

# 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	616.510,26	0,13%	702	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	7.955.948,41	1,62%	883	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	22.836.063,70	4,64%	795	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.909.072,78	1,20%	641	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.989.754,58	1,83%	105	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	23.014.565,55	4,67%	305	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.094.349,11	2,05%	791	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	17.151.006,52	3,48%	850	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.080.575,47	4,48%	914	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.417.055,15	2,12%	771	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.928.561,06	1,20%	450	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	8.278.615,36	1,68%	217	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	19.304.442,05	3,92%	1.003	0,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	41.480.728,61	8,42%	161	2,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.641.036,15	4,19%	447	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	77.305.494,70	15,70%	439	1,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	30.556.625,32	6,20%	6.095	6,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	17.034.584,77	3,46%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	44.847.054,48	9,11%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	5.978.862,65	1,21%	680	1,74%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

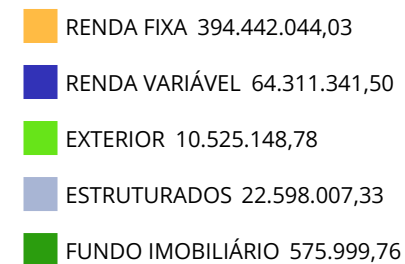
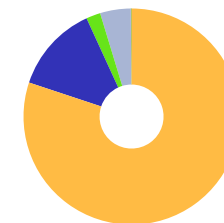
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	433.685,25	0,09%	3.034	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	750.135,91	0,15%	147	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	30.268,35	0,01%	2.035	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	10.953.670,04	2,22%	2.370	0,75%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	8.658.577,98	1,76%	83	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	672.683,65	0,14%	277	0,78%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.668.411,80	1,35%	1.706	2,05%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+92	Não há	3.923.260,55	0,80%	103	1,06%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	12.923.270,82	2,62%	22	1,52%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	13.318.514,50	2,70%	33	1,39%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	3.384.945,15	0,69%	107	0,28%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	3.453.579,86	0,70%	51	0,93%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+6 du	Não há	333.704,74	0,07%	11	0,01%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INV...	D+6 du	Não há	329.371,14	0,07%	13	0,00%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.023.547,89	0,61%	340	0,45%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	6.694.705,83	1,36%	2.630	1,23%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.798.998,28	0,97%	4.948	0,33%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.812.121,43	1,18%	10	11,13%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	5.292.181,79	1,07%	72	0,90%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	575.999,76	0,12%		0,19%	Artigo 11º

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>492.452.541,40</b>				

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

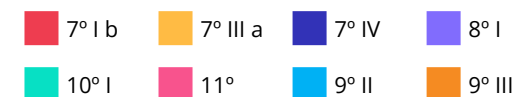
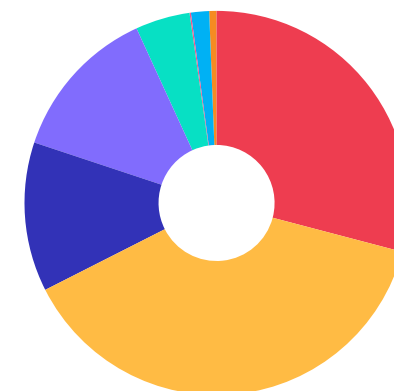
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	45,00%	221.603.643,63
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	143.272.077,95	29,09%	10,00%	30,00%	90,00%	299.935.209,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	189.288.326,83	38,44%	15,00%	24,00%	60,00%	106.183.198,01
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	61.881.639,25	12,57%	10,00%	20,00%	20,00%	36.608.869,03
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	24.622.627,07
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>394.442.044,03</b>	<b>80,10%</b>	<b>35,00%</b>	<b>77,00%</b>	<b>220,00%</b>	



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%	64.311.341,50	13,06%	0,00%	15,00%	30,00%	83.424.420,92
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	22.598.007,33	4,59%	0,00%	5,00%	10,00%	26.647.246,81
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	4.924.525,41
Artigo 11º	5,00%	575.999,76	0,12%	0,00%	1,00%	2,00%	9.273.051,07
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>87.485.348,59</b>	<b>17,77%</b>	<b>0,00%</b>	<b>21,00%</b>	<b>43,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	7.501.600,89	1,52%	0,00%	1,00%	10,00%	41.743.653,25
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.023.547,89	0,61%	0,00%	1,00%	10,00%	46.221.706,25
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>10.525.148,78</b>	<b>2,14%</b>	<b>0,00%</b>	<b>2,00%</b>	<b>20,00%</b>	



