

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

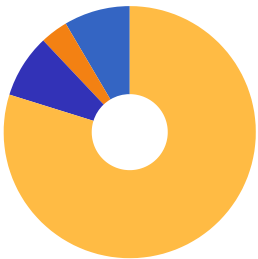
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.125.403,85	6,01%	702	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.409.735,60	6,56%	883	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.946.213,90	5,67%	795	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	231.723,22	0,45%	291	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.697.854,62	5,19%	1.144	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	360.931,38	0,69%	92	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	855.091,50	1,64%	199	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	527.376,81	1,01%	121	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	537.718,49	1,03%	305	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.232.830,87	8,14%	791	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.404.673,01	6,55%	850	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.898.802,05	7,50%	771	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.085.550,16	2,09%	728	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	573.772,41	1,10%	38	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	990.384,98	1,90%	76	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	157.940,25	0,30%	217	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI IPCA+ FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	174.777,80	0,34%	9.266	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.762.762,37	5,31%	1.696	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	573.916,81	1,10%	1.177	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	3.243.401,25	6,24%	1.134	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.819.007,54	3,50%	989	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.278.020,69	6,30%	439	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	610.830,19	1,17%	222	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	566.613,08	1,09%	543	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	1.089.658,79	2,10%	19.325	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	800.457,08	1,54%	1.151	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	487.419,52	0,94%	88	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	849.438,61	1,63%	2.141	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	D+3	Não há	442.569,34	0,85%	6.073	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	355.002,49	0,68%	9.842	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.495.044,85	2,88%	468	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.356.502,63	4,53%	174.744	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.621.858,11	3,12%	6.694	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	432.006,17	0,83%	2.597	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			51.995.290,42				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	15,35%	100,00%	51.995.290,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	31.973.543,27	61,49%	0,00%	16,34%	100,00%	20.021.747,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	9.525.176,48	18,32%	0,00%	15,34%	60,00%	21.671.997,77
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,34%	20,00%	10.399.058,08
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,24%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,24%	5,00%	2.599.764,52
Total Renda Fixa	100,00%	41.498.719,75	79,81%	0,00%	62,85%	285,00%	

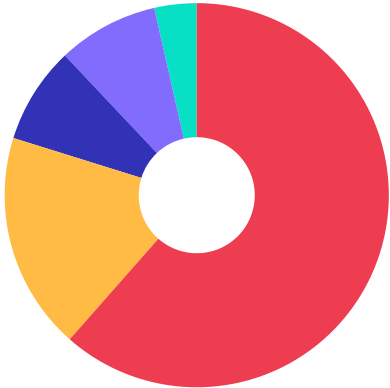


- RENDA FIXA 41.498.719,75
- RENDA VARIÁVEL 4.236.156,42
- EXTERIOR 1.850.047,34
- ESTRUTURADOS 4.410.366,91

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	4.236.156,42	8,15%	0,00%	15,00%	30,00%	11.362.430,71
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.410.366,91	8,48%	0,00%	10,00%	10,00%	789.162,13
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.599.764,52
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.599.764,52
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	8.646.523,33	16,63%	0,00%	30,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.850.047,34	3,56%	0,00%	7,15%	10,00%	3.349.481,70
Total Exterior	10,00%	1.850.047,34	3,56%	0,00%	7,15%	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	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	31.973.543,27	61,49	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	9.525.176,48	18,32	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	4.236.156,42	8,15	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	1.850.047,34	3,56	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	4.410.366,91	8,48	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	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
CAIXA DTVM	23.142.370,07	44,51	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	22.565.966,20	43,40	-
SICREDI	2.937.540,17	5,65	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.332.927,83	4,49	0,00
BANRISUL CORRETORA	573.916,81	1,10	0,00
ITAÚ UNIBANCO	442.569,34	0,85	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,81%	0,81%	4,15%	4,81%	11,43%	23,53%	-	-
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%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	0,70%	0,70%	3,95%	4,64%	11,08%	22,73%	0,57%	1,93%
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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,60%	0,60%	5,55%	6,14%	18,37%	28,70%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	0,57%	5,50%	5,94%	17,94%	27,86%	1,08%	3,57%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,47%	-1,47%	5,89%	1,54%	19,03%	23,38%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,51%	-1,51%	5,82%	1,40%	18,57%	22,51%	2,05%	6,48%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,77%	5,92%	12,95%	27,12%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	0,87%	2,74%	5,80%	12,67%	26,44%	0,12%	0,33%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,84%	2,65%	4,87%	9,72%	0,33%	3,99%
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%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,56%	-0,56%	4,91%	2,15%	15,08%	22,01%	1,59%	4,50%

