

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.687.391,40	1,38%	795	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	17.694.247,47	6,63%	650	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	6.977.182,80	2,62%	99	2,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	1.174.134,84	0,44%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	21.317.970,44	7,99%	306	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	15.308.421,90	5,74%	209	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	32.300.530,91	12,11%	83	7,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	12.030.841,27	4,51%	53	5,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	10.522.604,82	3,94%	12	18,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.119.703,31	3,04%	843	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	859.933,21	0,32%	913	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.463.202,89	3,92%	1.191	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.137.770,07	2,30%	452	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	14.774.458,28	5,54%	220	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	385.326,23	0,14%	1.015	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	11.596.607,09	4,35%	149	1,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	325.247,18	0,12%	362	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	7.018.537,46	2,63%	220	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	Não se ...	27 meses	303.683,28	0,11%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.627.584,17	1,36%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

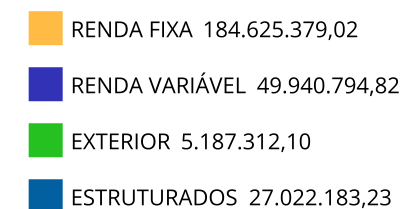
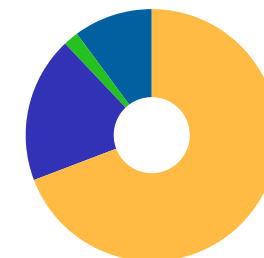
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.170.573,87	1,19%	1.264	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.533.768,46	2,07%	2.595	0,94%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.601.051,18	0,97%	17.395	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.220.120,51	1,21%	1.963	1,94%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	7.108.840,80	2,66%	2.045	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	4.272.928,30	1,60%	116	0,62%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.515.490,36	1,69%	2.318	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	3.650.422,38	1,37%	305	0,84%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.021.331,45	1,13%	13.227	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.640.879,59	0,99%	1.564	1,75%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.648.932,96	2,12%	30.919	0,97%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	4.556.454,96	1,71%	32	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	3.071.056,53	1,15%	17.010	0,58%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.116.255,57	0,79%	336	0,30%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.523.824,65	3,20%	4.902	0,60%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	3.752.394,00	1,41%	583	1,89%	Artigo 10º, Inciso I
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.728.116,25	2,52%	366	7,49%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	3.005.636,47	1,13%	75	0,47%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	3.416.768,35	1,28%	17	3,28%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.595.443,51	0,60%	28	2,32%	Artigo 10º, Inciso II

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			266.775.669,17				

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

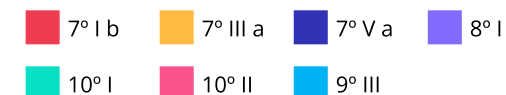
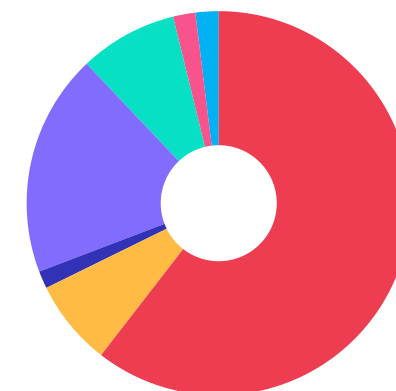
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	50,00%	133.387.834,59
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	161.368.393,61	60,49%	8,00%	27,00%	70,00%	25.374.574,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	19.325.717,96	7,24%	2,00%	16,00%	60,00%	140.739.683,54
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	53.355.133,83
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	3.931.267,45	1,47%	0,00%	2,00%	3,00%	4.072.002,63
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.338.783,46
Total Renda Fixa	100,00%	184.625.379,02	69,21%	10,00%	60,00%	208,00%	



