

IMPES - INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDENCIA
DOS SERVIDORES DE SAO FRANCISCO DO
GUAPORE

CNPJ 12.257.289/0001-08



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

**FEVEREIRO
2024**

1. FUNDOS DE INVESTIMENTO

Limite Resolução 4.963/2021 Art. 18 limite max 20%

PRODUTO / FUNDO	DISP. RESG.	SALDO	PARTICIP. S/TOTAL	QUANT. COTISTAS	% / PL DO FUNDO	RESOLUÇÃO 4963
BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.	D+1	292.155,28	0,47%	884	0,00%	Art. 7º, I, b
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	261.979,78	0,42%	174	0,08%	Art. 10º, I
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	1.461.676,90	2,34%	1.015	0,03%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	715.880,75	1,14%	795	0,01%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	3.092.969,19	4,94%	246	0,33%	Art. 7º, I, b
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	6.788.394,64	10,85%	99	2,56%	Art. 7º, I, b
BB INSTITUCIONAL FI RF	D+0	6.432.564,27	10,28%	159	0,31%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	1.612.288,84	2,58%	1.152	0,02%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	4.843.102,56	7,74%	645	0,12%	Art. 7º, I, b
BB MULTIMERCADO MACRO LP	D+1	247.390,33	0,40%	38.763	0,02%	Art. 10º, I
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	10.693.006,13	17,09%	1.139	0,06%	Art. 7º, III, a
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	D+1	8.497.046,59	13,58%	90	2,23%	Art. 7º, I, b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	D+0	263.917,96	0,42%	362	0,02%	Art. 7º, I, b
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	D+0	3.432.861,19	5,49%	993	0,02%	Art. 7º, III, a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	D+0	5.518.170,59	8,82%	441	0,09%	Art. 7º, III, a
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	D+4	1.227.750,34	1,96%	190	0,49%	Art. 8º, I

ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	D+0	2.066.219,53	3,30%	841	0,03%	Art. 7º, V, b
ITAÚ INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	D+1	4.641.914,48	7,42%	220	0,19%	Art. 7º, III, a
ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES	D+3	496.965,24	0,79%	5.900	0,22%	Art. 8º, I
TOTAL		62.586.254,59				

2. RENTABILIDADE DOS FUNDOS

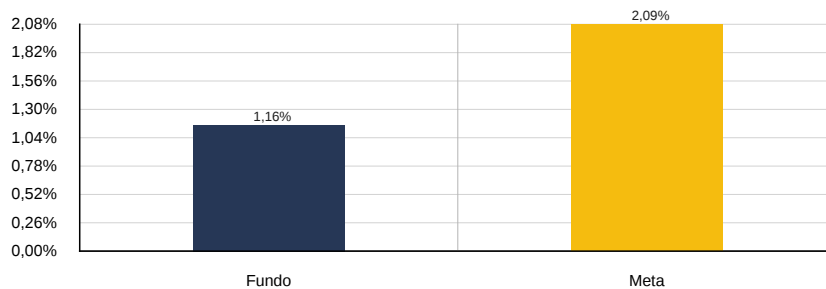
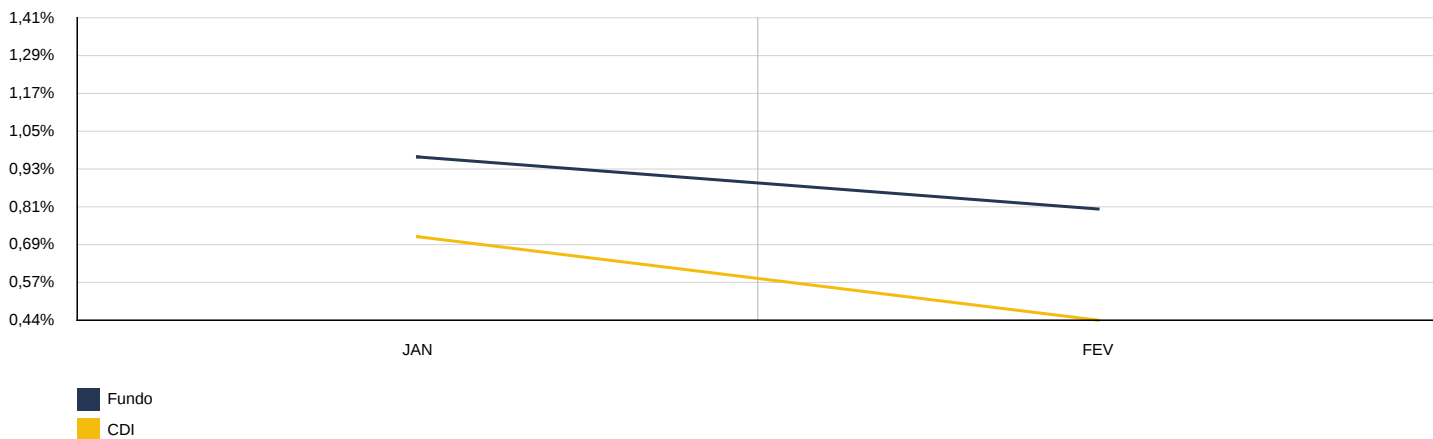
CNPJ	FUNDO	MÊS	ANTERIOR	6 MESES	ANO	12 MESES
13.322.205/0001-35	BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.	0,44%	0,71%	4,30%	1,16%	9,78%
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,71%	0,76%	6,04%	1,48%	12,78%
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,73%	0,88%	5,17%	1,61%	11,62%
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	0,66%	4,31%	1,24%	10,24%
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,52%	-0,49%	3,70%	0,02%	14,42%
14.964.240/0001-10	BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,63%	0,45%	5,06%	1,08%	13,89%
02.296.928/0001-90	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,86%	1,03%	6,02%	1,90%	13,16%
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,74%	0,86%	5,40%	1,61%	12,42%
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,44%	0,66%	5,62%	1,10%	15,44%
05.962.491/0001-75	BB MULTIMERCADO MACRO LP	0,50%	0,02%	4,66%	0,52%	9,58%
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,80%	0,97%	5,67%	1,78%	12,75%
32.161.826/0001-29	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	0,30%	0,57%	5,69%	0,87%	17,46%
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	0,73%	0,88%	5,18%	1,61%	11,42%
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RF DI LP	0,82%	1,00%	5,90%	1,84%	13,25%
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	0,82%	1,01%	5,90%	1,83%	13,31%
02.887.290/0001-62	ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	1,00%	-3,77%	11,33%	-2,81%	26,08%
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	0,91%	1,03%	6,38%	1,95%	13,94%
32.972.942/0001-28	ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	0,51%	0,90%	4,98%	1,42%	12,14%

