

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
TÍTULOS PÚBLICOS			36.829.447,43	17,67%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	4.182.989,92	2,01%	315	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.210.031,08	1,54%	199	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.603.540,69	0,77%	370	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	4.005.577,99	1,92%	230	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	2.609.893,75	1,25%	207	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	730.875,67	0,35%	83	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	16.391.291,15	7,86%	110	1,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	516.143,50	0,25%	791	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.654.363,67	2,71%	850	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.668.983,98	6,08%	52	4,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	18.597.223,17	8,92%	914	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.140.481,94	0,55%	284	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.915.241,20	2,36%	1.190	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.526.543,85	2,17%	251	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.087.385,84	2,44%	728	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	0,01	0,00%	13.451	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	891.587,49	0,43%	26	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	399.041,75	0,19%	129	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	483.339,39	0,23%	401	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

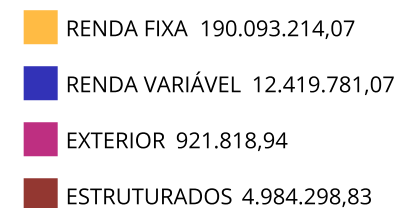
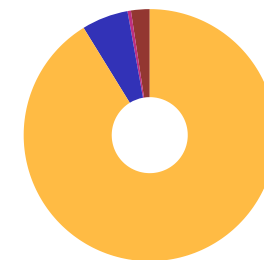
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	138.869,46	0,07%	1.134	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.733.197,51	3,23%	447	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA...	D+1 du	Não há	725.471,44	0,35%	34	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENC...	D+0	Não há	312.570,90	0,15%	10.725	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	78.345,55	0,04%	363	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	42.994.511,63	20,63%	989	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.565,36	0,00%	397	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	640.972,70	0,31%	99	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	622.809,76	0,30%	459	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info	Não se aplica	3.361.024,35	1,61%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	2.788.485,02	1,34%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	3.947.677,69	1,89%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SAFRA	S/Info	Não se aplica	2.194.843,35	1,05%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info	Não se aplica	1.102.885,88	0,53%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	704.355,57	0,34%	2.611	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.308.813,90	0,63%	2.105	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	7.988.347,15	3,83%	918	1,27%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	333.090,20	0,16%	83	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+23	Não há	314.901,92	0,15%	44	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.143.120,38	0,55%	13.510	0,08%	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
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	288.756,33	0,14%	1.081	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	338.395,62	0,16%	55	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	314.929,41	0,15%	9.842	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	323.342,55	0,16%	468	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	283.546,98	0,14%	340	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	25 Meses	2.390.605,39	1,15%	103	4,70%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	1.092.200,74	0,52%	155	0,90%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC M...	D+2	Não há	526.172,60	0,25%	460	0,87%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	975.320,10	0,47%	6.694	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			208.419.112,91				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			0,07				Artigo 6º
PL Total			208.419.112,98				

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

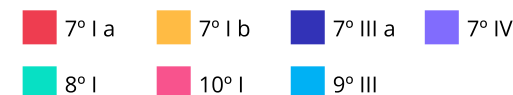
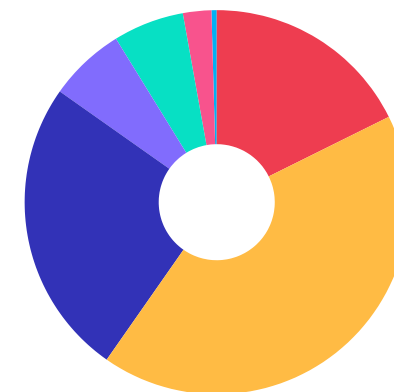
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	36.829.447,43	17,67%	0,00%	15,00%	100,00%	171.589.665,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	87.614.536,04	42,04%	40,00%	30,00%	100,00%	120.804.576,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	52.254.314,31	25,07%	20,00%	30,00%	60,00%	72.797.153,44
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	13.394.916,29	6,43%	0,00%	10,00%	20,00%	28.288.906,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.420.955,65
Total Renda Fixa	100,00%	190.093.214,07	91,21%	60,00%	85,00%	285,00%	



