

CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	58.130.984,89	6,36%	883	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	90.262.579,73	9,87%	795	1,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	13.347.734,79	1,46%	1.144	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	2.698.236,12	0,30%	92	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	73.517.131,17	8,04%	370	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	147.454.788,89	16,13%	305	3,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	50.451.743,89	5,52%	1.190	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.927.620,59	1,41%	124	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	44.709.378,26	4,89%	1.696	2,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	157.612.067,15	17,24%	447	1,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	84.651,30	0,01%	363	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.757.639,03	1,40%	397	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info	Não se aplica	27.192.357,29	2,97%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info	Não se aplica	15.904.131,56	1,74%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	223.220,87	0,02%	59	0,37%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
TRENDBANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	10.895.659,99	1,19%	48	3,54%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	25.765.270,09	2,82%	771	0,35%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	13.116.246,22	1,43%	3.034	5,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.330.463,28	0,47%	12.834	2,26%	Artigo 8º, Inciso I

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

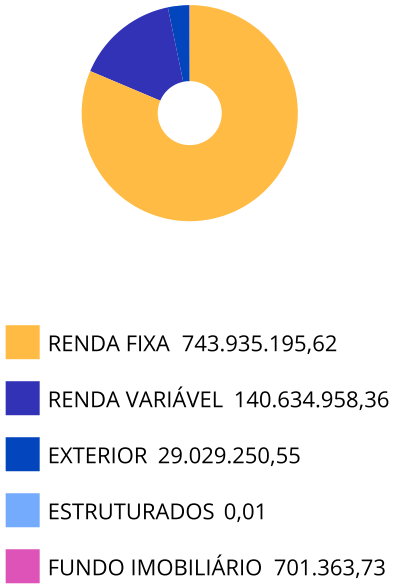
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.888.580,75	0,86%	2.611	1,43%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	23.891.096,35	2,61%	25.212	2,90%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	14.959.711,82	1,64%	17.732	1,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	10.897.596,12	1,19%	82	2,83%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.944.893,46	1,42%	6.061	11,44%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.826.682,08	1,40%	5.353	1,94%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	29.706.833,52	3,25%	2.079	4,34%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	10.072.854,76	1,10%	28	4,05%	Artigo 8º, Inciso I
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	11.910.297,05	1,30%	7.468	1,68%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	9.799.671,89	1,07%	3.757	1,62%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	7.319.281,61	0,80%	176	2,28%	Artigo 9º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	701.363,73	0,08%		0,49%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			**914.300.768,27**				

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	40,00%	365.720.307,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	493.500.198,33	53,98%	10,00%	47,00%	90,00%	329.370.493,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	170.454.357,48	18,64%	5,00%	15,70%	60,00%	378.126.103,48
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	43.096.488,85	4,71%	2,00%	7,00%	20,00%	139.763.664,80
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	223.220,88	0,02%	0,00%	0,10%	0,50%	4.348.282,96
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	36.660.930,08	4,01%	0,00%	4,00%	5,00%	9.054.108,33
Total Renda Fixa	100,00%	743.935.195,62	81,37%	17,00%	74,80%	215,50%	



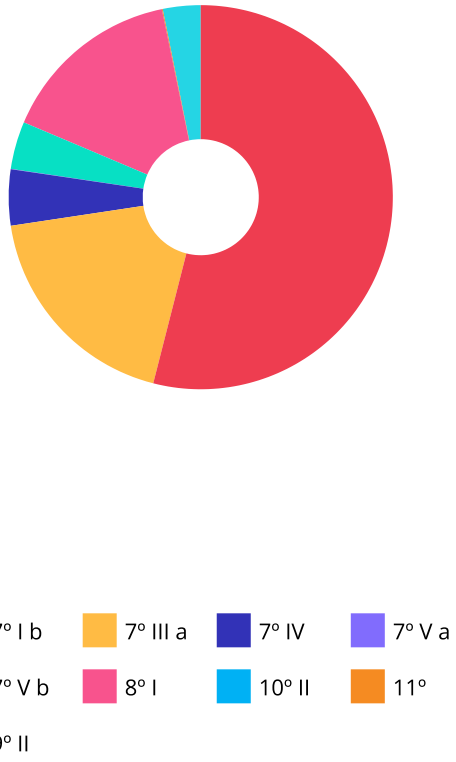
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	140.634.958,36	15,38%	5,00%	20,00%	35,00%	179.370.310,53
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	91.430.076,83
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,10%	5,00%	45.715.038,40
Artigo 11º	5,00%	701.363,73	0,08%	0,00%	0,10%	5,00%	45.013.674,68
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	141.336.322,10	15,46%	5,00%	22,20%	55,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	29.029.250,55	3,18%	0,00%	2,00%	10,00%	62.400.826,28
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	91.430.076,83
Total Exterior	10,00%	29.029.250,55	3,18%	0,00%	3,00%	20,00%	



Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	493.500.198,33	53,98	10,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	170.454.357,48	18,64	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	223.220,88	0,02	0,00	0,50
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	36.660.930,08	4,01	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	140.634.958,36	15,38	5,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	29.029.250,55	3,18	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,01	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	701.363,73	0,08	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	299.922.178,89	32,80	-
CAIXA DTVM	234.660.355,74	25,67	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	157.612.067,15	17,24	0,01
SICREDI	44.709.378,26	4,89	0,04
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	38.522.909,12	4,21	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	32.800.147,24	3,59	0,01
ICATU VANGUARDA	29.706.833,52	3,25	0,05
BANCO BRADESCO	27.192.357,29	2,97	0,00
BANCO SANTANDER	15.904.131,56	1,74	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	13.116.246,22	1,43	0,04
XP ASSET MANAGEMENT	11.910.297,05	1,30	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	7.319.281,61	0,80	0,08
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	701.363,73	0,08	-
VILA RICA CAPITAL	223.220,87	0,02	-
PLURAL	0,02	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)

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,27%	1,27%	3,69%	7,88%	16,82%	36,40%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,72%	0,72%	-7,84%	210,39%	215,34%	63,59%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,81%	0,81%	4,15%	4,81%	11,43%	23,53%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	0,71%	3,96%	4,60%	10,93%	23,00%	0,57%	1,88%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,77%	5,92%	12,95%	27,12%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,91%	2,80%	5,87%	12,79%	26,67%	0,11%	0,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	0,87%	2,74%	5,80%	12,67%	26,44%	0,12%	0,33%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,93%	4,32%	11,07%	23,25%	0,55%	1,86%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	1,11%	2,84%	2,65%	4,87%	9,72%	0,33%	3,99%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,66%	0,66%	3,94%	4,32%	11,14%	23,30%	0,55%	1,87%
CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01%	1,01%	2,98%	6,53%	13,43%	28,71%	0,02%	0,11%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,03%	1,03%	3,11%	6,80%	13,73%	29,54%	0,02%	0,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,88%	0,88%	2,55%	5,51%	11,49%	23,72%	0,00%	0,03%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,04%	6,56%	13,58%	28,79%	0,07%	0,09%

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TRENDBANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-	-	-	-	-	-	-	-
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,97%	0,97%	2,79%	6,02%	12,84%	27,21%	0,01%	0,06%
IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	2,84%	5,37%	10,86%	22,58%	0,33%	1,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	1,10%	2,83%	5,35%	10,82%	23,49%	0,33%	1,26%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,90%	0,90%	3,62%	5,03%	11,65%	23,73%	0,40%	1,43%