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%	49.940.794,82	18,72%	5,00%	20,00%	30,00%	30.091.905,93
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	80.032.700,75
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	22.009.971,37	8,25%	1,00%	10,00%	10,00%	4.667.595,55
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	5.012.211,86	1,88%	1,00%	3,00%	5,00%	8.326.571,60
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.338.783,46
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	76.962.978,05	28,85%	7,00%	33,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	26.677.566,92
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.187.312,10	1,94%	0,00%	2,00%	10,00%	21.490.254,82
Total Exterior	10,00%	5.187.312,10	1,94%	0,00%	5,00%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	161.368.393,61	60,49	8,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	19.325.717,96	7,24	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	3.931.267,45	1,47	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	49.940.794,82	18,72	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	5.187.312,10	1,94	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	22.009.971,37	8,25	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	5.012.211,86	1,88	1,00	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
CAIXA DTVM	133.935.372,95	50,21	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.294.732,78	16,60	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	24.814.327,19	9,30	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	11.596.607,09	4,35	-
TRÍGONO CAPITAL	10.205.387,92	3,83	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	7.108.840,80	2,66	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	6.728.116,25	2,52	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	5.121.892,04	1,92	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.515.490,36	1,69	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.650.422,38	1,37	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.627.584,17	1,36	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.416.768,35	1,28	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.220.120,51	1,21	-
PERFIN INVESTIMENTOS	2.640.879,59	0,99	-
KPTL	1.595.443,51	0,60	-
GENIAL GESTÃO LTDA	303.683,28	0,11	-

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%	-	-
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,35%	2,37%	3,56%	6,15%	11,81%	26,33%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,16%	-0,53%	-0,67%	-1,40%	-0,33%	-10,39%	0,03%	3,54%
IMA Geral (Benchmark)	0,64%	1,11%	2,75%	5,15%	14,09%	26,08%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	1,08%	2,70%	5,06%	13,89%	25,95%	0,40%	1,72%
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 5 (Benchmark)	0,59%	1,28%	2,76%	4,42%	10,44%	23,21%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	1,24%	2,70%	4,32%	10,29%	22,91%	0,41%	1,75%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	1,13%	2,84%	1,05%	5,37%	-	0,65%	4,93%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,07%	-0,98%	-0,07%	2,27%	4,36%	9,06%	4,79%	3,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,84%	2,78%	5,17%	10,15%	23,23%	0,25%	1,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	1,24%	2,70%	4,31%	10,24%	22,71%	0,41%	1,77%
IMA-B (Benchmark)	0,55%	0,10%	2,85%	3,87%	14,70%	23,81%	-	-

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 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%
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,73%	1,61%	2,44%	5,18%	11,42%	23,83%	0,00%	0,04%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	-0,50%	-0,87%	-1,74%	-2,76%	-4,65%	12,44%	0,18%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,51%	1,42%	2,56%	4,98%	12,14%	26,09%	0,33%	0,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,61%	2,45%	5,17%	11,62%	24,88%	0,01%	0,05%
IPCA (Benchmark)	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	1,03%	2,60%	4,86%	14,72%	25,46%	0,47%	2,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,04%	2,66%	4,80%	15,14%	24,39%	0,49%	2,86%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,02%	-2,36%	-0,11%	0,49%	-	-	4,73%	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,58%	1,13%	2,85%	1,06%	-	-	0,65%	-
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
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	0,45%	0,97%	2,08%	3,50%	8,86%	23,73%	0,37%	1,43%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,56%	1,07%	2,91%	6,54%	13,66%	24,79%	0,47%	3,09%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5,65%	7,37%	12,91%	15,94%	36,36%	35,36%	5,23%	12,28%

