

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 | | | 414.351.097,67 | 40,63% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3 | Não há | 2.069.928,26 | 0,20% | 702 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 17.914.195,28 | 1,76% | 795 | 0,34% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0 | Não há | 80.569,76 | 0,01% | 1.144 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI... | D+0 | 15/08/2024 | 969.014,15 | 0,10% | 140 | 0,50% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI... | D+1 | Não há | 6.197.653,35 | 0,61% | 100 | 1,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 18.434.720,77 | 1,81% | 791 | 0,35% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 32.957.244,51 | 3,23% | 914 | 0,43% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 61.878.356,67 | 6,07% | 771 | 1,24% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 103.673,98 | 0,01% | 1.190 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 42.276.755,44 | 4,15% | 450 | 1,76% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1 | Não há | 339.751,88 | 0,03% | 217 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 8.798.371,42 | 0,86% | 108 | 1,61% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 8.132.440,31 | 0,80% | 22 | 6,48% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIX... | D+0 | Não há | 18.360.137,99 | 1,80% | 733 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 6.646.129,39 | 0,65% | 7.008 | 1,64% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 4.921.736,10 | 0,48% | 247 | 0,53% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA | D+3 | Não há | 2.496.645,63 | 0,24% | 2.742 | 4,02% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 12.109.529,53 | 1,19% | 158 | 6,51% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | D+1 du ... | Não há | 7.317.710,51 | 0,72% | 4.213 | 2,39% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|----------|---------------|--------------------|----------|------------------|---------------------|
| AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES | D+16 du | Não há | 6.505.667,12 | 0,64% | 147 | 4,33% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 2.425.459,35 | 0,24% | 1.294 | 0,29% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 5.403.054,70 | 0,53% | 17.732 | 0,39% | Artigo 8º, Inciso I |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 9.683.682,34 | 0,95% | 2.035 | 5,87% | Artigo 8º, Inciso I |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES | D+7 du | Não há | 14.123.128,70 | 1,38% | 5.929 | 6,33% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | D+25 | Não há | 7.564.463,28 | 0,74% | 918 | 1,20% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ... | D+33 | Não há | 17.497.443,40 | 1,72% | 147 | 1,78% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES | D+23 | Não há | 11.668.291,03 | 1,14% | 117 | 1,71% | Artigo 8º, Inciso I |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | D+15 | Não há | 8.883.873,81 | 0,87% | 2.370 | 0,61% | Artigo 8º, Inciso I |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+32 | Não há | 19.565.225,61 | 1,92% | 83 | 0,87% | Artigo 8º, Inciso I |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 2.091.896,62 | 0,21% | 2.079 | 0,31% | Artigo 8º, Inciso I |
| INDIE FIC AÇÕES | D+32 | Não há | 11.520.403,21 | 1,13% | 8.624 | 3,20% | Artigo 8º, Inciso I |
| OCCAM FIC AÇÕES | D+4 ou ... | Não há | 1.483.839,14 | 0,15% | 1.081 | 0,17% | Artigo 8º, Inciso I |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 1.957.192,63 | 0,19% | 3.626 | 0,64% | Artigo 8º, Inciso I |
| SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES | D+3 du | Não há | 1.554.021,68 | 0,15% | 107 | 1,52% | Artigo 8º, Inciso I |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 1.999.377,25 | 0,20% | 137 | 1,28% | Artigo 8º, Inciso I |
| SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 349.797,62 | 0,03% | 921 | 0,49% | Artigo 8º, Inciso I |
| SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES | D+3 | Não há | 5.485.177,36 | 0,54% | 32 | 4,09% | Artigo 8º, Inciso I |
| SPX APACHE FIC AÇÕES | D+4 ou ... | Não há | 894.478,66 | 0,09% | 112 | 0,16% | Artigo 8º, Inciso I |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | D+32 | Não há | 27.424.239,57 | 2,69% | 55 | 1,41% | Artigo 8º, Inciso I |

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

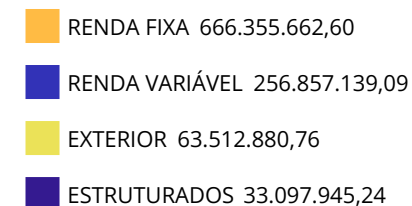
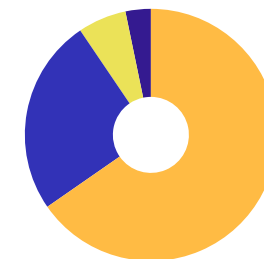
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|---------|----------|---------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+32 | Não há | 853.662,92 | 0,08% | 22 | 0,10% | Artigo 8º, Inciso I |
| TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ... | D+32 | Não há | 840.793,89 | 0,08% | 33 | 0,09% | Artigo 8º, Inciso I |
| VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES | D+7 | Não há | 11.680.310,62 | 1,15% | 37 | 10,41% | Artigo 8º, Inciso I |
| VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES | D+63 | Não há | 1.533.090,44 | 0,15% | 134 | 0,29% | Artigo 8º, Inciso I |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 26.688.730,58 | 2,62% | 1.232 | 9,71% | Artigo 8º, Inciso I |
| IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | D+3 | Não há | 25.392.657,66 | 2,49% | 8.480 | 0,57% | Artigo 8º, Inciso II |
| IT NOW S&P500® TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11 | D+3 | Não há | 29.133.935,64 | 2,86% | 10.591 | 4,79% | Artigo 8º, Inciso II |
| TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENT... | D+2 du | Não há | 2.653.244,26 | 0,26% | 21.547 | 33,42% | Artigo 8º, Inciso II |
| ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI... | D+5 du | Não há | 15.196.120,80 | 1,49% | 79 | 7,48% | Artigo 9º, Inciso II |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE... | D+6 du | Não há | 5.542.434,04 | 0,54% | 2.347 | 2,27% | Artigo 9º, Inciso II |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC... | D+6 du | Não há | 4.055.578,87 | 0,40% | 129 | 3,42% | Artigo 9º, Inciso II |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME... | D+5 | Não há | 23.057.630,36 | 2,26% | 7.468 | 3,25% | Artigo 9º, Inciso II |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 4.788.981,69 | 0,47% | 468 | 0,23% | Artigo 9º, Inciso III |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+5 | Não há | 4.183.870,75 | 0,41% | 340 | 0,62% | Artigo 9º, Inciso III |
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+5 | Não há | 6.688.264,25 | 0,66% | 59.573 | 0,46% | Artigo 9º, Inciso III |
| BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 675.273,27 | 0,07% | 20 | 0,49% | Artigo 10º, Inciso I |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | D+2 du | Não há | 15.303.622,75 | 1,50% | 2.630 | 2,82% | Artigo 10º, Inciso I |
| SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP | D+1 du | Não há | 3.965.698,39 | 0,39% | 6.060 | 1,86% | Artigo 10º, Inciso I |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 13.153.350,83 | 1,29% | 27.948 | 1,55% | Artigo 10º, Inciso I |

