

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	572.621,79	0,07%	795	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	482.598,80	0,06%	96	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	154.187.656,47	18,80%	315	5,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRADESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	12.908.258,26	1,57%	13	14,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	307.283.051,11	37,47%	207	16,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	6.472.390,58	0,79%	34	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	783.770,09	0,10%	791	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.327.579,37	0,53%	850	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	341.481,49	0,04%	914	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.498.356,15	0,30%	284	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.596.737,00	0,68%	771	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	12.551.476,02	1,53%	30	5,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	384.407,77	0,05%	217	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.316.970,72	1,50%	26	2,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	9.599.656,98	1,17%	129	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.985.627,94	1,95%	68	4,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	110.249.138,83	13,44%	124	8,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.278.599,82	1,25%	108	1,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	64.264,56	0,01%	1.003	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.612.044,87	0,44%	99	0,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

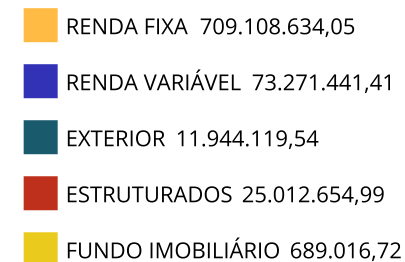
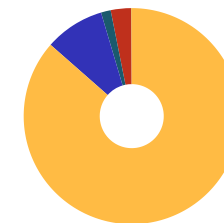
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	1.629.188,22	0,20%	1.427	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	19.931.811,18	2,43%	447	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	3.969.394,40	0,48%	363	0,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.366.374,16	0,53%	989	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.914.546,99	0,36%	226	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	152.129,49	0,02%	64	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	5.648.500,99	0,69%	771	0,08%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	11.580.728,78	1,41%	19.325	0,94%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	11.175.146,38	1,36%	17.732	0,80%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.023.784,37	0,25%	918	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.010.177,68	0,37%	204	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	149.765,30	0,02%	82	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	107.580,77	0,01%	88	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.808.396,77	0,22%	6.061	1,60%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.795.813,25	0,46%	2.261	1,51%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.341.974,99	0,53%	2.141	2,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	12.437.084,43	1,52%	15.790	1,41%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	D+4	Não há	8.582.678,62	1,05%	14.527	1,31%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.587.516,58	0,19%	3.626	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.602.066,43	0,44%	137	2,31%	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
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FI...	D+3 du	Não há	4.002.564,93	0,49%	2.836	6,63%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPAATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	5.066.162,13	0,62%	28	2,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3 du	Não há	11.944.119,54	1,46%	3.142	7,72%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	7.141.867,21	0,87%	6.694	0,43%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	12.577.192,24	1,53%	597	1,02%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	5.293.595,54	0,65%	72	0,90%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	689.016,72	0,08%		0,23%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			820.025.866,71				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			657.652,16				Artigo 6º
PL Total			820.683.518,87				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	328.010.346,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	666.820.379,19	81,32%	15,00%	73,00%	90,00%	71.202.900,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	70,00%	36.639.753,87	4,47%	2,00%	9,00%	60,00%	455.375.766,16
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	164.005.173,34
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	10,00%	5.648.500,99	0,69%	0,00%	1,00%	5,00%	35.352.792,35
Total Renda Fixa	100,00%	709.108.634,05	86,47%	17,00%	87,00%	215,00%	



ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

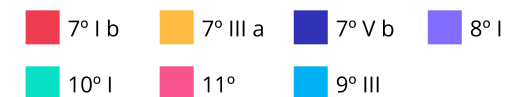
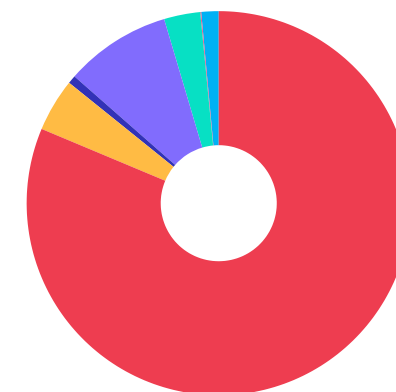


