

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
TÍTULOS PÚBLICOS			36.445.234,97	17,27%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	4.094.908,99	1,94%	315	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.228.457,32	1,53%	199	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.570.439,08	0,74%	370	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	4.036.995,58	1,91%	233	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	2.553.176,35	1,21%	209	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	735.064,82	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	16.051.134,30	7,61%	110	1,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	519.006,84	0,25%	798	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.691.688,19	2,70%	843	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.720.400,48	6,03%	56	4,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	19.127.479,93	9,06%	913	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.146.153,90	0,54%	283	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.014.875,71	2,38%	1.191	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.540.707,27	2,15%	252	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.127.398,13	2,43%	734	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	0,01	0,00%	13.442	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	895.856,10	0,42%	26	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	402.233,03	0,19%	123	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	485.948,38	0,23%	381	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

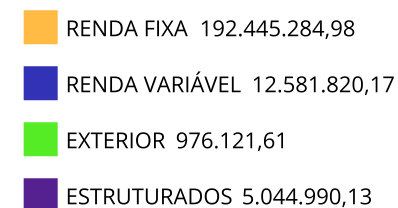
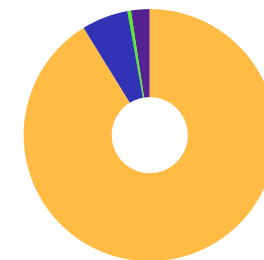
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	304.110,07	0,14%	1.139	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.793.529,51	3,22%	449	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA...	D+1 du	Não há	730.805,84	0,35%	33	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENC...	D+0	Não há	1.067.725,79	0,51%	11.351	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	104.959,58	0,05%	362	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	44.251.755,68	20,97%	993	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.630,80	0,00%	407	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	645.380,79	0,31%	96	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	628.177,15	0,30%	461	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info	Não se aplica	3.392.646,66	1,61%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	2.814.981,68	1,33%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	3.985.181,11	1,89%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SAFRA	S/Info	Não se aplica	2.218.539,67	1,05%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info	Não se aplica	1.112.701,27	0,53%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	722.157,98	0,34%	2.595	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.340.616,80	0,64%	2.045	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	8.046.224,28	3,81%	909	1,28%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	342.762,99	0,16%	87	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+23	Não há	316.746,97	0,15%	44	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.175.262,94	0,56%	13.227	0,08%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	292.079,35	0,14%	1.053	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	345.968,86	0,16%	58	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	336.093,77	0,16%	9.869	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	343.615,16	0,16%	470	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	296.412,68	0,14%	336	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	25 Meses	2.381.893,83	1,13%	121	2,64%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	1.101.754,63	0,52%	155	0,90%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC M...	D+2	Não há	530.449,19	0,25%	460	0,87%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.030.892,48	0,49%	6.935	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			211.048.216,89				

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

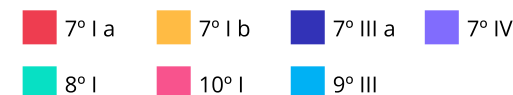
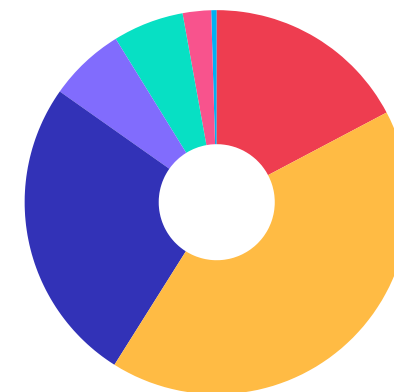
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	36.445.234,97	17,27%	0,00%	15,00%	100,00%	174.602.981,92
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	87.941.924,41	41,67%	40,00%	30,00%	100,00%	123.106.292,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	54.534.075,21	25,84%	20,00%	30,00%	60,00%	72.094.854,92
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	13.524.050,39	6,41%	0,00%	10,00%	20,00%	28.685.592,99
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.552.410,84
Total Renda Fixa	100,00%	192.445.284,98	91,19%	60,00%	85,00%	285,00%	



