

# 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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.040.115,85	3,86%	884	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	2.100.786,77	1,34%	99	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	2.527.396,08	1,62%	315	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	9.921.061,27	6,34%	370	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.831.216,87	1,81%	247	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	10.220.950,83	6,54%	209	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.768.164,31	3,05%	798	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	11.877.980,18	7,59%	843	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.755.485,90	5,60%	56	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.885.896,26	5,04%	913	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.073.250,72	5,16%	775	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	3.150.927,91	2,01%	161	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.185.144,47	4,59%	1.191	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.660.795,99	5,54%	452	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	307.967,87	0,20%	734	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	556.905,91	0,36%	220	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.112.012,87	0,71%	1.860	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	7.568.668,43	4,84%	149	1,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.333.755,25	1,49%	30	1,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.463.633,21	6,05%	449	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

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

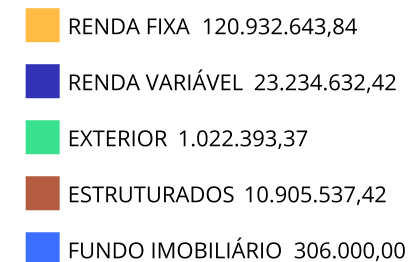
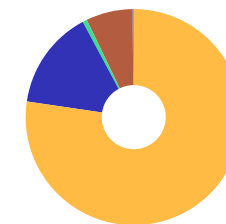
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.563.396,40	2,92%	116	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	949.050,23	0,61%	227	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	78.080,26	0,05%	98	0,27%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	444.404,90	0,28%	2.626	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	2.050.862,52	1,31%	19.668	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.259.046,70	0,81%	1.264	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.191.751,76	1,40%	430	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.822.385,81	1,80%	122	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.531.826,27	1,62%	909	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.809.226,13	2,44%	202	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	263.676,79	0,17%	5.988	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.310.132,99	1,48%	116	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	991.232,95	0,63%	13.227	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	497.187,32	0,32%	16.230	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.390.486,71	0,89%	4.262	0,63%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.672.411,57	1,71%	58	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.022.393,37	0,65%	470	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	828.372,23	0,53%	38.763	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.847.471,11	1,18%	4.902	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.301.051,98	1,47%	112	0,41%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	2.492.629,61	1,59%	583	1,25%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	3.436.012,49	2,20%	20	1,91%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	306.000,00	0,20%		0,21%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>156.401.207,05</b>				

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

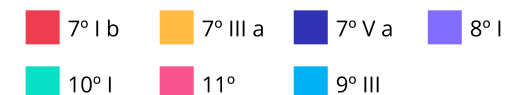
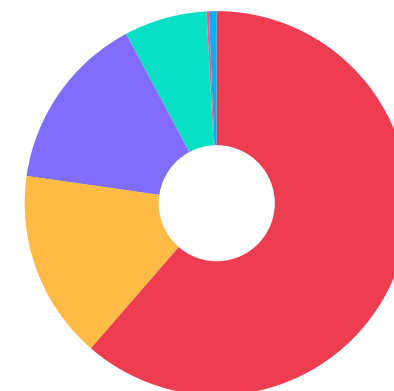
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	46.920.362,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	95.976.060,06	61,37%	35,00%	54,30%	90,00%	44.785.026,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	24.878.503,52	15,91%	5,00%	19,00%	60,00%	68.962.220,71
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	15.640.120,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	78.080,26	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-78.080,26
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	7.820.060,35
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>120.932.643,84</b>	<b>77,32%</b>	<b>40,00%</b>	<b>77,30%</b>	<b>195,00%</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%	23.234.632,42	14,86%	0,00%	15,00%	30,00%	23.685.729,70
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.905.537,42	6,97%	0,00%	7,00%	10,00%	4.734.583,29
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	3.128.024,14
Artigo 11º	5,00%	306.000,00	0,20%	0,00%	0,20%	2,00%	2.822.024,14
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>34.446.169,84</b>	<b>22,02%</b>	<b>0,00%</b>	<b>22,20%</b>	<b>44,00%</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%	5,00%	7.820.060,35
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.022.393,37	0,65%	0,00%	0,50%	5,00%	6.797.666,98
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>1.022.393,37</b>	<b>0,65%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,50%</b>	<b>10,00%</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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	95.976.060,06	61,37	35,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	24.878.503,52	15,91	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	23.234.632,42	14,86	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	1.022.393,37	0,65	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	10.905.537,42	6,97	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 11º	306.000,00	0,20	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	93.283.419,32	59,64	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	27.211.411,33	17,40	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.727.641,42	15,81	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	3.436.012,49	2,20	0,22
TARPON INVESTIMENTOS	2.672.411,57	1,71	-
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	1.548.138,86	0,99	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.390.486,71	0,89	0,02
SICREDI	1.112.012,87	0,71	0,00
PLURAL	497.187,32	0,32	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	444.404,90	0,28	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	78.080,26	0,05	0,09

