.666,61	0,48	0,04

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 Fevereiro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,42%	1,23%	2,70%	4,46%	10,12%	22,51%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	1,16%	2,59%	4,30%	9,78%	22,13%	0,48%	1,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,44%	1,17%	2,59%	4,43%	9,99%	22,02%	0,48%	1,70%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,76%	1,61%	2,53%	5,52%	12,71%	27,14%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,74%	1,66%	2,56%	5,48%	12,54%	26,69%	0,09%	0,29%
IMA-B (Benchmark)	0,55%	0,10%	2,85%	3,87%	14,70%	23,81%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	0,05%	2,79%	3,75%	14,39%	23,18%	0,79%	3,97%
IRF-M (Benchmark)	0,46%	1,13%	2,63%	5,74%	15,85%	27,58%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	1,11%	2,59%	5,64%	15,62%	27,21%	0,75%	2,33%
Selic (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,68%	12,74%	27,39%	-	-
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,79%	1,74%	2,63%	5,53%	12,43%	26,63%	0,00%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,32%	-1,03%	-1,25%	-6,07%	-5,40%	-78,84%	0,07%	3,46%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	1,99%	2,95%	6,17%	13,60%	28,88%	0,05%	0,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,63%	2,59%	5,52%	14,98%	26,64%	0,04%	1,14%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	1,78%	2,70%	5,67%	12,75%	27,44%	0,01%	0,06%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,47%	1,09%	1,63%	3,45%	7,86%	16,11%	0,07%	0,15%
IPCA (Benchmark)	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,87%	2,82%	5,24%	-	-	0,25%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,21%	2,44%	4,59%	12,70%	25,41%	0,42%	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,85%	2,79%	5,19%	10,20%	22,19%	0,25%	1,07%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,18%	-0,93%	-1,41%	-6,97%	-15,09%	-61,85%	0,63%	7,75%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,17%	-1,08%	-0,16%	2,20%	-	-	4,98%	-

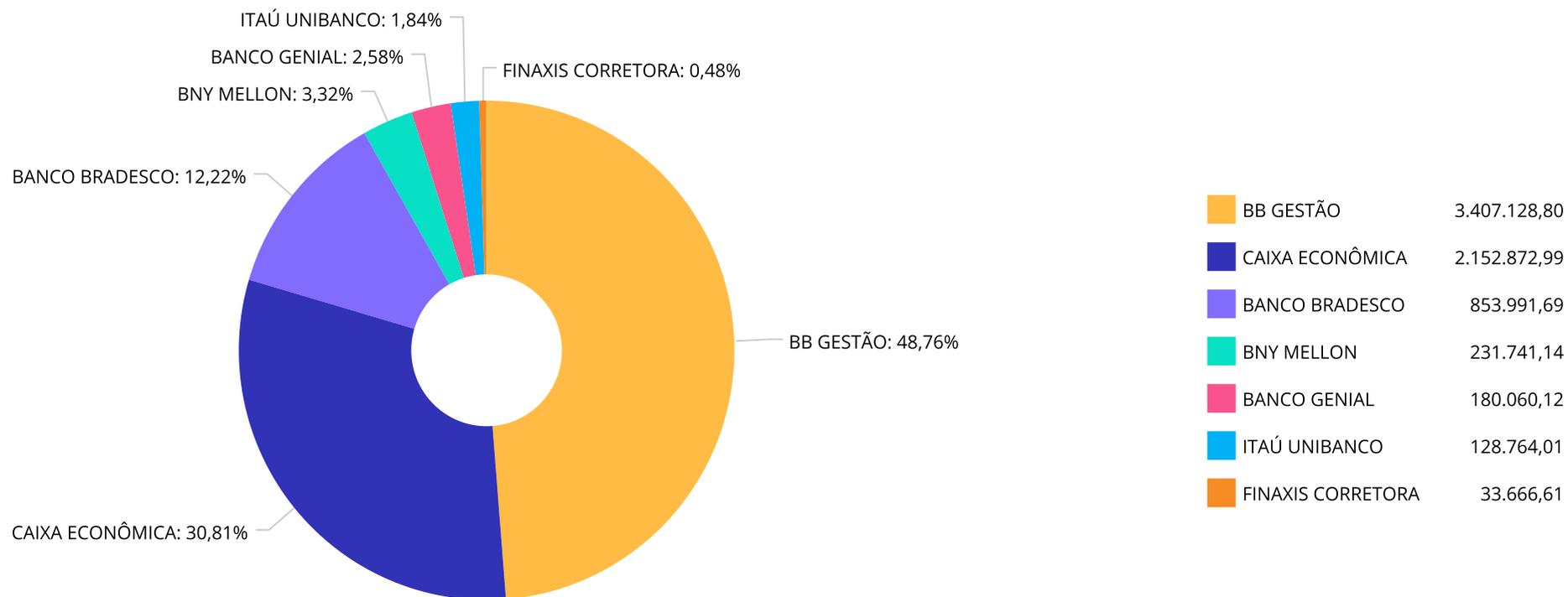
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,27%	11,12%	13,99%	15,34%	32,07%	18,33%	8,72%	14,39%
Ibovespa (Benchmark)	0,99%	-3,85%	1,33%	11,47%	22,96%	14,03%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2,29%	-0,50%	6,12%	13,69%	30,84%	29,10%	6,91%	16,20%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	5,17%	6,84%	11,57%	13,06%	28,36%	16,23%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	5,68%	7,44%	13,00%	16,00%	36,71%	35,93%	5,25%	12,33%