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%	12.581.820,17	5,96%	0,00%	5,00%	10,00%	8.523.001,52
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.552.410,84
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.044.990,13	2,39%	0,00%	4,00%	10,00%	16.059.831,56
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.552.410,84
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	17.626.810,30	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%	10.552.410,84
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.552.410,84
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	976.121,61	0,46%	0,00%	1,00%	10,00%	20.128.700,08
Total Exterior	10,00%	976.121,61	0,46%	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 '	54.534.075,21	25,84	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	135.055.626,34	63,99	0,54
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	36.445.234,97	17,27	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.256.167,21	4,86	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.793.529,51	3,22	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.985.181,11	1,89	-
BANCO BRADESCO	3.392.646,66	1,61	0,00
BANCO BTG PACTUAL	2.814.981,68	1,33	0,00
BANCO SAFRA	2.218.539,67	1,05	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.145.021,50	1,02	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.071.422,64	0,98	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	1.594.501,81	0,76	-
BANCO SANTANDER	1.112.701,27	0,53	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	1.067.725,79	0,51	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	628.177,15	0,30	0,00
SICREDI	485.948,38	0,23	0,00
TARPON INVESTIMENTOS	345.968,86	0,16	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	342.762,99	0,16	0,00
OCCAM BRASIL	292.079,35	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 Fevereiro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	1,20%	2,06%	3,07%	5,15%	9,72%	21,65%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	1,13%	2,84%	1,05%	5,37%	-	0,65%	4,93%
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	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%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,34%	0,94%	2,69%	5,87%	17,85%	28,53%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	0,90%	2,63%	5,76%	17,51%	27,67%	1,01%	3,37%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,51%	-0,96%	2,94%	3,37%	18,26%	24,00%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	-0,97%	2,93%	3,41%	17,93%	23,32%	1,25%	6,09%
IRF-M 1 (Benchmark)	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%
IMA-B 5 (Benchmark)	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%

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
IMA-B (Benchmark)	0,55%	0,10%	2,85%	3,87%	14,70%	23,81%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,54%	0,02%	2,82%	3,73%	14,59%	23,38%	0,81%	4,09%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,48%	-0,10%	2,67%	3,69%	14,56%	23,86%	0,85%	4,16%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,08%	-2,42%	-0,16%	0,45%	8,27%	9,00%	4,84%	5,66%
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	1,88%	2,85%	6,07%	13,48%	28,56%	0,05%	0,09%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,80%	1,76%	2,66%	5,60%	12,55%	27,01%	0,01%	0,05%
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%
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,79%	1,75%	2,66%	5,60%	12,57%	26,99%	0,01%	0,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83%	1,84%	2,78%	5,90%	13,25%	27,96%	0,02%	0,07%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,62%	1,37%	2,07%	4,39%	9,87%	21,04%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,73%	1,61%	2,44%	5,18%	11,42%	23,83%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	1,74%	2,66%	5,58%	12,63%	27,10%	0,05%	0,09%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	1,99%	2,95%	6,17%	13,60%	28,88%	0,05%	0,09%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86%	1,91%	2,87%	5,96%	13,39%	28,29%	0,03%	0,09%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,78%	1,74%	2,63%	5,57%	12,48%	26,81%	0,00%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,69%	1,58%	2,58%	4,99%	12,07%	27,41%	0,17%	0,53%

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
IPCA (Benchmark)	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA SAFRA	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,87%	2,82%	5,24%	-	-	0,25%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	1,13%	2,84%	3,96%	11,66%	-	0,65%	2,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,85%	2,79%	5,19%	10,20%	22,19%	0,25%	1,07%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,21%	2,44%	4,59%	12,70%	25,41%	0,42%	1,32%
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,74%	1,58%	2,70%	4,41%	12,69%	-	0,40%	1,13%
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
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%	14,39%

Ibovespa (Benchmark)	0,99%	-3,85%	1,33%	11,47%	22,96%	14,03%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	0,88%	-0,62%	2,12%	7,47%	-	-	3,09%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	-0,36%	-0,72%	4,52%	11,09%	16,70%	7,89%	2,17%	8,22%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,81%	0,46%	7,85%	16,62%	17,30%	17,61%	5,38%	14,54%
OCCAM FIC AÇÕES	1,15%	-2,69%	2,07%	11,14%	17,16%	9,37%	6,81%	15,12%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,43%	-1,02%	3,76%	12,36%	16,89%	6,29%	6,19%	17,01%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	0,81%	-0,27%	2,11%	6,56%	11,32%	9,84%	2,74%	4,14%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,24%	-4,06%	5,39%	15,20%	49,41%	60,85%	5,76%	18,38%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,73%	-3,45%	1,76%	6,61%	17,41%	6,48%	6,41%	15,70%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,90%	1,37%	4,08%	15,78%	50,26%	48,40%	5,44%	17,72%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,59%	-4,14%	1,86%	8,71%	13,98%	13,18%	7,35%	15,16%

