

# 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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.921.910,06	3,95%	709	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	7.486.643,27	7,54%	884	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.263.415,77	3,29%	795	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	769.760,09	0,78%	99	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.635.878,88	4,67%	1.152	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.780.701,27	4,82%	645	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	613.462,45	0,62%	678	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	3.443.104,04	3,47%	306	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	2.039.319,96	2,05%	209	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	1.027.234,22	1,04%	53	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.089.271,52	11,17%	798	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	9.445.575,40	9,52%	843	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.782.883,22	4,82%	913	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.433.378,76	4,47%	1.191	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.839.293,37	1,85%	452	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.092.597,43	4,12%	220	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	319.316,36	0,32%	1.015	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	5.120.626,44	5,16%	1.139	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.474.608,05	2,49%	149	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.639.150,91	2,66%	116	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

**Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)**

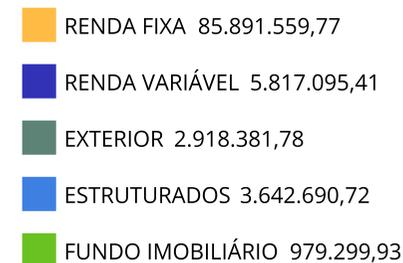
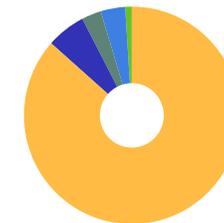
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.852.600,06	1,87%	993	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.510.503,63	3,54%	441	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.403.940,91	1,41%	227	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	Não pos...	Não há	906.383,70	0,91%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.401.192,21	1,41%	536	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	236.507,02	0,24%	5.209	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	172.320,93	0,17%	568	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	771.913,20	0,78%	122	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.346.402,53	1,36%	202	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	479.599,17	0,48%	146	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	720.878,69	0,73%	13.227	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	688.281,66	0,69%	94	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.200.369,42	1,21%	9.869	0,17%	Artigo 9º, Inciso III
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	885.104,52	0,89%	65	0,70%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	608.058,71	0,61%	470	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	224.849,13	0,23%	480	1,03%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.642.690,72	3,67%	4.902	0,25%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	68.947,65	0,07%		0,02%	Artigo 11º
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	102.000,00	0,10%		0,07%	Artigo 11º
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII1...	Não se ...	Não se aplica	808.352,28	0,81%		0,16%	Artigo 11º

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 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>99.249.027,61</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>566.755,15</b>				Artigo 6º
		<b>PL Total</b>	<b>99.815.782,76</b>				

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

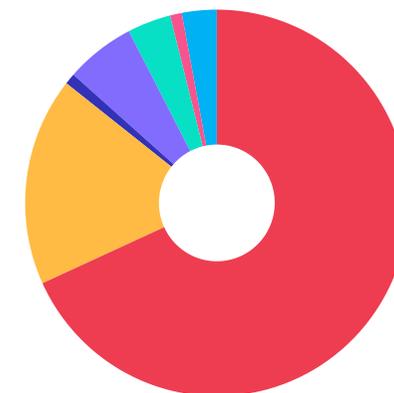
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	40,00%	39.699.611,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	67.664.429,71	68,18%	5,00%	50,00%	90,00%	21.659.695,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	17.320.746,36	17,45%	0,00%	25,00%	60,00%	42.228.670,21
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	19.849.805,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	906.383,70	0,91%	0,00%	1,00%	5,00%	4.056.067,68
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.962.451,38
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>85.891.559,77</b>	<b>86,54%</b>	<b>5,00%</b>	<b>84,00%</b>	<b>220,00%</b>	



**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%	5.817.095,41	5,86%	0,00%	9,00%	30,00%	23.957.612,87
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	9.924.902,76
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.642.690,72	3,67%	0,00%	4,00%	10,00%	6.282.212,04
Artigo 11º	5,00%	979.299,93	0,99%	0,00%	1,00%	2,00%	1.005.680,62
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>10.439.086,06</b>	<b>10,52%</b>	<b>0,00%</b>	<b>14,00%</b>	<b>52,00%</b>	