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	45,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	143.272.077,95	29,09	10,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	189.288.326,83	38,44	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	64.311.341,50	13,06	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	7.501.600,89	1,52	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.023.547,89	0,61	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	22.598.007,33	4,59	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 11º	575.999,76	0,12	0,00	2,00
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	179.780.360,42	36,51	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	104.941.290,82	21,31	-
BANCO DAYCOVAL	44.847.054,48	9,11	-
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	30.556.625,32	6,20	-
TRÍGONO CAPITAL	26.241.785,32	5,33	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	20.641.036,15	4,19	-
BANCO BTG PACTUAL	17.034.584,77	3,46	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	10.953.670,04	2,22	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	8.658.577,98	1,76	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	8.315.729,68	1,69	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	8.278.615,36	1,68	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	6.694.705,83	1,36	-
SOMMA INVESTIMENTOS	6.668.411,80	1,35	-
4UM INVESTIMENTOS	5.978.862,65	1,21	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.812.121,43	1,18	-
TARPON INVESTIMENTOS	3.923.260,55	0,80	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	750.135,91	0,15	-
PRÓPIO CAPITAL	672.683,65	0,14	-
MIRAE ASSET	663.075,88	0,13	-
ZION INVEST	575.999,76	0,12	-

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
AZ QUEST INVESTIMENTOS	433.685,25	0,09	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	30.268,35	0,01	-

**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
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
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%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
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%
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 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,84%	2,68%	4,90%	9,69%	0,33%	3,96%
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%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-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%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,67%	0,67%	4,68%	6,05%	16,31%	27,74%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	0,66%	4,64%	5,92%	15,88%	27,01%	0,79%	2,43%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,67%	0,67%	4,66%	5,95%	16,08%	27,41%	0,79%	2,44%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	0,81%	0,81%	3,84%	6,33%	13,89%	26,11%	0,28%	1,17%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,03%	1,03%	3,02%	6,37%	12,98%	27,42%	0,02%	0,20%

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,88%	0,88%	2,56%	5,51%	11,76%	24,82%	0,01%	0,05%
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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	2,96%	6,31%	13,28%	28,05%	0,02%	0,09%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,04%	6,56%	13,58%	28,79%	0,07%	0,09%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	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%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,33%	4,67%	13,16%	25,72%	0,46%	1,30%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	-0,44%	-0,44%	2,88%	4,51%	13,19%	-	5,95%	13,94%

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
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	-0,44%	-0,44%	2,88%	4,51%	13,19%	-	5,95%	13,94%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,51%	0,51%	5,85%	5,53%	12,87%	25,14%	0,58%	3,32%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	1,63%	1,63%	16,83%	8,69%	26,81%	25,34%	5,13%	12,74%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	-4,28%	-4,28%	13,55%	5,07%	20,10%	18,53%	6,66%	15,23%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-1,71%	-1,71%	14,88%	3,45%	10,45%	6,00%	6,58%	15,98%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	-6,77%	-6,77%	7,88%	-8,34%	7,67%	0,61%	10,04%	22,63%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-4,59%	-4,59%	12,16%	3,29%	4,13%	0,56%	5,41%	15,98%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-4,94%	-4,94%	9,44%	-0,56%	4,41%	3,24%	5,53%	16,59%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,43%	-3,43%	13,39%	1,79%	11,23%	13,48%	6,30%	14,43%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,49%	-1,49%	14,31%	8,75%	40,63%	37,57%	8,15%	18,51%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,91%	-6,91%	-1,10%	-2,94%	3,25%	26,49%	7,30%	19,17%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,11%	-6,11%	11,40%	10,26%	42,45%	65,39%	10,51%	18,92%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,81%	-7,81%	-3,19%	-5,63%	-1,03%	11,28%	7,33%	19,24%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	0,67%	0,67%	5,63%	4,26%	18,16%	20,04%	-	-