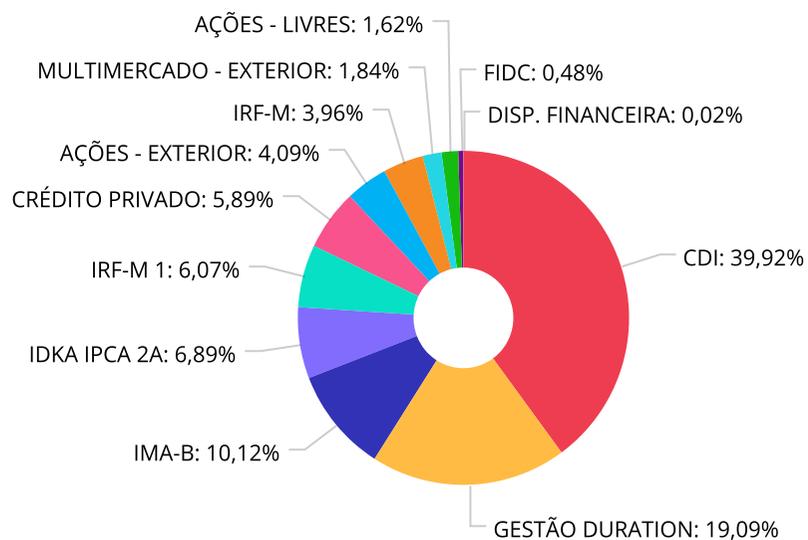
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,27%	11,12%	13,99%	15,34%	32,07%	18,33%	8,72%	14,393%

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



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

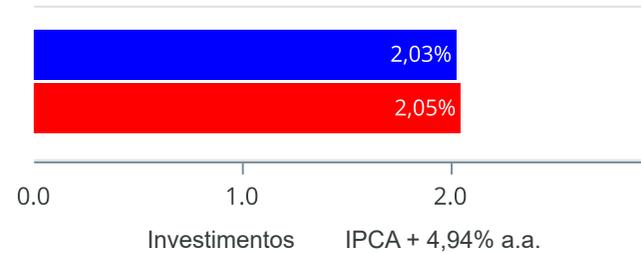


■ CDI	2.790.028,20	■ GESTÃO DURATION	1.334.683,72	■ IMA-B	707.367,78	■ IDKA IPCA 2A	481.685,89
■ IRF-M 1	424.235,89	■ CRÉDITO PRIVADO	411.801,26	■ AÇÕES - EXTERIOR	285.693,14	■ IRF-M	277.110,14
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	128.764,01	■ AÇÕES - LIVRES	113.188,72	■ FIDC	33.666,61	■ DISP. FINANCEIRA	1.518,74