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%	12.419.781,07	5,96%	0,00%	5,00%	10,00%	8.422.130,22
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.420.955,65
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.984.298,83	2,39%	0,00%	4,00%	10,00%	15.857.612,46
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.420.955,65
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	17.404.079,90	8,35%	0,00%	9,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.420.955,65
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.420.955,65
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	921.818,94	0,44%	0,00%	1,00%	10,00%	19.920.092,35
Total Exterior	10,00%	921.818,94	0,44%	0,00%	1,00%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	52.254.314,31	25,07	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ASSET	133.212.851,43	63,92	0,53
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	36.829.447,43	17,67	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.154.716,13	4,87	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.733.197,51	3,23	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.947.677,69	1,89	-
BANCO BRADESCO	3.361.024,35	1,61	0,00
BANCO BTG PACTUAL	2.788.485,02	1,34	0,00
BANCO SAFRA	2.194.843,35	1,05	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.106.560,36	1,01	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.034.285,34	0,98	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	1.574.176,22	0,76	-
BANCO SANTANDER	1.102.885,88	0,53	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	622.809,76	0,30	0,00
SICREDI	483.339,39	0,23	0,00
TARPON INVESTIMENTOS	338.395,62	0,16	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	333.090,20	0,16	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	312.570,90	0,15	0,00
OCCAM BRASIL	288.756,33	0,14	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
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	0,85%	2,51%	4,53%	9,73%	21,87%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	0,55%	1,94%	0,87%	6,56%	-	0,82%	5,05%
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,76%	0,76%	5,03%	6,12%	17,00%	27,97%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,73%	0,73%	5,03%	5,95%	16,48%	-	0,82%	2,90%
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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,60%	0,60%	5,55%	6,14%	18,37%	28,70%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	0,59%	5,52%	6,01%	18,02%	27,84%	1,08%	3,56%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,47%	-1,47%	5,89%	1,54%	19,03%	23,38%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,46%	-1,46%	5,87%	1,60%	18,68%	22,73%	2,01%	6,40%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,77%	5,92%	12,95%	27,12%	-	-
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%	-	-
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%

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
IMA-B (Benchmark)	-0,45%	-0,45%	4,97%	2,91%	15,53%	23,80%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,51%	-0,51%	5,02%	2,75%	15,39%	23,35%	1,31%	4,28%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	-0,57%	-0,57%	5,06%	2,69%	15,44%	23,90%	1,34%	4,33%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,35%	-0,35%	4,71%	-0,23%	8,56%	9,03%	1,36%	5,95%
CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,95%	2,78%	5,94%	12,79%	27,22%	0,02%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,89%	0,89%	2,65%	5,37%	12,41%	27,77%	0,20%	0,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01%	1,01%	2,98%	6,53%	13,43%	28,71%	0,02%	0,11%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04%	1,04%	2,96%	6,45%	13,33%	28,24%	0,04%	0,09%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	0,95%	2,75%	5,95%	12,67%	26,98%	0,01%	0,05%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,75%	0,75%	2,16%	4,67%	9,99%	20,98%	0,00%	0,04%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,04%	6,56%	13,58%	28,79%	0,07%	0,09%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,88%	0,88%	2,55%	5,51%	11,49%	23,72%	0,00%	0,03%
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,96%	0,96%	2,77%	5,97%	12,70%	26,98%	0,00%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,00%	1,00%	2,92%	6,34%	13,22%	27,95%	0,01%	0,07%
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%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,95%	0,95%	2,75%	5,92%	12,61%	26,74%	0,00%	0,04%

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
IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	2,84%	5,37%	10,86%	22,58%	0,33%	1,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,33%	4,67%	13,16%	25,72%	0,46%	1,30%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA SAFRA	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,12%	2,87%	5,42%	-	-	0,33%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	0,55%	4,88%	3,78%	12,92%	-	0,82%	3,05%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,84%	0,84%	3,23%	4,84%	12,79%	-	0,33%	1,12%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	1,12%	2,87%	2,45%	-	-	0,33%	-

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
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%

Ibovespa (Benchmark)	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	-1,49%	-1,49%	7,38%	5,05%	-	-	2,32%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	-0,36%	-0,36%	12,78%	7,82%	14,57%	8,81%	2,03%	8,37%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,70%	-4,70%	13,62%	1,68%	5,61%	13,17%	4,96%	15,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,29%	-2,29%	18,75%	7,82%	6,33%	13,01%	5,84%	14,95%
OCCAM FIC AÇÕES	-3,79%	-3,79%	11,66%	3,54%	8,37%	9,26%	5,54%	15,39%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-6,16%	-6,16%	11,40%	10,28%	42,45%	65,16%	10,56%	18,94%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,49%	-1,49%	14,31%	8,75%	40,63%	37,57%	8,15%	18,51%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,15%	-4,15%	11,76%	0,85%	8,47%	4,31%	6,58%	16,00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,37%	-3,37%	13,39%	1,81%	6,94%	1,60%	7,28%	17,28%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	-1,08%	-1,08%	6,86%	6,03%	10,16%	9,61%	1,99%	3,96%

