



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

FEVEREIRO/2024

Este relatório tem como objetivo demonstrar a análise do relatório de investimentos, de acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento a Política de Investimentos do mês em referência, e a aprovação pelo Conselho Fiscal.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

PARECER COMITE DE INVESTIMENTOS FEVEREIRO/2024

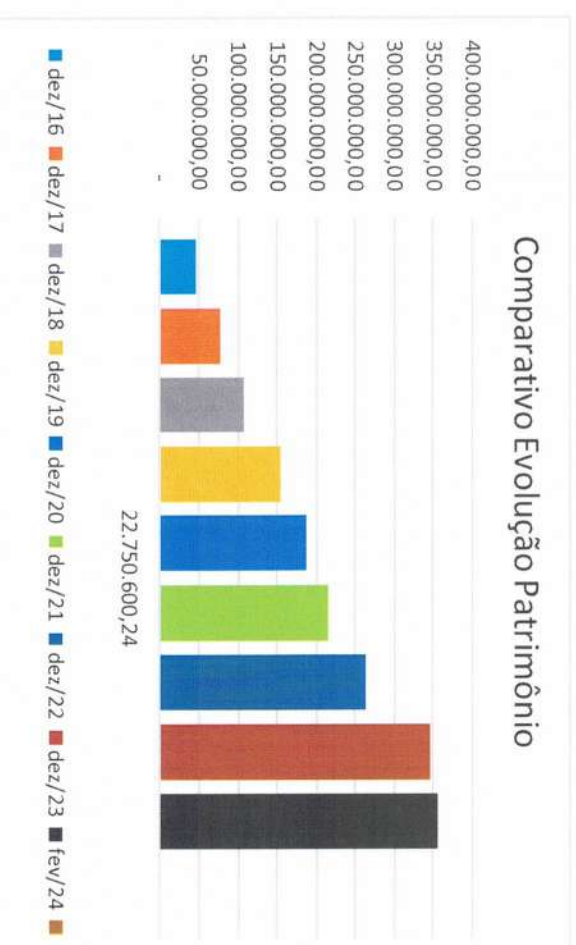
O comitê de investimentos do **INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPEÇERICA DA SERRA-ITAPREV**, fazendo uso de sua competência que lhe confere o Decreto Municipal Nº 2352/2015, em sua reunião ordinária do dia 13 de março de 2024, analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês de FEVEREIRO/2024 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

1) CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do **Instituto de Previdência do município de Itapeçerica da Serra-ITAPREV**, no mês fevereiro/2024 apresentou valorização de 0,86% encerrando o mês com recursos aplicados no valor total de R\$ 356.310.127,82 (Trezentos e cinquenta e seis milhões, trezentos e dez mil, cento e vinte e sete reais e dois centavos).

Início Itaprev

Ano	R\$
mar/15	9.333.541,95
dez/15	22.750.600,24
dez/16	47.169.736,15
dez/17	76.356.500,87
dez/18	107.384.837,09
dez/19	152.862.799,62
dez/20	186.459.080,35
dez/21	214.632.111,69
dez/22	263.411.729,77
dez/23	346.117.246,62
fev/24	356.310.127,82





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

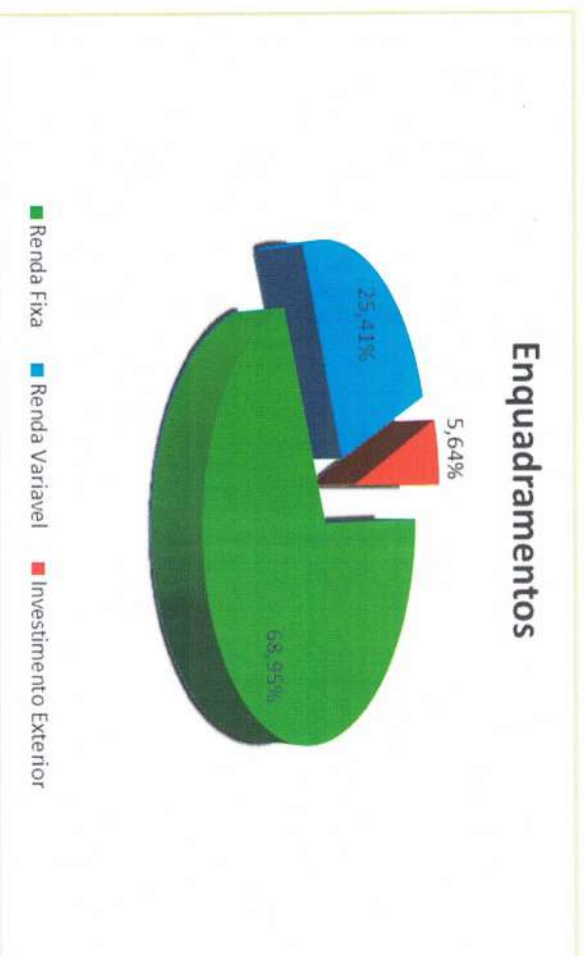
2) COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Instituto de Previdência do município de Itapeçerica da Serra-ITAPREV, atende aos requisitos de limites e enquadramento da Em atendimento a Resolução Nº 4963/2021 em substituição a resolução Nº 3922/2010 e suas alterações e, aos limites e enquadramentos aprovados na política de investimentos vigente sendo composta por:

68,94% em investimentos denominados Renda fixa;

25,41% em investimentos denominados Renda Variável; e

5,64% em investimentos denominados exterior.





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Recursos por fundo de Investimento

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	11.092.272,87	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.912.116,30	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	9.734.335,08	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.180.745,07	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.114.248,46	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	46980	16.109.771,95	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	16.223.633,61	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	16.139.191,95	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	20.696.868,13	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.523.456,32	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.914.361,46	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.374.871,61	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.308.024,21	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.825.119,13	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.977.878,44	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	11.195.222,04	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.070.280,26	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	1.596.962,89	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.762.511,25	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	11.098.614,87	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	D+0	Não se aplica	8.622.818,05	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	D+0	Não se aplica	8.644.888,09	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	D+0	Não se aplica	10.696.875,86	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	D+0	Não se aplica	10.731.104,42	Artigo 7º, Inciso IV	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	18/04/2018	6.963.732,05	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	Renda Fixa
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	3.592.609,26	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	Renda Fixa
Total Renda Fixa			243.102.513,63		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	5.327.458,11	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.022.995,04	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	11.238.525,09	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	6.678.977,10	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	7.323.756,62	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
FINACAP MAURITSSAD FI AÇÕES	D+3	Não há	4.584.742,35	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.316.901,57	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	1.432.170,46	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
SCHRÖDER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	2.569.756,44	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.145.281,82	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.940.939,10	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.226.186,24	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.277.558,66	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.503.997,26	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	4.572.814,33	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+3 du	25 meses	3.459.121,11	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	4.581.349,98	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	431.680,85	Artigo 11º	Renda Variável
Total Renda Variável			92.634.212,13		

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	9.859.375,11	Artigo 9º, Inciso III	Invest. Exterior
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	10.714.026,95	Artigo 9º, Inciso III	Invest. Exterior
Total Invest. Exterior			20.573.402,06		

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			12.857,70	Artigo 6º	
------------------------------	--	--	-----------	-----------	--

Total Renda Fixa	243.102.513,63
Total Renda Variável	92.634.212,13
Total Invest. Exterior	20.573.402,06
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	12.857,70
TOTAL RECURSOS PREVIDENCIÁRIOS	356.322.985,52



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

3) META ATUARIAL

O retorno da carteira de investimentos do Instituto de Previdência do Município de ITAPEÇERICA DA SERRA – ITAPREV, no acumulado do ano é positivo em 0,86 % (Zero virgula oitenta e seis por centos), abaixo da meta atuarial acumulada de 1,21% que em fevereiro ficou acumulada 1,21% (Um virgula vinte e um por cento).

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno no Mês	Retorno Mês	Meta	Retorno acumulado	Retorno acum.	Meta acum.	Gap (%)
Janeiro	346.117.246,62	9.410.934,24	5.335.370,02	349.067.034,69	-1.125.776,15	-0,32%	0,85%	-1.125.776,15	-0,32%	0,85%	-37,66%
Fevereiro	349.067.034,69	21.237.710,74	18.159.773,97	356.310.127,82	4.165.156,36	1,18%	1,21%	3.039.380,21	0,86%	2,07%	41,53%
						1,18%	1,21%	3.039.380,21	0,86%	2,07%	41,53%

Meta Atuarial Acumulada 2023



Meta Atuarial 2023



Retorno obtido no mês	1,18%
Meta atuarial do mês	1,21%
Retorno da carteira em 2024	0,86%
Meta atuarial em 2024	2,07%

RECURSOS PREVIDENCIARIOS	356.310.127,82
RECURSOS TAXA ADMINISTRATIVA	8.178.046,36
TOTAL DE RECURSOS ITAPREV	364.488.174,18



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

4) RETORNO ACUMULADO POR FUNDO DE INVESTIMENTO

8	Fundos acima da meta atuarial
27	Fundos abaixo da meta atuarial
13	Fundos com rendimento Negativo
48	Total Fundos investidos

16,67%	Fundos da carteira acima da meta atuarial no ano
56,25%	Fundos da carteira abaixo da meta atuarial no ano
27,08%	Fundos da carteira com rendimento negativo no a

