

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

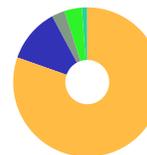
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	13.497.493,16	9,14%	709	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.538.012,08	4,43%	884	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.607.404,85	1,09%	650	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.014.741,10	0,69%	315	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	10.908.683,51	7,39%	101	1,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.372.564,19	2,28%	798	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.507.517,25	2,37%	843	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.651.931,09	4,50%	913	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FX...	D+0	Não há	1.703.582,89	1,15%	775	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.733.464,56	2,53%	1.191	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.183.673,95	10,28%	252	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FX...	D+0	Não há	4.786.956,60	3,24%	452	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.566.095,02	1,74%	1.139	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	7.716.709,48	5,22%	149	1,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.865.459,51	8,03%	149	1,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.732.908,20	8,62%	449	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.135.492,04	1,45%	993	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	131.757,54	0,09%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	96.291,99	0,07%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	7.394.752,35	5,01%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MASTER II FIDC MULTISSETORIA L SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	13.947,35	0,01%	35	1,10%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	625.261,08	0,42%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	911.811,74	0,62%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.053.523,73	0,71%	2.626	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.045.214,85	1,38%	17.395	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.839.443,31	2,60%	245	9,76%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.115.873,35	2,11%	122	0,71%	Artigo 8º, Inciso I
FINACA P MAURISSTAD FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.215.105,08	2,18%	305	0,74%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.624.426,42	1,10%	32	1,17%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.500.057,36	1,69%	1.676	0,78%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.468.174,86	0,99%	17.010	0,28%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.729.092,81	1,85%	470	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.667.980,61	3,84%	38.763	0,35%	Artigo 10º, Inciso I
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.753.690,55	1,19%		1,24%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			147.709.094,48				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.914.057,96				Artigo 6º
PL Total			151.623.152,44				

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

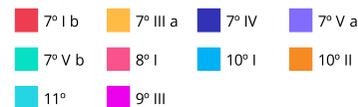
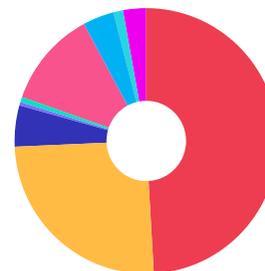
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	25,00%	36.927.273,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	72.506.025,23	49,09%	20,00%	30,00%	80,00%	45.661.250,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	37.244.713,78	25,21%	15,00%	20,00%	50,00%	36.609.833,46
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	7.394.752,35	5,01%	0,00%	15,00%	20,00%	22.147.066,55
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	639.208,43	0,43%	0,00%	1,00%	5,00%	6.746.246,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	911.811,74	0,62%	0,00%	1,00%	5,00%	6.473.642,98
Total Renda Fixa	100,00%	118.696.511,53	80,36%	35,00%	77,00%	185,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	17.393.644,10	11,78%	5,00%	15,00%	30,00%	26.919.084,24
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	44.312.728,34
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.667.980,62	3,84%	1,00%	3,00%	10,00%	9.102.928,83
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.385.454,71
Artigo 11º	5,00%	1.753.690,55	1,19%	0,00%	2,00%	5,00%	5.631.764,17
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	24.815.315,28	16,80%	6,00%	20,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.197.267,67	2,84%	0,00%	2,00%	10,00%	10.573.641,78
Total Exterior	10,00%	4.197.267,67	2,84%	0,00%	2,00%	10,00%	



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'	0,00	0,00	0,00	25,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	72.506.025,23	49,09	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	37.244.713,78	25,21	15,00	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	639.208,43	0,43	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	911.811,74	0,62	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	17.393.644,10	11,78	5,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	4.197.267,67	2,84	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.667.980,62	3,84	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,01	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	1.753.690,55	1,19	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	50.179.077,36	33,97	-
CAIXA DTVM	43.804.275,38	29,66	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.405.116,53	23,29	-
BANCO BTG PACTUAL	7.394.752,35	5,01	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.215.105,08	2,18	-
SOMMA INVESTIMENTOS	2.500.057,36	1,69	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.753.690,55	1,19	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.624.426,42	1,10	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.053.523,73	0,71	-
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	911.811,74	0,62	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	625.261,08	0,42	-
RJI CORRETORA DE VALORES	131.757,54	0,09	-
GENIAL GESTÃO LTDA	110.239,35	0,07	-
ARENA CAPITAL	0,01	0,00	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,06%	2,35%	3,58%	7,52%	16,69%	36,47%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1,46%	9,84%	1,78%	-3,90%	-22,38%	1.123,65%	-	-