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
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%
SICREDI IPCA+ FIC RENDA FIXA LP	-0,52%	-0,52%	5,00%	2,71%	15,32%	23,18%	1,31%	4,28%

Selic (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,80%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,93%	0,93%	2,68%	5,81%	12,40%	26,40%	0,01%	0,06%

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%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,97%	0,97%	2,79%	6,02%	12,84%	27,21%	0,01%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	0,90%	3,29%	5,13%	12,54%	26,56%	0,21%	0,83%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,00%	1,00%	2,92%	6,34%	13,22%	27,95%	0,01%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,95%	2,78%	5,94%	12,79%	27,22%	0,02%	0,08%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	2,96%	6,31%	13,28%	28,05%	0,02%	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%

IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,48%	0,48%	4,75%	4,60%	15,81%	24,85%	0,65%	3,04%
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 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	0,55%	4,88%	3,78%	12,92%	-	0,82%	3,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	-0,35%	4,72%	2,28%	14,81%	-	1,36%	4,46%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,93%	0,93%	2,81%	5,52%	12,33%	27,52%	0,09%	0,31%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,89%	0,89%	3,25%	5,86%	12,71%	25,87%	0,05%	0,56%
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 INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-4,73%	-4,73%	12,75%	4,76%	12,28%	13,81%	5,40%	16,07%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-4,66%	-4,66%	11,47%	4,00%	11,17%	11,55%	5,48%	15,62%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-4,56%	-4,56%	12,95%	4,14%	10,74%	10,15%	5,69%	16,46%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	-5,76%	-5,76%	11,16%	-3,67%	1,32%	-4,42%	6,86%	17,97%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,70%	-3,70%	12,67%	4,98%	21,24%	27,93%	6,88%	16,81%
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%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,67%	3,67%	13,51%	10,12%	14,54%	-3,02%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,25%	4,25%	13,79%	11,10%	19,31%	0,78%	5,46%	13,43%

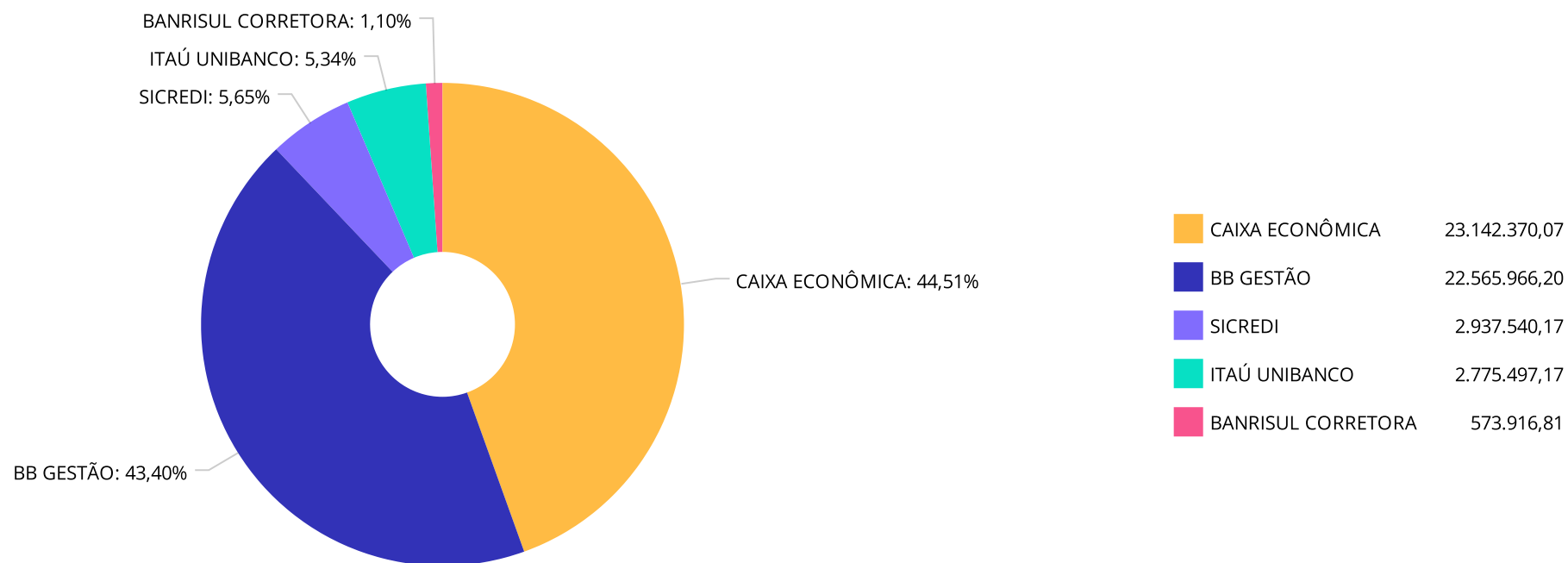
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%