**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>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	0,46%	1,23%	2,74%	5,73%	16,26%	27,92%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,41%	1,14%	2,61%	5,51%	15,73%	-	0,83%	2,76%

<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%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,59%	1,01%	2,61%	4,65%	13,26%	24,73%	0,42%	2,02%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,08%	2,70%	5,06%	14,00%	25,93%	0,40%	1,76%
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%	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,75%	1,62%	2,53%	5,44%	12,50%	26,62%	0,09%	0,29%
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%

<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%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	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
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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,07%	2,80%	3,78%	14,54%	23,41%	0,79%	3,95%
<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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	1,74%	2,66%	5,58%	12,63%	27,10%	0,05%	0,09%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,80%	1,78%	2,69%	5,65%	12,70%	27,23%	0,01%	0,06%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,18%	-0,93%	-1,41%	-6,97%	-15,09%	-61,85%	0,63%	7,75%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	1,99%	2,95%	6,17%	13,60%	28,88%	0,05%	0,09%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,21%	2,44%	4,59%	12,70%	25,41%	0,42%	1,32%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,65%	1,54%	2,54%	4,59%	12,31%	24,71%	0,49%	1,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,04%	2,66%	4,80%	15,14%	24,39%	0,49%	2,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,87%	2,82%	5,24%	-	-	0,25%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,85%	2,79%	5,19%	10,20%	22,19%	0,25%	1,07%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	1,03%	2,60%	4,86%	14,72%	25,46%	0,47%	2,04%

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
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
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
<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%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,34%	0,56%	2,10%	6,49%	13,16%	25,99%	0,90%	3,54%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	0,52%	2,38%	4,66%	9,58%	20,00%	0,83%	2,43%

<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%	14,39%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	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%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,69%	-2,30%	1,15%	9,19%	10,88%	-	5,42%	6,97%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,24%	-4,06%	5,39%	15,20%	49,41%	60,85%	5,76%	18,38%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	1,31%	-2,31%	2,88%	9,42%	20,20%	7,38%	6,23%	16,37%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	1,93%	-2,44%	3,66%	8,12%	14,15%	12,34%	6,31%	15,85%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,03%	-3,15%	2,54%	10,82%	21,59%	10,73%	6,76%	16,22%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-0,03%	-8,46%	-3,00%	-1,70%	4,35%	-28,34%	9,06%	23,28%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	0,17%	-4,60%	1,23%	8,75%	21,01%	12,55%	6,47%	15,47%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,73%	-3,45%	1,76%	6,61%	17,41%	6,48%	6,41%	15,70%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,81%	0,46%	7,85%	16,62%	17,30%	17,61%	5,38%	14,54%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2,29%	-0,50%	6,12%	13,69%	30,84%	29,10%	6,91%	16,20%