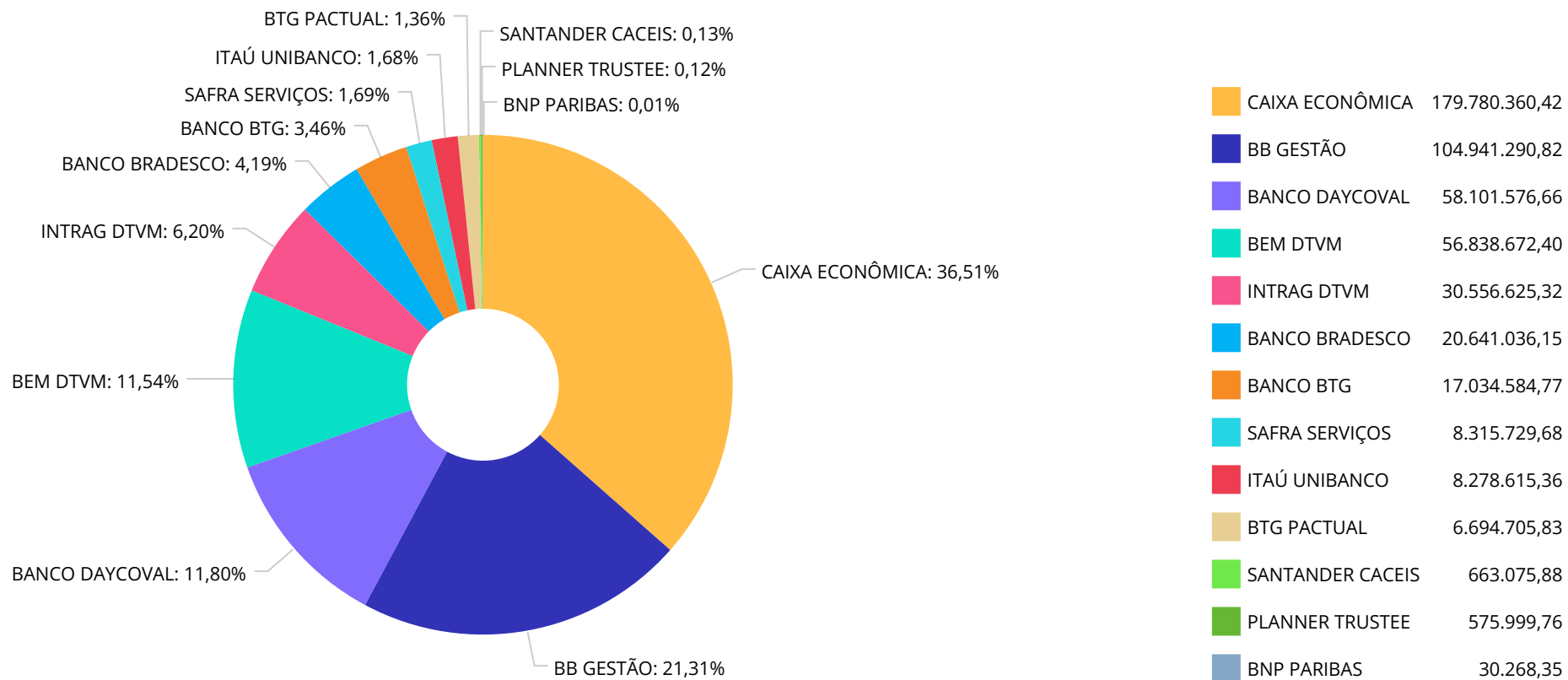
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	22,63%	22,63%	23,53%	-15,58%	-33,86%	-19,23%	15,80%	38,82%
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	1,59%	1,59%	15,54%	5,59%	18,86%	7,31%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1,72%	1,72%	17,05%	9,04%	27,92%	32,08%	5,17%	12,83%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-6,55%	-6,55%	12,50%	-6,30%	6,34%	-10,11%	-	-
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	-8,41%	-8,41%	11,00%	5,92%	26,99%	14,61%	8,33%	20,70%