Ibovespa (Benchmark)	0,99%	-3,85%	1,33%	11,47%	22,96%	14,03%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	1,28%	-1,09%	2,14%	9,56%	21,76%	-	5,62%	8,31%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,58%	-4,01%	1,79%	10,06%	16,96%	4,65%	7,13%	15,73%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,07%	-4,86%	0,19%	3,98%	11,10%	3,29%	6,45%	16,25%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,53%	-5,96%	-1,05%	7,61%	17,03%	4,59%	6,83%	15,63%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,81%	0,46%	7,85%	16,62%	17,30%	17,61%	5,38%	14,54%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,84%	-7,04%	-2,78%	-7,08%	3,96%	15,37%	9,66%	19,79%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,80%	-2,66%	3,67%	7,86%	19,48%	15,51%	6,39%	14,19%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2,79%	-2,75%	3,52%	11,84%	28,03%	19,72%	7,70%	15,56%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,53%	0,53%	8,01%	14,63%	22,94%	10,87%	6,74%	16,74%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,03%	-3,15%	2,54%	10,82%	21,59%	10,73%	6,76%	16,22%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,43%	-1,02%	3,76%	12,36%	16,89%	6,29%	6,19%	17,01%

IDIV (Benchmark)	0,91%	-2,64%	4,09%	13,07%	26,16%	32,52%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	-0,87%	-7,72%	-3,31%	-6,11%	6,66%	26,70%	9,34%	19,24%

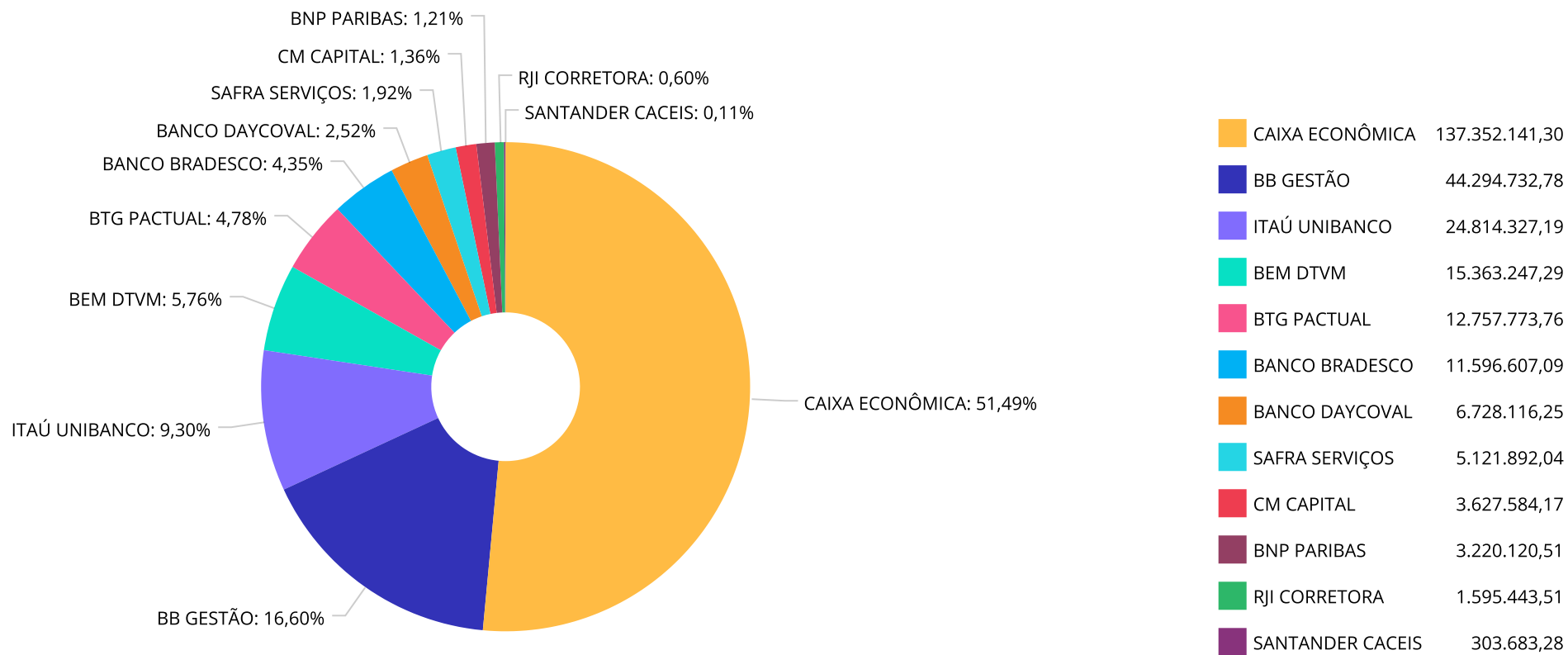
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2,53%	0,75%	8,95%	11,92%	29,22%	25,57%	7,45%	15,04%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,59%	2,91%	4,39%	7,87%	15,47%	34,73%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-43,79%	-43,88%	-43,96%	-44,20%	-44,69%	-49,52%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,42%	2,53%	3,80%	6,64%	12,86%	28,71%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	8,42%	8,20%	8,99%	8,38%	8,99%	12,86%	10,26%	-