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|--|---------|-----------------|-------------------------|--------------------|----------|------------------|---------------|
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 1.019.823.627,69 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 298.752,34 | | | | Artigo 6º |
| | | PL Total | 1.020.122.380,03 | | | | |

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

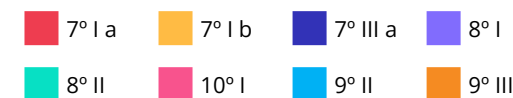
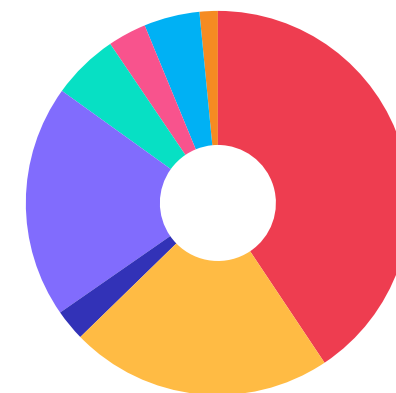
| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2024 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 414.351.097,67 | 40,63% | 20,00% | 45,00% | 70,00% | 299.525.441,71 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 225.158.943,16 | 22,08% | 5,00% | 16,00% | 70,00% | 488.717.596,22 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 26.845.621,77 | 2,63% | 0,00% | 1,00% | 60,00% | 585.048.554,84 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 20,00% | 203.964.725,54 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 50.991.181,38 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 666.355.662,60 | 65,34% | 25,00% | 74,00% | 225,00% | |



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% | 199.677.301,53 | 19,58% | 10,00% | 15,00% | 30,00% | 106.269.786,78 |
| Artigo 8º, Inciso II | 30,00% | 57.179.837,56 | 5,61% | 1,00% | 4,00% | 20,00% | 146.784.887,98 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 33.097.945,24 | 3,25% | 1,00% | 3,00% | 10,00% | 68.884.417,53 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 50.991.181,38 |
| Artigo 11º | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 50.991.181,38 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 289.955.084,33 | 28,43% | 12,00% | 22,00% | 70,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2024 | | | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|----------------------|--------------|--|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso II | 10,00% | 47.851.764,07 | 4,69% | 0,00% | 3,00% | 10,00% | 54.130.598,70 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 15.661.116,69 | 1,54% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 86.321.246,08 |
| Total Exterior | 10,00% | 63.512.880,76 | 6,23% | 0,00% | 4,00% | 20,00% | |



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2024 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 414.351.097,67 | 40,63 | 20,00 | 70,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 225.158.943,16 | 22,08 | 5,00 | 70,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 26.845.621,77 | 2,63 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 199.677.301,53 | 19,58 | 10,00 | 30,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 57.179.837,56 | 5,61 | 1,00 | 20,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 47.851.764,07 | 4,69 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 15.661.116,69 | 1,54 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 33.097.945,24 | 3,25 | 1,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 11º | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 12º | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL... | 414.351.097,67 | 40,63 | - |
| CAIXA DTVM | 197.169.930,77 | 19,33 | - |
| ITAÚ UNIBANCO | 54.526.593,30 | 5,35 | - |
| BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT | 41.499.577,47 | 4,07 | - |
| WESTERN ASSET | 38.597.274,00 | 3,78 | - |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 35.640.747,34 | 3,49 | - |
| XP GESTÃO DE RECURSOS | 34.006.441,09 | 3,33 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 33.783.957,60 | 3,31 | - |
| XP ASSET MANAGEMENT | 31.253.308,66 | 3,06 | - |
| TARPON INVESTIMENTOS | 27.424.239,57 | 2,69 | - |
| GUEPARDO INVESTIMENTOS | 19.565.225,61 | 1,92 | - |
| BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S... | 15.303.622,75 | 1,50 | - |
| VINCI PARTNERS | 13.213.401,06 | 1,30 | - |
| INDIE CAPITAL | 11.520.403,21 | 1,13 | - |
| CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS | 8.883.873,81 | 0,87 | - |
| SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ... | 8.140.440,63 | 0,80 | - |
| BRDESCO ASSET MANAGEMENT | 6.872.926,62 | 0,67 | - |
| BAYES CAPITAL MANAGEMENT | 6.505.667,12 | 0,64 | - |
| SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT... | 5.485.177,36 | 0,54 | - |
| GENIAL INVESTIMENTOS | 4.055.578,87 | 0,40 | - |