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	6.468.771,26	3.220.681,28	1.906.123,63	7.864.978,89	81.649,98	81.649,98	1,05%	1,05%	0,84%	0,84%	124,35%	0,66%
Fevereiro	7.864.978,89	1.238.146,20	2.191.126,30	6.988.225,36	76.226,57	157.876,55	0,97%	2,03%	1,20%	2,05%	98,90%	1,01%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



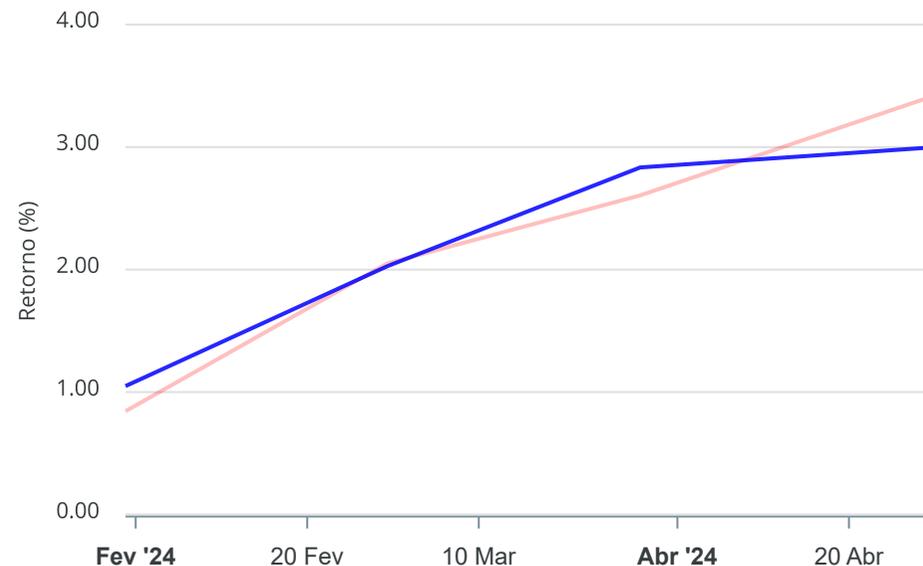
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Fevereiro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	949.967,54	0,00	62.409,05	894.993,56	7.435,07	0,78%	0,80%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	957.738,92	0,00	0,00	965.146,75	7.407,83	0,77%	0,77%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	330.196,79	0,00	9.599,32	323.021,05	2.423,58	0,73%	-2,17%	4,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	207.714,95	0,00	5.896,92	203.341,11	1.523,08	0,73%	0,74%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	525.529,20	0,00	14.664,01	514.680,79	3.815,60	0,73%	0,73%	0,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	376.238,58	45.000,00	0,00	424.235,89	2.997,31	0,71%	0,74%	0,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	367.498,27	0,00	0,00	369.536,97	2.038,70	0,55%	0,55%	0,42%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	10.779,42	445.596,46	0,00	458.858,24	2.482,36	0,54%	0,79%	0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	683.144,74	20.560,93	0,00	707.367,78	3.662,11	0,52%	0,53%	0,79%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.754.335,72	726.988,81	2.098.557,00	395.133,45	12.365,92	0,50%	0,90%	0,05%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	230.651,60	0,00	0,00	231.741,14	1.089,54	0,47%	0,47%	0,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	121.060,28	0,00	0,00	121.598,81	538,53	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	358.513,10	0,00	0,00	360.087,08	1.573,98	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	275.911,45	0,00	0,00	277.110,14	1.198,69	0,43%	0,43%	0,75%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	33.728,60	0,00	0,00	33.666,61	-61,99	-0,18%	-0,18%	0,63%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	180.632,96	0,00	0,00	180.060,12	-572,84	-0,32%	-0,32%	0,07%
Total Renda Fixa	7.363.642,12	1.238.146,20	2.191.126,30	6.460.579,49	49.917,47	0,68%		0,48%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	121.845,03	0,00	0,00	128.764,01	6.918,98	5,68%	5,68%	5,25%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	110.653,92	0,00	0,00	113.188,72	2.534,80	2,29%	2,29%	6,91%
Total Renda Variável	232.498,95	0,00	0,00	241.952,73	9.453,78	4,07%		6,03%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	268.837,82	0,00	0,00	285.693,14	16.855,32	6,27%	6,27%	8,72%
Total Exterior	268.837,82	0,00	0,00	285.693,14	16.855,32	6,27%		8,72%