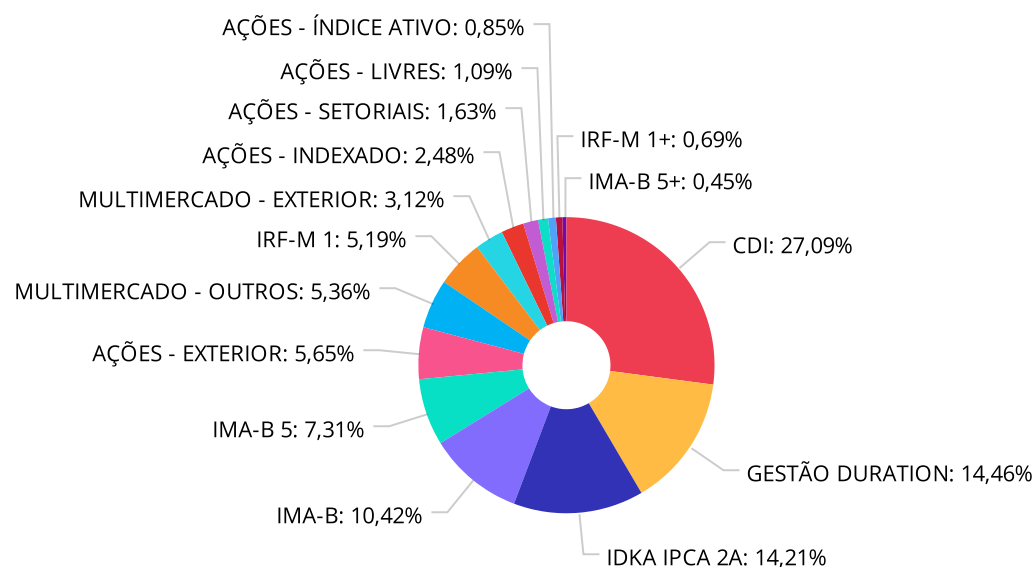
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

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

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



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

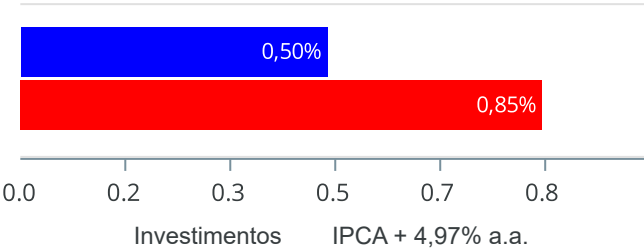


CDI	14.085.985,30	GESTÃO DURATION	7.516.174,97	IDKA IPCA 2A	7.388.181,02	IMA-B	5.416.563,84
IMA-B 5	3.801.305,40	AÇÕES - EXTERIOR	2.939.706,13	MULTIMERCADO - OUTROS	2.788.508,80	IRF-M 1	2.697.854,62
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.621.858,11	AÇÕES - INDEXADO	1.287.876,60	AÇÕES - SETORIAIS	849.438,61	AÇÕES - LIVRES	566.613,08
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	442.569,34	IRF-M 1+	360.931,38	IMA-B 5+	231.723,22		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