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	73.271.441,41	8,94%	0,00%	9,90%	30,00%	172.736.318,60
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	25.012.654,99	3,05%	0,00%	2,00%	10,00%	56.989.931,68
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	8.200.258,67
Artigo 11º	10,00%	689.016,72	0,08%	0,00%	0,10%	1,00%	7.511.241,95
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	98.973.113,12	12,07%	0,00%	12,00%	42,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	82.002.586,67
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	11.944.119,54	1,46%	0,00%	1,00%	10,00%	70.058.467,13
Total Exterior	10,00%	11.944.119,54	1,46%	0,00%	1,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	82.002.586,67



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	666.820.379,19	81,32	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	36.639.753,87	4,47	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5.648.500,99	0,69	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	73.271.441,41	8,94	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	11.944.119,54	1,46	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	25.012.654,99	3,05	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 11º	689.016,72	0,08	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	381.952.804,73	46,58	1,51
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	178.063.016,78	21,71	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	145.582.093,65	17,75	0,03
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	37.609.325,06	4,59	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	34.469.257,66	4,20	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	32.399.806,25	3,95	-
ITAÚ UNIBANCO	5.648.500,99	0,69	0,00
BANCO BRADESCO	3.612.044,87	0,44	0,07
ZION INVEST	689.016,72	0,08	-

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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,93%	0,93%	2,75%	5,02%	10,78%	24,20%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,07%	1,07%	2,78%	2,46%	5,08%	11,47%	0,11%	3,88%
IMA Geral (Benchmark)	0,47%	0,47%	3,98%	5,14%	14,53%	26,21%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	0,45%	3,90%	5,00%	14,31%	26,00%	0,56%	1,80%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,47%	-1,47%	5,89%	1,54%	19,03%	23,38%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,46%	-1,46%	5,87%	1,60%	18,68%	22,73%	2,01%	6,40%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,93%	4,32%	11,07%	23,25%	0,55%	1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	0,66%	3,94%	4,34%	11,18%	23,49%	0,55%	1,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,66%	0,66%	3,94%	4,32%	11,14%	23,30%	0,55%	1,87%
IMA-B (Benchmark)	-0,45%	-0,45%	4,97%	2,91%	15,53%	23,80%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,49%	-0,49%	5,00%	2,86%	15,52%	23,30%	1,31%	4,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,47%	-0,47%	4,92%	2,84%	15,36%	23,40%	1,27%	4,14%

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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,46%	-0,46%	4,79%	2,62%	15,28%	23,07%	1,28%	4,20%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	-0,57%	-0,57%	5,06%	2,69%	15,44%	23,90%	1,34%	4,33%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,48%	-0,48%	4,90%	2,78%	15,26%	23,19%	1,28%	4,16%

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%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,87%	0,87%	2,34%	5,32%	11,84%	23,65%	0,37%	1,79%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,85%	2,34%	-	-	0,33%	-
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,03%	1,03%	3,11%	6,80%	13,73%	29,54%	0,02%	0,21%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,00%	1,00%	2,92%	6,34%	13,22%	27,95%	0,01%	0,07%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	0,95%	2,75%	5,95%	12,67%	26,98%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,88%	0,88%	2,55%	5,51%	11,49%	23,72%	0,00%	0,03%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,79%	0,79%	2,29%	4,96%	10,60%	21,89%	0,01%	0,04%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,04%	6,56%	13,58%	28,79%	0,07%	0,09%
BRDESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,87%	5,42%	-	-	0,33%	-

IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,33%	4,67%	13,16%	25,72%	0,46%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,12%	2,87%	5,42%	-	-	0,33%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,48%	0,48%	4,75%	4,60%	15,81%	24,85%	0,65%	3,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,32%	0,32%	3,88%	4,74%	12,69%	23,89%	0,63%	1,79%
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, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FIC AÇÕES	-5,25%	-5,25%	14,48%	-1,61%	10,06%	-5,88%	7,29%	18,70%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-8,43%	-8,43%	12,59%	-11,83%	-5,88%	-30,20%	9,43%	23,55%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-4,73%	-4,73%	12,75%	4,76%	12,28%	13,81%	5,40%	16,07%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,73%	-2,73%	18,05%	7,36%	20,43%	25,73%	7,00%	16,49%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,15%	-4,15%	11,76%	0,85%	8,47%	4,31%	6,58%	16,00%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-6,46%	-6,46%	9,72%	2,43%	6,50%	3,69%	5,99%	16,12%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-3,82%	-3,82%	14,39%	2,73%	11,34%	2,70%	6,92%	17,80%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	-12,36%	-12,36%	0,82%	3,04%	-23,57%	-3,51%	8,15%	26,39%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-3,79%	-3,79%	14,14%	3,36%	11,54%	1,81%	6,27%	17,14%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	7,73%	7,73%	14,49%	27,21%	71,28%	127,07%	11,55%	30,07%
SANTANDER IBOVESPAATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,67%	-4,67%	13,48%	4,31%	12,27%	12,39%	5,39%	16,81%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,70%	-3,70%	12,67%	4,98%	21,24%	27,93%	6,88%	16,81%
IBX-50 (Benchmark)	-4,15%	-4,15%	13,07%	5,74%	11,32%	13,01%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-4,17%	-4,17%	12,72%	3,55%	7,84%	7,15%	5,38%	16,04%
IDIV (Benchmark)	-3,51%	-3,51%	14,18%	8,88%	15,58%	28,28%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,54%	-3,54%	13,62%	8,29%	14,09%	25,29%	4,60%	13,85%