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%	0,00%	10,00%	9.924.902,76
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.918.381,78	2,94%	0,00%	2,00%	10,00%	7.006.520,98
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>2.918.381,78</b>	<b>2,94%</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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	67.664.429,71	68,18	5,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	17.320.746,36	17,45	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	906.383,70	0,91	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	5.817.095,41	5,86	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	2.918.381,78	2,94	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.642.690,72	3,67	0,00	10,00
Artigo 11º	979.299,93	0,99	0,00	2,00
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	53.685.007,13	54,09	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.136.320,79	33,39	-
BRANCO ASSET MANAGEMENT	4.917.409,15	4,95	0,00
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	4.813.476,12	4,85	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	906.383,70	0,91	1,05
MÉRITO INVESTIMENTOS	808.352,28	0,81	-
META ASSET MANAGEMENT	688.281,66	0,69	0,32
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	224.849,13	0,23	0,00
ZION INVEST	68.947,65	0,07	-

**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
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,42%	2,53%	3,80%	6,64%	12,86%	28,71%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	-26,96%	-26,94%	-27,06%	-27,63%	-29,19%	-31,00%	-	-
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	1,16%	2,59%	4,30%	9,78%	22,13%	0,48%	1,73%
<b>IMA Geral (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,61%	2,51%	5,41%	12,42%	26,44%	0,09%	0,29%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,55%	0,10%	2,85%	3,87%	14,70%	23,81%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,59%	0,10%	2,87%	3,82%	14,79%	23,43%	0,80%	4,06%

**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
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	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%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,10%	2,57%	5,62%	15,44%	26,85%	0,75%	2,33%
<b>Selic (Benchmark)</b>	0,80%	1,78%	2,69%	5,68%	12,74%	27,39%	-	-
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,79%	1,74%	2,63%	5,53%	12,43%	26,63%	0,00%	0,05%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,63%	2,59%	5,52%	14,98%	26,64%	0,04%	1,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	1,78%	2,70%	5,67%	12,75%	27,44%	0,01%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,61%	2,45%	5,17%	11,62%	24,88%	0,01%	0,05%
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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,82%	1,83%	2,79%	5,90%	13,31%	27,98%	0,05%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83%	1,84%	2,78%	5,90%	13,25%	27,96%	0,02%	0,07%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,65%	1,54%	2,54%	4,59%	12,31%	24,71%	0,49%	1,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,21%	2,44%	4,59%	12,70%	25,41%	0,42%	1,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,04%	2,66%	4,80%	15,14%	24,39%	0,49%	2,86%

**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
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	1,03%	2,60%	4,86%	14,72%	25,46%	0,47%	2,04%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,17%	-1,08%	-0,16%	2,20%	-	-	4,98%	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,58%	1,13%	2,85%	1,06%	-	-	0,65%	-

**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
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,56%	1,07%	2,91%	6,54%	13,66%	24,79%	0,47%	3,09%

<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,06%	8,97%	12,09%	13,00%	23,72%	12,07%	7,84%	13,09%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,27%	11,12%	13,99%	15,34%	32,07%	18,33%	8,72%	14,39%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	0,99%	-3,85%	1,33%	11,47%	22,96%	14,03%	-	-
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	1,93%	-2,44%	3,66%	8,12%	14,15%	12,34%	6,31%	15,85%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2,29%	-0,50%	6,12%	13,69%	30,84%	29,10%	6,91%	16,20%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,35%	-4,33%	1,39%	8,74%	19,20%	11,32%	6,60%	15,20%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-0,01%	-8,21%	-2,65%	-1,29%	4,56%	-28,47%	9,01%	23,32%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,81%	0,46%	7,85%	16,62%	17,30%	17,61%	5,38%	14,54%