GESTOR	Produto / Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922 / 4.392 / 4.604	SEGMENTO	Ret. OBTIDO	Meta 2024	
ZION	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FIL - CARE11	Artigo 11º	RENDA VARIÁVEL	35,04%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	Artigo 9º, Inciso III	RENDA VARIÁVEL	11,26%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
CAIXA	CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I FIC AÇÕES	Artigo 9º, Inciso III	RENDA VARIÁVEL	11,12%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
CAIXA	CAIXA BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	6,63%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
4UM	4UM SMALL CAPS FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	6,55%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDA FIXA	2,26%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
DAYCOVAL	DAYCOVAL CLASSIC FIC RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	RENDA FIXA	2,23%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDA FIXA	2,23%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
SANTANDER	LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA 6,25%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDA FIXA	1,98%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
SANTANDER	LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA 5,93%	Artigo 7º, Inciso IV	RENDA FIXA	1,94%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
BB	BB TITULOS PUBLICOS VERTICE 2024 RENDA FIXA PREVIDENCIARIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,86%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
BB	BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,85%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
CAIXA	CAIXA BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	1,83%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
CAIXA	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,66%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
BB	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF PREVIDENCIARIO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	1,63%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
CAIXA	CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	1,62%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
CAIXA	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	1,54%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO
BB	BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	1,49%	2,07%	TX. ADMINISTRATIVA
GUEPARDO	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	1,37%	2,07%	PREVIDENCIÁRIO



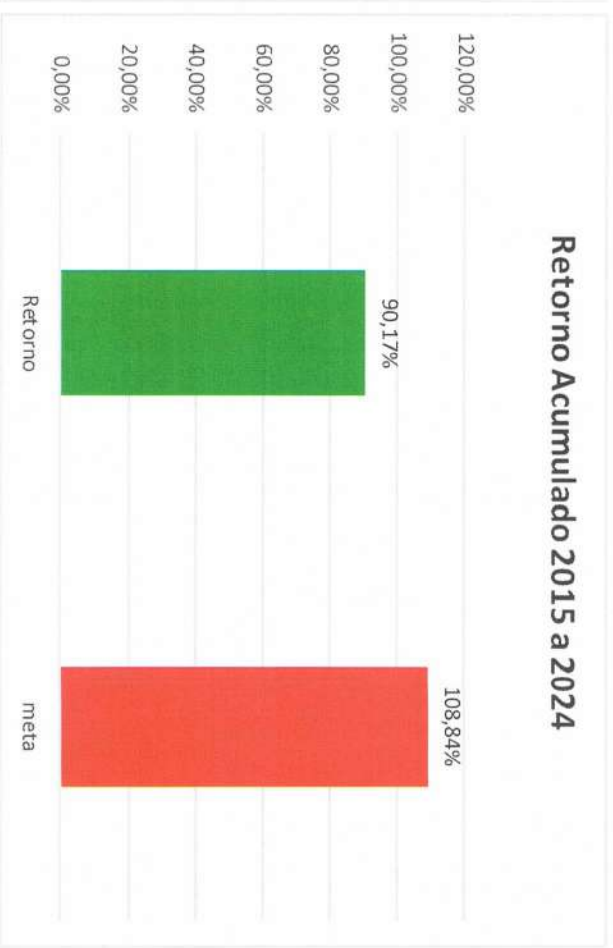
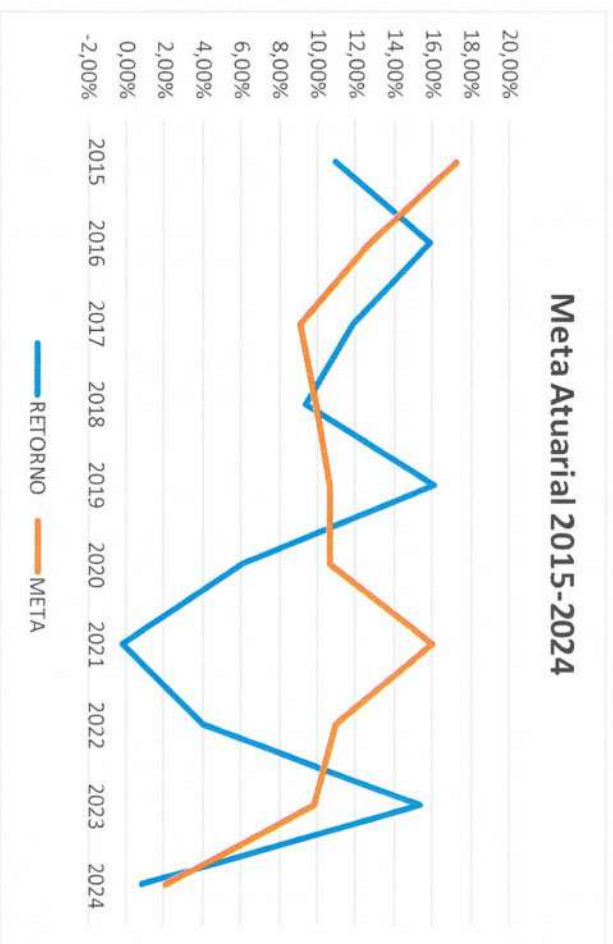
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP, DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

BB	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,24%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CAIXA	CAIXA BRASIL IPCA XVII FII RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,23%	2,07%	PREVIDENCIARIO
BB	BB ALOCAÇÃO FII MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	1,19%	2,07%	PREVIDENCIARIO
BB	BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	1,18%	2,07%	TX. ADMINISTRATIVA
CAIXA	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FII RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,17%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CAIXA	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FII RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,17%	2,07%	PREVIDENCIARIO
BB	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FII RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,15%	2,07%	PREVIDENCIARIO
DAYCOVAL	DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FII RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	1,15%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CAIXA	CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,14%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CAIXA	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FII RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,12%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CAIXA	CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FII RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,12%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CAIXA	CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	1,08%	2,07%	PREVIDENCIARIO
BB	BB TÍTULOS PÚBLICOS VERTICE 2028 RENDA FIXA PREVIDENCIARIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,71%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CAIXA	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FII RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,62%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CAIXA	CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FII RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,24%	2,07%	PREVIDENCIARIO
RIOBRAVO	RIO BRAVO PROTECAO BOLSA AMERICANA FII MULTIMERCADO	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	0,23%	2,07%	PREVIDENCIARIO
BB	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FII RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	-0,06%	2,07%	PREVIDENCIARIO
RIOBRAVO	RIO BRAVO ESTRATEGICO IMA-B FII RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	-0,35%	2,07%	PREVIDENCIARIO
AZQUEST	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-1,49%	2,07%	PREVIDENCIARIO
QUELUZ	QLZ MOS FII AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-1,85%	2,07%	PREVIDENCIARIO
RIOBRAVO	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FII MULTIMERCADO	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-2,30%	2,07%	PREVIDENCIARIO
CONSTANCIA	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FII AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-2,66%	2,07%	PREVIDENCIARIO
FINACAP	FINACAP MAURITSSAD FII AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-2,75%	2,07%	PREVIDENCIARIO
TARPON	TARPON GT 30 FII AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-4,06%	2,07%	PREVIDENCIARIO
DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FII AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-4,18%	2,07%	PREVIDENCIARIO
BNP	BNP PARIBAS ACTION FII AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-4,22%	2,07%	PREVIDENCIARIO
SCHRODER	SCHORDER BEST IDEAS	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-4,88%	2,07%	PREVIDENCIARIO
TRIGONO	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FII AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-7,04%	2,07%	PREVIDENCIARIO
TRIGONO	TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FII AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-7,79%	2,07%	PREVIDENCIARIO



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Retorno acumulado 2015 a 2024



5) ENQUADRAMENTO

Em atendimento a Resolução Nº 4963/2021 em substituição a resolução Nº 3922/2010 e suas alterações, e em atendimento aos limites previsto na política de investimentos vigente, a carteira de investimentos do **Instituto de Previdência do Município de Itapeverica da Serra**, atende aos limites pré-estabelecidos.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	72.807.634,84
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	188.388.305,77	45,84%	30,00%	50,00%	90,00%	161.670.050,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	35.659.226,49	8,78%	2,00%	5,00%	50,00%	146.564.860,60
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	38.695.886,42	10,82%	5,00%	12,50%	20,00%	34.201.948,42
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	10.556.341,31	2,90%	0,00%	3,00%	5,00%	7.968.067,40
Total Renda Fixa	100,00%	261.280.559,99	68,94%	37,00%	71,50%	185,00%	

Artigos - Renda Variável Estruturado - Fundo Imobiliário	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	72.807.689,84	18,86%	10,00%	18,75%	30,00%	38.538.762,31
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.394.841,34	5,32%	2,00%	6,00%	10,00%	17.063.976,08
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,10%	1,00%	3.544.881,74
Artigo 11º	5,00%	431.680,85	0,12%	0,00%	0,15%	2,00%	6.868.082,63
Total Renda Variável / Estruturado / Fundo Imobiliário	30,00%	92.634.212,13	25,41%	12,00%	24,00%	43,00%	

Artigos Exterior	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite -			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	36.448.817,42
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	20.573.402,08	5,84%	1,00%	4,00%	10,00%	15.875.415,36
Total Exterior	10,00%	20.573.402,08	5,84%	1,00%	4,50%	20,00%	