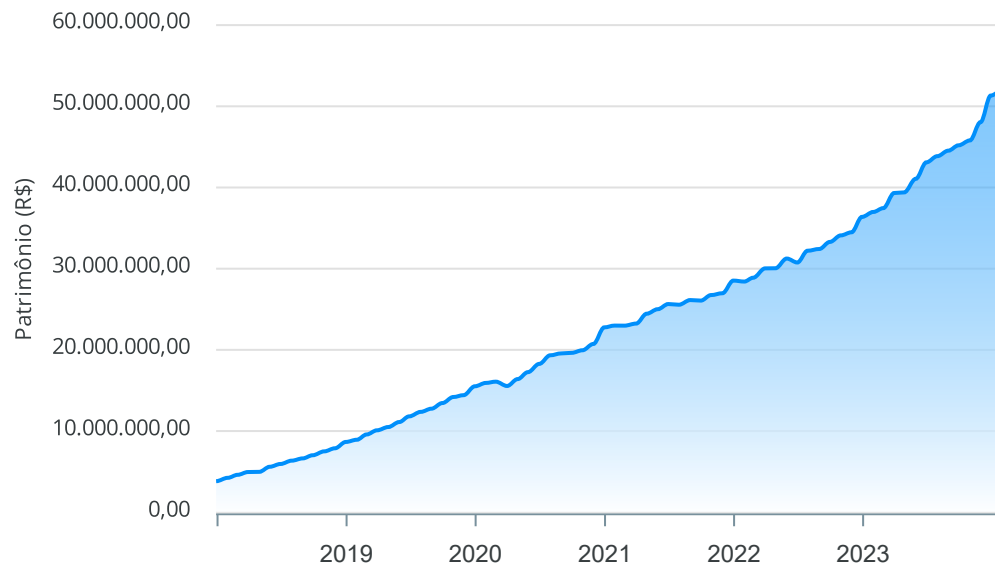
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	51.324.084,61	410.920,25	0,00	51.995.290,42	260.285,56	260.285,56	0,50%	0,50%	0,85%	0,85%	59,46%	1,18%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