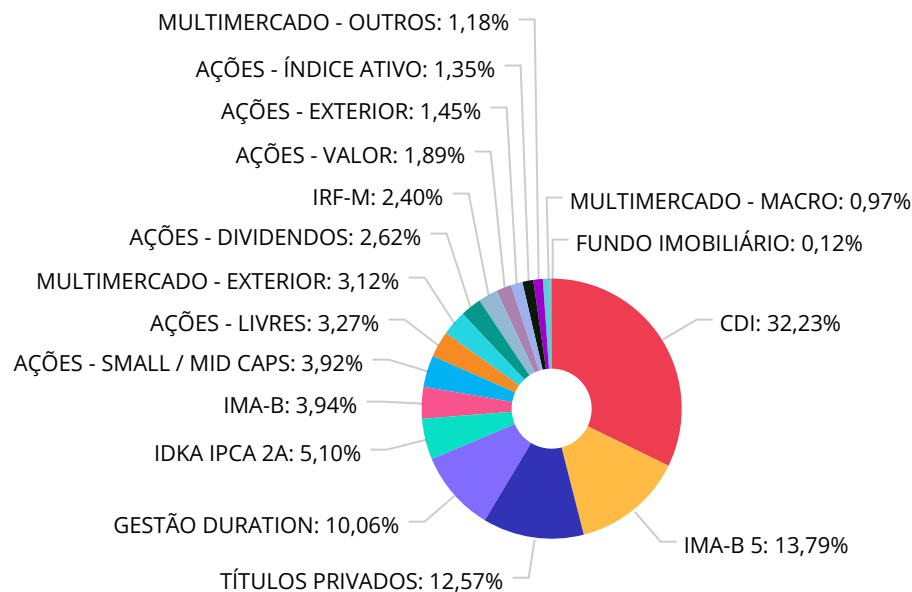
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	4,78%	4,78%	14,72%	12,57%	26,83%	5,62%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,73%	2,73%	11,88%	10,53%	17,61%	-4,90%	6,29%	13,459%
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	3,48%	3,48%	13,39%	9,28%	11,80%	-3,12%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	-0,75%	-0,75%	10,46%	1,79%	-0,20%	-9,53%	6,65%	14,327%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	4,18%	4,18%	14,69%	13,57%	17,84%	7,21%	6,68%	13,956%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO EXTE...	1,36%	1,36%	23,97%	1,53%	15,09%	-12,91%	12,94%	21,784%
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-0,53%	-0,53%	24,10%	9,30%	19,67%	-10,94%	13,83%	24,422%

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



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

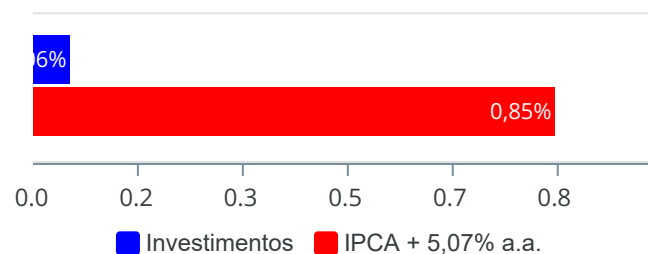


■ CDI	158.731.701,51	■ IMA-B 5	67.931.204,72	■ TÍTULOS PRIVADOS	61.881.639,25	■ GESTÃO DURATION	49.546.100,05
■ IDKA IPCA 2A	25.106.954,93	■ IMA-B	19.406.809,73	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	19.297.377,15	■ AÇÕES - LIVRES	16.091.020,10
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	15.371.832,77	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	12.923.270,82	■ IRF-M	11.837.633,84	■ AÇÕES - VALOR	9.331.261,63
■ AÇÕES - EXTERIOR	7.140.203,63	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.668.411,80	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.812.121,43	■ MULTIMERCADO - MACRO	4.798.998,28
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	575.999,76						

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	493.711.794,42	7.937.647,56	9.511.339,87	492.452.541,40	314.439,29	314.439,29	0,06%	0,06%	0,85%	0,85%	7,45%	1,74%