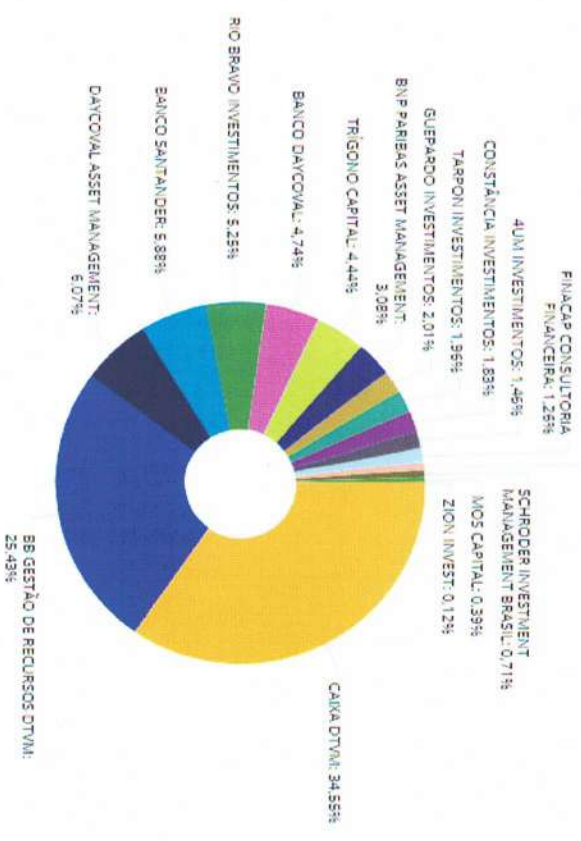
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

6) DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS

Os recursos financeiros do Instituto de Previdência do Município de Itapeverica da Serra, apresenta a seguinte distribuição quanto a gestores, administradores e Subsegmento de aplicações:

Gestores

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ Pl. Gestao
CAIXA DTVM	126.044.066,24	34,55%	Sl Info
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.062.103,47	25,43%	Sl Info
DAVCOVAL ASSET MANAGEMENT	22.111.567,62	6,07%	0,18%
BANCO SANTANDER	21.427.060,28	5,68%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	19.139.065,06	5,25%	1,22%
BANCO DAVCOVAL	17.207.700,14	4,74%	0,15%
TRIGONO CAPITAL	16.167.125,34	4,44%	Sl Info
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	11.238.525,09	3,08%	0,01%
GUERARDO INVESTIMENTOS	7.316.901,67	2,01%	0,10%
TARPPON INVESTIMENTOS	7.149.261,82	1,89%	Sl Info
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	6.878.877,10	1,83%	0,26%
4UM INVESTIMENTOS	5.327.458,11	1,49%	0,13%
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	4.584.742,35	1,29%	Sl Info
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.022.905,04	0,83%	0,01%
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL	2.569.756,44	0,71%	0,03%
MOS CAPITAL	1.432.170,46	0,39%	1,08%
ZION INVEST	431.650,85	0,12%	Sl Info





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

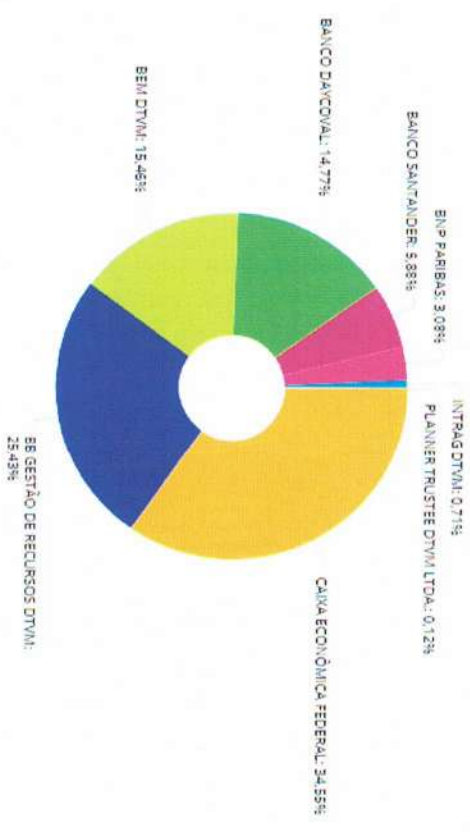
Administradores

Administrador	Valor	% s/Categoria	PL RPPS e PL Global **
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	126.944.098,24	34,95%	Não disponível
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	92.862.103,47	26,43%	Não disponível
BEM DTVM	59.362.554,39	16,46%	Não disponível
BANCO DAVCOVAL	53.841.477,45	14,77%	Não disponível
BANCO SANTANDER	21.427.800,28	5,88%	Não disponível
BNP PARIBAS	11.238.526,09	3,08%	Não disponível
INTRAG DTVM	2.560.766,44	0,71%	Não disponível
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA	431.860,85	0,12%	Não disponível

** RESOLUÇÃO Nº 4.963, DE 25 DE NOVEMBRO DE 2021 - Artigo 21º

§ 2º Os regimes próprios de previdência social somente poderão aplicar recursos em cotas de fundos de investimento quando atendidas, cumulativamente, as seguintes condições:

II - o administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social;



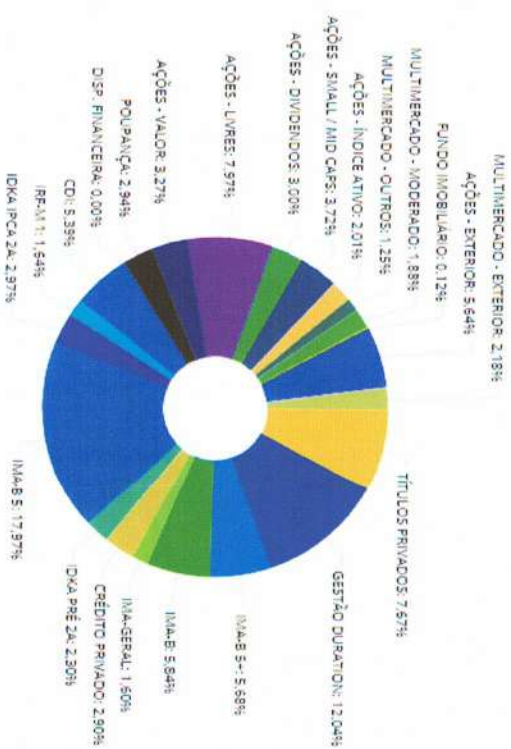


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP, DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Subsegmento das Aplicações

Subsegmento	Valor	%	Característica
TÍTULOS PRIVADOS	27.994.592,00	7,97%	→ TÍTULOS PRIVADOS - R\$ 27.994.592,00 - 7,9720%
GESTÃO DURATION	43.881.231,49	12,04%	→ GESTÃO DURATION - R\$ 43.881.231,49 - 12,0387%
IMA-B 5+	20.698.898,13	5,88%	→ LONGÍSSIMO PRAZO - R\$ 20.698.898,13 - 5,9781%
IMA-B	21.279.359,04	5,84%	→ LONGO PRAZO - R\$ 37.090.820,38 - 10,3522%
IMA-GERAL	6.525.119,13	1,80%	→
CRÉDITO PRIVADO	10.559.341,31	2,90%	→
IDKA PRÉ 2A	6.374.871,81	2,30%	→
IMA-B 6	65.514.956,80	17,97%	→ MÉDIO PRAZO - R\$ 84.719.308,17 - 23,2417%
IDKA IPCA 2A	10.529.477,78	2,97%	→
IRFAM 1	5.977.878,44	1,64%	→
CDI	10.661.708,09	5,38%	→ CURTO PRAZO - R\$ 38.373.809,52 - 9,9790%
DISP. FINANCEIRA	12.807,70	0,00%	→
POUPANÇA	10.731.104,42	2,94%	→
AÇÕES - VALOR	11.901.643,92	3,27%	→
AÇÕES - LIVRES	29.064.710,91	7,97%	→
AÇÕES - DIVIDENDOS	10.940.898,10	3,00%	→ AÇÕES - R\$ 72.807.869,64 - 19,9746%
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	13.579.638,39	3,72%	→
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.323.790,02	2,01%	→
MULTIMERCADO - OUTROS	4.572.814,33	1,25%	→ MULTIMERCADO - R\$ 11.431.722,97 - 3,1383%
MULTIMERCADO - MODERADO	6.868.908,64	1,88%	→
FUNDO IMOBILIÁRIO	431.850,85	0,12%	→ FUNDO IMOBILIÁRIO - R\$ 431.850,85 - 0,1184%
AÇÕES - EXTERIOR	20.573.402,08	5,64%	→ EXTERIOR - R\$ 28.536.530,43 - 7,8258%
MULTIMERCADO - EXTERIOR	7.963.118,37	2,18%	→





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

COI

	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO		0,03%	1,02%	1,98%	4,23%	0,54%	20,66%	1,75%	0,01%	0,055%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRI...		0,75%	2,38%	2,38%	6,02%	11,21%	24,78%	1,00%	0,01%	0,057%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIX...		0,77%	2,41%	2,41%	6,40%	13,73%	28,96%	0,30%	0,06%	0,082%
CAIXA BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIAL DI LP		0,87%	2,25%	2,75%	8,74%	12,03%	27,68%	0,20%	0,01%	0,074%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA ...		0,75%	2,37%	2,37%	6,02%	11,10%	23,79%	0,80%	0,01%	0,046%
DAYCOVAL CLASSIC FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...		1,03%	3,28%	3,28%	6,74%	14,42%	28,47%	0,35%	0,05%	0,244%
CDI (Benchmark)		0,83%	2,62%	2,62%	6,64%	12,38%	27,28%	-	-	-