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.

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

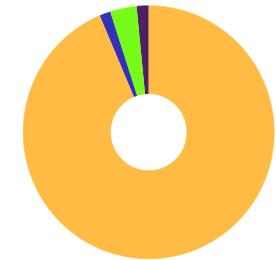
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	957.738,92	12,18%	702	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	121.060,28	1,54%	883	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	683.144,74	8,69%	650	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	207.714,95	2,64%	315	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	525.529,20	6,68%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	10.779,42	0,14%	680	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	330.196,79	4,20%	207	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	367.498,27	4,67%	791	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	358.513,10	4,56%	850	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	376.238,58	4,78%	1.190	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	275.911,45	3,51%	450	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	949.967,54	12,08%	1.134	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.754.335,72	22,31%	447	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	33.728,60	0,43%	98	0,12%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVA...	D+1 ou ...	Não há	180.632,96	2,30%	23	0,84%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	230.651,60	2,93%	14	2,12%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	110.653,92	1,41%	204	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	268.837,82	3,42%	468	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	121.845,03	1,55%	597	0,01%	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			7.864.978,89				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.107.227,56				Artigo 6º
PL Total			10.972.206,45				

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%	5,00%	10,00%	786.497,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.214.325,70	53,58%	20,00%	55,50%	90,00%	2.864.155,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	2.704.303,26	34,38%	10,00%	15,00%	60,00%	2.014.684,07
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	786.497,89
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	33.728,60	0,43%	0,00%	0,50%	5,00%	359.520,34
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	411.284,56	5,23%	0,00%	4,00%	5,00%	-18.035,62
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.572.995,78
Total Renda Fixa	100,00%	7.363.642,12	93,63%	30,00%	85,00%	200,00%	

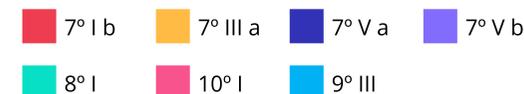
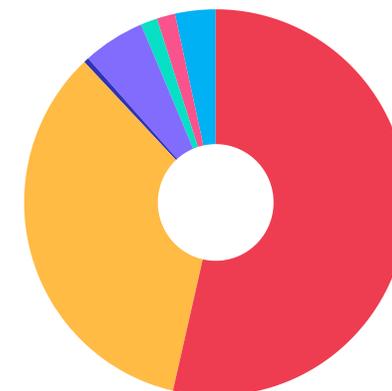


- RENDA FIXA 7.363.642,12
- RENDA VARIÁVEL 110.653,92
- EXTERIOR 268.837,82
- ESTRUTURADOS 121.845,03

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%	110.653,92	1,41%	0,00%	5,00%	20,00%	1.462.341,86
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	121.845,03	1,55%	0,00%	0,00%	5,00%	271.403,91
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	393.248,94
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	232.498,95	2,96%	0,00%	5,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	268.837,82	3,42%	0,00%	5,00%	10,00%	517.660,07
Total Exterior	10,00%	268.837,82	3,42%	0,00%	5,00%	10,00%	