<b>IBX (Benchmark)</b>	0,96%	-3,59%	1,70%	11,76%	22,23%	12,17%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	0,31%	-4,22%	2,99%	4,53%	1,72%	-11,33%	7,85%	21,04%

<b>IDIV (Benchmark)</b>	0,91%	-2,64%	4,09%	13,07%	26,16%	32,52%	-	-
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,90%	-2,74%	2,62%	11,15%	20,96%	17,73%	6,84%	14,95%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1,80%	-1,33%	4,50%	11,77%	25,83%	22,59%	6,12%	13,24%

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

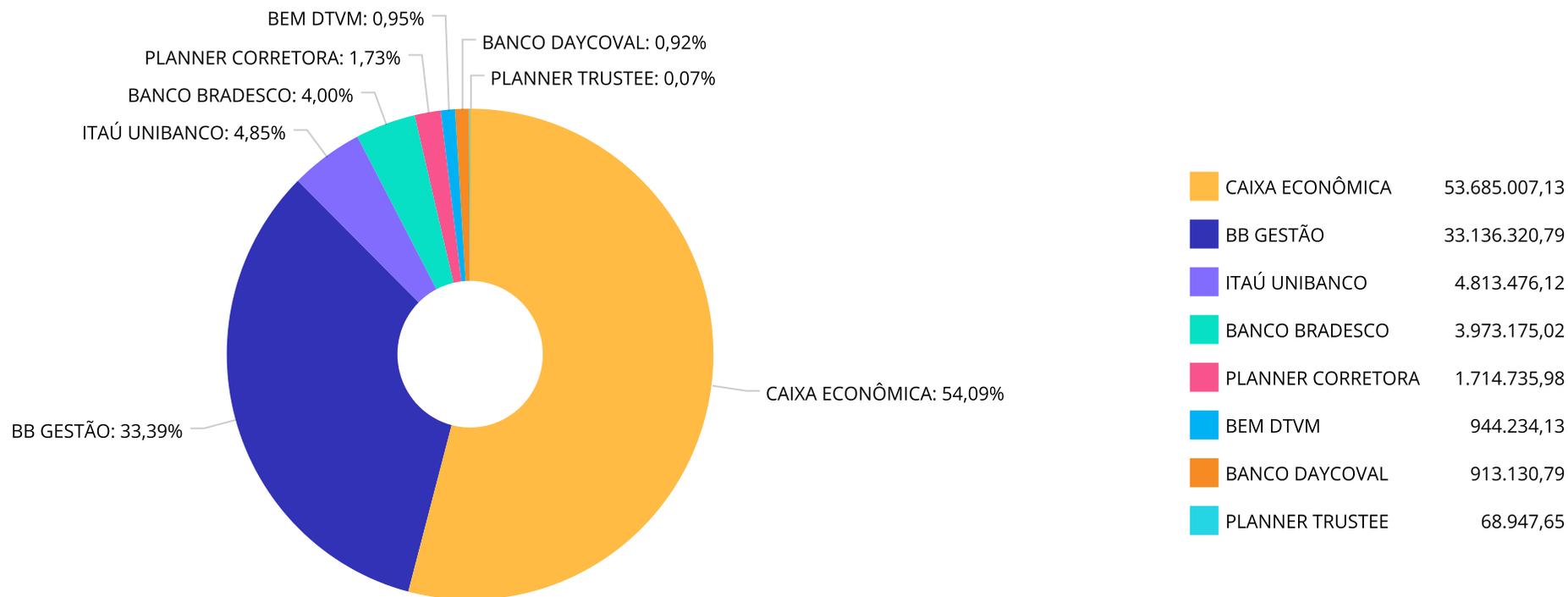
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IFIX (Benchmark)</b>	0,79%	1,47%	5,77%	4,58%	19,64%	22,58%	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	-0,29%	11,37%	15,04%	10,12%	11,40%	-1,16%	7,27%	10,46%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	10,12%	35,04%	31,21%	-2,63%	-17,04%	-30,71%	24,03%	37,92%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	21,00%	27,34%	30,42%	21,43%	65,48%	56,97%	45,15%	34,46%
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	5,66%	9,55%	12,36%	14,14%	21,82%	10,33%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,72%	11,25%	14,54%	15,41%	26,94%	14,21%	8,51%	13,58%