IDKA IPCA 2 Anos

	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 24 TÍTULOS PÚBLICOS FI...		0,50%	2,08%	2,08%	5,00%	8,45%	18,07%	0,20%	0,52%	1,595%
BB IDKA 3 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREV...		0,88%	2,05%	2,05%	4,90%	8,24%	20,09%	0,20%	0,47%	1,828%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)		0,99%	2,24%	2,24%	5,19%	8,48%	20,99%	-	-	-

IDKA PRÉ 2 ANOS

	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 24 FIC RENDA FIXA LP		0,60%	1,84%	1,84%	5,08%	10,70%	-	0,20%	0,80%	2,611%
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)		0,66%	1,75%	1,75%	6,20%	14,14%	27,54%	-	-	-

IMA Geral

	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC R...		0,51%	1,80%	1,80%	5,44%	12,50%	24,54%	0,20%	0,48%	1,707%
IMA Geral (Benchmark)		0,62%	1,84%	1,84%	6,01%	12,58%	24,78%	-	-	-

IMA-B

	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FIC REND...		0,00%	-2,42%	-2,42%	1,65%	5,34%	5,19%	0,20%	1,11%	5,545%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREV...		0,09%	0,11%	0,11%	4,82%	11,66%	10,66%	0,20%	1,09%	3,663%
IMA-B (Benchmark)		0,08%	0,18%	0,18%	4,96%	11,87%	20,21%	-	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

IMA-B-5

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B-FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	2,00%	2,00%	4,98%	0,44%	20,53%	0,20%	0,44%	1,701%
CAIXA BRASIL IMA-B-FIC TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,76%	2,01%	2,01%	4,98%	0,45%	20,73%	0,20%	0,44%	1,688%
CAIXA BRASIL 2007 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	0,81%	1,75%	1,75%	2,08%	3,35%	-	0,20%	0,75%	4,940%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DUALMICA FI RENDA FIXA	0,51%	1,87%	1,87%	4,52%	0,95%	19,73%	0,50%	0,76%	1,729%
IMA-B-5 (Benchmark)	0,77%	2,00%	2,08%	5,09%	0,52%	21,01%	-	-	-

IPCA

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,02%	2,75%	2,78%	5,01%	0,51%	20,12%	0,20%	0,20%	0,940%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2004 FI RENDA FIX...	0,03%	2,81%	2,81%	6,00%	-	-	0,20%	0,20%	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,02%	2,17%	2,17%	4,77%	11,59%	24,47%	0,40%	0,46%	1,043%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2008 FI RENDA FIX...	0,31%	1,03%	1,03%	4,85%	-	-	0,16%	0,88%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIX...	0,56%	1,80%	1,80%	4,77%	11,59%	28,10%	0,20%	0,56%	1,584%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,03%	-	-	-	-	-	-	0,03%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,20%	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,61%	3,83%	8,76%	-	-	-

IRFM 1

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,80%	2,47%	2,47%	5,37%	12,03%	28,80%	0,20%	0,08%	0,244%
IRFM 1 (Benchmark)	0,84%	2,48%	2,48%	5,42%	12,25%	27,08%	-	-	-

IPCA + 6,00% ao ano

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL FCA XVI F RENDA FIXA CREDITO P...	0,77%	2,01%	2,01%	5,11%	10,03%	21,94%	0,20%	0,53%	1,007%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,82%	2,88%	2,90%	5,55%	10,16%	22,20%	-	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Renda Variável

Não definido

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Anual	Var. Mês	Volatilidade - 12 meses
RIO BRANCO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI. AÇÕES	-1,35%	-1,12%	-1,12%	3,08%	8,53%	-	1,20%	2,02	2,70%
Não definido (Benchmark)									

CDI

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Anual	Var. Mês	Volatilidade - 12 meses
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,72%	1,02%	1,02%	6,59%	10,46%	22,59%	0,89%	0,55	1,48%
CAIXA JUROS E MÓVEIS FIC MULTIMERCADO LP	0,70%	2,33%	2,33%	6,12%	11,88%	20,54%	0,70%	0,27	0,97%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	1,03%	3,22%	3,22%	6,74%	14,40%	25,47%	0,95%	0,06	0,244%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,82%	2,82%	5,54%	12,38%	21,28%	-	-	-

Global BDRX

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Anual	Var. Mês	Volatilidade - 12 meses
Não há dados para a tabela									
GLOBAL BDRX (Benchmark)	4,04%	16,88%	16,88%	24,85%	34,95%	30,50%	-	-	-

Ibovespa

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Anual	Var. Mês	Volatilidade - 12 meses
RIO BRANCO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	-0,80%	-0,24%	-0,24%	7,82%	7,10%	-	1,20%	4,17	7,19%
FI AÇÕES MULTIMERCADO FI AÇÕES	1,66%	-1,23%	-1,23%	13,31%	32,73%	16,28%	2,00%	4,43	19,23%
TRIANGULO PLASSERIE SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC	0,64%	-0,10%	-0,10%	-8,90%	12,00%	6,89%	2,00%	0,80	12,25%
TRIANGULO DELTAHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÃO	2,10%	-6,66%	-6,66%	-8,93%	14,42%	24,33%	2,60%	6,84	18,18%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-0,60%	-5,04%	-5,04%	8,50%	15,12%	1,04%	2,50%	5,26	15,57%
CLZ VOS FI AÇÕES	1,18%	-0,73%	-0,73%	13,09%	48,52%	-	2,00%	5,78	35,85%
TARFON GT INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6,12%	2,39%	2,39%	14,21%	68,23%	58,87%	2,00%	4,46	17,282%
EMIS PARABAS ACTION FIC AÇÕES	-0,34%	-4,19%	-4,19%	4,34%	16,88%	-0,28%	2,00%	5,16	18,885%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	0,19%	-4,70%	-4,70%	6,74%	22,42%	7,24%	1,50%	0,11	18,557%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,06%	-1,63%	-1,63%	10,10%	24,24%	8,43%	2,00%	3,88	13,816%
GUERRA DO VALOR INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1,40%	2,88%	2,88%	15,70%	54,11%	41,70%	1,90%	5,46	16,885%
Bovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	6,00%	28,74%	8,79%	-	-	-

FIX

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Anual	Var. Mês	Volatilidade - 12 meses
BRASILIANI OSALVEIARD AND DEATH CARE SERVICES F	15,65%	68,20%	56,20%	28,90%	-4,80%	-44,85%	1,50%	17,07	38,880%
FIX (Benchmark)	1,45%	2,02%	2,67%	4,37%	23,44%	22,80%	-	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

IMA: B 5

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
ICATU VANQUANCA ISAPAT E LONG BIASED FI MULTIM...	1,32%	1,24%	1,24%	8,37%	17,52%	31,23%	2,00%	2,31	8,270%
IMA: B 6 (Benchmark)	0,77%	2,69%	2,69%	6,09%	6,62%	21,07%	.	.	.

MSCI ACWI

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA INDEBIA BOLSA AMERICANA FI MULTINERCAAO	3,39%	11,15%	11,15%	26,95%	39,04%	34,42%	1,20%	4,69	11,560%
MSCI ACWI (Benchmark)	3,14%	11,17%	11,17%	13,07%	19,99%	19,67%	.	.	.

MSCI USA Extended ESG Focus

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	2,10%	13,86%	13,86%	22,00%	28,41%	21,60%	1,00%	6,80	13,276%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,34%	13,20%	13,20%	22,11%	24,60%	19,96%	.	.	.

SMLL

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,89%	1,29%	1,29%	10,39%	23,82%	0,40%	2,00%	4,31	18,828%
4UMI SMALL CAPS FIC AÇÕES	2,88%	-2,16%	-2,16%	10,22%	57,59%	23,80%	2,00%	6,03	18,200%
SMLL (Benchmark)	2,15%	-4,00%	-4,00%	8,93%	24,13%	-10,67%	.	.	.

Investimento no Exterior

Global BRPX

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NIVEL I	3,46%	14,58%	14,58%	23,77%	32,44%	27,50%	0,70%	5,50	14,034%
Global BRPX (Benchmark)	4,04%	16,58%	16,58%	24,68%	34,05%	30,58%	.	.	.

MSCI USA Extended ESG Focus

Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VAR Mês	Volatilidade - 12 meses
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	2,18%	13,86%	13,86%	22,00%	28,41%	21,60%	1,00%	5,80	13,276%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,34%	13,20%	13,20%	22,12%	24,60%	19,96%	.	.	.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

8) DELIBERAÇÕES

Deliberações do comitê de investimentos:

FUNDO

BB IMA-B TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO

APLICAÇÃO R\$3.068.601,17-Aplicação para diversificação da carteira em ativos de renda fixa de longo prazo. Os recursos da aplicação serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES (R\$2.000.000,00) e do saldo referente ao pagamento de cupons de fundos vértice.

FUNDO

CAIXA BRASIL 2030 II TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA

RESGATE R\$ 564.076,52 – Pagamento de cupons semestrais. Os recursos serão aplicados no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES para futura diversificação.