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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	4.214.325,70	53,58	20,00	55,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	2.704.303,26	34,38	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	33.728,60	0,43	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	110.653,92	1,41	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	268.837,82	3,42	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	121.845,03	1,55	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.445.155,63	43,80	-
CAIXA ASSET	2.087.849,93	26,55	0,00
BRANCO ASSET MANAGEMENT	1.765.115,14	22,44	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	230.651,60	2,93	1,41
GENIAL GESTÃO LTDA	180.632,96	2,30	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	121.845,03	1,55	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	33.728,60	0,43	0,04

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%
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%
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%
IRF-M (Benchmark)	0,67%	0,67%	4,68%	6,05%	16,31%	27,74%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,67%	0,67%	4,66%	5,95%	16,08%	27,41%	0,79%	2,44%
Selic (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,80%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	0,95%	2,73%	5,89%	12,57%	26,60%	0,01%	0,05%
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%
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%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,62%	0,62%	1,72%	3,73%	8,02%	16,34%	0,05%	0,15%

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
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,71%	-0,71%	-1,50%	-5,24%	-5,41%	-80,11%	0,82%	3,47%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,04%	6,56%	13,58%	28,79%	0,07%	0,09%
IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,12%	2,87%	5,42%	-	-	0,33%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,33%	4,67%	13,16%	25,72%	0,46%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	2,84%	5,37%	10,86%	22,58%	0,33%	1,26%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,75%	-0,75%	-5,97%	-7,21%	-14,74%	-61,85%	0,31%	7,78%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	1,12%	2,87%	2,45%	-	-	0,33%	-

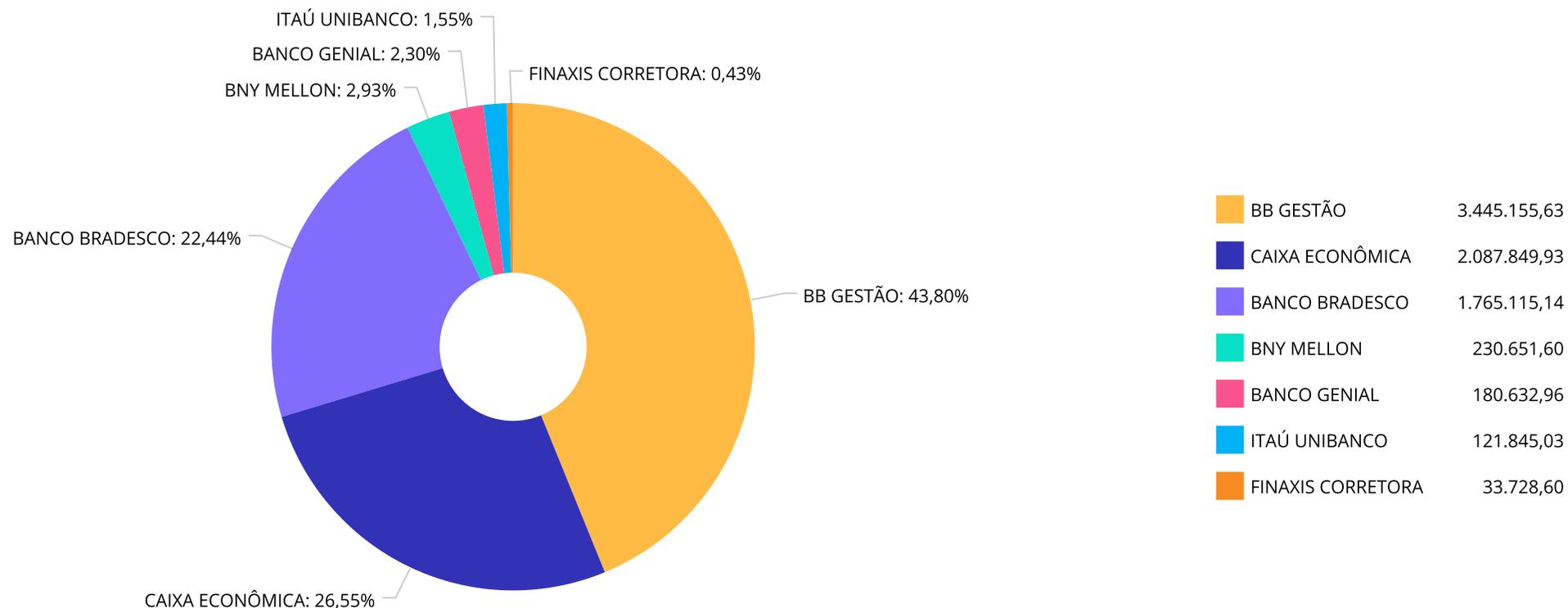
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,73%	-2,73%	18,05%	7,36%	20,43%	25,73%	7,00%	16,49%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,59%	1,59%	15,54%	5,59%	18,86%	7,31%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	1,67%	1,67%	16,91%	8,73%	27,05%	25,82%	5,15%	12,81%