IDIV (Benchmark)	-3,51%	-3,51%	14,18%	8,88%	15,58%	28,28%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,73%	-1,73%	16,81%	3,51%	19,32%	20,15%	7,01%	15,17%

MSCI ACWI (Benchmark)	2,86%	2,86%	12,43%	7,98%	9,50%	-5,80%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,69%	1,69%	16,97%	8,77%	27,17%	25,92%	5,15%	12,84%

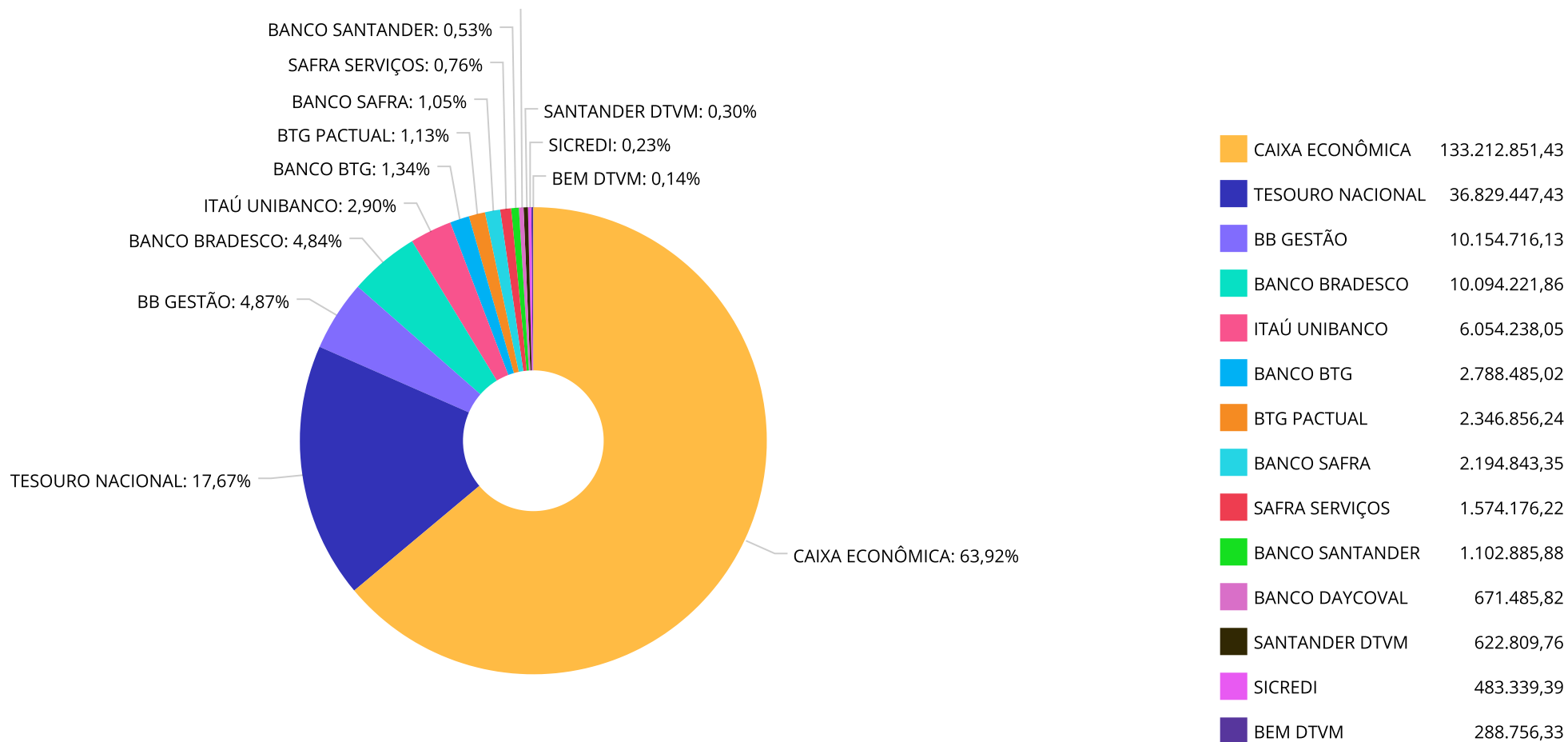
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,67%	3,67%	13,51%	10,12%	14,54%	-3,02%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,25%	4,25%	13,79%	11,10%	19,31%	0,78%	5,46%	13,43%