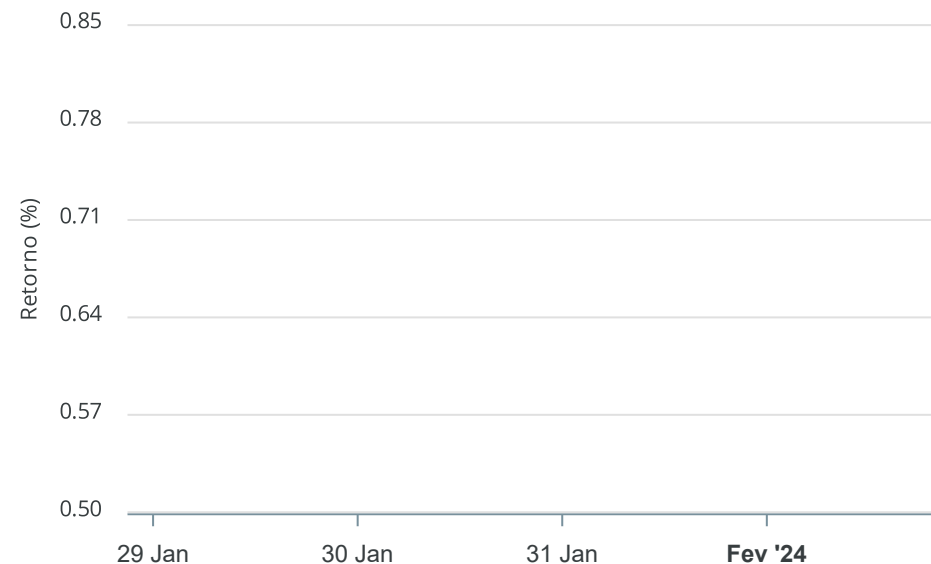
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	531.831,76	0,00	0,00	537.718,49	5.886,73	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.245.348,76	0,00	0,00	3.278.020,69	32.671,93	1,01%	1,01%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.800.942,14	0,00	0,00	1.819.007,54	18.065,40	1,00%	1,00%	0,01%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	2.736.294,28	0,00	0,00	2.762.762,37	26.468,09	0,97%	0,97%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.211.472,54	882,23	0,00	3.243.401,25	31.046,48	0,97%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.075.329,81	0,00	0,00	1.085.550,16	10.220,35	0,95%	0,95%	0,02%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	568.629,13	0,00	0,00	573.916,81	5.287,68	0,93%	0,93%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	605.359,91	0,00	0,00	610.830,19	5.470,28	0,90%	0,90%	0,21%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.674.728,96	0,00	0,00	2.697.854,62	23.125,66	0,86%	0,86%	0,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.099.087,50	0,00	0,00	3.125.403,85	26.316,35	0,85%	0,85%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.380.017,09	0,00	0,00	3.404.673,01	24.655,92	0,73%	0,73%	0,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.385.635,56	0,00	0,00	3.409.735,60	24.100,04	0,71%	0,71%	0,57%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	569.764,51	0,00	0,00	573.772,41	4.007,90	0,70%	0,70%	0,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.926.890,11	0,00	0,00	2.946.213,90	19.323,79	0,66%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.971.554,06	235.260,22	0,00	4.232.830,87	26.016,59	0,62%	0,66%	0,46%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	358.890,47	0,00	0,00	360.931,38	2.040,91	0,57%	0,57%	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	850.409,93	0,00	0,00	855.091,50	4.681,57	0,55%	0,55%	0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	157.192,76	0,00	0,00	157.940,25	747,49	0,48%	0,48%	0,65%
SICREDI IPCA+ FIC RENDA FIXA LP	0,00	174.777,80	0,00	174.777,80	0,00	0,00%	-0,52%	1,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	529.225,29	0,00	0,00	527.376,81	-1.848,48	-0,35%	-0,35%	1,36%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.917.026,19	0,00	0,00	3.898.802,05	-18.224,14	-0,47%	-0,47%	1,27%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	995.943,37	0,00	0,00	990.384,98	-5.558,39	-0,56%	-0,56%	1,59%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	235.283,65	0,00	0,00	231.723,22	-3.560,43	-1,51%	-1,51%	2,05%
Total Renda Fixa	40.826.857,78	410.920,25	0,00	41.498.719,75	260.941,72	0,63%		0,43%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.594.977,71	0,00	0,00	1.621.858,11	26.880,40	1,69%	1,69%	5,15%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.071.731,95	0,00	0,00	1.089.658,79	17.926,84	1,67%	1,67%	5,08%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	428.026,07	0,00	0,00	432.006,17	3.980,10	0,93%	0,93%	0,09%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.335.768,96	0,00	0,00	2.356.502,63	20.733,67	0,89%	0,89%	0,05%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	882.069,99	0,00	0,00	849.438,61	-32.631,38	-3,70%	-3,70%	6,88%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	838.693,03	0,00	0,00	800.457,08	-38.235,95	-4,56%	-4,56%	5,69%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	594.324,09	0,00	0,00	566.613,08	-27.711,01	-4,66%	-4,66%	5,48%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	511.626,15	0,00	0,00	487.419,52	-24.206,63	-4,73%	-4,73%	5,40%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	469.636,98	0,00	0,00	442.569,34	-27.067,64	-5,76%	-5,76%	6,86%
Total Renda Variável	8.726.854,93	0,00	0,00	8.646.523,33	-80.331,60	-0,92%		3,84%

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	1.429.832,47	0,00	0,00	1.495.044,85	65.212,38	4,56%	4,56%	5,69%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	340.539,43	0,00	0,00	355.002,49	14.463,06	4,25%	4,25%	5,46%
Total Exterior	1.770.371,90	0,00	0,00	1.850.047,34	79.675,44	4,50%		5,65%

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.