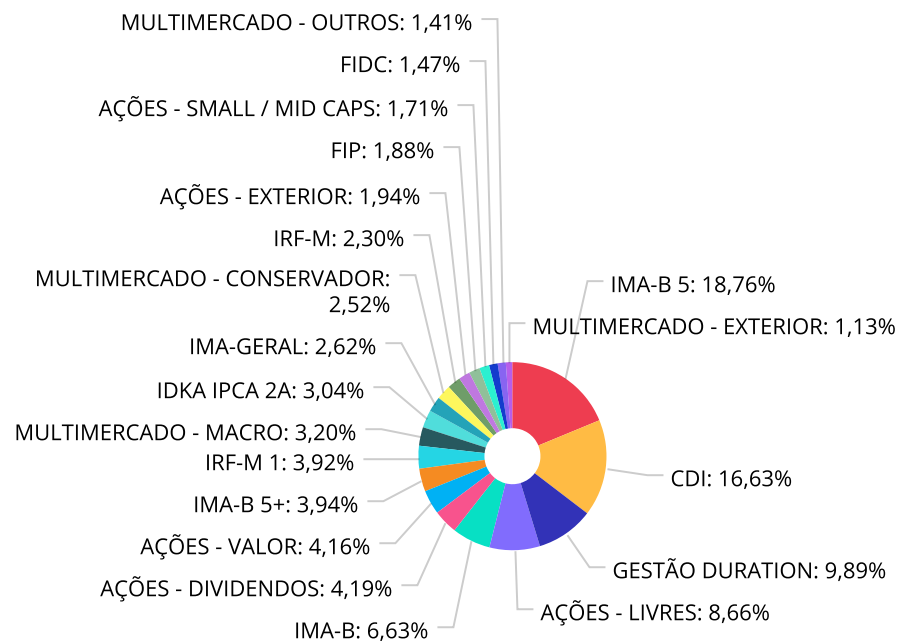
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,54%	7,40%	10,09%	11,35%	22,66%	7,22%	6,09%	13,328%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,64%	12,77%	16,92%	22,59%	55,95%	34,34%	9,07%	16,300%