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%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,34%	0,94%	2,69%	5,87%	17,85%	28,53%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	0,90%	2,63%	5,76%	17,51%	27,67%	1,01%	3,37%

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%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,25%	-9,01%	-17,74%	-17,44%	-26,87%	-23,54%	0,11%	21,44%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,56%	1,22%	2,68%	4,27%	10,16%	22,36%	0,42%	1,77%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,40%	-20,37%	-35,02%	-35,38%	-36,15%	-48,03%	0,10%	26,98%
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%	-	-
--------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,07%	2,80%	3,78%	14,54%	23,41%	0,79%	3,95%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,52%	0,04%	2,77%	3,70%	14,35%	23,01%	0,79%	3,98%
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%

IRF-M (Benchmark)	0,46%	1,13%	2,63%	5,74%	15,85%	27,58%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	1,11%	2,59%	5,64%	15,62%	27,21%	0,75%	2,33%

CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,63%	2,59%	5,52%	14,98%	26,64%	0,04%	1,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	1,78%	2,70%	5,67%	12,75%	27,44%	0,01%	0,06%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,47%	1,09%	1,63%	3,45%	7,86%	16,11%	0,07%	0,15%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,18%	-0,93%	-1,41%	-6,97%	-15,09%	-61,85%	0,63%	7,75%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83%	1,84%	2,78%	5,90%	13,25%	27,96%	0,02%	0,07%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	1,99%	2,95%	6,17%	13,60%	28,88%	0,05%	0,09%

IPCA (Benchmark)	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,87%	2,82%	5,24%	-	-	0,25%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	1,03%	2,60%	4,86%	14,72%	25,46%	0,47%	2,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC 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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50%	0,52%	2,38%	4,66%	9,58%	20,00%	0,83%	2,43%
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%	14,39%
Ibovespa (Benchmark)	0,99%	-3,85%	1,33%	11,47%	22,96%	14,03%	-	-
SCHRODER BEST IDEAS FIAÇÕES	0,06%	-4,88%	1,01%	8,30%	20,45%	12,81%	6,83%	15,88%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	1,93%	-2,44%	3,66%	8,12%	14,15%	12,34%	6,31%	15,85%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIAÇÕES	0,53%	-5,96%	-1,05%	7,61%	17,03%	4,59%	6,83%	15,63%
SOMMA BRASIL FIAÇÕES	0,47%	-4,14%	1,19%	9,81%	15,95%	2,23%	6,52%	15,40%
FINACAP MAURITSSTAD FIAÇÕES	2,79%	-2,75%	3,52%	11,84%	28,03%	19,72%	7,70%	15,56%
IDIV (Benchmark)	0,91%	-2,64%	4,09%	13,07%	26,16%	32,52%	-	-
BRADESCO H DIVIDENDOS FIAÇÕES	0,83%	-2,83%	3,85%	12,63%	25,18%	30,07%	6,14%	13,53%
IFIX (Benchmark)	0,79%	1,47%	5,77%	4,58%	19,64%	22,58%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-