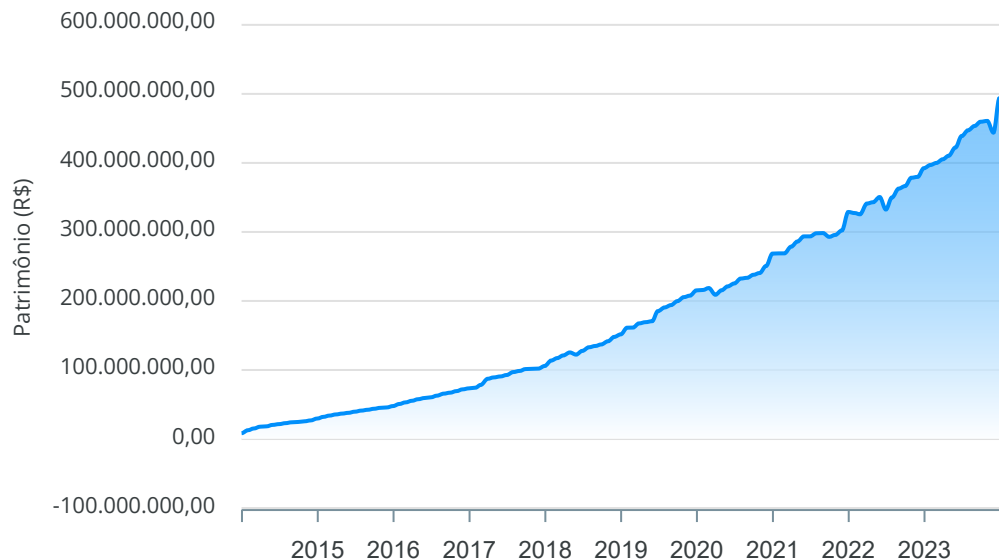
Investimentos x Meta de Rentabilidade





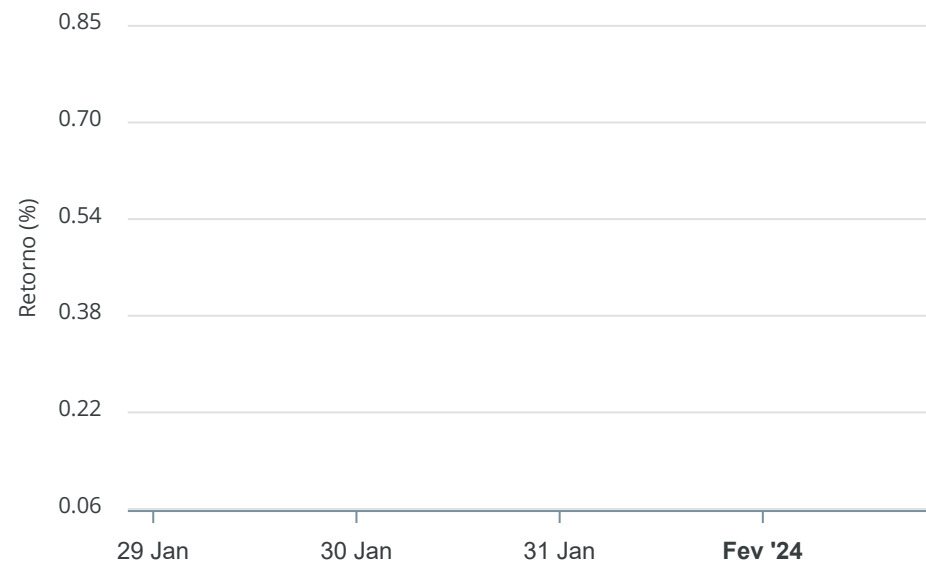
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
LETRA FINANCEIRA BTG	16.845.889,03	0,00	0,00	17.034.584,77	188.695,74	1,12%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	44.351.910,04	0,00	0,00	44.847.054,48	495.144,44	1,12%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.762.611,11	0,00	0,00	23.014.565,55	251.954,44	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.891.435,02	0,00	0,00	8.989.754,58	98.319,56	1,11%	1,11%	0,33%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.419.143,84	0,00	0,00	20.641.036,15	221.892,31	1,09%	1,09%	0,07%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	41.058.008,49	0,00	0,00	41.480.728,61	422.720,12	1,03%	1,03%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	76.538.580,17	0,00	3.600,00	77.305.494,70	770.514,53	1,01%	1,01%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	611.319,15	0,00	0,00	616.510,26	5.191,11	0,85%	0,85%	0,07%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	30.311.073,26	0,00	0,00	30.556.625,32	245.552,06	0,81%	0,81%	0,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	17.026.802,57	0,00	0,00	17.151.006,52	124.203,95	0,73%	0,73%	0,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.899.715,71	0,00	0,00	7.955.948,41	56.232,70	0,71%	0,71%	0,57%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	26.918.374,28	1.690.536,52	9.507.739,87	19.304.442,05	203.271,12	0,71%	0,88%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.889.006,75	0,00	0,00	5.928.561,06	39.554,31	0,67%	0,67%	0,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.934.952,50	0,00	0,00	22.080.575,47	145.622,97	0,66%	0,66%	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	22.686.285,26	0,00	0,00	22.836.063,70	149.778,44	0,66%	0,66%	0,55%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.870.433,73	0,00	0,00	5.909.072,78	38.639,05	0,66%	0,66%	0,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.028.654,15	0,00	0,00	10.094.349,11	65.694,96	0,66%	0,66%	0,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	8.239.435,10	0,00	0,00	8.278.615,36	39.180,26	0,48%	0,48%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.465.747,50	0,00	0,00	10.417.055,15	-48.692,35	-0,47%	-0,47%	1,27%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>398.749.377,66</b>	<b>1.690.536,52</b>	<b>9.511.339,87</b>	<b>394.442.044,03</b>	<b>3.513.469,72</b>	<b>0,88%</b>		<b>0,28%</b>