IDIV (Benchmark)	0,91%	-2,64%	4,09%	13,07%	26,16%	32,52%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2,53%	0,75%	8,95%	11,92%	29,22%	25,57%	7,45%	15,04%

MSCI ACWI (Benchmark)	4,79%	7,79%	10,70%	12,33%	15,81%	5,67%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,70%	7,48%	13,06%	16,03%	36,81%	35,94%	5,27%	12,36%

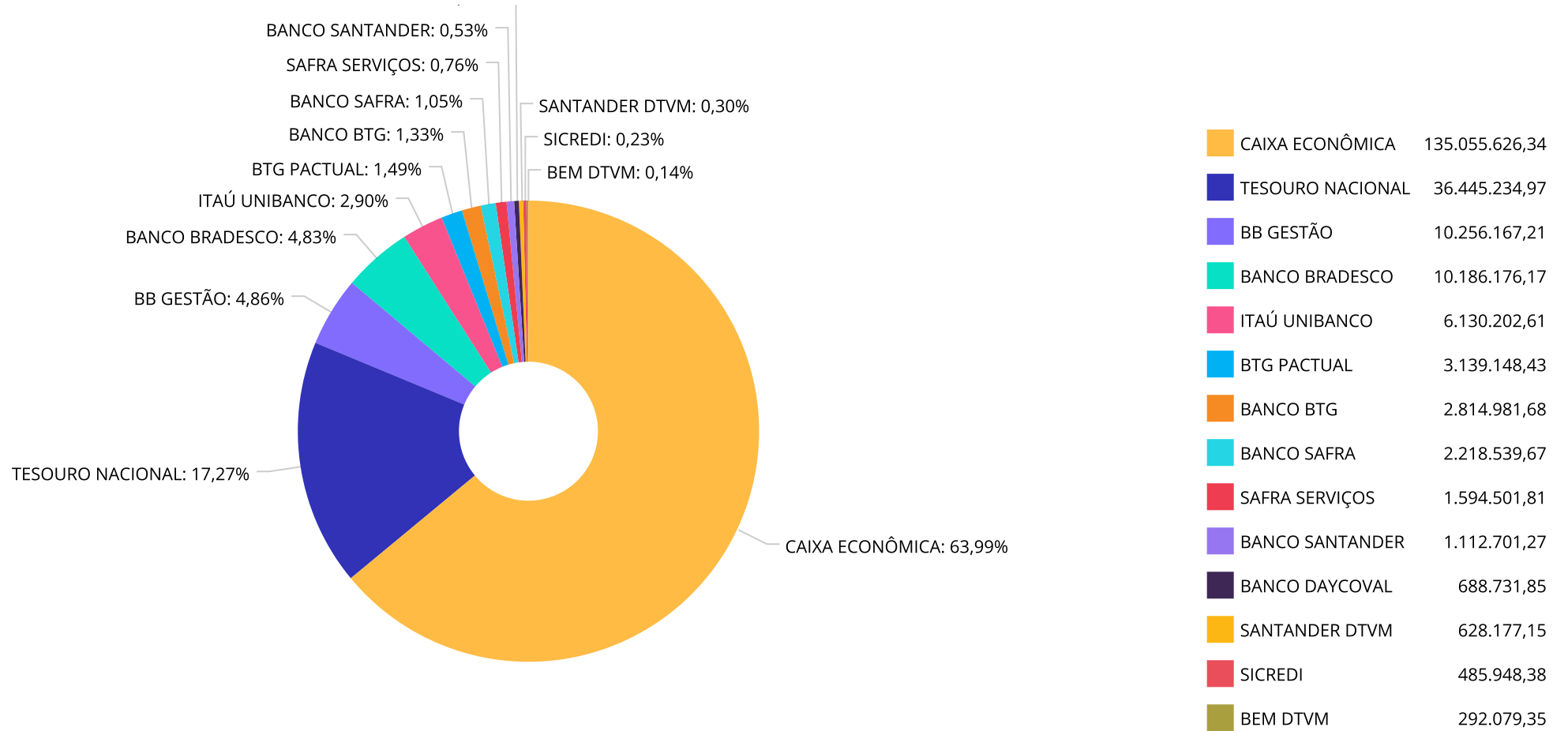
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	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%