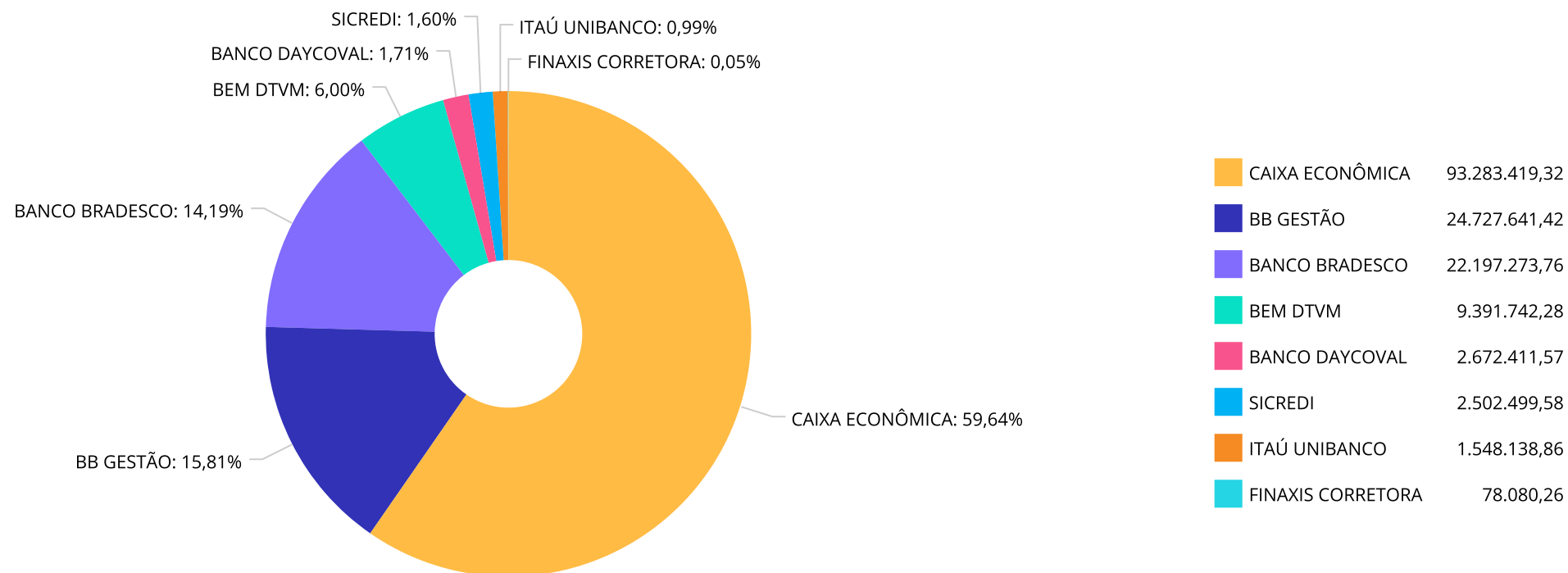
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,58%	-4,01%	1,79%	10,06%	16,96%	4,65%	7,13%	15,73%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	0,79%	1,47%	5,77%	4,58%	19,64%	22,58%	-	-
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>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	5,17%	6,84%	11,57%	13,06%	28,36%	16,23%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5,26%	7,02%	12,45%	14,41%	31,01%	28,35%	5,29%	11,92%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	0,47%	-6,11%	0,51%	1,70%	19,40%	-4,74%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2,05%	-4,97%	0,50%	2,21%	4,28%	-11,93%	8,13%	20,77%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,63%	-1,49%	3,68%	6,16%	16,93%	2,55%	6,31%	16,74%

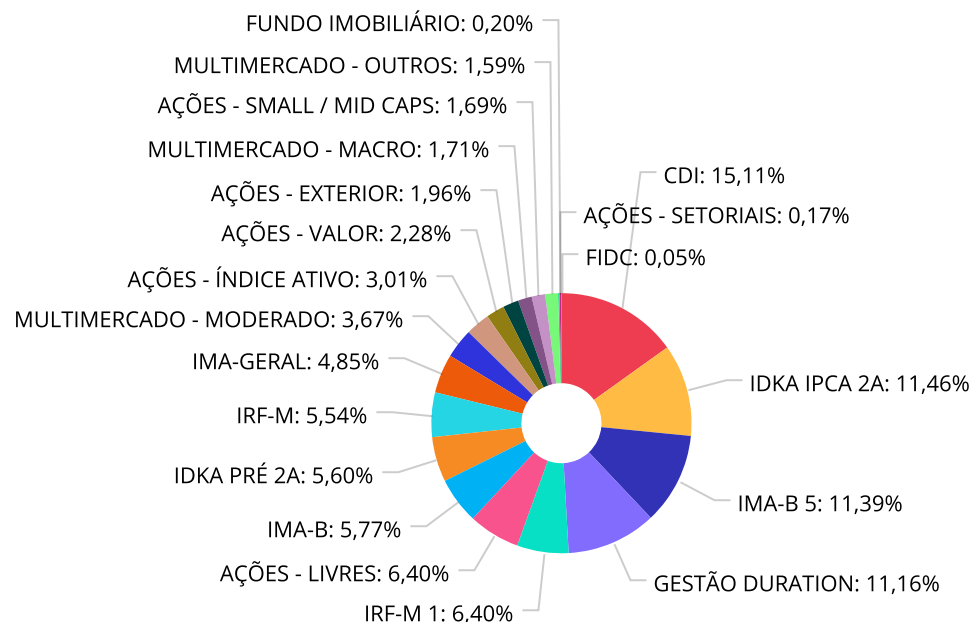
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,27%	11,12%	13,99%	15,34%	32,07%	18,33%	8,72%	14,393%