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|------------------------|--------------|---------------|----------------|
| SICREDI | 3.965.698,39 | 0,39 | - |
| ICATU VANGUARDA | 2.091.896,62 | 0,21 | - |
| TRÍGONO CAPITAL | 1.694.456,81 | 0,17 | - |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT | 1.554.021,68 | 0,15 | - |
| OCCAM BRASIL | 1.483.839,14 | 0,15 | - |
| SPX CAPITAL | 894.478,66 | 0,09 | - |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT | 339.751,88 | 0,03 | - |

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 |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,83% | 0,83% | 2,77% | 5,92% | 12,95% | 27,12% | - | - |
| SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA | 0,84% | 0,84% | 2,71% | 5,83% | 12,76% | 26,70% | 0,15% | 0,34% |
| 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% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,87% | 0,87% | 2,74% | 5,80% | 12,67% | 26,44% | 0,12% | 0,33% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IMA-B 5 (Benchmark) | 0,68% | 0,68% | 3,99% | 4,44% | 11,33% | 23,79% | - | - |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 0,66% | 0,66% | 3,94% | 4,32% | 11,14% | 23,30% | 0,55% | 1,87% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,66% | 0,66% | 3,94% | 4,34% | 11,18% | 23,49% | 0,55% | 1,85% |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | 0,55% | 0,55% | 4,77% | 4,08% | 11,30% | 21,06% | 0,81% | 2,70% |

| | | | | | | | | |
|---|--------|--------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IMA-B (Benchmark) | -0,45% | -0,45% | 4,97% | 2,91% | 15,53% | 23,80% | - | - |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA | -0,56% | -0,56% | 5,76% | 2,63% | 15,45% | 20,81% | 1,52% | 4,90% |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | -0,48% | -0,48% | 4,90% | 2,78% | 15,26% | 23,19% | 1,28% | 4,16% |
| BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA | -0,51% | -0,51% | 4,79% | 2,57% | 14,29% | 21,09% | 1,27% | 4,13% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,47% | -0,47% | 4,92% | 2,84% | 15,36% | 23,40% | 1,27% | 4,14% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | -0,48% | -0,48% | 4,89% | 2,75% | 15,18% | 23,00% | 1,27% | 4,17% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,49% | -0,49% | 4,89% | 2,70% | 15,25% | 23,11% | 1,28% | 4,18% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IRF-M (Benchmark) | 0,67% | 0,67% | 4,68% | 6,05% | 16,31% | 27,74% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,67% | 0,67% | 4,66% | 5,95% | 16,08% | 27,41% | 0,79% | 2,44% |

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 |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark) | 0,97% | 0,97% | 2,81% | 6,04% | 12,87% | 27,33% | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,85% | 0,85% | 2,92% | 5,79% | 15,22% | 26,51% | 0,07% | 1,31% |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,96% | 0,96% | 2,77% | 5,96% | 12,72% | 27,04% | 0,01% | 0,05% |
| IPCA (Benchmark) | 0,42% | 0,42% | 1,27% | 2,01% | 4,51% | 10,54% | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,66% | 0,66% | 3,33% | 4,67% | 13,16% | 25,72% | 0,46% | 1,30% |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,48% | 0,48% | 4,75% | 4,60% | 15,81% | 24,85% | 0,65% | 3,04% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,10% | 1,10% | 2,83% | 5,35% | 10,83% | 23,83% | 0,33% | 1,26% |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | 0,18% | 0,18% | 4,80% | 3,96% | 12,59% | 20,18% | 1,05% | 3,33% |

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 |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES | 4,27% | 4,27% | 20,05% | 15,51% | 25,78% | 2,61% | 8,61% | 16,82% |
| CDI (Benchmark) | 0,97% | 0,97% | 2,81% | 6,04% | 12,87% | 27,33% | - | - |
| BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 0,71% | 0,71% | 3,03% | 5,46% | 12,54% | 27,03% | 0,24% | 0,60% |
| 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% | - | - |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | -2,10% | -2,10% | 15,57% | 8,88% | 19,40% | 29,66% | 5,77% | 14,98% |
| SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES | -6,78% | -6,78% | 15,72% | -6,86% | 8,08% | -20,09% | 10,25% | 25,34% |
| VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES | -4,73% | -4,73% | 12,63% | 1,91% | 10,32% | 7,67% | 6,29% | 16,36% |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | -3,82% | -3,82% | 14,39% | 2,73% | 11,34% | 2,70% | 6,92% | 17,80% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | -4,94% | -4,94% | 9,44% | -0,56% | 4,41% | 3,24% | 5,53% | 16,59% |
| TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | -7,81% | -7,81% | -3,19% | -5,63% | -1,03% | 11,28% | 7,33% | 19,24% |
| AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES | -4,28% | -4,28% | 13,55% | 5,07% | 20,10% | 18,53% | 6,66% | 15,23% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | -3,43% | -3,43% | 13,39% | 1,79% | 11,23% | 13,48% | 6,30% | 14,43% |
| IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | -4,79% | -4,79% | 13,11% | 5,09% | 13,24% | 15,16% | 5,50% | 16,35% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | -6,91% | -6,91% | -1,10% | -2,94% | 3,25% | 26,49% | 7,30% | 19,17% |