FUNDO

CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA FIC RENDA FIXA

APLICAÇÃO R\$ 4.000.000,00- Aplicação para diversificação em ativos de renda fixa gestão ativa. Os recursos da aplicação serão resgatados no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

FUNDO

BB TITULOS PUBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO

RESGATE R\$ 462.235,10-Pagamento de cupons semestrais. Os recursos do pagamento serão aplicados no fundo BB IMA-B TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA.

FUNDO

BB TITULOS PUBLICOS VERTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIA

RESGATE R\$ 458.052,11-Pagamento de cupons semestrais. Os recursos do pagamento serão aplicados no fundo BB IMA-B TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA.

FUNDO

BB TITULOS PUBLICOS VERTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIA

RESGATE R\$ 148.313,96-Pagamento de cupons semestrais. Os recursos do pagamento serão aplicados no fundo BB IMA-B TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA.

FUNDO

4UM SMALL CAPS FI AÇÕES

APLICAÇÃO R\$ 5.000.000,00- Aplicação para diversificação da carteira em ativos de renda variável. Os recursos da aplicação serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

FUNDO

BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES

APLICAÇÃO R\$ 1.502.530,04 – Aplicação para diversificação da carteira em ativos de renda variável. Os recursos da aplicação serão resgatados do fundo ACCESS EQUITY WORLD

FUNDO

CAIXA INDEXADO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO

APLICAÇÃO R\$ 1.000.000,00- Aplicação para diversificação da carteira em ativos de investimento no exterior. Os recursos da aplicação serão resgatados do fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

FUNDO

ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTAVEL IS INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

RESGATE R\$ 1.502.530,04-Resgate para reenquadramento da carteira. Ativos destinados a investidores qualificados desde maio/2021. Os recursos do resgate serão aplicados no fundo BNP ACTION FIC FIA

FUNDO

SCHRODER SISTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR

RESGATE R\$ 1.598.081,15- Resgate para reenquadramento da carteira. Ativos destinados a investidores qualificados desde maio/2021. Os recursos do resgate serão aplicados no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

Repassse das contribuições dos entes - Estima-se o recebimento de aproximadamente R\$ 4.800.000,00 (Quatro milhões e oitocentos mil reais) que serão utilizados aproximadamente R\$ 1.500.000,00 (Um milhão e quinhentos reais) para pagamento de benefícios e custeio do RPPS. O Saldo restante ficará aplicado no fundo CX BR DISPONIBILIDADE para futura diversificação da carteira.

9) OUTRAS ANALISES

A carteira do RPPS atende as especificações e enquadramentos e limites da Resolução Nº 4963/2021;

Segundo consta em recente estudo de ALM realizado no ITAPREV, a carteira de investimentos do RPPS possui aproximadamente 90% de liquidez em D+30, permitindo a manutenção do portfólio em casos de mudanças no cenário econômico;

Não há desequilíbrio ou ativos em liquidação na carteira do RPPS;

No fechamento do mês, a carteira de investimentos encontra-se com rentabilidade acima da meta atuarial acumulada projetada.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

10) Credenciamento

Distribuidores

GRID AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTOS LTDA

Gestores

TRIGONO CAPITAL LTDA - Renovação

ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Administradores

Administradores com credenciamento validos (Não houve novo credenciamento no mês)

11) Assuntos Gerais:

Depois de um 2023 acima das expectativas de mercado, com início de cortes na SELIC e um direcionamento para controle da inflação, 2024 iniciou com a expectativa de um cenário mais desafiador e com expectativas de crescimento da economia brasileira menor que 2023. No cenário internacional há a expectativas de quando o FOMC iniciará as cortes na taxa de juros americanas, que sinalizavam que seria em março/24, mas que agora já há expectativa para cortes entre o fim o primeiro e início do segundo semestre. Janeiro foi um mês volátil e ativos de renda variável em sua maioria fecharam com rendimentos negativos.

Buscando captar as oportunidades do cenário, o comitê ao longo de 2023 e começo de 2024 acompanhou o desempenho dos fundos 4UM SMALL CAPS FI AÇÕES da gestora 4UM, distribuído pela ATINA agente autônomo de investimentos e o fundo ICATU VANGUARDA IGARATE LONG BIASED FI MULTIMERCADO da gestora ICATU distribuído pela GRID agentes autônomos de Investimentos.

Ao longo dos períodos analisados os fundos mostraram retornos consistentes que podem agregar a carteira do RPPS, em comparativos a outros fundos do mercado e da própria carteira do RPPS, optou-se pelos fundos devido a consistência dos retornos mostrando o compromisso dos gestores.

Em atendimento política de investimentos, o comitê de investimentos oficializou o conselho administrativo para aprovação das aplicações nos fundos sendo uma aplicação inicial de R\$ 5.000.000,00 com possível aplicação adicional de R\$ 5.000.000,00 conforme os fundos



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

demonstrarem retornos satisfatórios, ambos os fundos possuem parecer favorável da consultoria de investimentos com sugestão de exposição no segmento em que os fundos se enquadraram. Após análise e aprovação pelo conselho administrativo em resposta ao ofício Nº16/2024, foram aprovadas as aplicações, sendo realizada a aplicação no fundo 4UM SMALL CAPS em fevereiro e, a aplicação no fundo ICATU VANGUARDA será realizada no mês de março. Antes da aplicação o comitê ainda no processo de diligência conversou com os distribuidores e gestores dos fundos para demonstrarem ainda a visão de cenário e a viabilidade de aplicação em ambos os fundos.

Quanto ao resgate do fundo ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, o comitê aprovou por aplicar os recursos no fundo que o RPPS possui com a gestora BNP PARIBAS ACTION FIA, devido ao compromisso e a credibilidade da gestora com a administração de recursos. O comitê pondera que o fundo não é um dos melhores na carteira nem do mercado, mas apresenta retornos consistentes no longo prazo que é o objetivo do RPPS.

Para o resgate do fundo SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES, o comitê de investimentos também analisará a aplicação dos recursos no fundo que o RPPS ainda possui com a gestora o SCHRODER BEST IDEAS, no caso do resgate e aplicação do fundo da SCHRODER houve uma diferença no resgate e aplicação, por que no caso do BNP PARIBAS o RPPs possui conta no banco BNP PARIBAS e ocorrerá a migração de recursos entre fundos. Os fundos SCHRODER possuem administração BEM DTVM, o que faz que necessariamente os recursos do resgate serão creditados na conta previdenciária do RPPS na CAIXA ECONOMICA FEDERAL e depois deverão ser enviados novamente a conta do fundo SCHRODER BEST IDEAS na BEM DTVM para aplicação, somado a esse processo todo de resgate e aplicação, todos os fundos da SCHRODER estão em migração para a administração INTRAG(Itaú) o que demandará tempo para credenciamento par aplicação, o comitê analisa aplicar os recursos dos resgates em um dos novos fundos 4UM ou ICATU, até lá o recursos ficarão aplicados no fundo de aplicação automática CAIXA BR DISPONIBILIDADE FIC RF.

Em fevereiro o comitê de investimentos realizou reunião com a Atina Agente autônomos de investimentos em reunião on-line também os gestores da 4UM para conversarmos sobre o fundo 4UM SMALL CAPS, alvo de análise do comitê, a reunião foi para atualização das perspectivas dos gestores quanto ao cenário de 2024 e as oportunidades que o fundo poderia usufruir, para justificar opção pelo aporte no fundo ao final do período do longo período de análise do comitê. Com parecer favorável da consultoria de investimentos e do conselho fiscal, o aporte ao fundo foi realizado em fevereiro/24.

O comitê de investimentos também recebeu o representante da R3 agentes autônomos para reunião para atualização dos fundos que o RPPS possui que o agente autônomo distribuiu, além da atualização sobre os fundos foi prestando ao comitê os fundos da gestora VOLKIN, o comitê analisará futuramente a viabilidade e o potencial dos fundos da gestora agregar a carteira do RPPS.




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Para o processo de capacitação do comitê de investimentos, os membros participaram do congresso RPPS 2024-O QUE FAZER? Realizado pela associação APEPREV na cidade de Curitiba, congresso com temas sobre as oportunidades de investimentos para o cenário projetado para o ano além de palestras com temas previdenciários que impactam na gestão dos recursos, como atualização de base de cadastros para cálculo atuarial, estudo de ALM, entre outros. No mês de março o comitê de investimentos também participará do 6º Congresso Brasileiro de Investimentos que será realizado novamente na cidade de Florianópolis/SC.