32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES	0,30%	-5,76%	4,71%	-5,49%	11,29%
--------------------	-----------------------------	-------	--------	-------	--------	--------

3. CARTEIRA DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

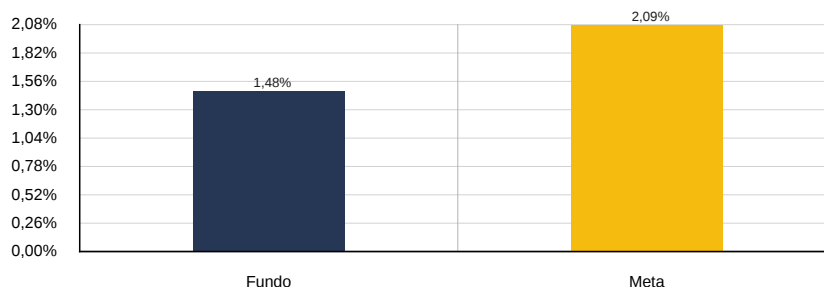
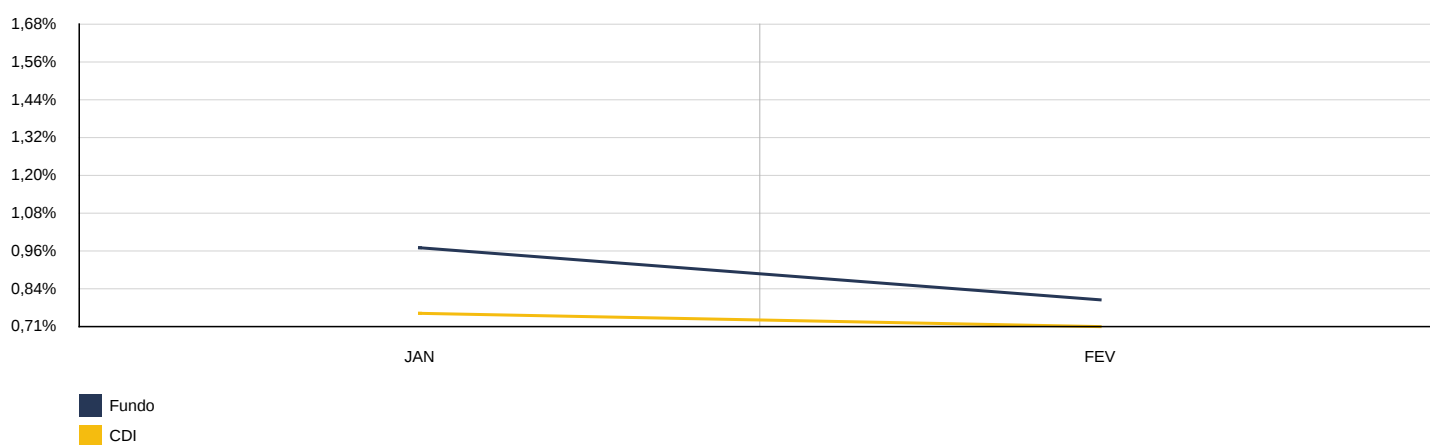
2024	BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.					CNPJ: 13.322.205/0001-35	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	288.805,59	0,00	0,00	290.861,40	2.055,81	0,71%	0,83%
Fevereiro	290.861,40	0,00	0,00	292.155,28	1.293,88	0,44%	1,24%
Acumulado no Ano					3.349,69	1,16%	2,09%

BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.



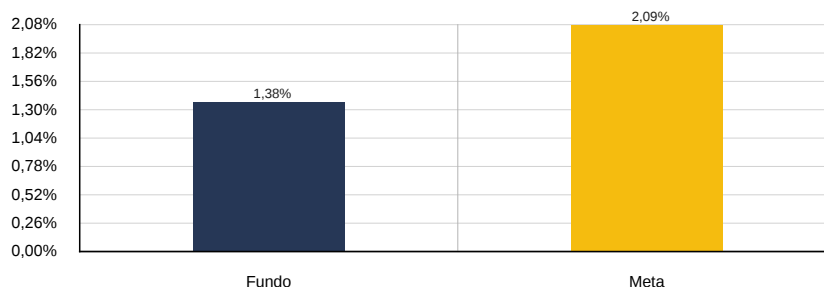
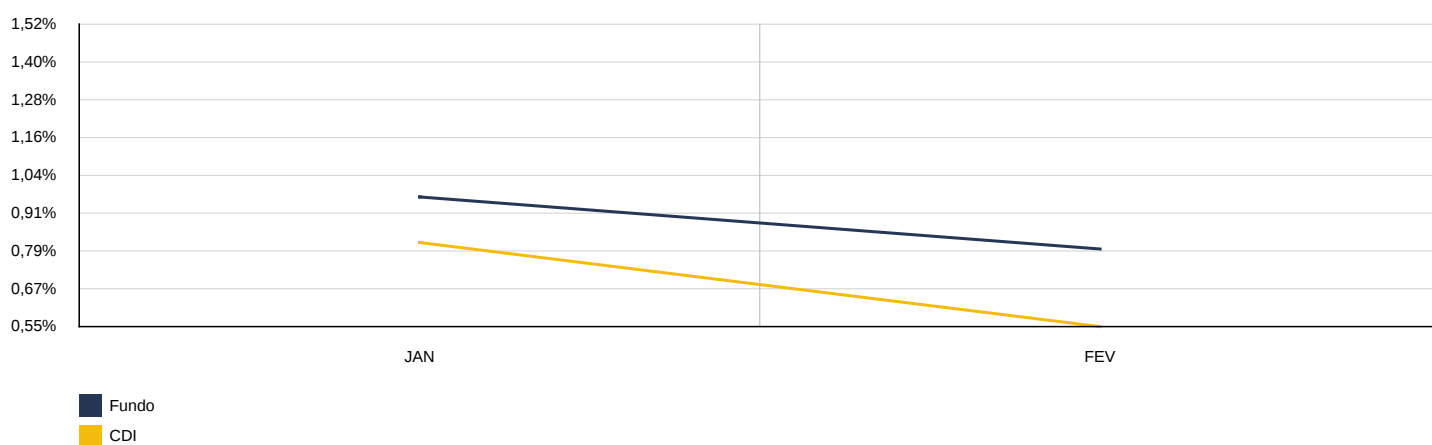
2024	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP					CNPJ: 10.418.362/0001-50	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	258.166,37	0,00	0,00	260.120,81	1.954,44	0,76%	0,83%
Fevereiro	260.120,81	0,00	0,00	261.979,78	1.858,97	0,71%	1,24%
Acumulado no Ano					3.813,41	1,48%	2,09%

BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP



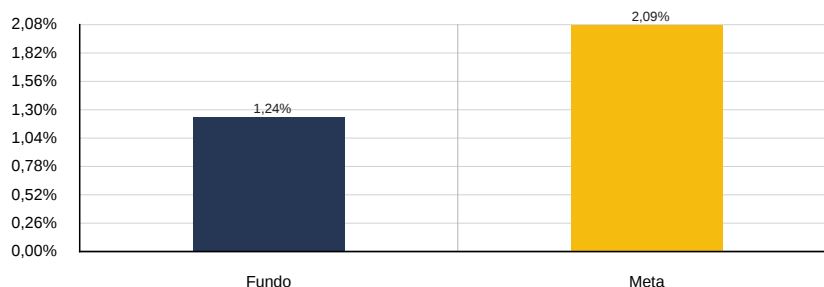
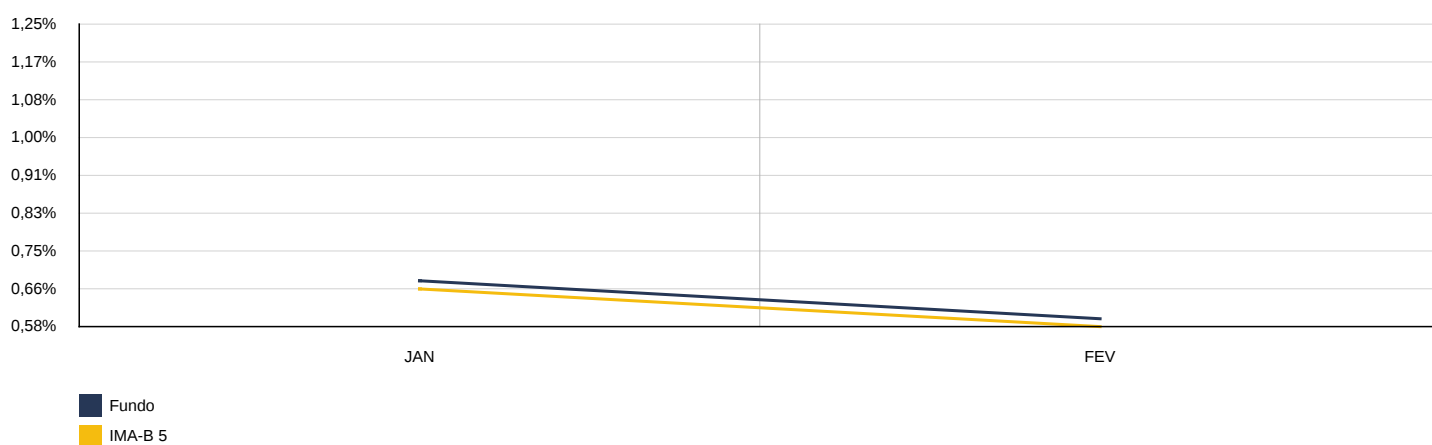
2024	BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.077.415/0001-05	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.381.576,79	98.349,24	352.307,00	1.139.770,11	12.151,08	0,82%	0,83%
Fevereiro	1.139.770,11	645.814,67	333.768,84	1.461.676,90	9.860,96	0,55%	1,24%
Acumulado no Ano					22.012,04	1,38%	2,09%

BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO



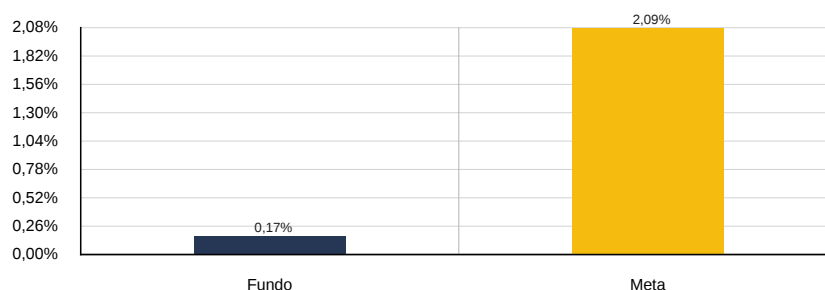
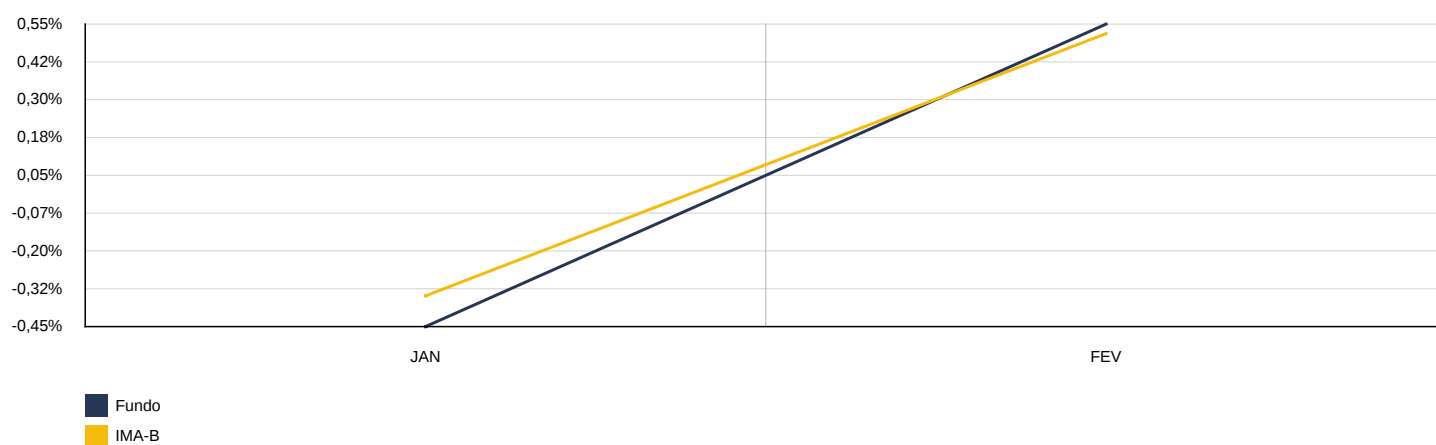
2024	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP					CNPJ: 03.543.447/0001-03	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	707.114,85	0,00	0,00	711.783,34	4.668,49	0,66%	0,83%
Fevereiro	711.783,34	0,00	0,00	715.880,75	4.097,41	0,58%	1,24%
Acumulado no Ano					8.765,90	1,24%	2,09%

BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP



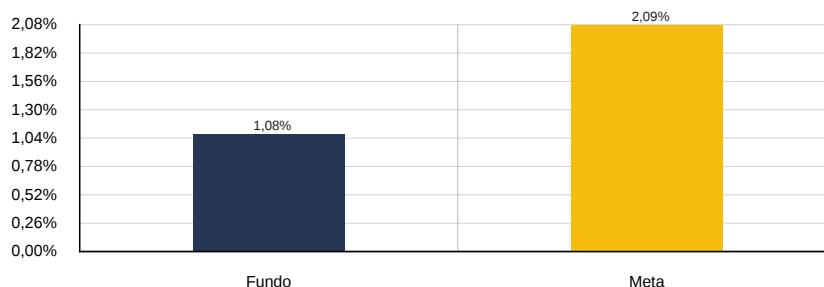
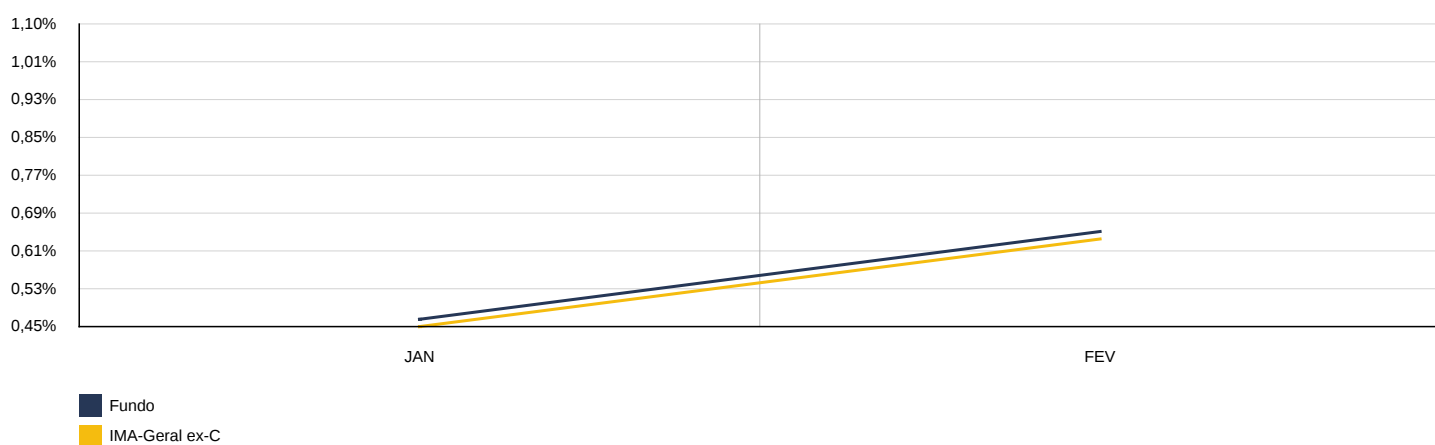
2024	BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 07.861.554/0001-22	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	2.540.714,00	547.048,19	0,00	3.077.018,42	-10.743,77	-0,35%	0,83%
Fevereiro	3.077.018,42	0,00	0,00	3.092.969,19	15.950,77	0,52%	1,24%
Acumulado no Ano					5.207,00	0,17%	2,09%

BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO



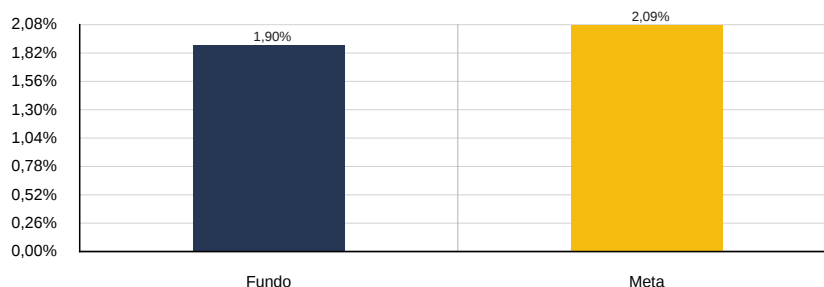
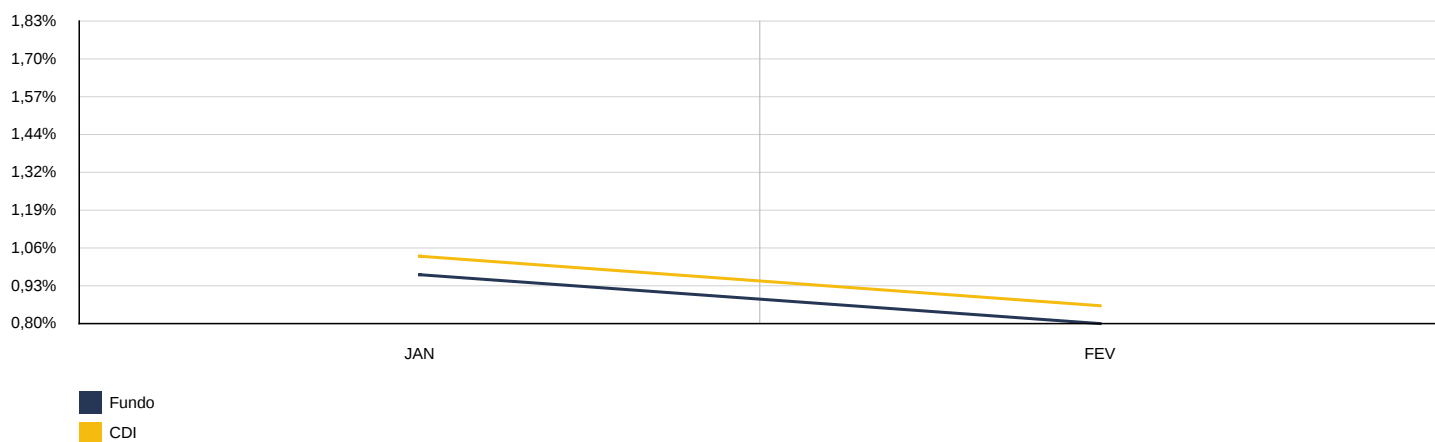
2024	BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 14.964.240/0001-10	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	6.715.694,34	0,00	0,00	6.745.628,52	29.934,18	0,45%	0,83%
Fevereiro	6.745.628,52	0,00	0,00	6.788.394,64	42.766,12	0,63%	1,24%
Acumulado no Ano					72.700,30	1,08%	2,09%

BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO



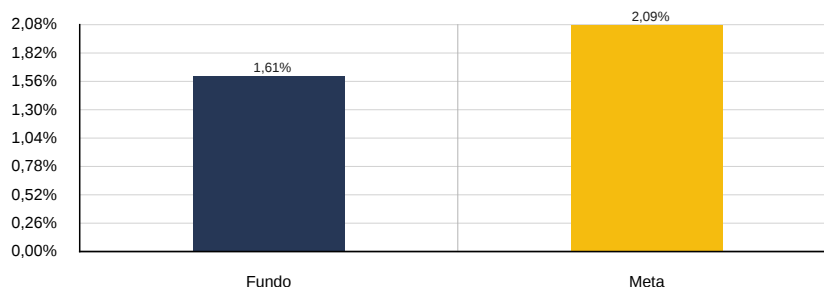
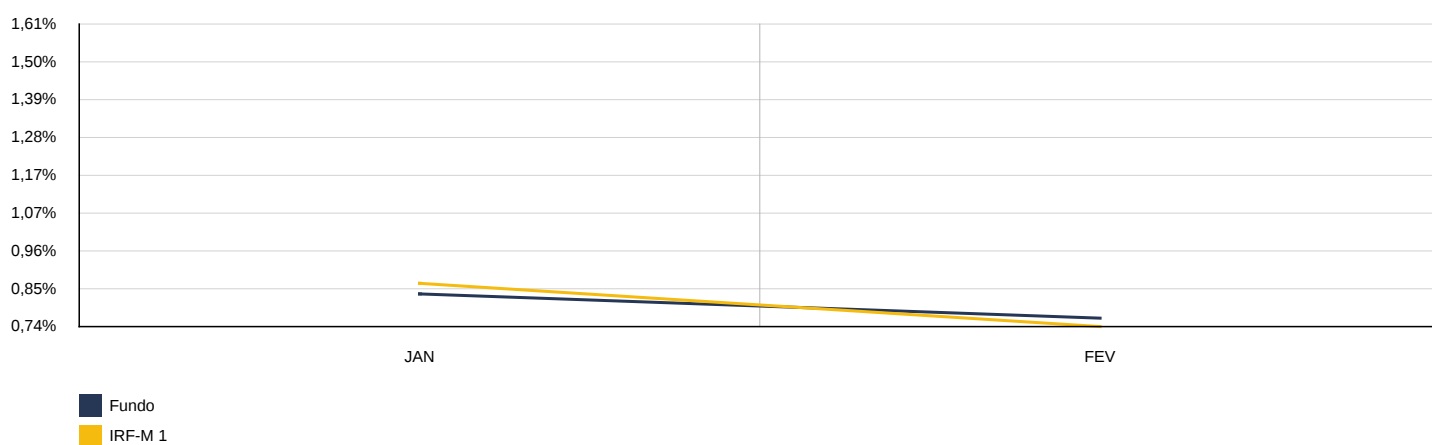
2024	BB INSTITUCIONAL FI RF					CNPJ: 02.296.928/0001-90	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	6.312.656,92	0,00	0,00	6.377.650,02	64.993,10	1,03%	0,83%
Fevereiro	6.377.650,02	0,00	0,00	6.432.564,27	54.914,25	0,86%	1,24%
Acumulado no Ano					119.907,35	1,90%	2,09%

BB INSTITUCIONAL FI RF



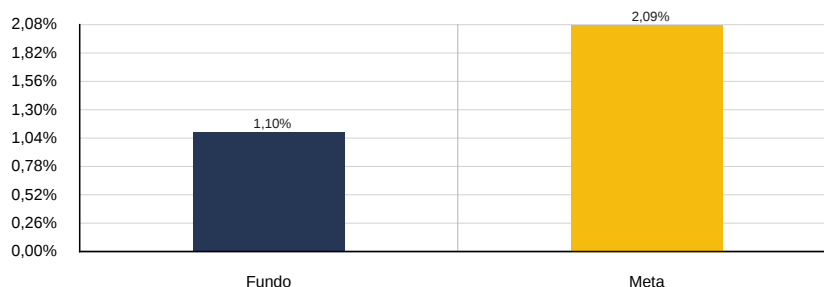
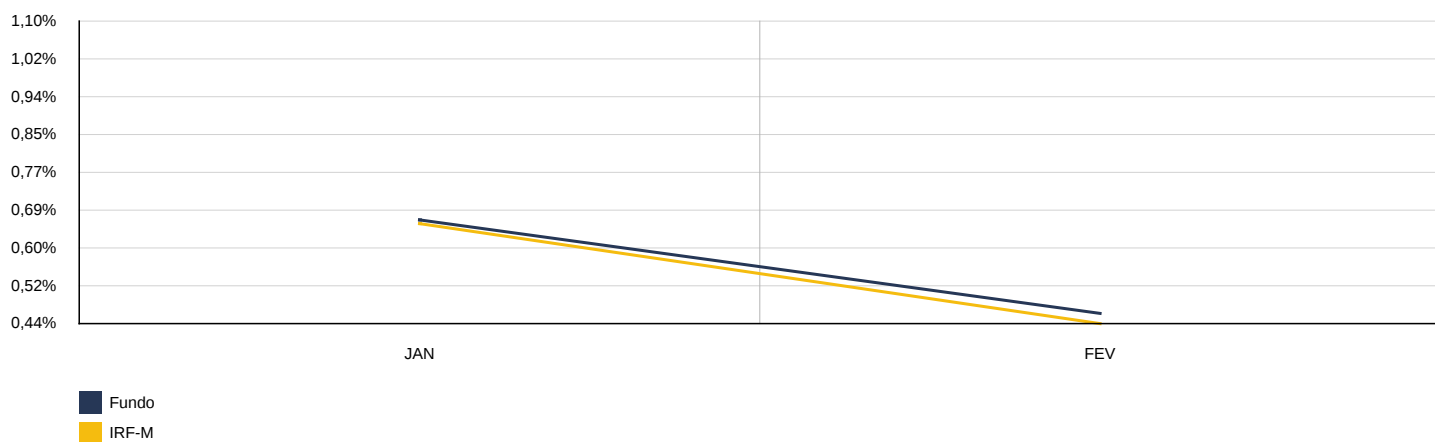
2024	BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO					CNPJ: 11.328.882/0001-35	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.586.712,82	0,00	0,00	1.600.431,51	13.718,69	0,86%	0,83%
Fevereiro	1.600.431,51	0,00	0,00	1.612.288,84	11.857,33	0,74%	1,24%
Acumulado no Ano					25.576,02	1,61%	2,09%

BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO



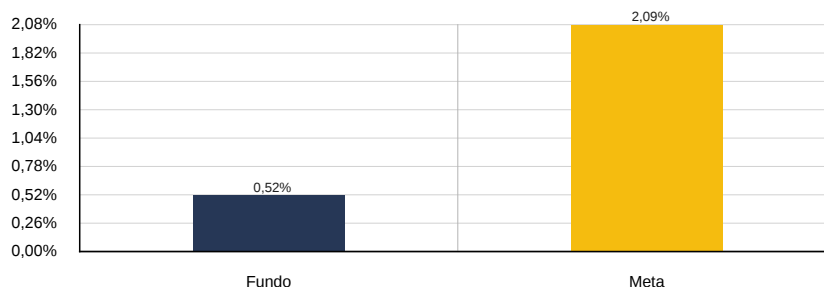
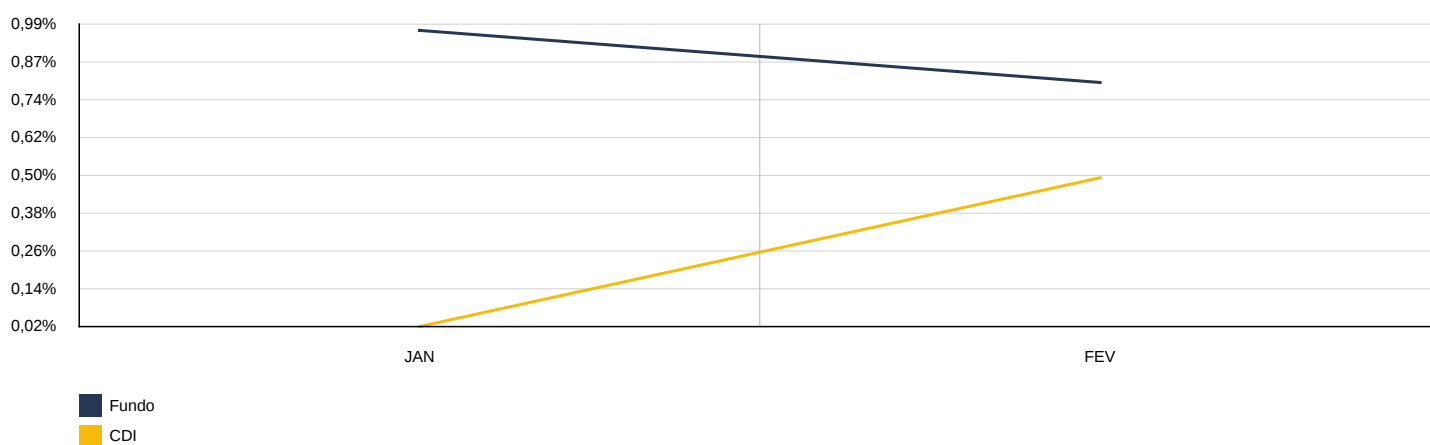
2024	BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 07.111.384/0001-69	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	4.790.457,54	0,00	0,00	4.821.988,22	31.530,68	0,66%	0,83%
Fevereiro	4.821.988,22	0,00	0,00	4.843.102,56	21.114,34	0,44%	1,24%
Acumulado no Ano					52.645,02	1,10%	2,09%

BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO



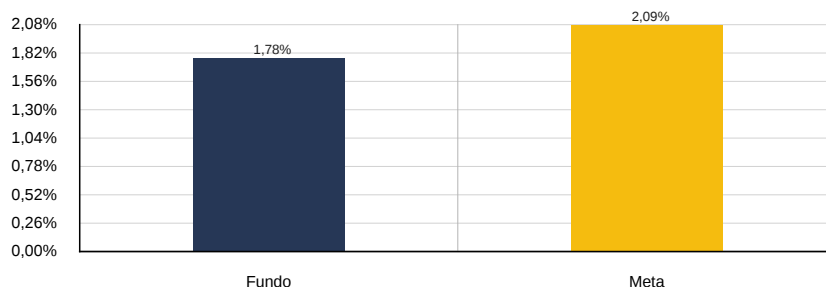
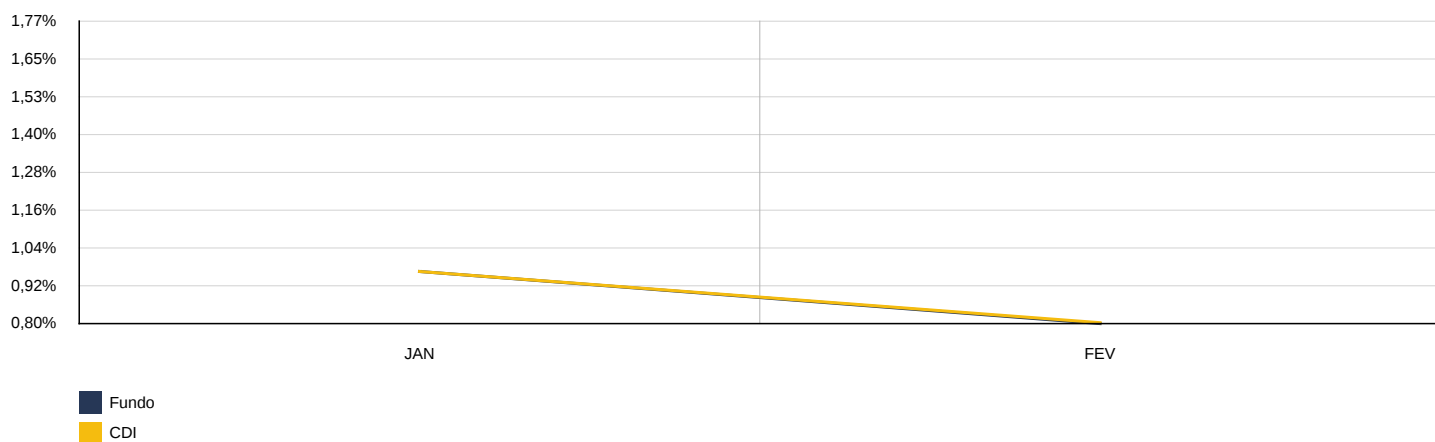
2024	BB MULTIMERCADO MACRO LP					CNPJ: 05.962.491/0001-75	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	246.120,32	0,00	0,00	246.169,84	49,52	0,02%	0,83%
Fevereiro	246.169,84	0,00	0,00	247.390,33	1.220,49	0,50%	1,24%
Acumulado no Ano					1.270,01	0,52%	2,09%