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 |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | -6,46% | -6,46% | 9,72% | 2,43% | 6,50% | 3,69% | 5,99% | 16,12% |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | -3,79% | -3,79% | 14,14% | 3,36% | 11,54% | 1,81% | 6,27% | 17,14% |
| OCCAM FIC AÇÕES | -3,79% | -3,79% | 11,66% | 3,54% | 8,37% | 9,26% | 5,54% | 15,39% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | -4,15% | -4,15% | 11,76% | 0,85% | 8,47% | 4,31% | 6,58% | 16,00% |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | -6,16% | -6,16% | 11,40% | 10,28% | 42,45% | 65,16% | 10,56% | 18,94% |
| SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES | -4,26% | -4,26% | 11,75% | 1,19% | 0,39% | 2,72% | 5,37% | 16,42% |
| VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES | -4,03% | -4,03% | 14,05% | 4,66% | 13,48% | 8,44% | 5,55% | 16,72% |
| SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES | -4,94% | -4,94% | 12,90% | 2,49% | 9,52% | 14,91% | 6,16% | 16,25% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES | -4,13% | -4,13% | 14,09% | 4,05% | 12,06% | 10,66% | 5,62% | 16,67% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES | -4,57% | -4,57% | 13,44% | 3,06% | 7,75% | 3,66% | 5,68% | 16,19% |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | -1,49% | -1,49% | 14,31% | 8,75% | 40,63% | 37,57% | 8,15% | 18,51% |
| IBX (Benchmark) | -4,51% | -4,51% | 13,20% | 5,15% | 11,88% | 12,72% | - | - |
| INDIE FIC AÇÕES | -5,46% | -5,46% | 13,63% | -2,02% | 15,52% | -5,11% | 6,92% | 20,97% |
| SPX APACHE FIC AÇÕES | -5,06% | -5,06% | 12,05% | 1,28% | 17,96% | 23,57% | 6,61% | 16,13% |
| IDIV (Benchmark) | -3,51% | -3,51% | 14,18% | 8,88% | 15,58% | 28,28% | - | - |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES | -4,26% | -4,26% | 10,54% | 3,64% | 8,01% | 10,01% | 4,98% | 14,72% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | -3,07% | -3,07% | 12,60% | 6,01% | 15,84% | 19,58% | 4,80% | 13,79% |

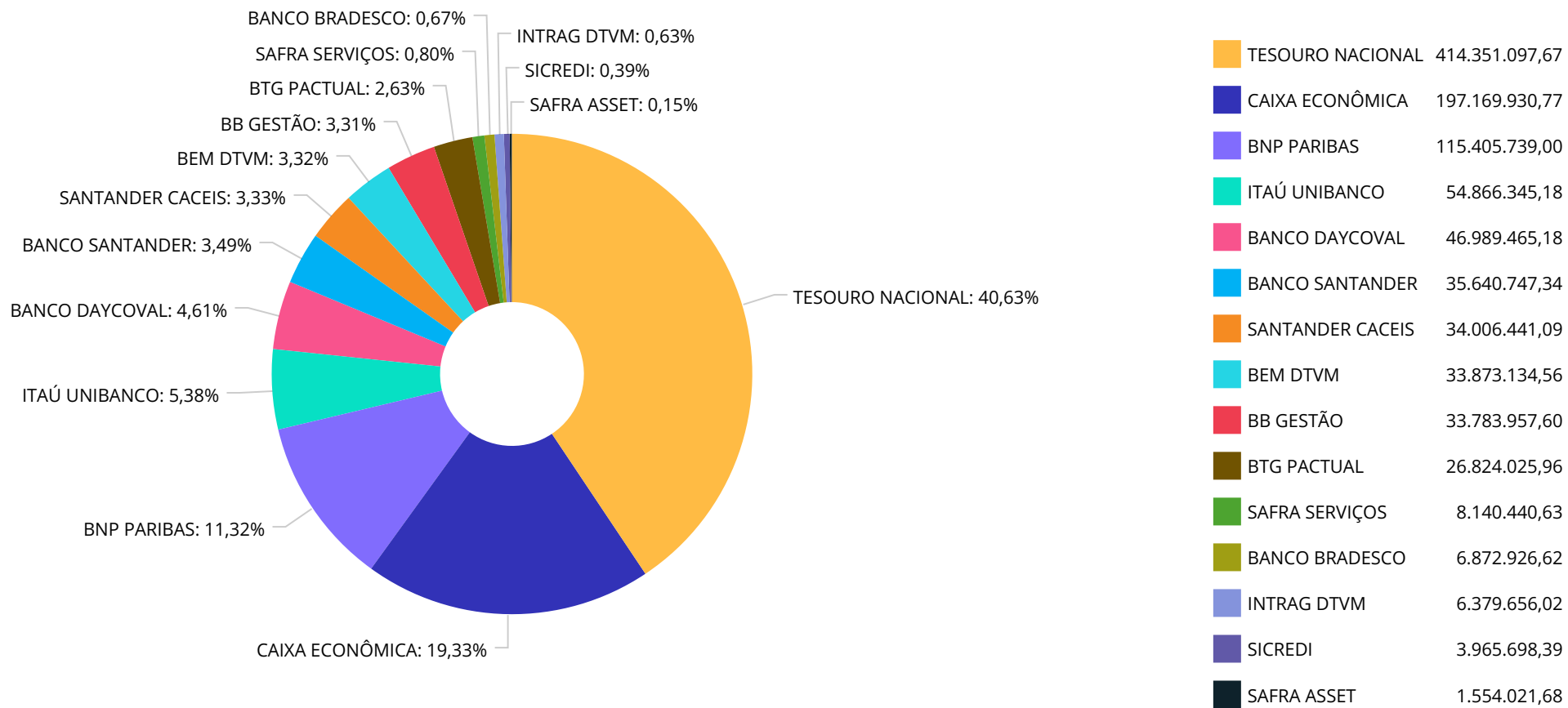
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| NASDAQ 100 Index (Benchmark) | 4,21% | 4,21% | 16,48% | 13,62% | 37,56% | 6,13% | - | - |
| TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENTO NO EXTERIOR - N... | 3,61% | 3,61% | 16,68% | 13,55% | 37,67% | 7,16% | 8,30% | 18,07% |
| S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark) | 1,59% | 1,59% | 15,54% | 5,59% | 18,86% | 7,31% | - | - |
| SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP | 1,70% | 1,70% | 17,09% | 8,97% | 27,65% | 26,74% | 5,19% | 12,81% |
| IT NOW S&P500@ TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11 | 3,41% | 3,41% | 13,59% | 10,60% | 16,50% | 1,58% | 6,45% | 13,64% |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 1,66% | 1,66% | 16,87% | 8,71% | 26,98% | 25,55% | 5,14% | 12,80% |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 1,72% | 1,72% | 17,05% | 9,04% | 27,92% | 32,08% | 5,17% | 12,83% |
| SMLL (Benchmark) | -6,55% | -6,55% | 12,50% | -6,30% | 6,34% | -10,11% | - | - |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES | -4,71% | -4,71% | 12,72% | -3,42% | 3,52% | -9,22% | 9,06% | 19,81% |