José Roberto dos Santos
Membro Comitê de investimento
CPA-10/CGRPPS/CP RPPS CGINV II



Alex Domingues de Castro Santos
Membro Comitê de investimento
CPA-10/CGRPPS/CP RPPS CGINV I



Rafael de Jesus Freitas
Membro Comitê de investimento
CPA-10/CP RPPS CG INVI



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL

O Conselho Fiscal, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, aprovou o relatório de investimentos, conforme registro na ata de reunião em anexo



CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	11.092.272,87	3,04%	709	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	47.189,14	0,01%	92.215	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.912.116,30	1,07%	884	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	9.734.335,08	2,67%	795	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	10.180.745,07	2,79%	650	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	5.114.248,46	1,40%	315	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	16.109.771,95	4,42%	43	7,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	16.223.633,61	4,45%	370	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	16.139.191,95	4,43%	-83	3,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	20.696.868,13	5,68%	110	2,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.523.456,32	3,16%	798	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.914.361,46	1,90%	843	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.374.871,61	2,30%	56	3,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.308.024,21	2,01%	913	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	5.825.119,13	1,60%	161	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.977.878,44	1,64%	1.191	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	11.195.222,04	3,07%	1.874	9,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.130.857,22	2,23%	1.015	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.070.280,26	2,76%	116	1,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	1.596.962,89	0,44%	362	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.762.511,25	1,31%	993	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	11.098.614,87	3,04%	14	7,92%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	D+0	Não se aplica	8.622.818,05	2,37%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	D+0	Não se aplica	8.644.888,09	2,37%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	D+0	Não se aplica	10.696.875,86	2,93%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	D+0	Não se aplica	10.731.104,42	2,94%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	6.963.732,05	1,91%	102	3,11%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	3.592.609,26	0,99%	44.708	0,27%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	5.327.458,11	1,46%	672	1,63%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FI AÇÕES	D+30	Não há	3.022.995,04	0,83%	2.626	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FI AÇÕES	D+30	Não há	11.238.525,09	3,08%	1.963	6,78%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	6.678.977,10	1,83%	2.318	0,44%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	7.323.756,62	2,01%	378	5,74%	Artigo 8º, Inciso I
FINAÇAP MAURITSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	4.584.742,35	1,26%	305	1,06%	Artigo 8º, Inciso I
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	7.316.901,57	2,01%	87	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	1.432.170,46	0,39%	62	1,67%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	2.569.756,44	0,71%	32	1,85%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FI AÇÕES	D+32	Não há	7.145.281,82	1,96%	58	0,36%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	10.940.939,10	3,00%	22	1,31%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FI AÇ...	D+32	Não há	5.226.186,24	1,43%	32	0,57%	Artigo 8º, Inciso I



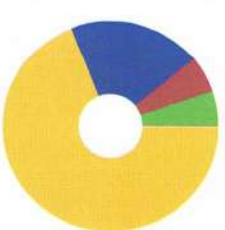
Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	D+5	Não há	9.859.375,11	2,70%	9.869	1,37%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	D+4	Não há	10.714.026,95	2,94%	470	0,48%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.277.558,66	0,62%	89	1,80%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.503.997,26	1,24%	6.935	0,25%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	4.572.814,33	1,25%	2.570	0,36%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	3.459.121,11	0,95%	21	1,46%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	4.581.349,98	1,26%	20	2,55%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	431.680,85	0,12%		0,15%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			364.488.174,18				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			12.857,70				Artigo 6º
			PL Total	364.501.031,88			



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	72.897.634,84
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	166.369.305,77	45,64%	30,00%	50,00%	90,00%	161.670.050,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	35.659.226,49	9,78%	2,00%	5,00%	50,00%	146.584.860,60
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	38.695.686,42	10,62%	5,00%	12,50%	20,00%	34.201.948,42
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	10.556.341,31	2,90%	0,00%	3,00%	5,00%	7.668.067,40
Total Renda Fixa	100,00%	251.280.559,99	68,94%	37,00%	71,50%	185,00%	



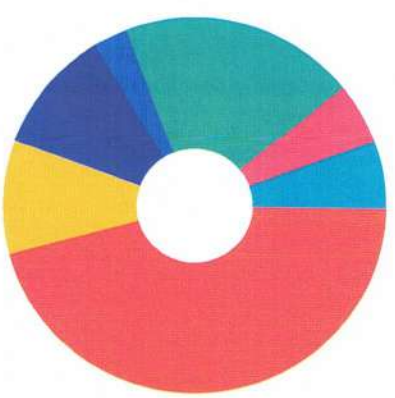
- RENDA FIXA 251.280.559,99
- RENDA VARIÁVEL 72.807.689,94
- EXTERIOR 20.573.402,06
- ESTRUTURADOS 19.394.841,34
- FUNDO IMOBILIÁRIO 431.680,85



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%	72.807.689,94	19,98%	10,00%	18,75%	30,00%	36.538.762,31
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.394.841,34	5,32%	2,00%	5,00%	10,00%	17.053.976,08
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,10%	1,00%	3.644.881,74
Artigo 11º	5,00%	431.680,85	0,12%	0,00%	0,15%	2,00%	6.858.082,63
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	92.634.212,13	25,41%	12,00%	24,00%	43,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,50%	10,00%	36.448.817,42	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	20.573.402,06	5,64%	1,00%	4,00%	10,00%	15.875.415,36
Total Exterior	10,00%	20.573.402,06	5,64%	1,00%	4,50%	20,00%	



- 7º I b
- 7º III a
- 7º IV
- 7º V b
- 8º I
- 10º I
- 11º
- 9º II
- 9º III



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	166.369.305,77	45,64	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	35.659.226,49	9,78	2,00	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10.556.341,31	2,90	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	72.807.689,94	19,98	10,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	20.573.402,06	5,64	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	19.394.841,34	5,32	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 11º	431.680,85	0,12	0,00	2,00



Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	125.944.096,24	34,55	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	92.682.103,47	25,43	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	22.111.587,92	6,07	0,19
BANCO SANTANDER	21.427.980,28	5,88	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	19.139.085,96	5,25	1,22
BANCO DAYCOVAL	17.267.706,14	4,74	0,15
TRIGONO CAPITAL	16.167.125,34	4,44	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	11.238.525,09	3,08	0,01
GUERPARDO INVESTIMENTOS	7.316.901,57	2,01	0,10
TARPON INVESTIMENTOS	7.145.281,82	1,96	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	6.678.977,10	1,83	0,26
4UM INVESTIMENTOS	5.327.458,11	1,46	0,13
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	4.584.742,35	1,26	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.022.995,04	0,83	0,01
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	2.569.756,44	0,71	0,03
MOS CAPITAL	1.432.170,46	0,39	1,08
ZION INVEST	431.680,85	0,12	-

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
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	1,16%	2,59%	4,30%	9,78%	22,13%	0,48%	1,73%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,27%	2,22%	3,31%	5,65%	10,77%	23,98%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,56%	1,24%	2,68%	4,39%	10,88%	24,09%	0,46%	1,86%
IMA Geral (Benchmark)	0,64%	1,11%	2,75%	5,15%	14,09%	26,08%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,08%	2,70%	5,06%	14,00%	25,93%	0,40%	1,76%
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 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	1,13%	2,84%	1,05%	5,37%	-	0,65%	4,93%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,52%	1,16%	2,57%	4,04%	10,01%	22,07%	0,53%	1,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	1,24%	2,70%	4,31%	10,24%	22,71%	0,41%	1,77%



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

	Mes	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
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%
IMA-B (Benchmark)	0,55%	0,10%	2,85%	3,87%	14,70%	23,81%	-	-
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	0,05%	2,79%	3,75%	14,39%	23,18%	0,79%	3,97%
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,00%	2,23%	3,33%	6,88%	14,21%	28,55%	0,08%	0,26%
BB FLUXO FIG RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,61%	2,45%	5,17%	11,62%	24,88%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83%	1,84%	2,78%	5,90%	13,25%	27,96%	0,02%	0,07%
BB AUTOMÁTICO FIG RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,61%	1,35%	2,05%	4,37%	9,87%	20,99%	0,00%	0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,63%	2,59%	5,52%	14,98%	26,64%	0,04%	1,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIG RENDA FIXA SIMPLES	0,73%	1,61%	2,44%	5,18%	11,42%	23,83%	0,00%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	-	-	-	-	-	-	-	-
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 ATIVA FIG RENDA FIXA LP	0,65%	1,54%	2,54%	4,59%	12,31%	24,71%	0,49%	1,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIG RENDA FIXA	0,56%	1,21%	2,44%	4,59%	12,70%	25,41%	0,42%	1,32%



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
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,87%	2,82%	5,24%	-	-	0,25%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	0,72%	2,72%	3,75%	-	-	0,68%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,78%	-0,35%	2,19%	2,92%	10,40%	-	2,38%	5,96%



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
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-0,93%	0,23%	1,23%	4,82%	12,82%	-	2,27%	2,15%
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,65%	1,19%	2,43%	5,32%	11,49%	23,97%	0,46%	1,47%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,68%	1,62%	2,54%	5,29%	12,17%	26,98%	0,27%	0,34%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,00%	2,23%	3,33%	6,88%	14,21%	28,55%	0,08%	0,26%
Global BDRX (Benchmark)	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL 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%	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,69%	-2,30%	1,15%	9,19%	10,88%	-	5,42%	6,97%
QLZ MOS FIAÇÕES	1,79%	-1,86%	3,67%	6,98%	41,44%	-	6,27%	22,08%
BNP PARIBAS ACTION FIAÇÕES	0,07%	-4,86%	0,19%	3,98%	11,10%	3,29%	6,45%	16,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	0,80%	-2,66%	3,67%	7,86%	19,48%	15,51%	6,39%	14,19%
FINACAP MAURITSTAD FIAÇÕES	2,79%	-2,75%	3,52%	11,84%	28,03%	19,72%	7,70%	15,56%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIAÇÕES	-0,94%	-7,78%	-3,38%	-5,99%	6,75%	28,47%	9,58%	19,21%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FIAÇÕES	0,48%	-4,18%	0,59%	9,80%	15,99%	8,96%	6,73%	15,94%
TARPPON GT INSTITUCIONAL I FIAÇÕES	2,24%	-4,06%	5,39%	15,20%	49,41%	60,85%	5,76%	18,38%