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-8,43%	-8,43%	12,59%	-11,83%	-5,88%	-30,20%	9,43%	23,55%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,67%	-4,67%	13,48%	4,31%	12,27%	12,39%	5,39%	16,81%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-1,71%	-1,71%	14,88%	3,45%	10,45%	6,00%	6,58%	15,98%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-6,46%	-6,46%	9,72%	2,43%	6,50%	3,69%	5,99%	16,12%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-5,18%	-5,18%	11,13%	3,37%	4,06%	-1,34%	6,01%	16,60%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-8,56%	-8,56%	13,78%	-4,77%	29,15%	12,58%	10,82%	27,05%
IBX-50 (Benchmark)	-4,15%	-4,15%	13,07%	5,74%	11,32%	13,01%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-4,17%	-4,17%	12,72%	3,55%	7,84%	7,15%	5,38%	16,04%
IDIV (Benchmark)	-3,51%	-3,51%	14,18%	8,88%	15,58%	28,28%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,26%	-4,26%	10,54%	3,64%	8,01%	10,01%	4,98%	14,72%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,73%	-1,73%	16,81%	3,51%	19,32%	20,15%	7,01%	15,17%
IFIX (Benchmark)	0,67%	0,67%	5,63%	4,26%	18,16%	20,04%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
SMLL (Benchmark)	-6,55%	-6,55%	12,50%	-6,30%	6,34%	-10,11%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-6,59%	-6,59%	12,09%	-6,54%	5,31%	-11,42%	9,75%	21,65%

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,30%	1,30%	3,82%	7,23%	15,48%	34,97%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-

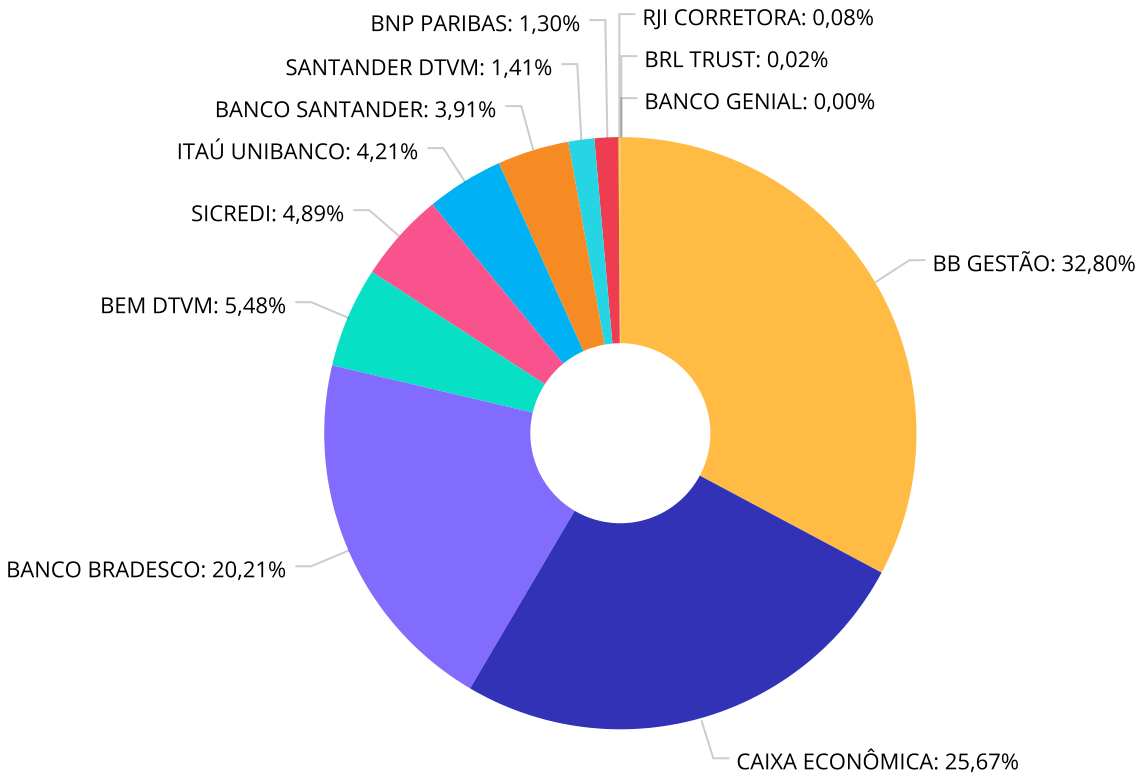
Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	3,48%	3,48%	13,39%	9,28%	11,80%	-3,12%	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4,04%	4,04%	21,71%	13,90%	29,36%	-4,31%	9,69%	20,177%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3,08%	3,08%	14,24%	9,65%	10,62%	-4,02%	5,61%	11,524%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,86%	2,86%	12,43%	7,98%	9,50%	-5,80%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	2,79%	2,79%	16,40%	9,90%	13,12%	0,70%	6,09%	15,086%