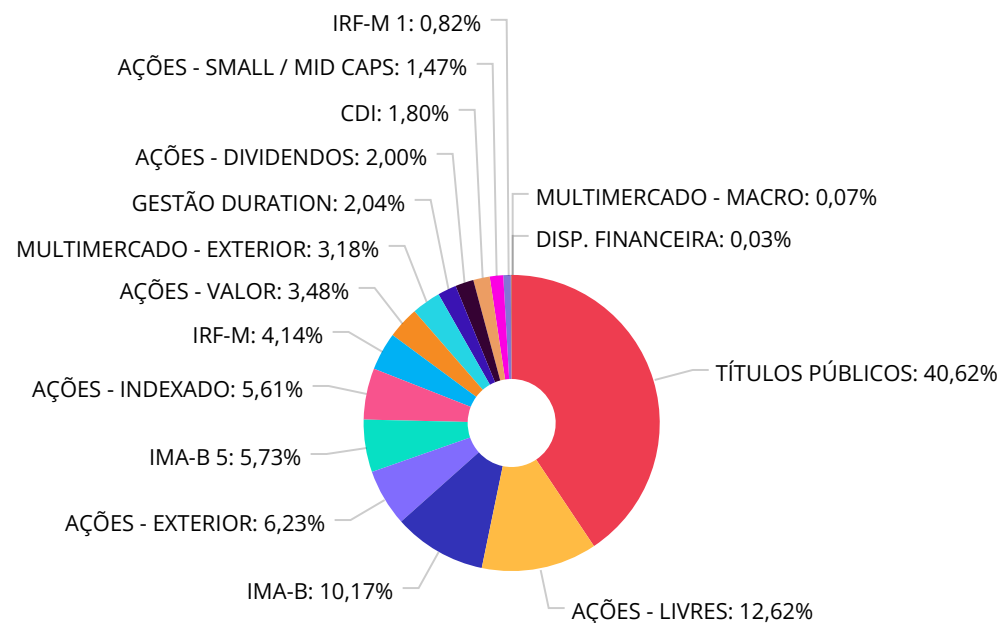
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| 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% |
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,27% | 6,27% | 18,87% | 16,73% | 33,97% | 2,43% | 6,42% | 15,851% |
| MSCI WORLD (Benchmark) | 3,48% | 3,48% | 13,39% | 9,28% | 11,80% | -3,12% | - | - |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | -4,25% | -4,25% | 22,56% | 1,86% | 16,60% | -32,59% | 15,85% | 30,100% |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 4,04% | 4,04% | 21,71% | 13,90% | 29,36% | -4,31% | 9,69% | 20,177% |
| Ibovespa (Benchmark) | -4,79% | -4,79% | 12,91% | 4,76% | 12,63% | 13,92% | - | - |
| SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES | -6,78% | -6,78% | 15,72% | -6,86% | 8,08% | -20,09% | 10,25% | 25,338% |
| MSCI ACWI (Benchmark) | 2,86% | 2,86% | 12,43% | 7,98% | 9,50% | -5,80% | - | - |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER... | 2,38% | 2,38% | 21,15% | 10,68% | 30,11% | 2,91% | 7,64% | 17,260% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES | 4,27% | 4,27% | 20,04% | 15,51% | 25,78% | 2,61% | 8,61% | 16,821% |

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



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



| | | | | | | | |
|----------------------------|----------------|--------------------|----------------|------------------------|----------------|--------------------|---------------|
| ■ TÍTULOS PÚBLICOS | 414.351.097,67 | ■ AÇÕES - LIVRES | 128.777.763,25 | ■ IMA-B | 103.720.003,21 | ■ AÇÕES - EXTERIOR | 63.512.880,76 |
| ■ IMA-B 5 | 58.486.583,33 | ■ AÇÕES - INDEXADO | 57.179.837,56 | ■ IRF-M | 42.276.755,44 | ■ AÇÕES - VALOR | 35.492.612,75 |
| ■ MULTIMERCADO - EXTERIOR | 32.422.671,97 | ■ GESTÃO DURATION | 20.844.400,91 | ■ AÇÕES - DIVIDENDOS | 20.443.002,94 | ■ CDI | 18.360.137,99 |
| ■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS | 14.963.922,59 | ■ IRF-M 1 | 8.316.684,05 | ■ MULTIMERCADO - MACRO | 675.273,27 | ■ DISP. FINANCEIRA | 298.752,34 |