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 - ...	469.714,09	0,00	0,00	575.999,76	106.285,67	22,63%	22,63%	15,80%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6.581.325,05	0,00	0,00	6.694.705,83	113.380,78	1,72%	1,72%	5,17%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5.207.409,19	0,00	0,00	5.292.181,79	84.772,60	1,63%	1,63%	5,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.774.578,29	0,00	0,00	4.798.998,28	24.419,99	0,51%	0,51%	0,58%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.415.425,07	6.247.111,04	0,00	8.658.577,98	-3.958,13	-0,05%	-1,49%	8,15%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.837.564,52	0,00	0,00	5.812.121,43	-25.443,09	-0,44%	-0,44%	5,95%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	441.227,78	0,00	0,00	433.685,25	-7.542,53	-1,71%	-1,71%	6,58%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.342.538,72	0,00	0,00	10.953.670,04	-388.868,68	-3,43%	-3,43%	6,30%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	783.649,34	0,00	0,00	750.135,91	-33.513,43	-4,28%	-4,28%	6,66%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6.988.834,79	0,00	0,00	6.668.411,80	-320.422,99	-4,58%	-4,58%	5,41%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	31.839,61	0,00	0,00	30.268,35	-1.571,26	-4,93%	-4,93%	5,53%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.178.593,74	0,00	0,00	3.923.260,55	-255.333,19	-6,11%	-6,11%	10,51%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	721.495,70	0,00	0,00	672.683,65	-48.812,05	-6,77%	-6,77%	10,04%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.881.984,90	0,00	0,00	12.923.270,82	-958.714,08	-6,91%	-6,91%	7,30%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	14.446.156,64	0,00	0,00	13.318.514,50	-1.127.642,14	-7,81%	-7,81%	7,33%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	6.528.035,85	0,00	0,00	5.978.862,65	-549.173,20	-8,41%	-8,41%	8,33%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>84.630.373,28</b>	<b>6.247.111,04</b>	<b>0,00</b>	<b>87.485.348,59</b>	<b>-3.392.135,73</b>	<b>-3,73%</b>		<b>6,65%</b>

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
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3.248.981,56	0,00	0,00	3.384.945,15	135.963,59	4,18%	4,18%	6,68%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.943.081,29	0,00	0,00	3.023.547,89	80.466,60	2,73%	2,73%	6,29%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	324.967,41	0,00	0,00	329.371,14	4.403,73	1,36%	1,36%	12,94%
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	335.478,18	0,00	0,00	333.704,74	-1.773,44	-0,53%	-0,53%	13,83%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	3.479.535,04	0,00	0,00	3.453.579,86	-25.955,18	-0,75%	-0,75%	6,65%
<b>Total Exterior</b>	<b>10.332.043,48</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>10.525.148,78</b>	<b>193.105,30</b>	<b>1,87%</b>		<b>6,98%</b>

## 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.