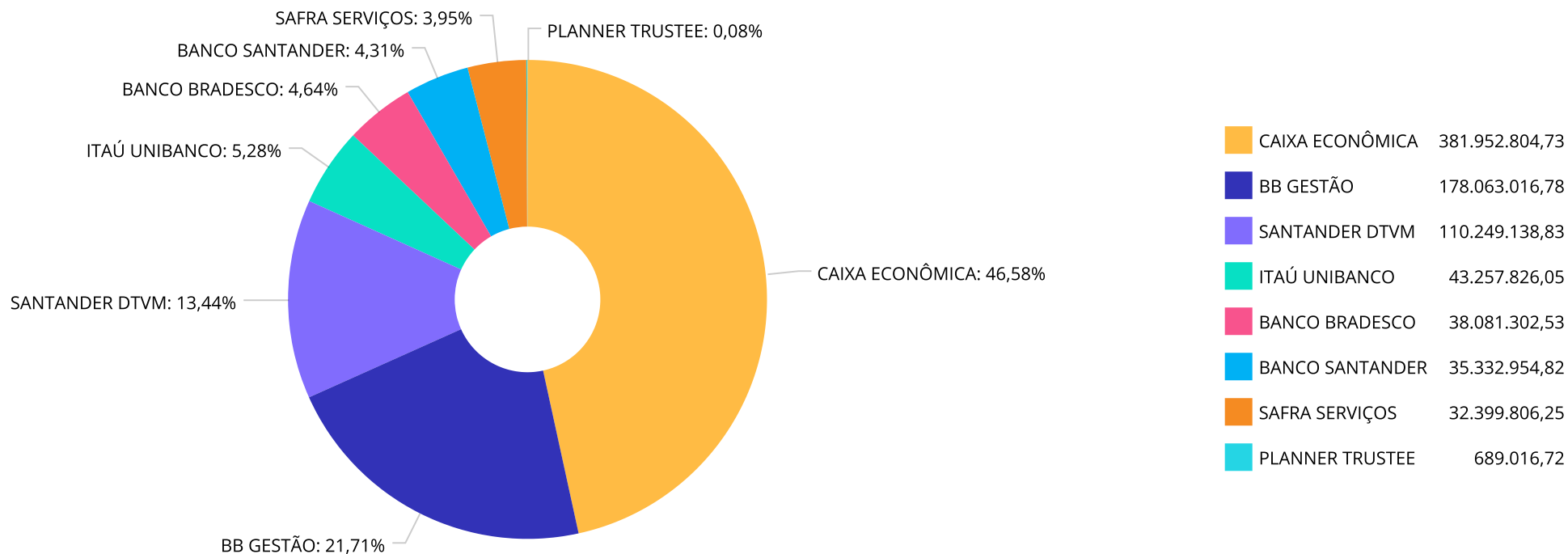
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	0,67%	0,67%	5,63%	4,26%	18,16%	20,04%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	22,63%	22,63%	23,53%	-15,58%	-33,86%	-19,23%	15,80%	38,82%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,86%	2,86%	12,43%	7,98%	9,50%	-5,80%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,69%	1,69%	16,97%	8,77%	27,17%	25,92%	5,15%	12,84%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,59%	1,59%	15,54%	5,59%	18,86%	7,31%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1,67%	1,67%	16,06%	7,88%	22,41%	18,81%	5,08%	12,38%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1,67%	1,67%	16,91%	8,73%	27,05%	25,82%	5,15%	12,81%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	1,63%	1,63%	16,83%	8,69%	26,81%	25,34%	5,13%	12,74%