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



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

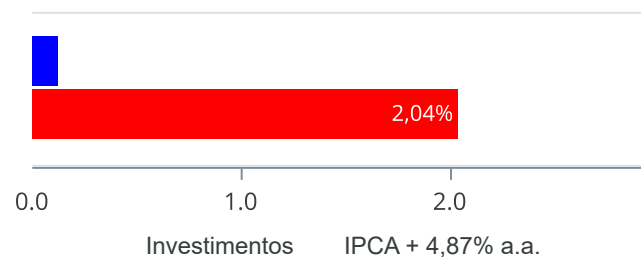


IMA-B 5	50.052.831,63	CDI	44.355.503,21	GESTÃO DURATION	26.371.065,37
ACÇÕES - LIVRES	23.107.713,89	IMA-B	17.694.247,47	ACÇÕES - DIVIDENDOS	11.182.701,42
ACÇÕES - VALOR	11.093.924,55	IMA-B 5+	10.522.604,82	IRF-M 1	10.463.202,89
MULTIMERCADO - MACRO	8.523.824,65	IDKA IPCA 2A	8.119.703,31	IMA-GERAL	6.977.182,80
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	6.728.116,25	IRF-M	6.137.770,07	ACÇÕES - EXTERIOR	5.187.312,10
FIP	5.012.211,86	ACÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.556.454,96	FIDC	3.931.267,45
MULTIMERCADO - OUTROS	3.752.394,00	MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.005.636,47		

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	262.588.417,28	13.304.514,97	9.901.084,94	264.939.005,41	-1.052.841,90	-1.052.841,90	-0,40%	-0,40%	0,84%	0,84%	-47,25%	1,99%
Fevereiro	264.939.005,41	30.502.448,14	30.033.713,68	266.775.669,17	1.367.929,30	315.087,40	0,52%	0,12%	1,19%	2,04%	5,76%	2,95%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



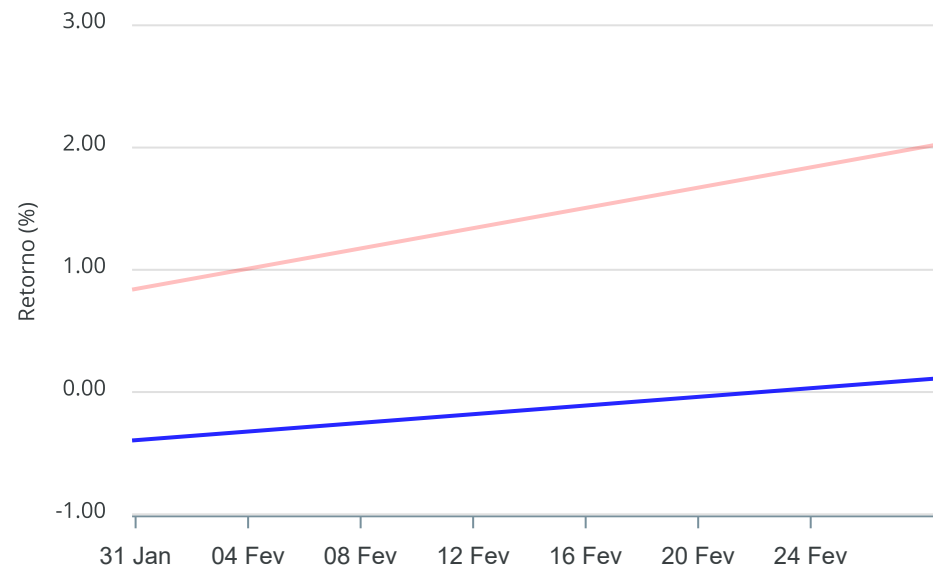
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.386.116,54	0,00	0,00	10.463.202,89	77.086,35	0,74%	0,74%	0,09%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.648.490,05	0,00	454.925,08	15.308.421,90	114.856,93	0,73%	-2,17%	4,98%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.767.390,96	0,00	607.690,30	21.317.970,44	158.269,78	0,73%	-2,06%	4,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.200.049,70	0,00	34.572,34	1.174.134,84	8.657,48	0,72%	0,73%	0,25%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	6.933.227,33	0,00	0,00	6.977.182,80	43.955,47	0,63%	0,63%	0,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	332.919,79	72.451,85	22.500,14	385.326,23	2.454,73	0,61%	0,73%	0,01%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.961.976,39	0,00	0,00	12.030.841,27	68.864,88	0,58%	0,58%	0,65%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.666.286,26	0,00	0,00	3.687.391,40	21.105,14	0,58%	0,58%	0,41%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.530.483,52	0,00	0,00	11.596.607,09	66.123,57	0,57%	0,57%	0,47%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.116.449,41	0,00	0,00	32.300.530,91	184.081,50	0,57%	0,57%	0,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	14.692.532,79	0,00	0,00	14.774.458,28	81.925,49	0,56%	0,56%	0,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	17.600.836,76	0,00	0,00	17.694.247,47	93.410,71	0,53%	0,53%	0,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	6.982.937,15	0,00	0,00	7.018.537,46	35.600,31	0,51%	0,51%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.994.285,84	650.000,00	1.534.569,47	6.137.770,07	28.053,70	0,37%	0,43%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.509.894,42	3.247.369,14	11.700.000,00	8.119.703,31	62.439,75	0,32%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	207.984,01	650.000,00	0,00	859.933,21	1.949,20	0,23%	0,58%	0,41%
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.500.000,00	0,00	10.522.604,82	22.604,82	0,22%	-2,02%	4,73%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	616.102,32	15.382.627,15	15.679.456,35	325.247,18	5.974,06	0,04%	0,73%	0,00%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.633.230,89	0,00	0,00	3.627.584,17	-5.646,72	-0,16%	-0,16%	0,03%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	305.215,62	0,00	0,00	303.683,28	-1.532,34	-0,50%	-0,50%	0,18%