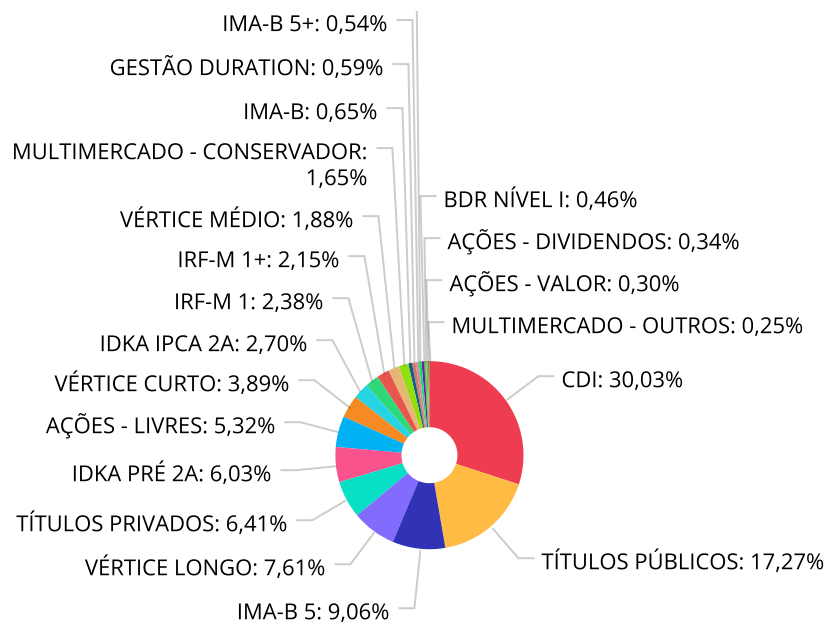
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	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%
Global BDRX (Benchmark)	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,54%	7,40%	10,09%	11,35%	22,66%	7,22%	6,09%	13,328%
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	63.369.896,12	■ TÍTULOS PÚBLICOS	36.445.234,97	■ IMA-B 5	19.127.479,93
■ VÉRTICE LONGO	16.051.134,30	■ TÍTULOS PRIVADOS	13.524.050,39	■ IDKA PRÉ 2A	12.720.400,48
■ AÇÕES - LIVRES	11.224.819,85	■ VÉRTICE CURTO	8.218.524,42	■ IDKA IPCA 2A	5.691.688,19
■ IRF-M 1	5.014.875,71	■ IRF-M 1+	4.540.707,27	■ VÉRTICE MÉDIO	3.963.522,14
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	3.483.648,46	■ IMA-B	1.381.804,48	■ GESTÃO DURATION	1.249.812,68
■ IMA-B 5+	1.146.153,90	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.030.892,48	■ BDR NÍVEL I	976.121,61
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	722.157,98	■ AÇÕES - VALOR	634.842,34	■ MULTIMERCADO - OUTROS	530.449,19

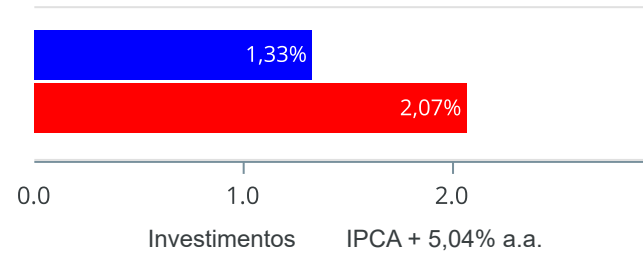
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 2024)

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	4.346,718599	9.999.480,92	10.619.033,53	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	07/06/2022	3.600	4.135,37157300	4.313,727086	14.887.337,66	15.529.417,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	29/03/2023	2.419	4.132,9683	4.263,32221	9.997.650,32	10.312.976,42	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