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

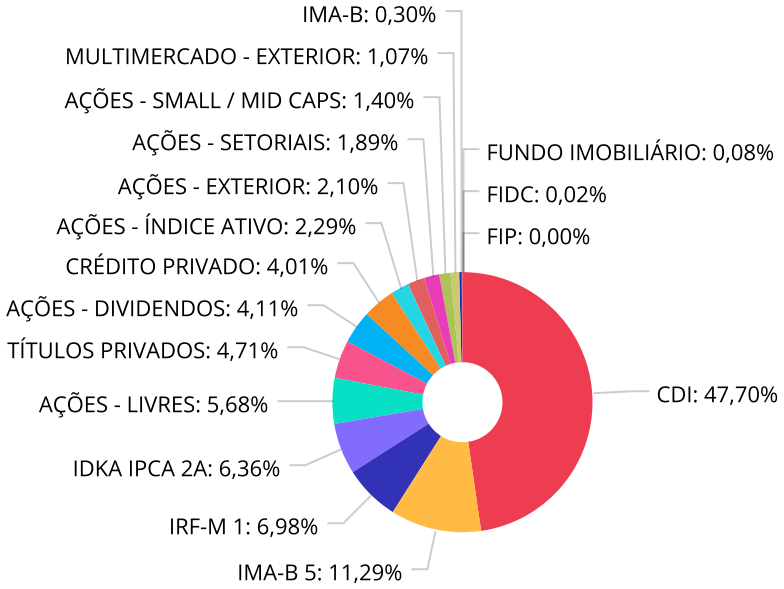
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2024)



BB GESTÃO	299.922.178,89
CAIXA ECONÔMICA	234.660.355,74
BANCO BRADESCO	184.804.424,44
BEM DTVM	50.142.361,35
SICREDI	44.709.378,26
ITAÚ UNIBANCO	38.522.909,12
BANCO SANTANDER	35.776.658,21
SANTANDER DTVM	12.927.620,59
BNP PARIBAS	11.910.297,05
RJI CORRETORA	701.363,74
BRL TRUST	223.220,87
BANCO GENIAL	0,01

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

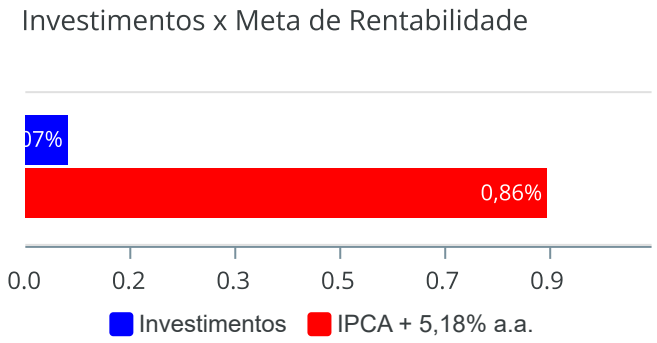


CDI	436.135.655,80	IMA-B 5	103.190.200,32	IRF-M 1	63.799.478,68	IDKA IPCA 2A	58.130.984,89
AÇÕES - LIVRES	51.967.054,39	TÍTULOS PRIVADOS	43.096.488,85	AÇÕES - DIVIDENDOS	37.595.414,27	CRÉDITO PRIVADO	36.660.930,08
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	20.970.450,88	AÇÕES - EXTERIOR	19.229.578,66	AÇÕES - SETORIAIS	17.275.356,74	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	12.826.682,08
MULTIMERCADO - EXTERIOR	9.799.671,89	IMA-B	2.698.236,12	FUNDO IMOBILIÁRIO	701.363,73	FIDC	223.220,88
FIP	0,01						