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 | 15/08/2030 | 03/08/2022 | 170 | 3.977,335032 | 4.317,649337 | 676.146,96 | 734.000,38 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 15/08/2022 | 240 | 4.042,830139 | 4.386,183987 | 970.279,23 | 1.052.684,15 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 16/08/2022 | 368 | 4.053,223383 | 4.395,075583 | 1.491.586,20 | 1.617.387,81 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 11/11/2022 | 701 | 4.028,221339 | 4.326,793176 | 2.823.783,16 | 3.033.082,01 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 12/08/2022 | 1.268 | 4.160,660528 | 4.386,183987 | 5.275.717,55 | 5.561.681,29 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 13/09/2022 | 4.250 | 4.049,90807 | 4.388,403733 | 17.212.109,30 | 18.650.715,86 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 14/10/2022 | 4.501 | 4.052,45053 | 4.384,187057 | 18.240.079,84 | 19.733.225,94 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 09/08/2022 | 520 | 4.068,86026 | 4.403,988198 | 2.115.807,34 | 2.290.073,86 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 24/08/2022 | 564 | 4.029,667122 | 4.321,613769 | 2.272.732,26 | 2.437.390,16 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 12/08/2022 | 1.293 | 4.023,63576 | 4.311,498791 | 5.202.561,04 | 5.574.767,93 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 13/09/2022 | 3.709 | 4.017,096069 | 4.319,58741 | 14.899.409,32 | 16.021.349,70 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 14/10/2022 | 3.965 | 4.010,545468 | 4.325,637058 | 15.901.812,78 | 17.151.150,93 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 18/11/2022 | 4.183 | 3.949,154659 | 4.236,304904 | 16.519.313,94 | 17.720.463,41 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 15/12/2022 | 4.054 | 3.880,301353 | 4.138,152623 | 15.730.741,69 | 16.776.070,73 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 11/01/2023 | 2.808 | 3.981,78350 | 4.182,509702 | 11.180.848,07 | 11.744.487,24 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 10/02/2023 | 2.553 | 3.969,50631 | 4.145,55598 | 10.134.149,61 | 10.583.604,41 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 10/03/2023 | 4.130 | 4.030,827035 | 4.160,606529 | 16.647.315,65 | 17.183.304,96 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 25/08/2022 | 569 | 4.059,281709 | 4.409,575399 | 2.309.731,29 | 2.509.048,40 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 13/09/2022 | 3.749 | 4.051,669462 | 4.400,83515 | 15.189.708,81 | 16.498.730,97 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 14/10/2022 | 3.975 | 4.098,511687 | 4.440,80739 | 16.291.583,96 | 17.652.209,37 | Curva |

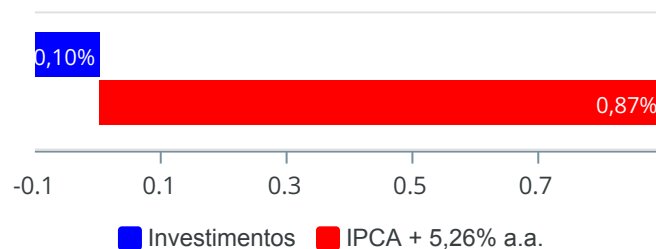
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2024)

| Títulos Públicos | Vencimento | Compra | Qtde | P.U. Compra | P.U. Atual | \$ Pago | \$ Atual | Marcação |
|--|------------|------------|-------|--------------|--------------|---------------|---------------|----------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 13/09/2022 | 3.749 | 4.051,669462 | 4.400,83515 | 15.189.708,81 | 16.498.730,97 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 14/10/2022 | 3.975 | 4.098,511687 | 4.440,80739 | 16.291.583,96 | 17.652.209,37 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 15/12/2022 | 3.997 | 4.098,511687 | 4.195,588545 | 16.381.751,21 | 16.769.767,41 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 21/11/2022 | 4.105 | 4.024,675706 | 4.316,888401 | 16.521.293,77 | 17.720.826,88 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 12/08/2022 | 1.276 | 4.018,020049 | 4.370,868582 | 5.126.993,58 | 5.577.228,31 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 12/01/2023 | 2.795 | 3.981,78350 | 4.201,915661 | 11.129.084,88 | 11.744.354,27 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 25/08/2022 | 566 | 4.019,06785 | 4.317,039748 | 2.274.792,40 | 2.443.444,49 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 13/09/2022 | 3.721 | 4.081,965410 | 4.312,062136 | 15.188.993,29 | 16.045.183,20 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 14/10/2022 | 3.945 | 4.035,965324 | 4.357,680434 | 15.921.883,20 | 17.191.049,31 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 21/11/2022 | 4.208 | 3.926,721131 | 4.214,712831 | 16.523.642,52 | 17.735.511,59 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 15/12/2022 | 5.274 | 3.926,721131 | 4.082,684203 | 20.709.527,24 | 21.532.076,48 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 12/08/2022 | 1.305 | 3.985,130583 | 4.277,445874 | 5.200.595,41 | 5.582.066,86 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 11/01/2023 | 3.448 | 3.981,78350 | 4.122,433628 | 13.729.189,51 | 14.214.151,14 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 17/02/2023 | 1.065 | 3.940,959413 | 4.103,414443 | 4.197.121,77 | 4.370.136,38 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 10/03/2023 | 4.220 | 3.955,371187 | 4.083,142446 | 16.691.666,41 | 17.230.861,12 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 10/02/2023 | 3.277 | 3.901,91222 | 4.074,894073 | 12.786.566,34 | 13.353.427,87 | 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 | 1.011.626.590,10 | 13.279.000,00 | 7.836.000,00 | 1.016.072.356,83 | -997.233,27 | -997.233,27 | -0,10% | -0,10% | 0,87% | 0,87% | -11,26% | 4,43% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