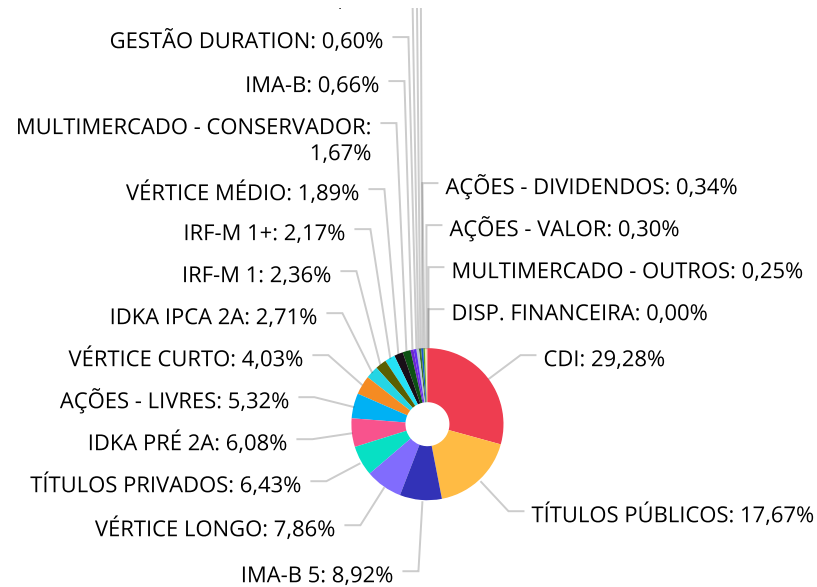
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,67%	3,67%	13,51%	10,12%	14,54%	-3,02%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,25%	4,25%	13,79%	11,09%	19,31%	0,78%	5,46%	13,425%
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%
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%

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



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



CDI	61.020.848,46	TÍTULOS PÚBLICOS	36.829.447,43	IMA-B 5	18.597.223,17
VÉRTICE LONGO	16.391.291,15	TÍTULOS PRIVADOS	13.394.916,29	IDKA PRÉ 2A	12.668.983,98
AÇÕES - LIVRES	11.093.578,97	VÉRTICE CURTO	8.396.424,36	IDKA IPCA 2A	5.654.363,67
IRF-M 1	4.915.241,20	IRF-M 1+	4.526.543,85	VÉRTICE MÉDIO	3.940.906,75
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	3.482.806,13	IMA-B	1.374.926,88	GESTÃO DURATION	1.241.614,94
IMA-B 5+	1.140.481,94	MULTIMERCADO - EXTERIOR	975.320,10	BDR NÍVEL I	921.818,94
AÇÕES - DIVIDENDOS	704.355,57	AÇÕES - VALOR	621.846,53	MULTIMERCADO - OUTROS	526.172,60
DISP. FINANCEIRA	0,07				

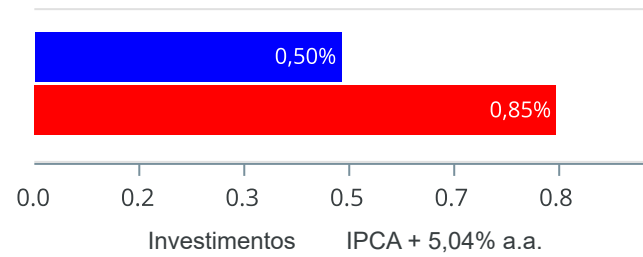
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	24/08/2022	2.443	4093,115400	4.303,658212	9.999.480,92	10.513.837,01	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	07/06/2022	3.600	4.135,37157300	4.395,315214	14.887.337,66	15.823.134,77	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	29/03/2023	2.419	4.132,9683	4.344,277878	9.997.650,32	10.508.808,18	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