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

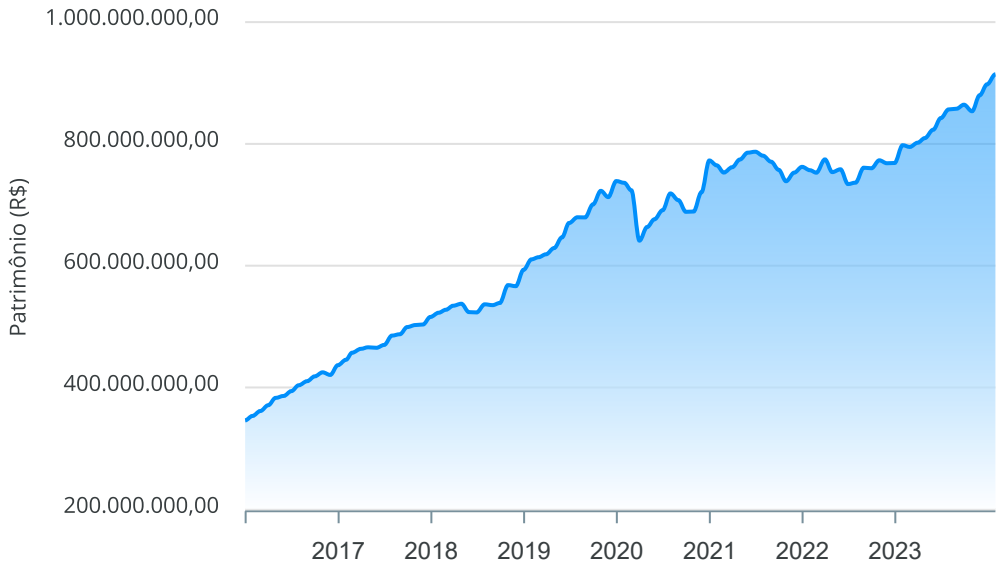
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	897.795.438,94	59.478.222,65	43.605.924,51	914.300.768,27	633.031,19	633.031,19	0,07%	0,07%	0,86%	0,86%	8,02%	1,53%



Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

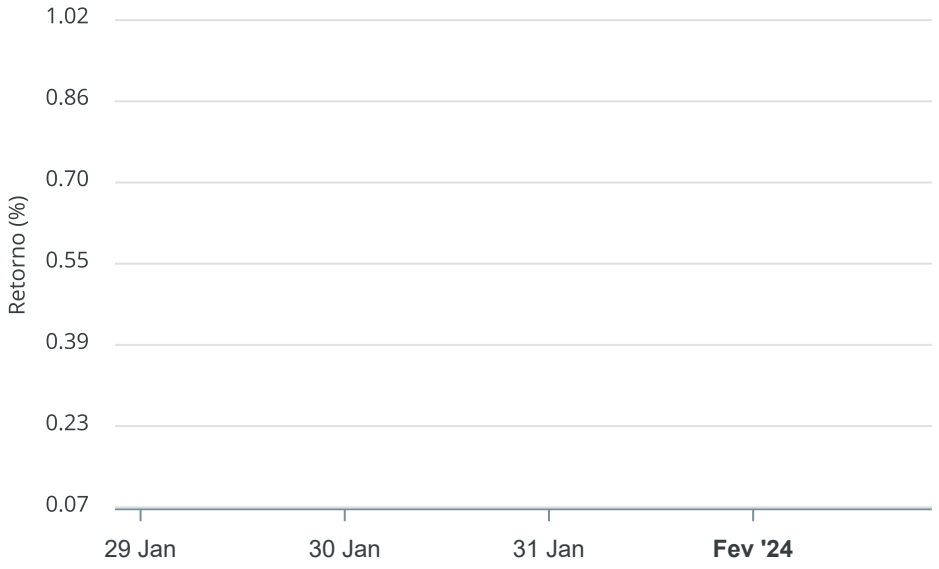
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2024 **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	72.712.048,31	0,00	0,00	73.517.131,17	805.082,86	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	145.840.511,70	0,00	0,00	147.454.788,89	1.614.277,19	1,11%	1,11%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.668.766,08	0,00	0,00	2.698.236,12	29.470,04	1,10%	1,10%	0,33%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	26.897.267,41	0,00	0,00	27.192.357,29	295.089,88	1,10%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	15.735.313,23	0,00	0,00	15.904.131,56	168.818,33	1,07%	-	-
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	25.502.198,40	0,00	0,00	25.765.270,09	263.071,69	1,03%	1,03%	0,02%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	44.281.049,03	0,00	0,00	44.709.378,26	428.329,23	0,97%	0,97%	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	143.957.134,30	24.293.183,14	12.216.934,33	157.612.067,15	1.578.684,04	0,94%	1,09%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	50.178.875,15	247.895,91	431.918,38	50.451.743,89	456.891,21	0,91%	0,91%	0,11%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.798.088,31	0,00	0,00	10.895.659,99	97.571,68	0,90%	0,90%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	13.403.976,45	0,00	171.737,33	13.347.734,79	115.495,67	0,86%	0,86%	0,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.161.473,54	2.489.385,38	0,00	12.757.639,03	106.780,11	0,84%	1,01%	0,02%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	221.618,27	0,00	0,00	223.220,87	1.602,60	0,72%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	57.720.114,62	0,00	0,00	58.130.984,89	410.870,27	0,71%	0,71%	0,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	89.670.560,52	0,00	0,00	90.262.579,73	592.019,21	0,66%	0,66%	0,55%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	11.056.894,61	1.797.410,14	0,00	12.927.620,59	73.315,84	0,57%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	81.037,06	28.335.796,08	28.469.879,23	84.651,30	137.697,39	0,48%	0,88%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.314.552,00	2.315.455,24	0,00	903,24	0,04%	0,88%	0,01%
TRENDBANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	**720.886.927,00**	**59.478.222,65**	**43.605.924,51**	**743.935.195,62**	**7.175.970,48**	**0,97%**		**0,27%**