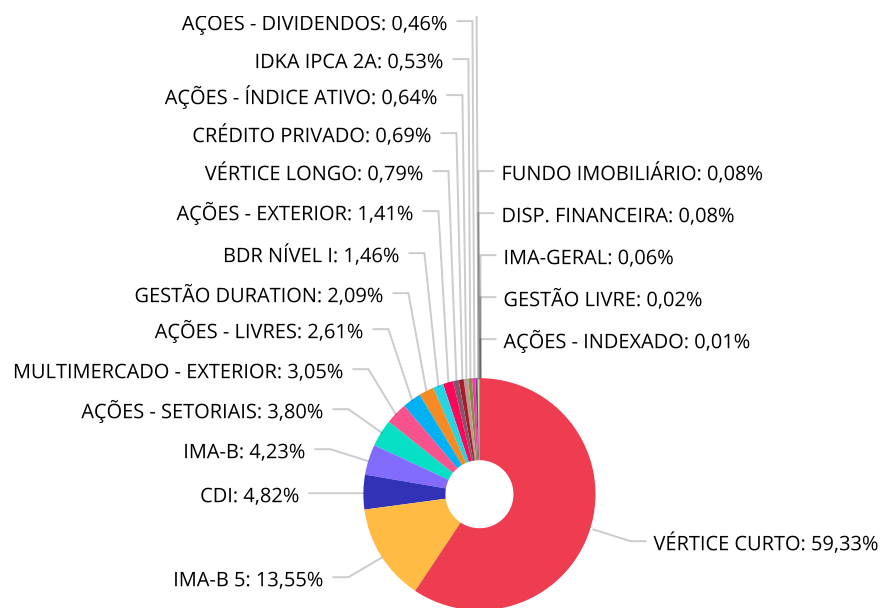
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,97%	4,97%	12,82%	13,41%	15,20%	1,85%	5,54%	12,951%

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



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

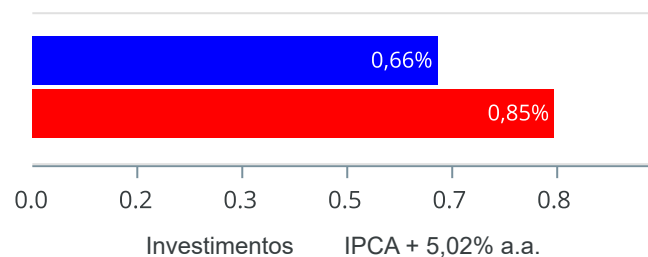


■ VÉRTICE CURTO	486.930.441,86	■ IMA-B 5	111.163.242,11	■ CDI	39.560.689,50	■ IMA-B	34.718.899,40
■ AÇÕES - SETORIAIS	31.172.699,74	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	25.012.654,99	■ AÇÕES - LIVRES	21.398.691,44	■ GESTÃO DURATION	17.153.805,80
■ BDR NÍVEL I	11.944.119,54	■ AÇÕES - EXTERIOR	11.580.728,78	■ VÉRTICE LONGO	6.472.390,58	■ CRÉDITO PRIVADO	5.648.500,99
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.215.927,43	■ IDKA IPCA 2A	4.327.579,37	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.795.813,25	■ IMA-B 5+	2.498.356,15
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	689.016,72	■ DISP. FINANCEIRA	657.652,16	■ IMA-GERAL	482.598,80	■ GESTÃO LIVRE	152.129,49
■ AÇÕES - INDEXADO	107.580,77						

