

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

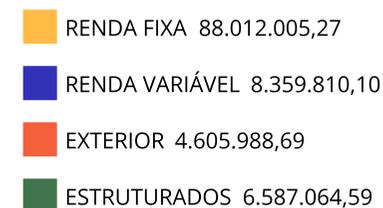
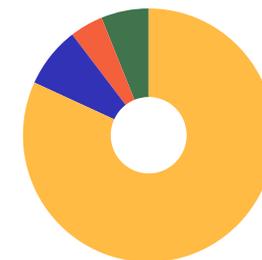
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.695.636,55	1,58%	447	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	480.220,16	0,45%	116	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.641.018,48	8,96%	439	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	4.746.554,92	4,41%	459	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info	Não se aplica	1.071.820,60	1,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.832.248,80	2,63%	918	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	371.657,45	0,35%	88	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	136.936,45	0,13%	6.058	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	160.170,89	0,15%	6.061	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.656.480,01	1,54%	117	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	207.408,35	0,19%	2.141	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	399.554,12	0,37%	5.353	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.526.041,99	1,42%	65	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	435.420,22	0,40%	64	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	633.891,82	0,59%	8.781	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	963.454,31	0,90%	65	0,80%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.642.534,38	3,39%	468	0,17%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	553.529,16	0,51%	4.948	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.802.851,28	1,68%	112	0,32%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.995.594,33	1,86%	5.060	0,37%	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
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	1.503.699,52	1,40%	35	1,46%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	731.390,30	0,68%	597	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			107.564.868,65				

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

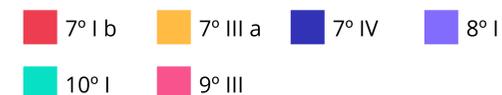
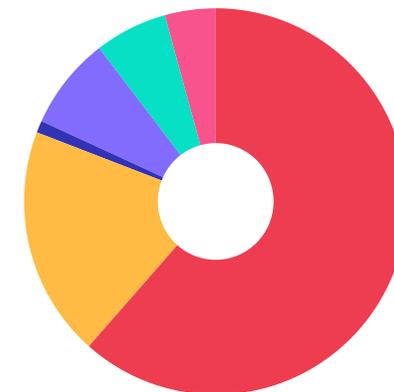
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,37%	40,00%	43.025.947,46
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	66.168.599,48	61,52%	0,00%	15,92%	95,00%	36.018.025,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	20.771.585,19	19,31%	0,00%	15,39%	45,00%	27.632.605,70
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	1.071.820,60	1,00%	0,00%	15,39%	20,00%	20.441.153,13
Total Renda Fixa	100,00%	88.012.005,27	81,82%	0,00%	62,07%	200,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	8.359.810,10	7,77%	0,00%	25,74%	30,00%	23.909.650,50
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	32.269.460,60
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	6.587.064,59	6,12%	0,00%	2,58%	10,00%	4.169.422,28
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.378.243,43
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,68%	5,00%	5.378.243,43
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	14.946.874,69	13,90%	0,00%	30,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.605.988,69	4,28%	0,00%	6,93%	10,00%	6.150.498,18
Total Exterior	10,00%	4.605.988,69	4,28%	0,00%	6,93%	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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	66.168.599,48	61,52	0,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	20.771.585,19	19,31	0,00	45,00
Artigo 8º, Inciso I	8.359.810,10	7,77	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	4.605.988,69	4,28	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	6.587.064,59	6,12	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	59.061.408,38	54,91	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	16.892.917,17	15,70	0,00
SICREDI	10.373.060,69	9,64	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.984.196,22	9,28	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	5.657.262,44	5,26	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	4.524.203,15	4,21	0,00
BANCO SANTANDER	1.071.820,60	1,00	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%	-	-
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%
IMA Geral (Benchmark)	0,47%	0,47%	3,98%	5,14%	14,53%	26,21%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,47%	-0,47%	4,91%	2,80%	15,26%	23,23%	1,27%	4,16%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	0,45%	3,95%	5,01%	14,44%	26,03%	0,58%	1,84%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,77%	5,92%	12,95%	27,12%	-	-
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	0,84%	0,84%	2,71%	5,83%	12,76%	26,70%	0,15%	0,34%
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 5 (Benchmark)	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,66%	0,66%	3,94%	4,34%	11,12%	23,35%	0,55%	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%
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%
IMA-B (Benchmark)	-0,45%	-0,45%	4,97%	2,91%	15,53%	23,80%	-	-
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
CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,04%	6,56%	13,58%	28,79%	0,07%	0,09%
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%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,97%	0,97%	2,79%	6,02%	12,84%	27,21%	0,01%	0,06%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04%	1,04%	2,96%	6,45%	13,33%	28,24%	0,04%	0,09%
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%