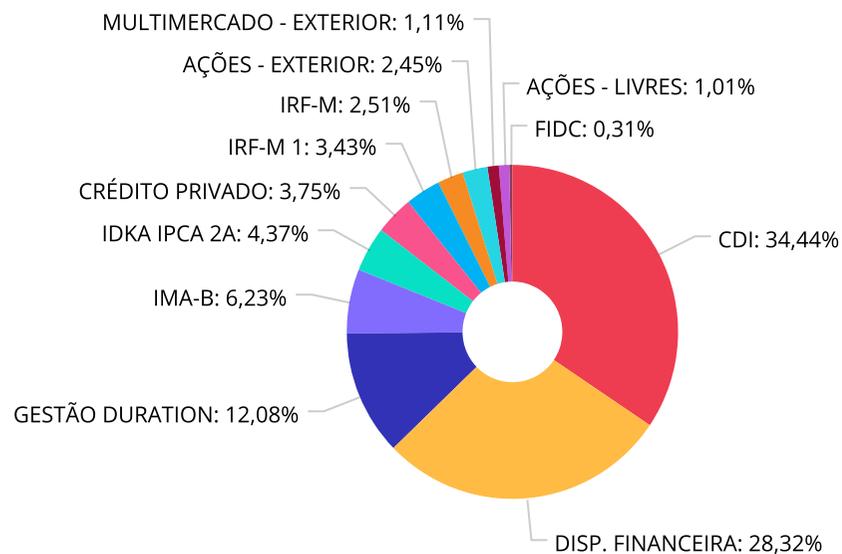
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
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)

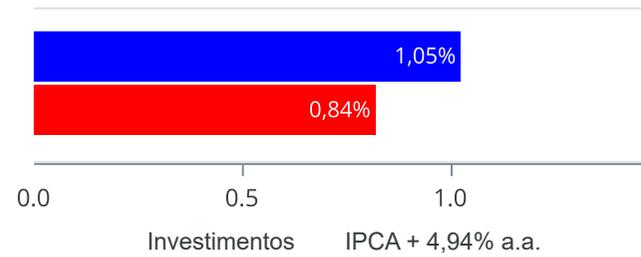


CDI	3.778.523,62	DISP. FINANCEIRA	3.107.227,56	GESTÃO DURATION	1.325.237,19	IMA-B	683.144,74
IDKA IPCA 2A	479.573,38	CRÉDITO PRIVADO	411.284,56	IRF-M 1	376.238,58	IRF-M	275.911,45
AÇÕES - EXTERIOR	268.837,82	MULTIMERCADO - EXTERIOR	121.845,03	AÇÕES - LIVRES	110.653,92	FIDC	33.728,60

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	6.468.771,26	3.220.681,28	1.906.123,63	7.864.978,89	81.649,98	81.649,98	1,05%	1,05%	0,84%	0,84%	124,35%	0,66%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