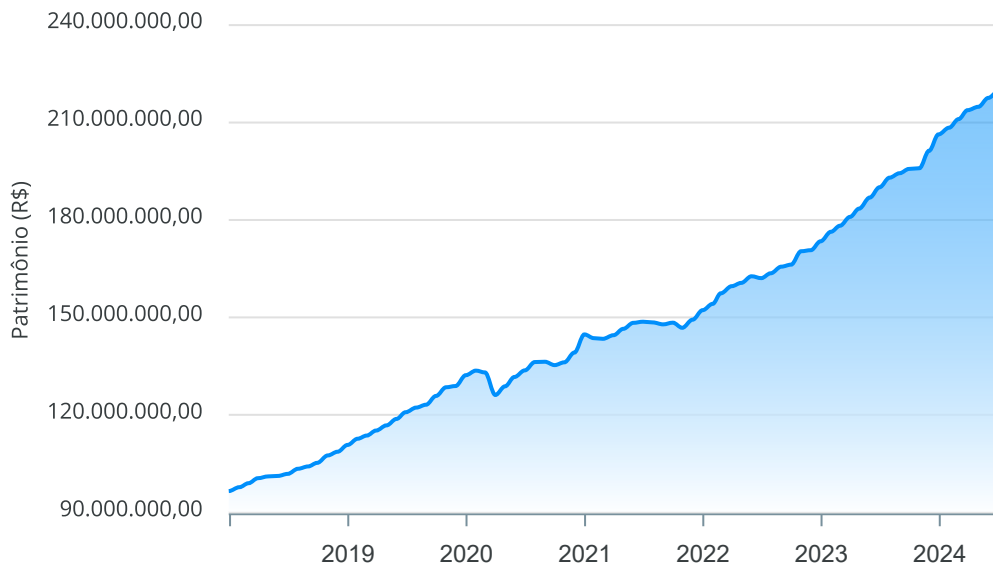
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	206.350.303,76	3.334.294,40	2.301.696,15	208.419.112,91	1.036.210,90	1.036.210,90	0,50%	0,50%	0,85%	0,85%	58,65%	1,04%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



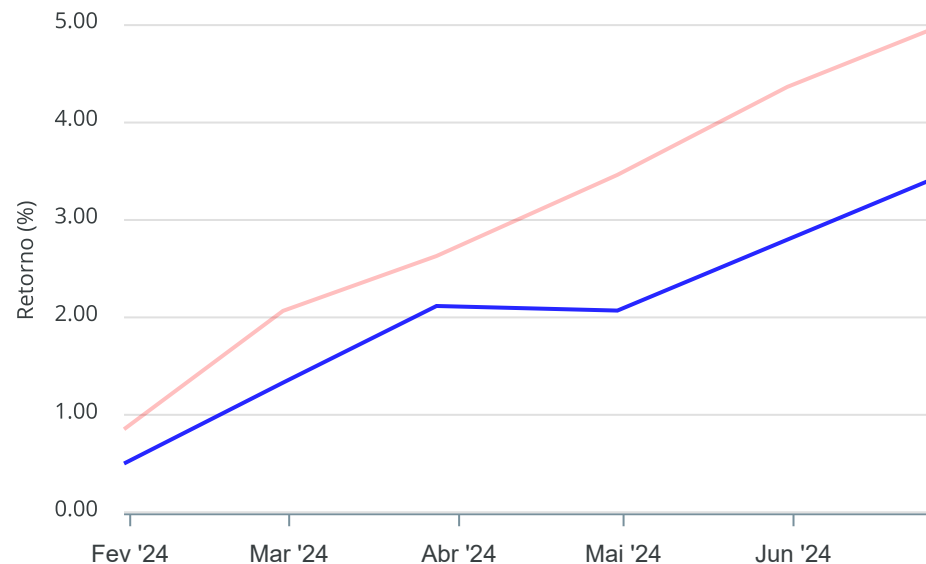
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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	2.757.178,94	0,00	0,00	2.788.485,02	31.306,08	1,14%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	4.136.819,97	0,00	0,00	4.182.989,92	46.169,95	1,12%	1,12%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.581.106,01	0,00	0,00	2.609.893,75	28.787,74	1,12%	1,12%	0,33%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	3.904.363,78	0,00	0,00	3.947.677,69	43.313,91	1,11%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.585.980,39	0,00	0,00	1.603.540,69	17.560,30	1,11%	1,11%	0,33%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	3.324.777,59	0,00	0,00	3.361.024,35	36.246,76	1,09%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.660.815,26	0,00	0,00	6.733.197,51	72.382,25	1,09%	1,09%	0,07%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	616.395,40	0,00	0,00	622.809,76	6.414,36	1,04%	1,04%	0,04%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	1.091.628,82	0,00	0,00	1.102.885,88	11.257,06	1,03%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	36.454.862,52	0,00	0,00	36.829.447,43	374.584,91	1,03%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.489,90	0,00	0,00	7.565,36	75,46	1,01%	1,01%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	43.675.773,38	1.107.905,05	2.225.890,00	42.994.511,63	436.723,20	0,98%	1,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	137.539,81	0,00	0,00	138.869,46	1.329,65	0,97%	0,97%	0,01%
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIA...	309.611,65	0,00	0,00	312.570,90	2.959,25	0,96%	0,96%	0,00%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	395.283,23	0,00	0,00	399.041,75	3.758,52	0,95%	0,95%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.039.488,66	0,00	0,00	5.087.385,84	47.897,18	0,95%	0,95%	0,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	3.968.028,94	0,00	0,00	4.005.577,99	37.549,05	0,95%	0,95%	0,00%
LETRA FINANCEIRA SAFRA	2.174.832,13	0,00	0,00	2.194.843,35	20.011,22	0,92%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.870.825,05	0,00	0,00	4.915.241,20	44.416,15	0,91%	0,91%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	635.333,95	0,00	0,00	640.972,70	5.638,75	0,89%	0,89%	0,20%