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%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,89%	0,89%	3,09%	4,56%	12,69%	25,05%	0,18%	1,01%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,46%	0,46%	3,82%	4,85%	15,10%	25,59%	0,57%	2,16%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	0,56%	1,94%	0,89%	-	-	0,82%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	1,12%	2,87%	2,45%	-	-	0,33%	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,85%	2,34%	-	-	0,33%	-

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%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,94%	0,94%	2,91%	6,00%	13,08%	27,82%	0,13%	0,36%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,68%	-0,68%	5,38%	5,54%	11,80%	24,08%	1,84%	4,67%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,22%	0,22%	5,61%	5,70%	11,75%	26,74%	0,89%	3,66%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,51%	0,51%	5,85%	5,53%	12,87%	25,14%	0,58%	3,32%

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%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,72%	3,72%	12,95%	11,12%	17,75%	-0,14%	5,54%	13,20%

Ibovespa (Benchmark)	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-8,43%	-8,43%	12,59%	-11,83%	-5,88%	-30,20%	9,43%	23,55%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-8,52%	-8,52%	13,58%	-4,79%	28,00%	10,04%	10,75%	26,85%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-4,73%	-4,73%	12,75%	4,76%	12,28%	13,81%	5,40%	16,07%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,15%	-4,15%	11,76%	0,85%	8,47%	4,31%	6,58%	16,00%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-6,24%	-6,24%	10,23%	-7,52%	-4,18%	-13,25%	7,58%	19,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-6,19%	-6,19%	10,45%	-7,26%	-3,33%	-13,15%	7,57%	18,94%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,70%	-3,70%	12,67%	4,98%	21,24%	27,93%	6,88%	16,81%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,13%	-4,13%	14,09%	4,05%	12,06%	10,66%	5,62%	16,67%

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

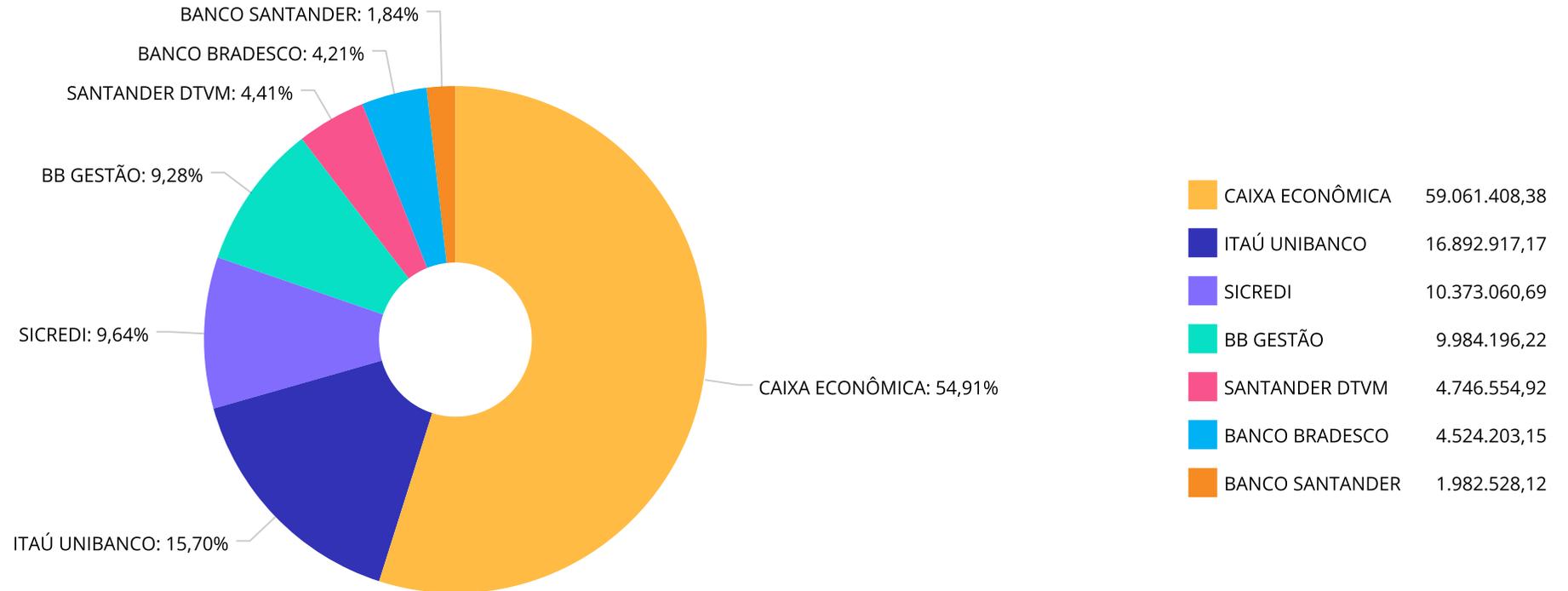
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	1,59%	1,59%	15,54%	5,59%	18,86%	7,31%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	1,67%	1,67%	16,91%	8,73%	27,05%	25,82%	5,15%	12,81%