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



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



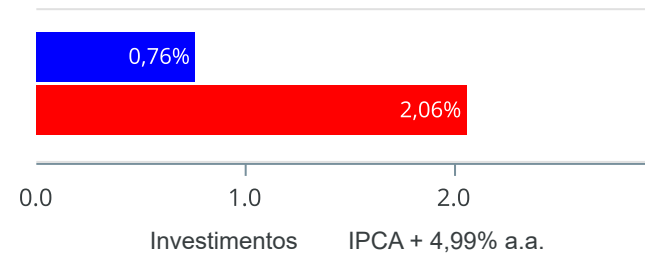
■ CDI	23.631.960,86	■ IDKA IPCA 2A	17.918.096,03	■ IMA-B 5	17.806.957,53	■ GESTÃO DURATION	17.457.135,05
■ IRF-M 1	10.016.361,34	■ AÇÕES - LIVRES	10.004.696,92	■ IMA-B	9.022.300,95	■ IDKA PRÉ 2A	8.755.485,90
■ IRF-M	8.660.795,99	■ IMA-GERAL	7.585.469,93	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.737.064,47	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	4.710.059,84
■ AÇÕES - VALOR	3.569.179,69	■ AÇÕES - EXTERIOR	3.073.255,89	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.675.843,34	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.636.156,66
■ MULTIMERCADO - OUTROS	2.492.629,61	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	306.000,00	■ AÇÕES - SETORIAIS	263.676,79	■ FIDC	78.080,26



**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	153.841.926,53	1.482.661,57	923.770,00	154.226.764,77	-174.053,33	-174.053,33	-0,11%	-0,11%	0,85%	0,85%	-13,30%	1,62%
Fevereiro	154.226.764,77	2.481.759,99	1.661.439,58	156.401.207,05	1.354.121,87	1.180.068,54	0,87%	0,76%	1,20%	2,06%	36,90%	1,98%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