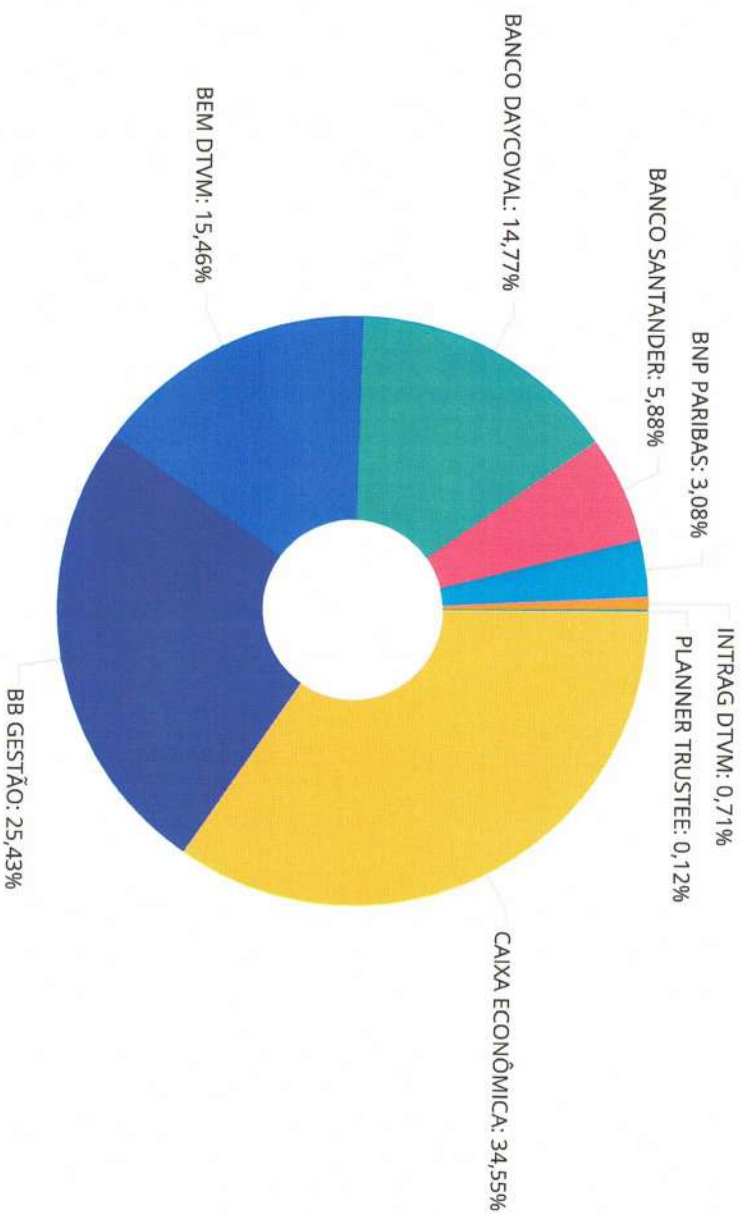
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	0,06%	-4,88%	1,01%	8,30%	20,45%	12,81%	6,83%	15,88%
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,90%	1,37%	4,08%	15,78%	50,26%	48,40%	5,44%	17,72%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,84%	-7,04%	-2,78%	-7,08%	3,96%	15,37%	9,66%	19,79%
IFIX (Benchmark)	0,79%	1,47%	5,77%	4,58%	19,64%	22,58%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	10,12%	35,04%	31,21%	-2,63%	-17,04%	-30,71%	24,03%	37,92%
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%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	5,66%	9,55%	12,36%	14,14%	21,82%	10,33%	-	-
BBAÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	6,72%	11,25%	14,54%	15,41%	26,94%	14,21%	8,51%	13,58%
SMLL (Benchmark)	0,47%	-6,11%	0,51%	1,70%	19,40%	-4,74%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,63%	-1,49%	3,68%	6,16%	16,93%	2,55%	6,31%	16,74%
4UM SMALL CAPS FIC AÇÕES	3,83%	-4,91%	2,97%	7,31%	38,00%	23,94%	9,83%	20,57%



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

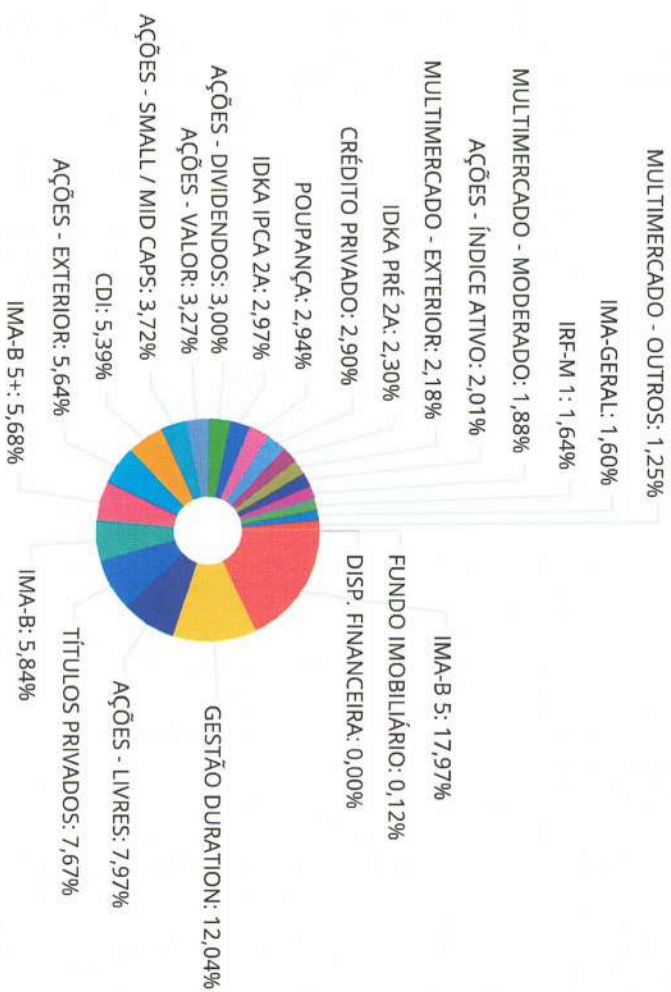
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	5,66%	9,55%	12,36%	14,14%	21,82%	10,33%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,72%	11,25%	14,54%	15,41%	26,94%	14,21%	8,51%	13,584%
Global BDRX (Benchmark)	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	6,27%	11,12%	13,99%	15,34%	32,07%	18,33%	8,72%	14,393%



CAIXA ECONÔMICA	125.944.096,24
BB GESTÃO	92.682.103,47
BEM DTVM	56.352.554,36
BANCO DAYCOVAL	53.841.477,45
BANCO SANTANDER	21.427.980,28
BNP PARIBAS	11.238.525,09
INTRAG DTVM	2.569.756,44
PLANNER TRUSTEE	431.680,85



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



Sub-Segment	Value	Sub-Segment	Value	Sub-Segment	Value
IMA-B 5	65.514.956,80	GESTÃO DURATION	43.881.231,49	AÇÕES - LIVRES	29.064.710,91
IMA-B	21.279.359,94	IMA-B 5+	20.696.868,13	AÇÕES - EXTERIOR	20.573.402,06
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	13.576.639,39	AÇÕES - VALOR	11.901.643,92	AÇÕES - DIVIDENDOS	10.940.939,10
POUPANÇA	10.731.104,42	CRÉDITO PRIVADO	10.556.341,31	IDKA PRÉ 2A	8.374.871,61
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.323.756,62	MULTIMERCADO - MODERADO	6.858.908,64	IRF-M 1	5.977.878,44
MULTIMERCADO - OUTROS	4.572.814,33	FUNDO IMOBILIÁRIO	431.680,85	DISP. FINANCEIRA	12.857,70
				TÍTULOS PRIVADOS	27.964.582,00
				CDI	19.651.768,96
				IDKA IPCA 2A	10.826.477,76
				MULTIMERCADO - EXTERIOR	7.963.118,37
				IMA-GERAL	5.825.119,13



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

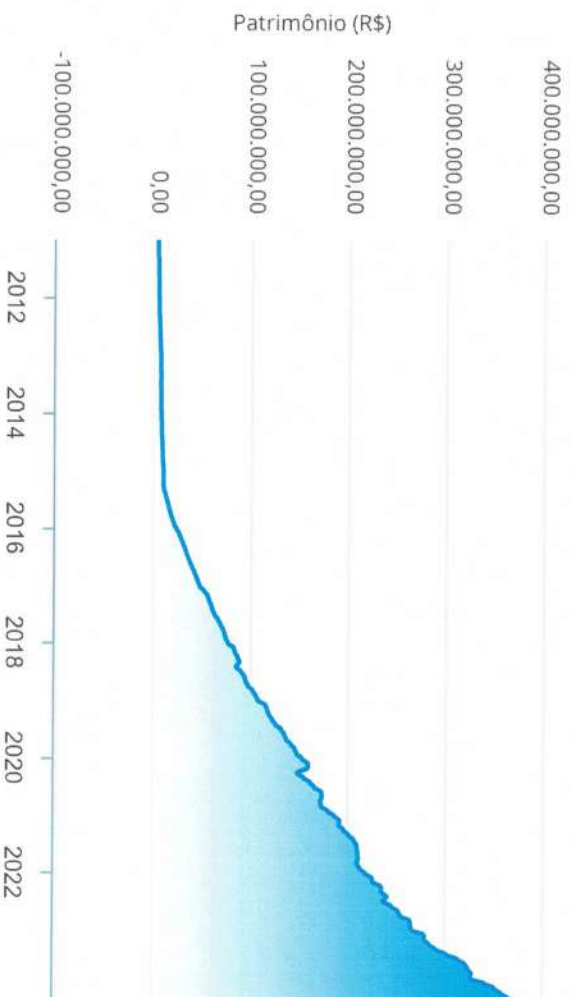
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	346.117.246,62	9.410.934,24	5.335.370,02	349.067.034,69	-1.125.776,15	-1.125.776,15	-0,32%	-0,32%	0,85%	0,85%	-37,66%	2,43%
Fevereiro	349.067.034,69	21.237.710,74	18.159.773,97	356.310.127,82	4.185.156,36	3.039.380,21	1,18%	0,86%	1,21%	2,07%	41,43%	3,02%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