SMLL (Benchmark)	-6,55%	-6,55%	12,50%	-6,30%	6,34%	-10,11%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-5,76%	-5,76%	13,19%	-5,09%	6,01%	-5,82%	8,95%	19,86%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-6,59%	-6,59%	12,09%	-6,54%	5,31%	-11,42%	9,75%	21,65%

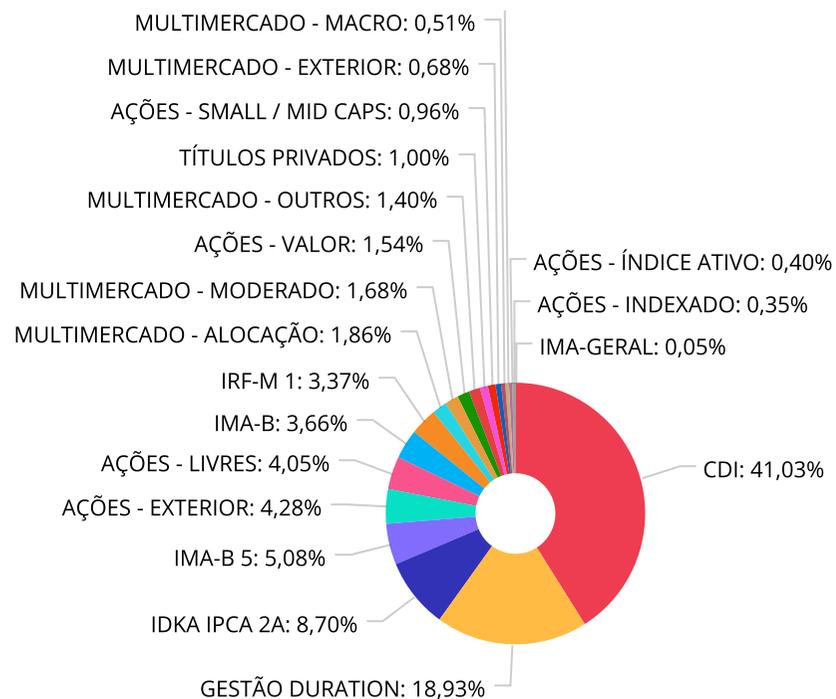
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,72%	3,72%	12,95%	11,12%	17,75%	-0,14%	5,54%	13,197%