BB MULTIMERCADO MACRO LP



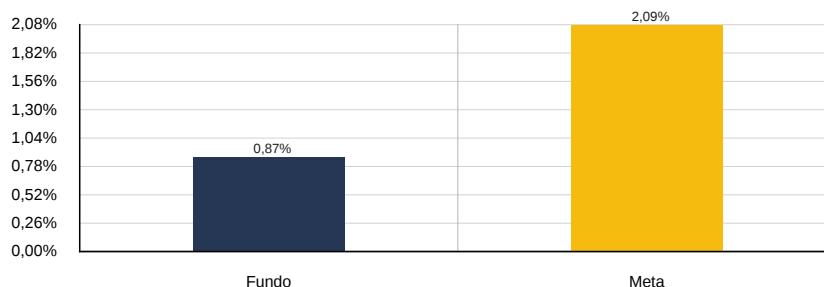
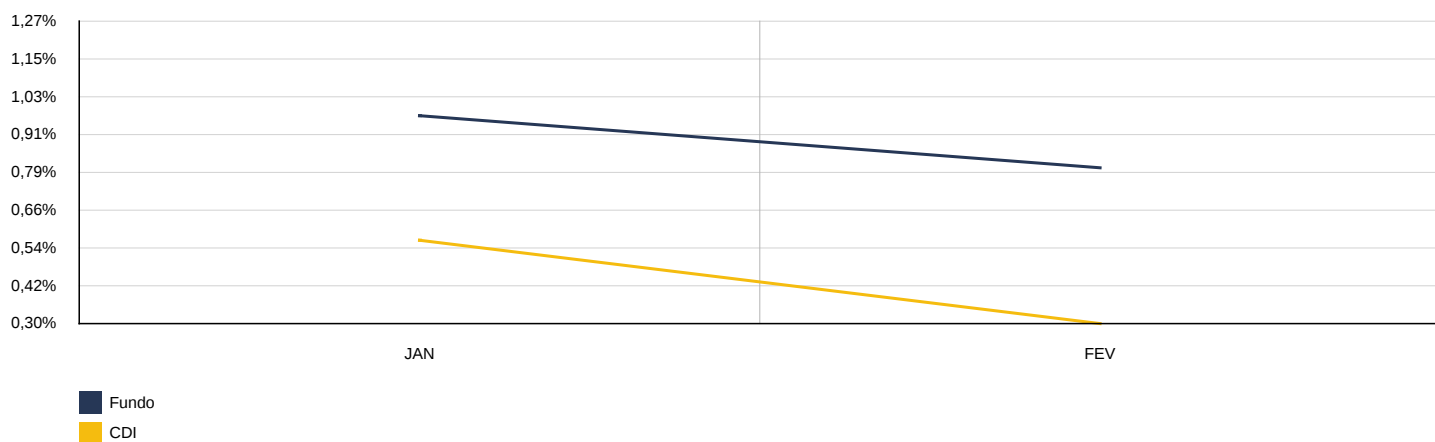
2024	BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.077.418/0001-49	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	10.506.245,02	0,00	0,00	10.607.812,75	101.567,73	0,97%	0,83%
Fevereiro	10.607.812,75	0,00	0,00	10.693.006,13	85.193,38	0,80%	1,24%
Acumulado no Ano					186.761,11	1,78%	2,09%

BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO



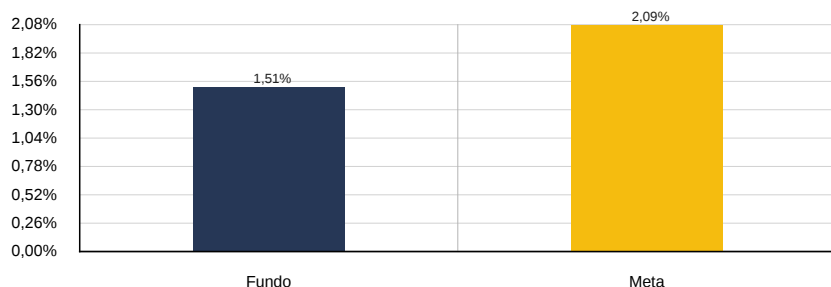
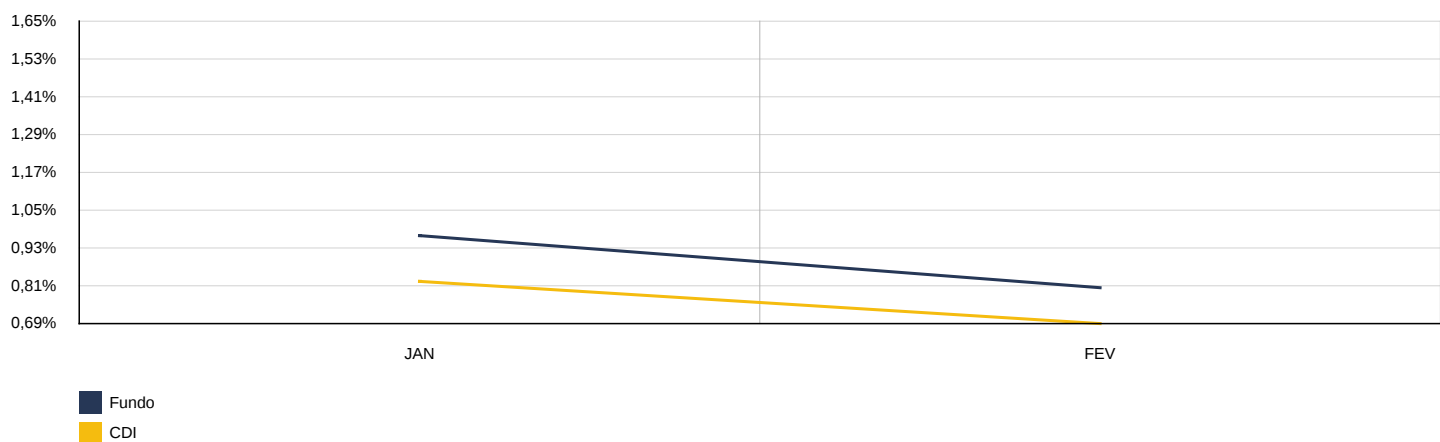
2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI					CNPJ: 32.161.826/0001-29	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	8.423.532,13	0,00	0,00	8.471.434,49	47.902,36	0,57%	0,83%
Fevereiro	8.471.434,49	0,00	0,00	8.497.046,59	25.612,10	0,30%	1,24%
Acumulado no Ano					73.514,46	0,87%	2,09%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI