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

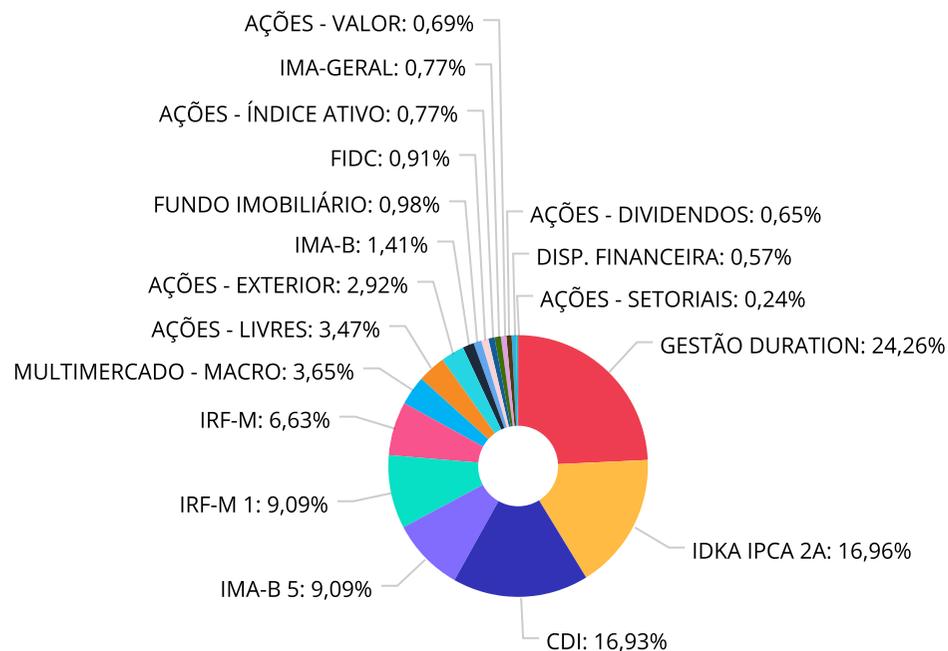
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	5,66%	9,55%	12,36%	14,14%	21,82%	10,33%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,72%	11,25%	14,54%	15,41%	26,94%	14,21%	8,51%	13,584%

<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,27%	11,12%	13,99%	15,34%	32,07%	18,33%	8,72%	14,393%
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,69%	10,22%	13,02%	14,24%	29,45%	17,03%	8,08%	13,735%
BRAPRES INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,06%	8,97%	12,09%	13,00%	23,72%	12,07%	7,84%	13,090%

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



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

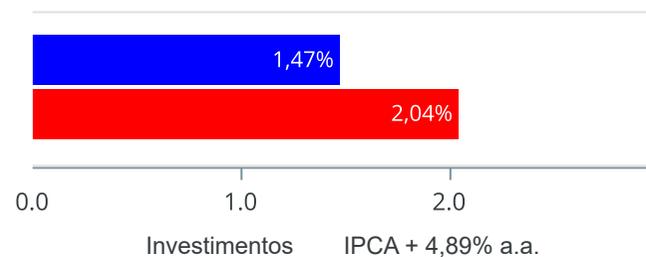


■ GESTÃO DURATION	24.217.537,97	■ IDKA IPCA 2A	16.932.218,67	■ CDI	16.898.932,94	■ IMA-B 5	9.073.533,21
■ IRF-M 1	9.069.257,64	■ IRF-M	6.619.994,64	■ MULTIMERCADO - MACRO	3.642.690,72	■ AÇÕES - LIVRES	3.468.473,43
■ AÇÕES - EXTERIOR	2.918.381,78	■ IMA-B	1.403.940,91	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	979.299,93	■ FIDC	906.383,70
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	771.913,20	■ IMA-GERAL	769.760,09	■ AÇÕES - VALOR	688.281,66	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	651.920,10
■ DISP. FINANCEIRA	566.755,15	■ AÇÕES - SETORIAIS	236.507,02				