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



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

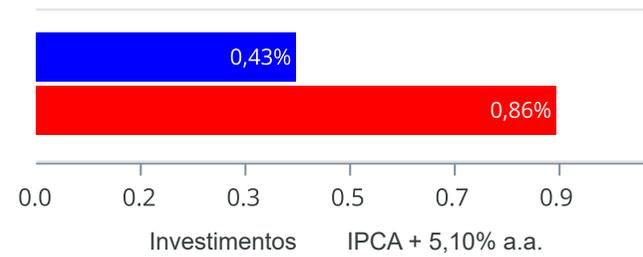


CDI	44.131.509,07	GESTÃO DURATION	20.362.055,30	IDKA IPCA 2A	9.361.939,11	IMA-B 5	5.461.031,15
AÇÕES - EXTERIOR	4.605.988,69	AÇÕES - LIVRES	4.358.290,79	IMA-B	3.937.414,92	IRF-M 1	3.627.693,16
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.995.594,33	MULTIMERCADO - MODERADO	1.802.851,28	AÇÕES - VALOR	1.656.480,01	MULTIMERCADO - OUTROS	1.503.699,52
TÍTULOS PRIVADOS	1.071.820,60	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.033.445,94	MULTIMERCADO - EXTERIOR	731.390,30	MULTIMERCADO - MACRO	553.529,16
AÇÕES - SETORIAIS	504.515,69	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	435.420,22	AÇÕES - INDEXADO	371.657,45	IMA-GERAL	58.541,96

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	108.595.135,77	807.607,41	2.304.753,66	107.564.868,65	466.879,13	466.879,13	0,43%	0,43%	0,86%	0,86%	50,16%	1,13%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



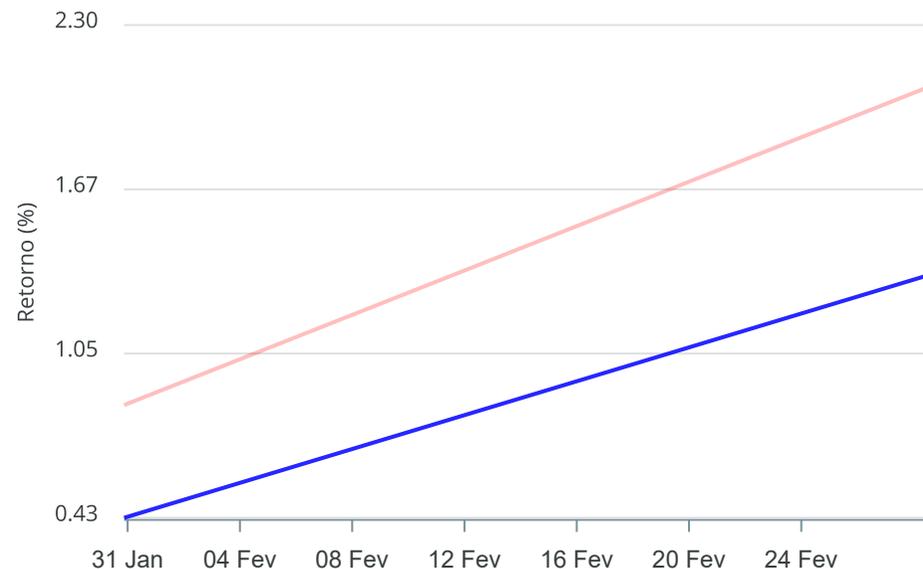
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.167.515,60	0,00	0,00	2.191.690,45	24.174,85	1,12%	1,12%	0,33%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1.607.933,72	0,00	0,00	1.625.768,77	17.835,05	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.453.658,23	0,00	0,00	1.469.748,46	16.090,23	1,11%	1,11%	0,33%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.677.408,35	0,00	0,00	1.695.636,55	18.228,20	1,09%	1,09%	0,07%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	4.697.669,88	0,00	0,00	4.746.554,92	48.885,04	1,04%	1,04%	0,04%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	1.060.833,88	0,00	0,00	1.071.820,60	10.986,72	1,04%	-	-
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	10.273.683,67	0,00	0,00	10.373.060,69	99.377,02	0,97%	0,97%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.320.608,61	0,00	0,00	2.343.042,79	22.434,18	0,97%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	9.809.389,08	806.581,41	1.075.385,64	9.641.018,48	100.433,63	0,95%	1,01%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.380.508,96	0,00	431.195,77	10.044.987,96	95.674,77	0,92%	0,95%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.692.433,85	0,00	0,00	2.716.985,64	24.551,79	0,91%	0,91%	0,11%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	476.008,88	0,00	0,00	480.220,16	4.211,28	0,88%	0,88%	0,18%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	903.158,34	0,00	0,00	910.707,52	7.549,18	0,84%	0,84%	0,15%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.084.959,15	0,00	798.172,25	3.317.417,47	30.630,57	0,75%	0,85%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.001.717,56	0,00	0,00	5.038.203,15	36.485,59	0,73%	0,73%	0,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.293.175,76	0,00	0,00	4.323.735,96	30.560,20	0,71%	0,71%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.549.824,63	0,00	0,00	2.566.752,55	16.927,92	0,66%	0,66%	0,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1.956.758,59	0,00	0,00	1.969.708,23	12.949,64	0,66%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.923.013,14	0,00	0,00	8.981.465,35	58.452,21	0,66%	0,66%	0,46%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	919.468,03	0,00	0,00	924.570,37	5.102,34	0,55%	0,55%	0,82%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.689.756,35	1.026,00	0,00	5.717.840,03	27.057,68	0,48%	0,48%	0,65%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.856.648,42	0,00	0,00	1.865.112,29	8.463,87	0,46%	0,46%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	58.280,24	0,00	0,00	58.541,96	261,72	0,45%	0,45%	0,58%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.193.812,88	0,00	0,00	1.188.258,63	-5.554,25	-0,47%	-0,47%	1,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.762.053,27	0,00	0,00	2.749.156,29	-12.896,98	-0,47%	-0,47%	1,27%
Total Renda Fixa	88.810.279,07	807.607,41	2.304.753,66	88.012.005,27	698.872,45	0,79%		0,29%