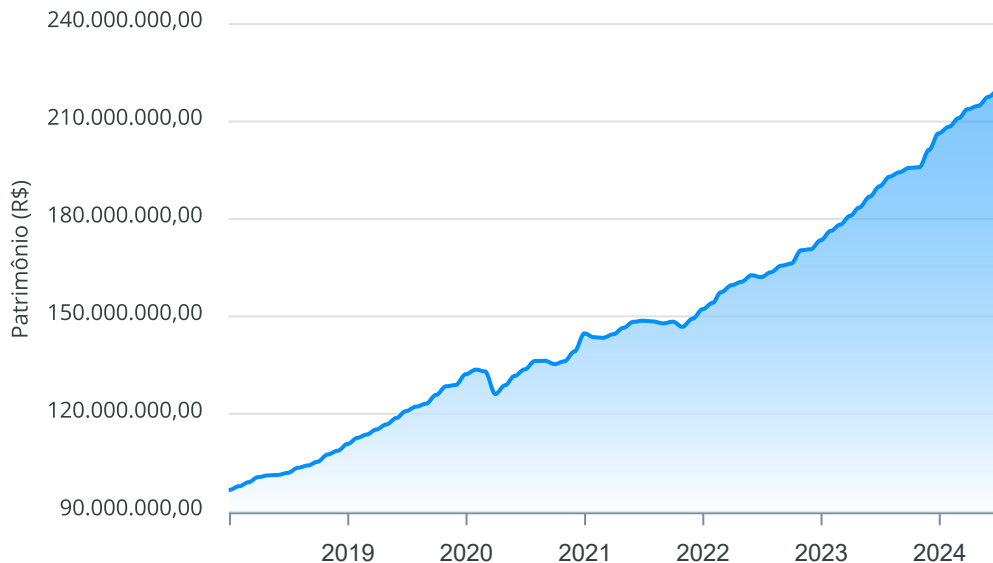
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	206.350.303,76	3.334.294,40	2.301.696,15	208.419.112,91	1.036.210,90	1.036.210,90	0,50%	0,50%	0,85%	0,85%	58,65%	1,04%
Fevereiro	208.419.112,91	4.237.268,09	3.336.772,21	211.048.216,89	1.728.608,10	2.764.819,00	0,83%	1,33%	1,20%	2,07%	64,33%	1,42%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



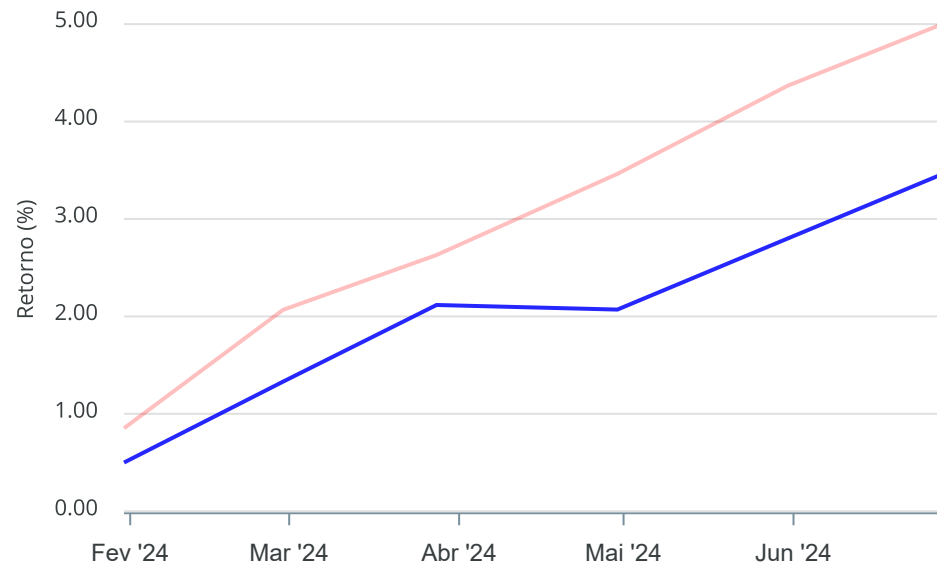
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Fevereiro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LETRA FINANCEIRA SAFRA	2.194.843,35	0,00	0,00	2.218.539,67	23.696,32	1,08%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	36.829.447,43	0,00	749.585,90	36.445.234,97	365.373,44	0,99%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	2.788.485,02	0,00	0,00	2.814.981,68	26.496,66	0,95%	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	3.947.677,69	0,00	0,00	3.985.181,11	37.503,42	0,95%	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	3.361.024,35	0,00	0,00	3.392.646,66	31.622,31	0,94%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.733.197,51	0,00	0,00	6.793.529,51	60.332,00	0,90%	0,90%	0,05%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	1.102.885,88	0,00	0,00	1.112.701,27	9.815,39	0,89%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.565,36	0,00	0,00	7.630,80	65,44	0,86%	0,86%	0,05%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	622.809,76	0,00	0,00	628.177,15	5.367,39	0,86%	0,86%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	42.994.511,63	2.727.814,44	1.836.426,35	44.251.755,68	365.855,96	0,80%	0,82%	0,02%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	399.041,75	0,00	0,00	402.233,03	3.191,28	0,80%	0,80%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.087.385,84	0,00	0,00	5.127.398,13	40.012,29	0,79%	0,79%	0,05%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	4.005.577,99	0,00	0,00	4.036.995,58	31.417,59	0,78%	0,78%	0,00%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	725.471,44	0,00	0,00	730.805,84	5.334,40	0,74%	0,74%	0,40%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.609.893,75	0,00	75.873,53	2.553.176,35	19.156,13	0,73%	-2,17%	4,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	4.182.989,92	0,00	118.752,96	4.094.908,99	30.672,03	0,73%	0,74%	0,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.915.241,20	63.153,31	0,00	5.014.875,71	36.481,20	0,73%	0,74%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.603.540,69	0,00	44.744,11	1.570.439,08	11.642,50	0,73%	0,73%	0,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	640.972,70	0,00	0,00	645.380,79	4.408,09	0,69%	0,69%	0,17%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.391.291,15	0,00	437.460,78	16.051.134,30	97.303,93	0,59%	-2,08%	4,84%