**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	97.100.970,85	1.311.815,69	409.763,05	98.633.083,97	630.060,48	630.060,48	0,64%	0,64%	0,84%	0,84%	76,59%	0,98%
Fevereiro	98.633.083,97	1.856.418,56	2.053.737,47	99.249.027,61	813.262,55	1.443.323,03	0,82%	1,47%	1,19%	2,04%	72,09%	1,35%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



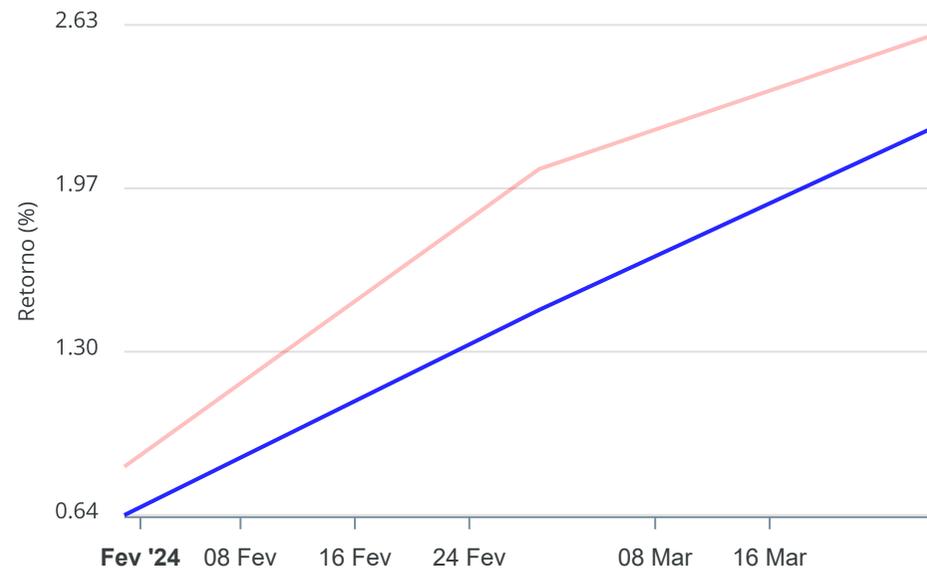
**Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores**

**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 Fevereiro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.837.446,21	0,00	0,00	1.852.600,06	15.153,85	0,82%	0,82%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.481.986,04	0,00	0,00	3.510.503,63	28.517,59	0,82%	0,82%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.510.306,62	570.000,00	0,00	5.120.626,44	40.319,82	0,79%	0,80%	0,01%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	608.683,98	0,00	0,00	613.462,45	4.778,47	0,79%	0,79%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.891.808,03	0,00	0,00	3.921.910,06	30.102,03	0,77%	0,77%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.400.716,39	0,00	0,00	4.433.378,76	32.662,37	0,74%	0,74%	0,09%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.084.622,33	0,00	60.603,10	2.039.319,96	15.300,73	0,73%	-2,17%	4,98%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.032.172,84	570.000,00	0,00	4.635.878,88	33.706,04	0,73%	0,74%	0,09%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.515.690,76	0,00	98.149,16	3.443.104,04	25.562,44	0,73%	-2,06%	4,79%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.622.067,62	0,00	0,00	2.639.150,91	17.083,29	0,65%	0,65%	0,49%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	764.910,69	0,00	0,00	769.760,09	4.849,40	0,63%	0,63%	0,40%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.395.714,04	0,00	0,00	1.403.940,91	8.226,87	0,59%	0,59%	0,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.755.458,10	0,00	0,00	4.782.883,22	27.425,12	0,58%	0,58%	0,41%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.021.354,30	0,00	0,00	1.027.234,22	5.879,92	0,58%	0,58%	0,65%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.244.737,30	0,00	0,00	3.263.415,77	18.678,47	0,58%	0,58%	0,41%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.460.497,89	0,00	0,00	2.474.608,05	14.110,16	0,57%	0,57%	0,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.069.903,67	0,00	0,00	4.092.597,43	22.693,76	0,56%	0,56%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.028.092,63	0,00	0,00	11.089.271,52	61.178,89	0,55%	0,55%	0,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.453.486,76	0,00	0,00	7.486.643,27	33.156,51	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.404.287,95	0,00	0,00	9.445.575,40	41.287,45	0,44%	0,44%	0,48%