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	719.372,83	0,00	0,00	731.390,30	12.017,47	1,67%	1,67%	5,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1.489.706,13	0,00	0,00	1.503.699,52	13.993,39	0,94%	0,94%	0,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	550.712,49	0,00	0,00	553.529,16	2.816,67	0,51%	0,51%	0,58%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.798.970,01	0,00	0,00	1.802.851,28	3.881,27	0,22%	0,22%	0,89%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.009.218,58	0,00	0,00	1.995.594,33	-13.624,25	-0,68%	-0,68%	1,84%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	215.375,99	0,00	0,00	207.408,35	-7.967,64	-3,70%	-3,70%	6,88%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.727.906,20	0,00	0,00	1.656.480,01	-71.426,19	-4,13%	-4,13%	5,62%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.954.818,34	0,00	0,00	2.832.248,80	-122.569,54	-4,15%	-4,15%	6,58%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	390.115,02	0,00	0,00	371.657,45	-18.457,57	-4,73%	-4,73%	5,40%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	672.661,23	0,00	0,00	633.891,82	-38.769,41	-5,76%	-5,76%	8,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.626.714,70	0,00	0,00	1.526.041,99	-100.672,71	-6,19%	-6,19%	7,57%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	464.406,84	0,00	0,00	435.420,22	-28.986,62	-6,24%	-6,24%	7,58%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	427.737,48	0,00	0,00	399.554,12	-28.183,36	-6,59%	-6,59%	9,75%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	174.918,72	0,00	0,00	160.170,89	-14.747,83	-8,43%	-8,43%	9,43%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	149.695,94	0,00	0,00	136.936,45	-12.759,49	-8,52%	-8,52%	10,75%
Total Renda Variável	15.372.330,50	0,00	0,00	14.946.874,69	-425.455,81	-2,77%		4,57%

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	3.483.650,62	0,00	0,00	3.642.534,38	158.883,76	4,56%	4,56%	5,69%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	928.875,58	0,00	0,00	963.454,31	34.578,73	3,72%	3,72%	5,54%
Total Exterior	4.412.526,20	0,00	0,00	4.605.988,69	193.462,49	4,38%		5,66%

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.