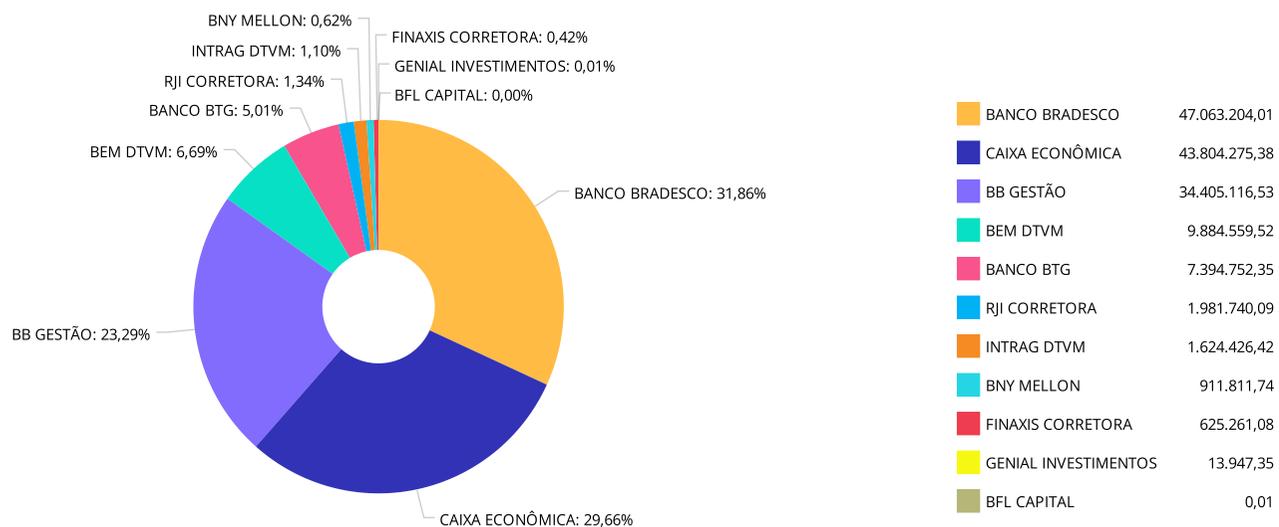
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	1,45%	2,61%	3,92%	6,89%	13,38%	29,90%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-

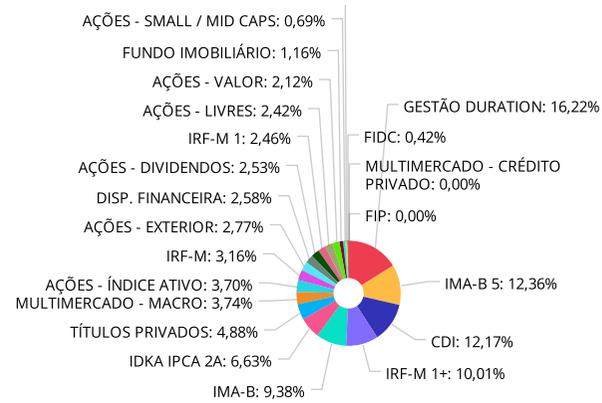
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	6,27%	11,12%	13,99%	15,34%	32,07%	18,33%	8,72%	14,393%
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	8,64%	12,77%	16,92%	22,59%	55,95%	34,34%	9,07%	16,300%

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



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



■ GESTÃO DURATION	24.586.766,83	■ IMA-B 5	18.745.440,13	■ CDI	18.449.236,36
■ IRF-M 1+	15.183.673,95	■ IMA-B	14.219.671,25	■ IDKA IPCA 2A	10.045.529,33
■ TÍTULOS PRIVADOS	7.394.752,35	■ MULTIMERCADO - MACRO	5.667.980,61	■ ACÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.615.930,71
■ IRF-M	4.786.956,60	■ ACÇÕES - EXTERIOR	4.197.267,67	■ DISP. FINANCEIRA	3.914.057,96
■ ACÇÕES - DIVIDENDOS	3.839.443,31	■ IRF-M 1	3.733.464,56	■ ACÇÕES - LIVRES	3.669.641,27
■ ACÇÕES - VALOR	3.215.105,08	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.753.690,55	■ ACÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.053.523,73
■ CRÉDITO PRIVADO	911.811,74	■ FIDC	639.208,43	■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	0,01
■ FIP	0,01				

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	131.921.519,37	5.400.000,00	3.100.000,00	134.359.826,23	138.306,86	138.306,86	0,10%	0,10%	0,82%	0,82%	12,54%	1,31%
Fevereiro	134.359.826,23	2.750.000,00	3.329.427,64	134.956.658,54	1.176.259,95	1.314.566,81	0,88%	0,98%	1,18%	2,01%	48,73%	1,48%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