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	138.869,46	163.497,07	0,00	304.110,07	1.743,54	0,58%	0,80%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.597.223,17	420.729,40	0,00	19.127.479,93	109.527,36	0,58%	0,58%	0,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.210.031,08	0,00	0,00	3.228.457,32	18.426,24	0,57%	0,57%	0,65%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	730.875,67	0,00	0,00	735.064,82	4.189,15	0,57%	0,57%	0,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	516.143,50	0,00	0,00	519.006,84	2.863,34	0,55%	0,55%	0,42%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	483.339,39	0,00	0,00	485.948,38	2.608,99	0,54%	0,54%	0,81%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIA...	312.570,90	749.585,97	0,00	1.067.725,79	5.568,92	0,52%	0,79%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.140.481,94	0,00	0,00	1.146.153,90	5.671,96	0,50%	0,50%	1,25%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	891.587,49	0,00	0,00	895.856,10	4.268,61	0,48%	0,48%	0,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.654.363,67	12.487,90	0,00	5.691.688,19	24.836,62	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	12.668.983,98	0,00	0,00	12.720.400,48	51.416,50	0,41%	0,41%	0,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.526.543,85	0,00	0,00	4.540.707,27	14.163,42	0,31%	0,31%	1,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	78.345,55	100.000,00	73.928,58	104.959,58	542,61	0,30%	0,73%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,62%	0,00%
Total Renda Fixa	190.093.214,07	4.237.268,09	3.336.772,21	192.445.284,98	1.451.575,03	0,76%		0,88%

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 INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	975.320,10	0,00	0,00	1.030.892,48	55.572,38	5,70%	5,70%	5,27%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	333.090,20	0,00	0,00	342.762,99	9.672,79	2,90%	2,90%	5,44%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.143.120,38	0,00	0,00	1.175.262,94	32.142,56	2,81%	2,81%	5,38%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	704.355,57	0,00	0,00	722.157,98	17.802,41	2,53%	2,53%	7,45%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.308.813,90	0,00	0,00	1.340.616,80	31.802,90	2,43%	2,43%	6,19%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	338.395,62	0,00	0,00	345.968,86	7.573,24	2,24%	2,24%	5,76%
OCCAM FIC AÇÕES	288.756,33	0,00	0,00	292.079,35	3.323,02	1,15%	1,15%	6,81%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	1.092.200,74	0,00	0,00	1.101.754,63	9.553,89	0,87%	0,87%	3,09%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MUL...	526.172,60	0,00	0,00	530.449,19	4.276,59	0,81%	0,81%	2,74%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7.988.347,15	0,00	0,00	8.046.224,28	57.877,13	0,72%	0,72%	6,41%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	314.901,92	0,00	0,00	316.746,97	1.845,05	0,59%	0,59%	7,35%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	2.390.605,39	0,00	0,00	2.381.893,83	-8.711,56	-0,36%	-0,36%	2,17%
Total Renda Variável	17.404.079,90	0,00	0,00	17.626.810,30	222.730,40	1,28%		5,40%

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	314.929,41	0,00	0,00	336.093,77	21.164,36	6,72%	6,72%	8,51%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	323.342,55	0,00	0,00	343.615,16	20.272,61	6,27%	6,27%	8,72%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	283.546,98	0,00	0,00	296.412,68	12.865,70	4,54%	4,54%	6,09%
Total Exterior	921.818,94	0,00	0,00	976.121,61	54.302,67	5,89%		7,85%