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
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.759.858,97	0,00	0,00	4.780.701,27	20.842,30	0,44%	0,44%	0,75%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.831.337,20	0,00	0,00	1.839.293,37	7.956,17	0,43%	0,43%	0,75%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.150.628,07	716.418,56	1.551.608,52	319.316,36	3.878,25	0,21%	0,73%	0,01%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	1.241.014,99	0,00	333.566,29	906.383,70	-1.065,00	-0,09%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>85.566.783,38</b>	<b>1.856.418,56</b>	<b>2.043.927,07</b>	<b>85.891.559,77</b>	<b>512.284,90</b>	<b>0,60%</b>		<b>0,65%</b>

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	84.300,00	0,00	580,00	102.000,00	18.280,00	21,68%	21,84%	45,15%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	62.611,92	0,00	0,00	68.947,65	6.335,73	10,12%	10,12%	24,03%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	701.163,20	0,00	0,00	720.878,69	19.715,49	2,81%	2,81%	5,38%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.316.250,56	0,00	0,00	1.346.402,53	30.151,97	2,29%	2,29%	6,91%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	757.334,86	0,00	0,00	771.913,20	14.578,34	1,92%	1,92%	6,31%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	169.105,08	0,00	0,00	172.320,93	3.215,85	1,90%	1,90%	6,84%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	471.133,31	0,00	0,00	479.599,17	8.465,86	1,80%	1,80%	6,12%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	810.736,80	0,00	9.230,40	808.352,28	6.845,88	0,84%	0,85%	7,27%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.622.412,94	0,00	0,00	3.642.690,72	20.277,78	0,56%	0,56%	0,47%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.396.329,26	0,00	0,00	1.401.192,21	4.862,95	0,35%	0,35%	6,60%
META VALOR FI AÇÕES	686.188,52	0,00	0,00	688.281,66	2.093,14	0,31%	0,31%	7,85%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	236.522,26	0,00	0,00	236.507,02	-15,24	-0,01%	-0,01%	9,01%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>10.314.088,71</b>	<b>0,00</b>	<b>9.810,40</b>	<b>10.439.086,06</b>	<b>134.807,75</b>	<b>1,31%</b>		<b>5,06%</b>

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 AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.124.780,24	0,00	0,00	1.200.369,42	75.589,18	6,72%	6,72%	8,51%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	572.184,46	0,00	0,00	608.058,71	35.874,25	6,27%	6,27%	8,72%
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	212.744,07	0,00	0,00	224.849,13	12.105,06	5,69%	5,69%	8,08%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	842.503,11	0,00	0,00	885.104,52	42.601,41	5,06%	5,06%	7,84%
<b>Total Exterior</b>	<b>2.752.211,88</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.918.381,78</b>	<b>166.169,90</b>	<b>6,04%</b>		<b>8,32%</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.