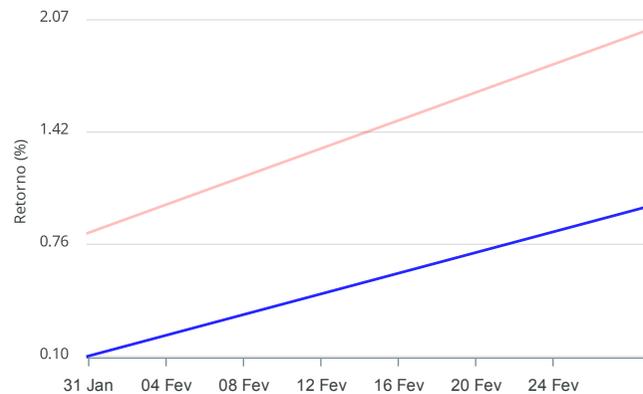
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	13.746,26	0,00	0,00	13.947,35	201,09	1,46%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	7.319.083,37	0,00	0,00	7.394.752,35	75.668,98	1,03%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.893.477,39	0,00	3.300.000,00	12.732.908,20	139.430,81	0,88%	0,90%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.118.024,21	0,00	0,00	2.135.492,04	17.467,83	0,82%	0,82%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.545.650,42	0,00	0,00	2.566.095,02	20.444,60	0,80%	0,80%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	13.393.895,20	0,00	0,00	13.497.493,16	103.597,96	0,77%	0,77%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.705.958,71	0,00	0,00	3.733.464,56	27.505,85	0,74%	0,74%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.036.568,04	0,00	29.427,64	1.014.741,10	7.600,70	0,73%	0,74%	0,25%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.672.708,99	0,00	0,00	7.716.709,48	44.000,49	0,57%	0,57%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.977.339,34	0,00	365.000,00	6.651.931,09	39.591,75	0,57%	0,58%	0,41%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	11.799.012,14	0,00	0,00	11.865.459,51	66.447,37	0,56%	0,56%	0,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.353.957,95	0,00	0,00	3.372.564,19	18.606,24	0,55%	0,55%	0,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.694.460,85	0,00	0,00	1.703.582,89	9.122,04	0,54%	0,54%	0,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.598.919,10	0,00	0,00	1.607.404,85	8.485,75	0,53%	0,53%	0,79%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	10.851.805,61	0,00	0,00	10.908.683,51	56.877,90	0,52%	0,52%	0,79%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	907.524,83	0,00	0,00	911.811,74	4.286,91	0,47%	0,47%	0,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.509.056,83	0,00	0,00	6.538.012,08	28.955,25	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.492.185,59	0,00	0,00	3.507.517,25	15.331,66	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.766.249,82	0,00	0,00	4.786.956,60	20.706,78	0,43%	0,43%	0,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.136.312,86	0,00	0,00	15.183.673,95	47.361,09	0,31%	0,31%	1,01%

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
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	131.431,23	0,00	0,00	131.757,54	326,31	0,25%	0,25%	0,11%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	626.412,45	0,00	0,00	625.261,08	-1.151,37	-0,18%	-0,18%	0,63%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	96.679,44	0,00	0,00	96.291,99	-387,45	-0,40%	-0,40%	0,10%
Total Renda Fixa	121.640.460,63	0,00	3.694.427,64	118.696.511,53	750.478,54	0,62%		0,45%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
FINACAP MAURITSSTAD FIAÇÕES	3.127.965,23	0,00	0,00	3.215.105,08	87.139,85	2,79%	2,79%	7,70%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	3.057.027,03	0,00	0,00	3.115.873,35	58.846,32	1,92%	1,92%	6,31%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIAÇÕES	1.036.600,37	0,00	0,00	1.053.523,73	16.923,36	1,63%	1,63%	6,31%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIAÇÕES	2.034.363,17	0,00	0,00	2.045.214,85	10.851,68	0,53%	0,53%	6,83%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.640.017,81	0,00	0,00	5.667.980,61	27.962,80	0,50%	0,50%	0,83%
SOMMA BRASIL FIAÇÕES	2.488.358,45	0,00	0,00	2.500.057,36	11.698,91	0,47%	0,47%	6,52%
BRADESCO H DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.085.344,85	2.750.000,00	0,00	3.839.443,31	4.098,46	0,11%	0,82%	6,14%
SCHRODER BEST IDEAS FIAÇÕES	1.623.399,83	0,00	0,00	1.624.426,42	1.026,59	0,06%	0,06%	6,83%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.754.464,69	0,00	0,00	1.753.690,55	-774,14	-0,04%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	21.847.541,45	2.750.000,00	0,00	24.815.315,28	217.773,83	0,89%		4,86%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Fevereiro / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.351.366,65	0,00	0,00	1.468.174,86	116.808,21	8,64%	8,64%	9,07%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.568.081,81	0,00	0,00	2.729.092,81	161.011,00	6,27%	6,27%	8,72%
Total Exterior	3.919.448,46	0,00	0,00	4.197.267,67	277.819,21	7,09%		8,84%