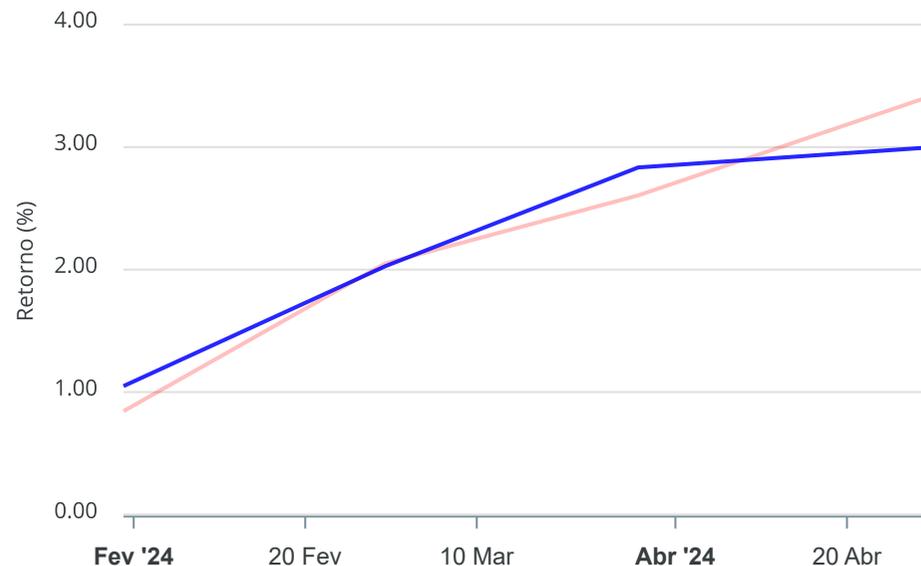
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	205.422,28	0,00	0,00	207.714,95	2.292,67	1,12%	1,12%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	326.554,64	0,00	0,00	330.196,79	3.642,15	1,12%	1,12%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	519.774,15	0,00	0,00	525.529,20	5.755,05	1,11%	1,11%	0,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.006.903,42	0,00	66.542,17	949.967,54	9.606,29	0,95%	0,97%	0,01%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	10.678,43	0,00	0,00	10.779,42	100,99	0,95%	0,95%	0,01%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	339.314,95	3.220.681,28	1.838.740,00	1.754.335,72	33.079,49	0,93%	1,09%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	372.838,74	0,00	0,00	376.238,58	3.399,84	0,91%	0,91%	0,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	949.674,62	0,00	0,00	957.738,92	8.064,30	0,85%	0,85%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	355.916,83	0,00	0,00	358.513,10	2.596,27	0,73%	0,73%	0,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	120.204,62	0,00	0,00	121.060,28	855,66	0,71%	0,71%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	274.070,62	0,00	0,00	275.911,45	1.840,83	0,67%	0,67%	0,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	365.106,55	0,00	0,00	367.498,27	2.391,72	0,66%	0,66%	0,46%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	229.238,64	0,00	0,00	230.651,60	1.412,96	0,62%	0,62%	0,05%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	181.924,39	0,00	841,46	180.632,96	-449,97	-0,25%	-0,71%	0,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	686.451,29	0,00	0,00	683.144,74	-3.306,55	-0,48%	-0,48%	1,28%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	33.982,54	0,00	0,00	33.728,60	-253,94	-0,75%	-0,75%	0,31%
Total Renda Fixa	5.978.056,71	3.220.681,28	1.906.123,63	7.363.642,12	71.027,76	0,97%		0,31%

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	119.843,00	0,00	0,00	121.845,03	2.002,03	1,67%	1,67%	5,15%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	113.760,17	0,00	0,00	110.653,92	-3.106,25	-2,73%	-2,73%	7,00%
Total Renda Variável	233.603,17	0,00	0,00	232.498,95	-1.104,22	-0,47%		6,03%

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	257.111,38	0,00	0,00	268.837,82	11.726,44	4,56%	4,56%	5,69%
Total Exterior	257.111,38	0,00	0,00	268.837,82	11.726,44	4,56%		5,69%

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.