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

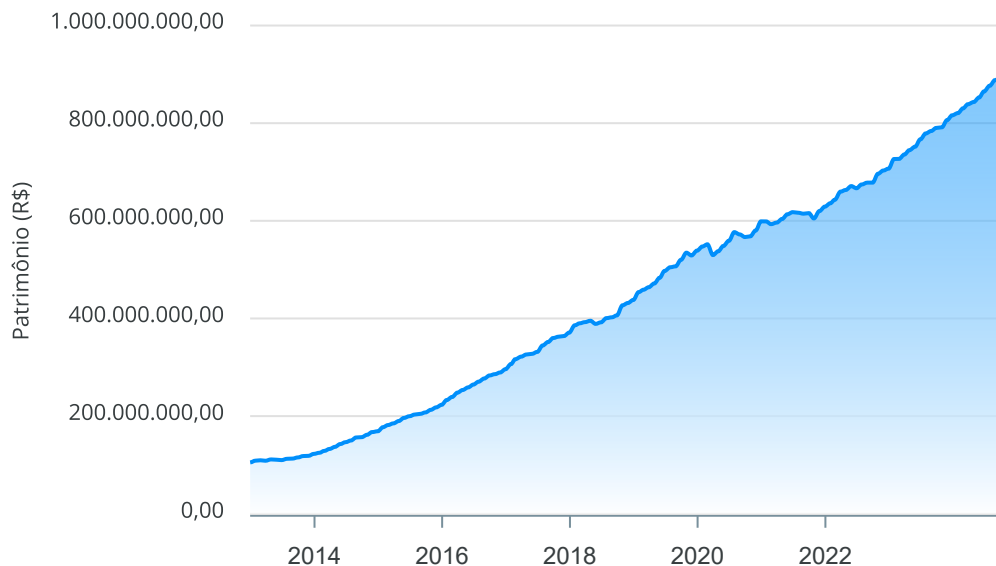
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	815.459.060,46	5.843.434,05	6.667.030,67	820.025.866,71	5.390.402,87	5.390.402,87	0,66%	0,66%	0,85%	0,85%	77,74%	1,25%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



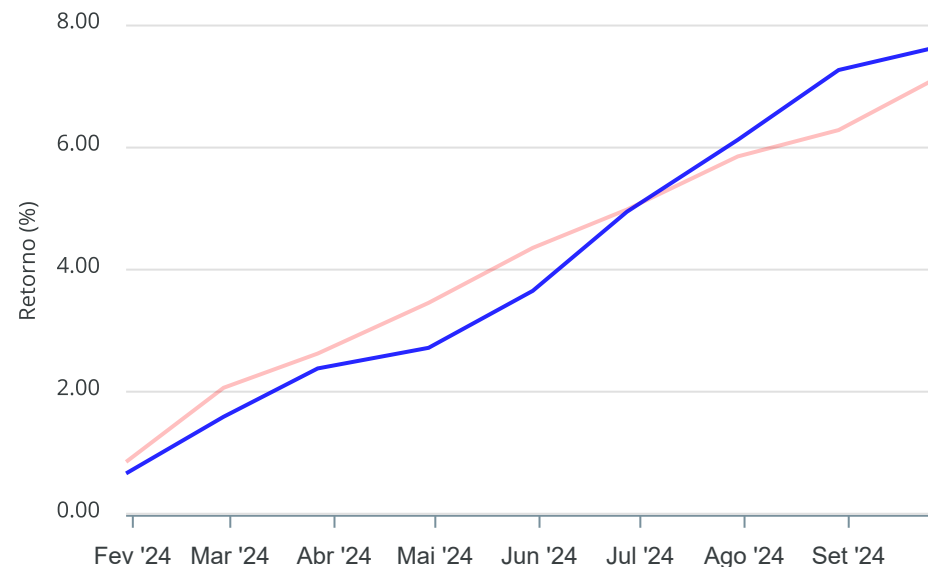
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	152.485.802,82	0,00	0,00	154.187.656,47	1.701.853,65	1,12%	1,12%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	303.893.647,29	0,00	0,00	307.283.051,11	3.389.403,82	1,12%	1,12%	0,33%
BRDESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	12.765.982,39	0,00	0,00	12.908.258,26	142.275,87	1,11%	1,11%	0,33%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	12.413.783,57	0,00	0,00	12.551.476,02	137.692,45	1,11%	1,11%	0,33%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.717.543,08	0,00	0,00	19.931.811,18	214.268,10	1,09%	1,09%	0,07%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.403.857,15	0,00	0,00	6.472.390,58	68.533,43	1,07%	1,07%	0,11%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.590.827,98	0,00	0,00	5.648.500,99	57.673,01	1,03%	1,03%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.323.009,71	0,00	0,00	4.366.374,16	43.364,45	1,00%	1,00%	0,01%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	9.509.239,34	0,00	0,00	9.599.656,98	90.417,64	0,95%	0,95%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	63.703,92	0,00	0,00	64.264,56	560,64	0,88%	0,88%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	150.818,11	0,00	0,00	152.129,49	1.311,38	0,87%	0,87%	0,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.296.239,96	0,00	0,00	4.327.579,37	31.339,41	0,73%	0,73%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	339.229,40	0,00	0,00	341.481,49	2.252,09	0,66%	0,66%	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	568.866,05	0,00	0,00	572.621,79	3.755,74	0,66%	0,66%	0,55%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	109.531.078,59	0,00	0,00	110.249.138,83	718.060,24	0,66%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	778.669,24	0,00	0,00	783.770,09	5.100,85	0,66%	0,66%	0,46%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	3.128.463,34	3.843.434,05	3.045.782,40	3.969.394,40	43.279,41	0,62%	0,88%	0,00%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.224.654,71	2.000.000,00	3.621.248,27	1.629.188,22	25.781,78	0,49%	0,79%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	382.588,48	0,00	0,00	384.407,77	1.819,29	0,48%	0,48%	0,65%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	480.457,23	0,00	0,00	482.598,80	2.141,57	0,45%	0,45%	0,56%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	15.934.572,83	0,00	0,00	15.985.627,94	51.055,11	0,32%	0,32%	0,63%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.628.582,15	0,00	0,00	3.612.044,87	-16.537,28	-0,46%	-0,46%	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.622.897,78	0,00	0,00	5.596.737,00	-26.160,78	-0,47%	-0,47%	1,27%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	10.327.764,31	0,00	0,00	10.278.599,82	-49.164,49	-0,48%	-0,48%	1,28%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.928.888,92	0,00	0,00	2.914.546,99	-14.341,93	-0,49%	-0,49%	1,31%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	12.387.819,57	0,00	0,00	12.316.970,72	-70.848,85	-0,57%	-0,57%	1,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.535.303,53	0,00	0,00	2.498.356,15	-36.947,38	-1,46%	-1,46%	2,01%
Total Renda Fixa	703.414.291,45	5.843.434,05	6.667.030,67	709.108.634,05	6.517.939,22	0,93%		0,41%