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	702.883,97	0,00	0,00	701.363,73	-1.520,24	-0,22%	0,00%	0,00%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.344.360,22	0,00	0,00	13.116.246,22	-228.114,00	-1,71%	-1,71%	6,58%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	8.027.786,60	0,00	0,00	7.888.580,75	-139.205,85	-1,73%	-1,73%	7,01%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	11.371.373,01	0,00	0,00	10.897.596,12	-473.776,89	-4,17%	-4,17%	5,38%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	31.028.423,28	0,00	0,00	29.706.833,52	-1.321.589,76	-4,26%	-4,26%	4,98%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10.565.847,33	0,00	0,00	10.072.854,76	-492.992,57	-4,67%	-4,67%	5,39%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	25.196.191,58	0,00	0,00	23.891.096,35	-1.305.095,23	-5,18%	-5,18%	6,01%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	15.993.088,25	0,00	0,00	14.959.711,82	-1.033.376,43	-6,46%	-6,46%	5,99%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	13.731.438,29	0,00	0,00	12.826.682,08	-904.756,21	-6,59%	-6,59%	9,75%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	14.136.801,14	0,00	0,00	12.944.893,46	-1.191.907,68	-8,43%	-8,43%	9,43%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	4.735.831,92	0,00	0,00	4.330.463,28	-405.368,64	-8,56%	-8,56%	10,82%
Total Renda Variável	**148.834.025,60**	**0,00**	**0,00**	**141.336.322,10**	**-7.497.703,50**	**-5,04%**		**6,58%**

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2024) **FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	11.447.696,58	0,00	0,00	11.910.297,05	462.600,47	4,04%	4,04%	9,69%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	9.506.429,82	0,00	0,00	9.799.671,89	293.242,07	3,08%	3,08%	5,61%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	7.120.359,94	0,00	0,00	7.319.281,61	198.921,67	2,79%	2,79%	6,09%
Total Exterior	**28.074.486,34**	**0,00**	**0,00**	**29.029.250,55**	**954.764,21**	**3,40%**		**7,41%**

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410

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.

Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos.
Av.Paulista, 302 – Cj. 10, Bela Vista, São Paulo/SP.
CEP: 01310-000 - Telefone: (13) 3878-8410