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
Total Renda Fixa	183.086.409,75	30.502.448,14	30.033.713,68	184.625.379,02	1.070.234,81	0,58%		1,63%

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
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.151.478,49	0,00	0,00	3.416.768,35	265.289,86	8,42%	8,42%	10,26%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2.844.963,67	0,00	0,00	3.005.636,47	160.672,80	5,65%	5,65%	5,23%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.938.700,30	0,00	0,00	3.021.331,45	82.631,15	2,81%	2,81%	5,38%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.551.484,01	0,00	0,00	3.650.422,38	98.938,37	2,79%	2,79%	7,70%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.575.740,73	0,00	0,00	2.640.879,59	65.138,86	2,53%	2,53%	6,74%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.397.351,79	0,00	0,00	5.533.768,46	136.416,67	2,53%	2,53%	7,45%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.940.200,67	0,00	0,00	7.108.840,80	168.640,13	2,43%	2,43%	6,19%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	3.704.961,00	0,00	0,00	3.752.394,00	47.433,00	1,28%	1,28%	5,62%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	4.229.386,34	0,00	0,00	4.272.928,30	43.541,96	1,03%	1,03%	6,76%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	4.518.716,94	0,00	0,00	4.556.454,96	37.738,02	0,84%	0,84%	9,66%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.479.681,49	0,00	0,00	4.515.490,36	35.808,87	0,80%	0,80%	6,39%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.152.185,02	0,00	0,00	3.170.573,87	18.388,85	0,58%	0,58%	7,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.476.375,04	0,00	0,00	8.523.824,65	47.449,61	0,56%	0,56%	0,47%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.587.250,29	0,00	0,00	2.601.051,18	13.800,89	0,53%	0,53%	6,83%
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	6.697.980,85	0,00	0,00	6.728.116,25	30.135,40	0,45%	0,45%	0,37%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.217.729,22	0,00	0,00	3.220.120,51	2.391,29	0,07%	0,07%	6,45%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	5.698.697,22	0,00	0,00	5.648.932,96	-49.764,26	-0,87%	-0,87%	9,34%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.838.589,62	0,00	0,00	1.595.443,51	-1.243.146,11	-43,79%	-	-
Total Renda Variável	77.001.472,69	0,00	0,00	76.962.978,05	-38.494,64	-0,05%		5,86%

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
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.826.722,81	0,00	0,00	3.071.056,53	244.333,72	8,64%	8,64%	9,07%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.024.400,16	0,00	0,00	2.116.255,57	91.855,41	4,54%	4,54%	6,09%
Total Exterior	4.851.122,97	0,00	0,00	5.187.312,10	336.189,13	6,93%		7,86%

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 & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