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	561.876,73	0,00	0,00	689.016,72	127.139,99	22,63%	22,63%	15,80%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	11.544.259,10	0,00	0,00	12.437.084,43	892.825,33	7,73%	7,73%	11,55%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7.023.499,09	0,00	0,00	7.141.867,21	118.368,12	1,69%	1,69%	5,15%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	11.390.205,06	0,00	0,00	11.580.728,78	190.523,72	1,67%	1,67%	5,08%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	12.370.536,50	0,00	0,00	12.577.192,24	206.655,74	1,67%	1,67%	5,15%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5.208.800,30	0,00	0,00	5.293.595,54	84.795,24	1,63%	1,63%	5,13%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.094.678,79	0,00	0,00	3.010.177,68	-84.501,11	-2,73%	-2,73%	7,00%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.935.009,53	0,00	0,00	3.795.813,25	-139.196,28	-3,54%	-3,54%	4,60%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4.508.772,99	0,00	0,00	4.341.974,99	-166.798,00	-3,70%	-3,70%	6,88%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	3.744.079,67	0,00	0,00	3.602.066,43	-142.013,24	-3,79%	-3,79%	6,27%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.650.551,15	0,00	0,00	1.587.516,58	-63.034,57	-3,82%	-3,82%	6,92%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.111.366,47	0,00	0,00	2.023.784,37	-87.582,10	-4,15%	-4,15%	6,58%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	156.276,40	0,00	0,00	149.765,30	-6.511,10	-4,17%	-4,17%	5,38%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.314.113,71	0,00	0,00	5.066.162,13	-247.951,58	-4,67%	-4,67%	5,39%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	112.923,54	0,00	0,00	107.580,77	-5.342,77	-4,73%	-4,73%	5,40%
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FIC ...	4.224.145,71	0,00	0,00	4.002.564,93	-221.580,78	-5,25%	-5,25%	7,29%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	11.947.095,27	0,00	0,00	11.175.146,38	-771.948,89	-6,46%	-6,46%	5,99%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1.974.905,82	0,00	0,00	1.808.396,77	-166.509,05	-8,43%	-8,43%	9,43%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	9.792.552,08	0,00	0,00	8.582.678,62	-1.209.873,46	-12,36%	-12,36%	8,15%
Total Renda Variável	100.665.647,91	0,00	0,00	98.973.113,12	-1.692.534,79	-1,68%		6,76%

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	11.379.121,10	0,00	0,00	11.944.119,54	564.998,44	4,97%	4,97%	5,54%
Total Exterior	11.379.121,10	0,00	0,00	11.944.119,54	564.998,44	4,97%		5,54%

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.