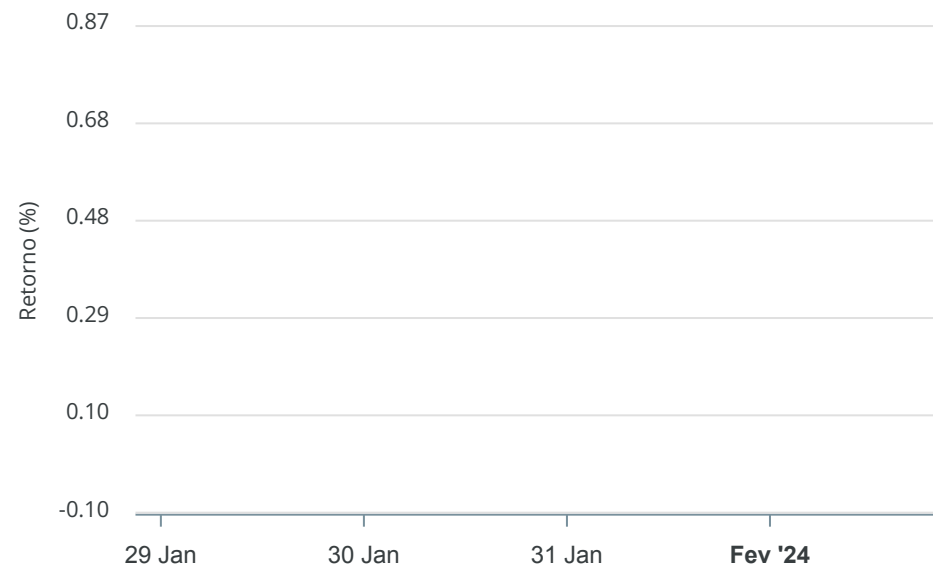
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 |
|---|----------------|--------------|--------------|----------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE... | 958.430,92 | 0,00 | 0,00 | 969.014,15 | 10.583,23 | 1,10% | 1,10% | 0,33% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 410.001.113,13 | 0,00 | 0,00 | 414.351.097,67 | 4.349.984,54 | 1,06% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 102.737,14 | 0,00 | 0,00 | 103.673,98 | 936,84 | 0,91% | 0,91% | 0,11% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 79.879,13 | 0,00 | 0,00 | 80.569,76 | 690,63 | 0,86% | 0,86% | 0,12% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 2.052.499,17 | 0,00 | 0,00 | 2.069.928,26 | 17.429,09 | 0,85% | 0,85% | 0,07% |
| SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA | 8.065.027,61 | 0,00 | 0,00 | 8.132.440,31 | 67.412,70 | 0,84% | 0,84% | 0,15% |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ... | 21.482.326,01 | 4.680.000,00 | 7.988.000,00 | 18.360.137,99 | 185.811,98 | 0,71% | 0,96% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 41.994.692,36 | 0,00 | 0,00 | 42.276.755,44 | 282.063,08 | 0,67% | 0,67% | 0,79% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 32.739.889,15 | 0,00 | 0,00 | 32.957.244,51 | 217.355,36 | 0,66% | 0,66% | 0,55% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 17.796.698,66 | 0,00 | 0,00 | 17.914.195,28 | 117.496,62 | 0,66% | 0,66% | 0,55% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 18.314.745,87 | 0,00 | 0,00 | 18.434.720,77 | 119.974,90 | 0,66% | 0,66% | 0,46% |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | 6.609.904,62 | 0,00 | 0,00 | 6.646.129,39 | 36.224,77 | 0,55% | 0,55% | 0,81% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 338.143,93 | 0,00 | 0,00 | 339.751,88 | 1.607,95 | 0,48% | 0,48% | 0,65% |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | 7.304.784,77 | 0,00 | 0,00 | 7.317.710,51 | 12.925,74 | 0,18% | 0,18% | 1,05% |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA | 4.089.996,40 | 8.029.000,00 | 0,00 | 12.109.529,53 | -9.466,87 | -0,08% | -0,56% | 1,52% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 61.030.045,05 | 1.130.000,00 | 0,00 | 61.878.356,67 | -281.688,38 | -0,45% | -0,47% | 1,27% |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 8.840.455,71 | 0,00 | 0,00 | 8.798.371,42 | -42.084,29 | -0,48% | -0,48% | 1,28% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ... | 6.227.387,88 | 0,00 | 0,00 | 6.197.653,35 | -29.734,53 | -0,48% | -0,48% | 1,27% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4.946.112,00 | 0,00 | 0,00 | 4.921.736,10 | -24.375,90 | -0,49% | -0,49% | 1,28% |
| BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA | 2.509.325,22 | 0,00 | 0,00 | 2.496.645,63 | -12.679,59 | -0,51% | -0,51% | 1,27% |

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 |
|-------------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| Total Renda Fixa | 655.484.194,73 | 13.839.000,00 | 7.988.000,00 | 666.355.662,60 | 5.020.467,87 | 0,76% | | 0,83% |