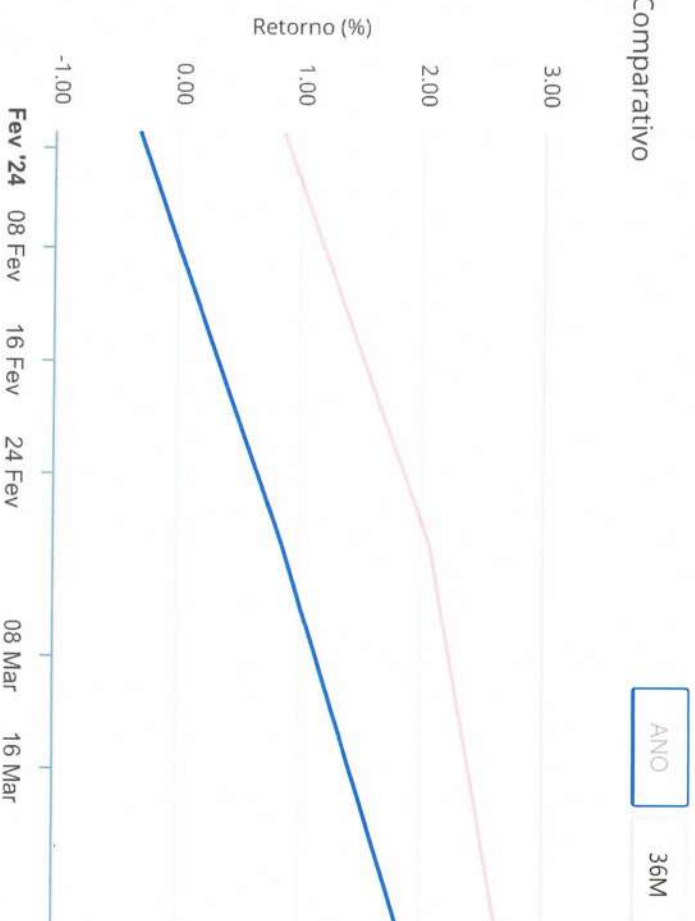




Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
 - IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
 - CDI IMA-B



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 (RS)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,23%	8.551.316,64	0,00	0,00	8.644.888,09	93.571,45	1,09%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL TAXA 7,00%	8.530.866,49	0,00	0,00	8.622.818,05	91.951,56	1,08%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3.556.955,42	0,00	0,00	3.592.609,26	35.653,84	1,00%	1,00%	0,08%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 6,25%	10.637.484,46	0,00	0,00	10.731.104,42	93.619,96	0,88%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER TAXA IPCA + 5,93%	10.605.966,32	0,00	0,00	10.696.875,86	90.909,54	0,86%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.723.555,01	0,00	0,00	4.762.511,25	38.956,24	0,82%	0,82%	0,02%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	11.012.511,32	0,00	0,00	11.098.614,87	86.103,55	0,78%	0,78%	2,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.007.135,81	0,00	0,00	11.092.272,87	85.137,06	0,77%	0,77%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.933.837,14	0,00	0,00	5.977.878,44	44.041,30	0,74%	0,74%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	5.224.255,25	0,00	148.313,96	5.114.248,46	38.307,17	0,73%	0,74%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIAR...	16.565.594,27	0,00	462.235,10	16.223.633,61	120.274,44	0,73%	0,73%	0,25%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	8.290.727,87	0,00	219.571,93	8.130.857,22	59.701,28	0,72%	0,73%	0,01%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.005.095,07	0,00	0,00	10.070.280,26	65.185,19	0,65%	0,65%	0,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	16.463.077,04	0,00	458.052,11	16.109.771,95	104.747,02	0,64%	0,64%	0,68%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	5.788.640,85	0,00	0,00	5.825.119,13	36.478,28	0,63%	0,63%	0,40%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.135.477,72	0,00	564.076,52	20.696.868,13	125.466,93	0,59%	-2,08%	4,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.266.119,88	0,00	0,00	7.308.024,21	41.904,33	0,58%	0,58%	0,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.678.619,69	0,00	0,00	9.734.335,08	55.715,39	0,58%	0,58%	0,41%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.047.214,30	0,00	0,00	16.139.191,95	91.977,65	0,57%	0,57%	0,65%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	6.924.692,76	0,00	0,00	6.963.732,05	39.039,29	0,56%	0,56%	0,46%



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
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	11.137.144,70	0,00	0,00	11.195.222,04	58.077,34	0,52%	0,52%	0,53%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.464.950,99	4.000.000,00	0,00	11.523.456,32	58.505,33	0,51%	0,55%	0,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.894.790,49	0,00	0,00	3.912.116,30	17.325,81	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.884.138,17	0,00	0,00	6.914.361,46	30.223,29	0,44%	0,44%	0,48%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	23.128,31	25.000,00	1.149,85	47.189,14	210,68	0,44%	0,61%	0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.069.721,40	3.068.601,17	0,00	10.180.745,07	42.422,50	0,42%	0,53%	0,79%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	8.341.019,96	0,00	0,00	8.374.871,61	33.851,65	0,41%	0,41%	0,83%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	8.324.484,98	6.666.579,53	13.426.485,09	1.596.962,89	32.383,47	0,22%	0,73%	0,00%
Total Renda Fixa	251.088.522,31	13.760.180,70	15.279.884,56	251.280.559,99	1.711.741,54	0,68%		0,96%

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 - Mes
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI - ...	392.012,88	0,00	0,00	431.680,85	39.667,97	10,12%	10,12%	24,03%
4UM SMALL CAPS FIAÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.327.458,11	327.458,11	6,55%	3,83%	9,83%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.295.079,50	1.000.000,00	0,00	4.503.997,26	208.917,76	4,88%	5,70%	5,27%
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.110.418,14	0,00	0,00	7.316.901,57	206.483,43	2,90%	2,90%	5,44%
FINACAP MAURITSTAD FIAÇÕES	4.460.480,85	0,00	0,00	4.584.742,35	124.261,50	2,79%	2,79%	7,70%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	6.988.872,03	0,00	0,00	7.145.281,82	156.409,79	2,24%	2,24%	5,76%
QLZ MOS FIAÇÕES	1.406.968,75	0,00	0,00	1.432.170,46	25.201,71	1,79%	1,79%	6,27%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.974.434,92	0,00	0,00	3.022.995,04	48.560,12	1,63%	1,63%	6,31%
TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	5.182.901,29	0,00	0,00	5.226.186,24	43.284,95	0,84%	0,84%	9,66%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	6.626.011,29	0,00	0,00	6.678.977,10	52.965,81	0,80%	0,80%	6,39%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	4.549.939,37	0,00	0,00	4.581.349,98	31.410,61	0,69%	0,69%	5,42%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	4.541.773,74	0,00	0,00	4.572.814,33	31.040,59	0,68%	0,68%	0,27%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.262.949,60	0,00	0,00	2.277.558,66	14.609,06	0,65%	0,65%	0,46%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FIAÇÕES	7.288.552,54	0,00	0,00	7.323.756,62	35.204,08	0,48%	0,48%	6,73%
SCHRODER BEST IDEAS FIAÇÕES	2.568.132,43	0,00	0,00	2.569.756,44	1.624,01	0,06%	0,06%	6,83%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9.734.818,08	1.502.530,04	0,00	11.238.525,09	1.176,97	0,01%	0,07%	6,45%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3.491.578,85	0,00	0,00	3.459.121,11	-32.457,74	-0,93%	-0,93%	2,27%
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.044.631,22	0,00	0,00	10.940.939,10	-103.692,12	-0,94%	-0,94%	9,58%
Total Renda Variável	83.919.555,48	7.502.530,04	0,00	92.634.212,13	1.212.126,61	1,33%		6,51%



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 - Mes
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	9.238.514,52	0,00	0,00	9.859.375,11	620.860,59	6,72%	6,72%	8,51%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	10.081.920,86	0,00	0,00	10.714.026,95	632.106,09	6,27%	6,27%	8,72%
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTAVEL IS INVESTIMENTO NO...	1.476.955,03	0,00	1.502.530,04	0,00	25.575,01	1,73%	3,38%	4,83%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.575.422,67	0,00	1.598.081,15	0,00	22.658,48	1,44%	2,92%	5,88%
Total Exterior	22.372.813,08	0,00	3.100.611,19	20.573.402,06	1.301.200,17	5,82%		8,62%



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.