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
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	719.456,60	0,00	0,00	725.471,44	6.014,84	0,84%	0,84%	0,33%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	10.480.755,80	2.094.981,11	0,00	12.668.983,98	93.247,07	0,74%	0,73%	0,82%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.600.283,40	13.169,58	0,00	5.654.363,67	40.910,69	0,73%	0,73%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.455.958,10	18.738,65	0,00	18.597.223,17	122.526,42	0,66%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	512.784,39	0,00	0,00	516.143,50	3.359,11	0,66%	0,66%	0,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.500.103,20	0,00	0,00	4.526.543,85	26.440,65	0,59%	0,59%	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.192.456,39	0,00	0,00	3.210.031,08	17.574,69	0,55%	0,55%	0,82%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	726.882,27	0,00	0,00	730.875,67	3.993,40	0,55%	0,55%	0,82%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	54.186,67	99.500,00	75.806,15	78.345,55	465,03	0,30%	0,88%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	0,01	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,75%	0,00%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.448.711,56	0,00	0,00	16.391.291,15	-57.420,41	-0,35%	-0,35%	1,36%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	485.830,38	0,00	0,00	483.339,39	-2.490,99	-0,51%	-0,51%	1,31%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	896.716,03	0,00	0,00	891.587,49	-5.128,54	-0,57%	-0,57%	1,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.157.348,15	0,00	0,00	1.140.481,94	-16.866,21	-1,46%	-1,46%	2,01%
Total Renda Fixa	187.559.608,32	3.334.294,40	2.301.696,15	190.093.214,07	1.501.007,50	0,80%		0,45%

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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	959.155,31	0,00	0,00	975.320,10	16.164,79	1,69%	1,69%	5,15%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	2.399.205,31	0,00	0,00	2.390.605,39	-8.599,92	-0,36%	-0,36%	2,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MUL...	531.895,25	0,00	0,00	526.172,60	-5.722,65	-1,08%	-1,08%	1,99%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	1.108.660,79	0,00	0,00	1.092.200,74	-16.460,05	-1,48%	-1,48%	2,32%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	338.129,29	0,00	0,00	333.090,20	-5.039,09	-1,49%	-1,49%	8,15%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	716.784,99	0,00	0,00	704.355,57	-12.429,42	-1,73%	-1,73%	7,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.169.865,13	0,00	0,00	1.143.120,38	-26.744,75	-2,29%	-2,29%	5,84%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.354.439,82	0,00	0,00	1.308.813,90	-45.625,92	-3,37%	-3,37%	7,28%
OCCAM FIC AÇÕES	300.140,31	0,00	0,00	288.756,33	-11.383,98	-3,79%	-3,79%	5,54%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8.334.054,06	0,00	0,00	7.988.347,15	-345.706,91	-4,15%	-4,15%	6,58%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	330.429,66	0,00	0,00	314.901,92	-15.527,74	-4,70%	-4,70%	4,96%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	360.597,04	0,00	0,00	338.395,62	-22.201,42	-6,16%	-6,16%	10,56%
Total Renda Variável	17.903.356,96	0,00	0,00	17.404.079,90	-499.277,06	-2,79%		5,55%

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	309.238,67	0,00	0,00	323.342,55	14.103,88	4,56%	4,56%	5,69%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	302.098,95	0,00	0,00	314.929,41	12.830,46	4,25%	4,25%	5,46%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	276.000,86	0,00	0,00	283.546,98	7.546,12	2,73%	2,73%	6,29%
Total Exterior	887.338,48	0,00	0,00	921.818,94	34.480,46	3,89%		5,80%