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 |
|---|----------------|------------|----------|---------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| TREND ETF NASDAQ 100 FUNDO DE ÍNDICE INVESTIMENTO ... | 2.560.916,96 | 0,00 | 0,00 | 2.653.244,26 | 92.327,30 | 3,61% | 3,61% | 8,30% |
| IT NOW S&P500® TRN FUNDO DE ÍNDICE - SPXI11 | 28.174.662,12 | 0,00 | 0,00 | 29.133.935,64 | 959.273,52 | 3,40% | 3,40% | 6,45% |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 15.044.442,32 | 0,00 | 0,00 | 15.303.622,75 | 259.180,43 | 1,72% | 1,72% | 5,17% |
| SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP | 3.899.598,74 | 0,00 | 0,00 | 3.965.698,39 | 66.099,65 | 1,70% | 1,70% | 5,19% |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 12.939.177,69 | 0,00 | 0,00 | 13.153.350,83 | 214.173,14 | 1,66% | 1,66% | 5,14% |
| BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 670.546,07 | 0,00 | 0,00 | 675.273,27 | 4.727,20 | 0,70% | 0,70% | 0,24% |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 19.861.214,25 | 0,00 | 0,00 | 19.565.225,61 | -295.988,64 | -1,49% | -1,49% | 8,15% |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 27.260.638,14 | 0,00 | 0,00 | 26.688.730,58 | -571.907,56 | -2,10% | -2,10% | 5,77% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 18.052.025,39 | 0,00 | 0,00 | 17.497.443,40 | -554.581,99 | -3,07% | -3,07% | 4,80% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 9.199.262,20 | 0,00 | 0,00 | 8.883.873,81 | -315.388,39 | -3,43% | -3,43% | 6,30% |
| OCCAM FIC AÇÕES | 1.542.338,27 | 0,00 | 0,00 | 1.483.839,14 | -58.499,13 | -3,79% | -3,79% | 5,54% |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | 2.078.203,68 | 0,00 | 0,00 | 1.999.377,25 | -78.826,43 | -3,79% | -3,79% | 6,27% |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | 2.034.905,69 | 0,00 | 0,00 | 1.957.192,63 | -77.713,06 | -3,82% | -3,82% | 6,92% |
| VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES | 12.170.769,40 | 0,00 | 0,00 | 11.680.310,62 | -490.458,78 | -4,03% | -4,03% | 5,55% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES | 12.171.419,06 | 0,00 | 0,00 | 11.668.291,03 | -503.128,03 | -4,13% | -4,13% | 5,62% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 7.891.826,02 | 0,00 | 0,00 | 7.564.463,28 | -327.362,74 | -4,15% | -4,15% | 6,58% |
| SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES | 365.341,36 | 0,00 | 0,00 | 349.797,62 | -15.543,74 | -4,25% | -4,25% | 5,37% |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 2.184.960,36 | 0,00 | 0,00 | 2.091.896,62 | -93.063,74 | -4,26% | -4,26% | 4,98% |
| AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES | 6.796.317,35 | 0,00 | 0,00 | 6.505.667,12 | -290.650,23 | -4,28% | -4,28% | 6,66% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES | 2.541.506,32 | 0,00 | 0,00 | 2.425.459,35 | -116.046,97 | -4,57% | -4,57% | 5,68% |

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 |
|--|-----------------------|-------------|-------------|-----------------------|----------------------|---------------|------------|--------------|
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES | 14.820.893,51 | 0,00 | 0,00 | 14.123.128,70 | -697.764,81 | -4,71% | -4,71% | 9,06% |
| VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES | 1.609.122,82 | 0,00 | 0,00 | 1.533.090,44 | -76.032,38 | -4,73% | -4,73% | 6,29% |
| IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | 26.670.225,43 | 0,00 | 0,00 | 25.392.657,66 | -1.277.567,77 | -4,79% | -4,79% | 5,50% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 10.186.370,43 | 0,00 | 0,00 | 9.683.682,34 | -502.688,09 | -4,93% | -4,93% | 5,53% |
| SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES | 5.770.233,95 | 0,00 | 0,00 | 5.485.177,36 | -285.056,59 | -4,94% | -4,94% | 6,16% |
| SPX APACHE FIC AÇÕES | 942.158,29 | 0,00 | 0,00 | 894.478,66 | -47.679,63 | -5,06% | -5,06% | 6,61% |
| INDIE FIC AÇÕES | 12.185.225,50 | 0,00 | 0,00 | 11.520.403,21 | -664.822,29 | -5,46% | -5,46% | 6,92% |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | 29.223.485,75 | 0,00 | 0,00 | 27.424.239,57 | -1.799.246,18 | -6,16% | -6,16% | 10,56% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 5.776.283,10 | 0,00 | 0,00 | 5.403.054,70 | -373.228,40 | -6,46% | -6,46% | 5,99% |
| SAFRA CONSUMO PB FIC AÇÕES | 1.667.048,87 | 0,00 | 0,00 | 1.554.021,68 | -113.027,19 | -6,78% | -6,78% | 10,25% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 916.991,99 | 0,00 | 0,00 | 853.662,92 | -63.329,07 | -6,91% | -6,91% | 7,30% |
| TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE... | 911.981,60 | 0,00 | 0,00 | 840.793,89 | -71.187,71 | -7,81% | -7,81% | 7,33% |
| Total Renda Variável | 298.120.092,63 | 0,00 | 0,00 | 289.955.084,33 | -8.165.008,30 | -2,74% | | 6,61% |

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 |
|---|----------------------|-------------|-------------|----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6.293.495,43 | 0,00 | 0,00 | 6.688.264,25 | 394.768,82 | 6,27% | 6,27% | 6,42% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 4.580.091,05 | 0,00 | 0,00 | 4.788.981,69 | 208.890,64 | 4,56% | 4,56% | 5,69% |
| ACCESS USA COMPANIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI A... | 14.573.248,07 | 0,00 | 0,00 | 15.196.120,80 | 622.872,73 | 4,27% | 4,27% | 8,61% |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT... | 22.162.063,22 | 0,00 | 0,00 | 23.057.630,36 | 895.567,14 | 4,04% | 4,04% | 9,69% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 4.072.524,13 | 0,00 | 0,00 | 4.183.870,75 | 111.346,62 | 2,73% | 2,73% | 6,29% |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST... | 5.413.682,88 | 0,00 | 0,00 | 5.542.434,04 | 128.751,16 | 2,38% | 2,38% | 7,64% |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A... | 4.235.727,29 | 0,00 | 0,00 | 4.055.578,87 | -180.148,42 | -4,25% | -4,25% | 15,85% |
| Total Exterior | 61.330.832,07 | 0,00 | 0,00 | 63.512.880,76 | 2.182.048,69 | 3,56% | | 8,78% |

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.