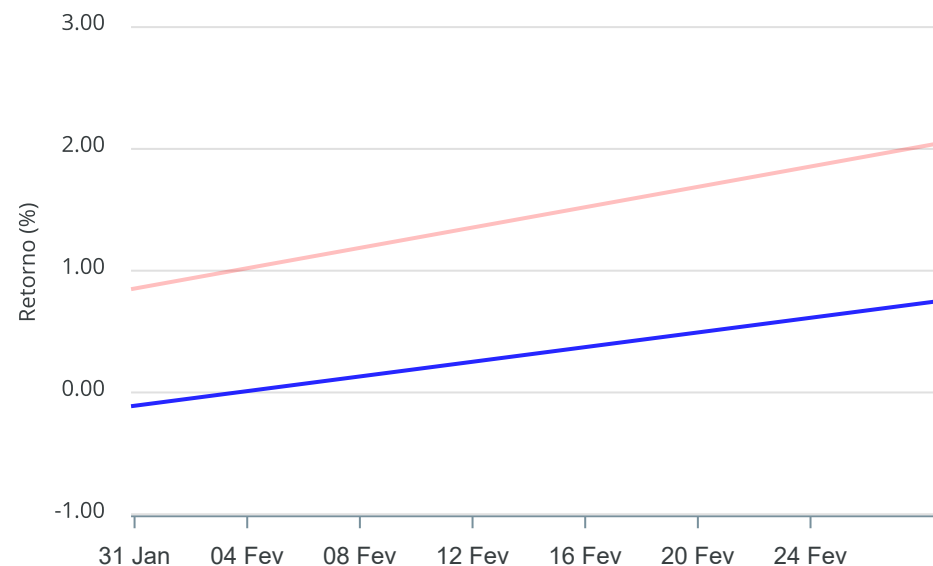


**Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores**

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.379.588,55	0,00	0,00	9.463.633,21	84.044,66	0,90%	0,90%	0,05%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1.103.161,12	0,00	0,00	1.112.012,87	8.851,75	0,80%	0,80%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	305.564,60	0,00	0,00	307.967,87	2.403,27	0,79%	0,79%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.132.208,78	0,00	0,00	7.185.144,47	52.935,69	0,74%	0,74%	0,09%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.751.975,95	58.408,88	0,00	2.831.216,87	20.832,04	0,74%	0,75%	0,09%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.448.003,62	0,00	303.739,14	10.220.950,83	76.686,35	0,73%	-2,17%	4,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.581.760,03	0,00	73.294,86	2.527.396,08	18.930,91	0,73%	0,74%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	10.130.176,74	0,00	282.665,58	9.921.061,27	73.550,11	0,73%	0,73%	0,25%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.533.857,41	0,00	0,00	4.563.396,40	29.538,99	0,65%	0,65%	0,49%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	2.087.552,05	0,00	0,00	2.100.786,77	13.234,72	0,63%	0,63%	0,40%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	3.131.196,05	0,00	0,00	3.150.927,91	19.731,86	0,63%	0,63%	0,40%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	2.319.981,96	0,00	0,00	2.333.755,25	13.773,29	0,59%	0,59%	0,42%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	943.488,95	0,00	0,00	949.050,23	5.561,28	0,59%	0,59%	0,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.840.678,40	0,00	0,00	7.885.896,26	45.217,86	0,58%	0,58%	0,41%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.525.512,11	0,00	0,00	7.568.668,43	43.156,32	0,57%	0,57%	0,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	553.817,82	0,00	0,00	556.905,91	3.088,09	0,56%	0,56%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.741.858,63	0,00	0,00	4.768.164,31	26.305,68	0,55%	0,55%	0,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.274.211,81	1.760.000,00	0,00	8.073.250,72	39.038,91	0,49%	0,54%	0,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.650.635,47	363.351,11	0,00	6.040.115,85	26.129,27	0,43%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.623.332,26	0,00	0,00	8.660.795,99	37.463,73	0,43%	0,43%	0,75%

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 IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	8.420.528,27	300.000,00	0,00	8.755.485,90	34.957,63	0,40%	0,41%	0,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.827.099,62	0,00	1.000.000,00	11.877.980,18	50.880,56	0,40%	0,44%	0,48%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	78.224,04	0,00	0,00	78.080,26	-143,78	-0,18%	-0,18%	0,63%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>119.384.414,24</b>	<b>2.481.759,99</b>	<b>1.659.699,58</b>	<b>120.932.643,84</b>	<b>726.169,19</b>	<b>0,60%</b>		<b>0,82%</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	252.900,00	0,00	1.740,00	306.000,00	54.840,00	21,68%	21,84%	45,15%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.948.390,81	0,00	0,00	2.050.862,52	102.471,71	5,26%	5,26%	5,29%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	964.123,47	0,00	0,00	991.232,95	27.109,48	2,81%	2,81%	5,38%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.723.920,55	0,00	0,00	3.809.226,13	85.305,58	2,29%	2,29%	6,91%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.613.912,64	0,00	0,00	2.672.411,57	58.498,93	2,24%	2,24%	5,76%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.147.712,91	0,00	0,00	2.191.751,76	44.038,85	2,05%	2,05%	8,13%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.769.082,28	0,00	0,00	2.822.385,81	53.303,53	1,92%	1,92%	6,31%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	437.266,17	0,00	0,00	444.404,90	7.138,73	1,63%	1,63%	6,31%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	490.742,64	0,00	0,00	497.187,32	6.444,68	1,31%	1,31%	6,23%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	2.461.120,95	0,00	0,00	2.492.629,61	31.508,66	1,28%	1,28%	5,62%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.286.592,30	0,00	0,00	2.310.132,99	23.540,69	1,03%	1,03%	6,76%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.513.614,65	0,00	0,00	2.531.826,27	18.211,62	0,72%	0,72%	6,41%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3.412.454,53	0,00	0,00	3.436.012,49	23.557,96	0,69%	0,69%	5,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.251.744,42	0,00	0,00	1.259.046,70	7.302,28	0,58%	0,58%	7,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.837.186,79	0,00	0,00	1.847.471,11	10.284,32	0,56%	0,56%	0,47%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	824.285,48	0,00	0,00	828.372,23	4.086,75	0,50%	0,50%	0,83%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.293.294,92	0,00	0,00	2.301.051,98	7.757,06	0,34%	0,34%	0,90%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.388.165,74	0,00	0,00	1.390.486,71	2.320,97	0,17%	0,17%	6,47%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	263.765,07	0,00	0,00	263.676,79	-88,28	-0,03%	-0,03%	9,06%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>33.880.276,32</b>	<b>0,00</b>	<b>1.740,00</b>	<b>34.446.169,84</b>	<b>567.633,52</b>	<b>1,68%</b>		<b>5,86%</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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	962.074,21	0,00	0,00	1.022.393,37	60.319,16	6,27%	6,27%	8,72%
<b>Total Exterior</b>	<b>962.074,21</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.022.393,37</b>	<b>60.319,16</b>	<b>6,27%</b>		<b>8,72%</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.