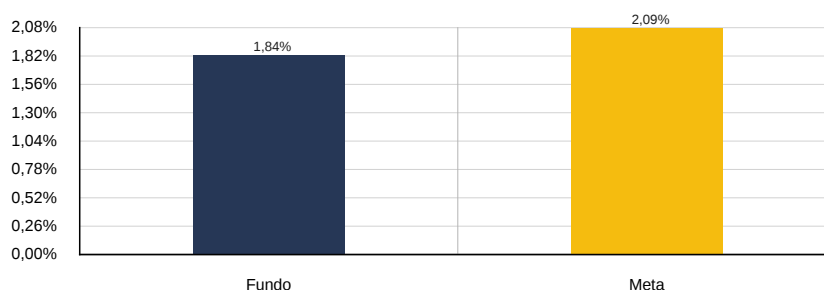
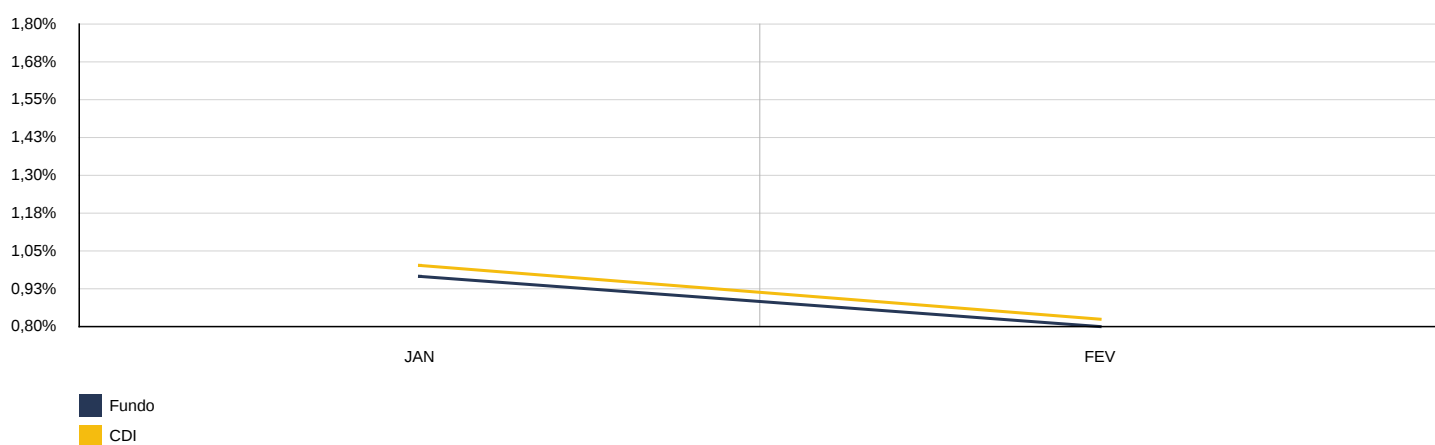
2024	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF					CNPJ: 14.508.643/0001-55	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	227.533,93	16.595,86	0,00	246.132,67	2.002,88	0,82%	0,83%
Fevereiro	246.132,67	15.988,37	0,00	263.917,96	1.796,92	0,69%	1,24%
Acumulado no Ano					3.799,80	1,51%	2,09%

CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF



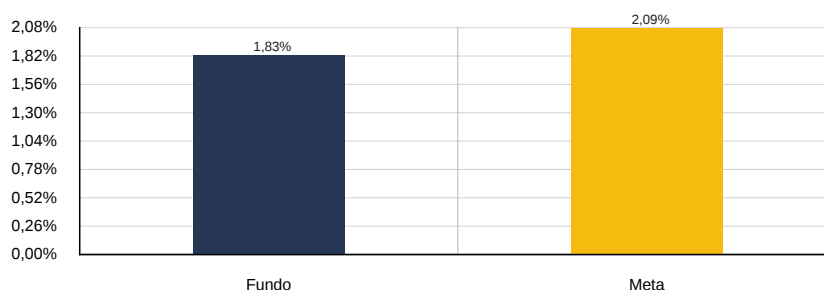
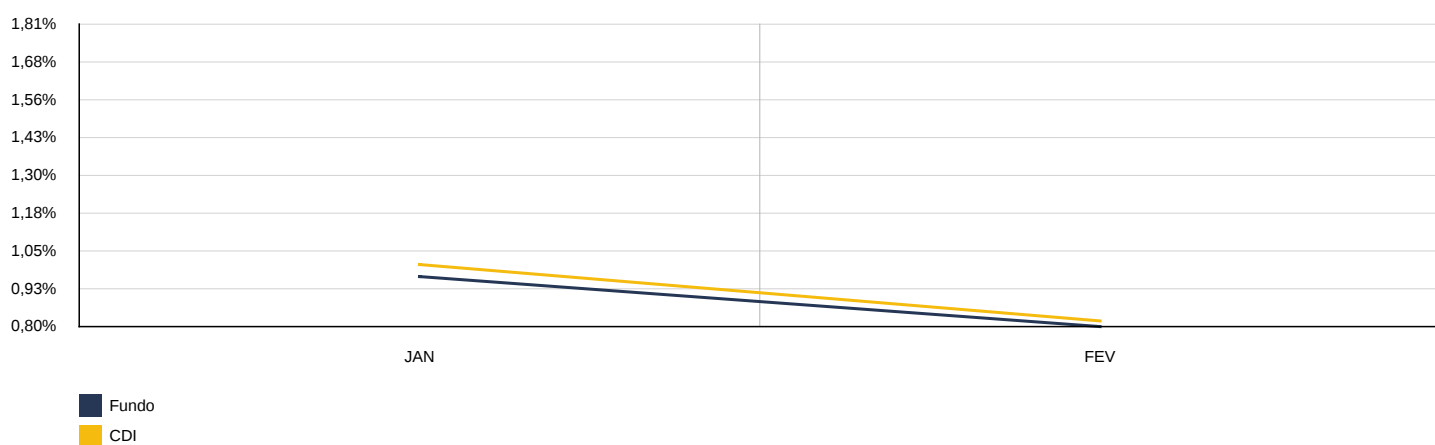
2024	CAIXA BRASIL FI RF DI LP					CNPJ: 03.737.206/0001-97	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	3.370.966,76	0,00	0,00	3.404.781,18	33.814,42	1,00%	0,83%
Fevereiro	3.404.781,18	0,00	0,00	3.432.861,19	28.080,01	0,82%	1,24%
Acumulado no Ano					61.894,43	1,84%	2,09%

CAIXA BRASIL FI RF DI LP



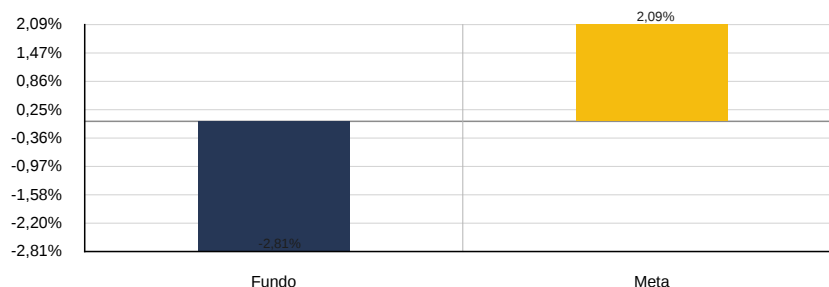
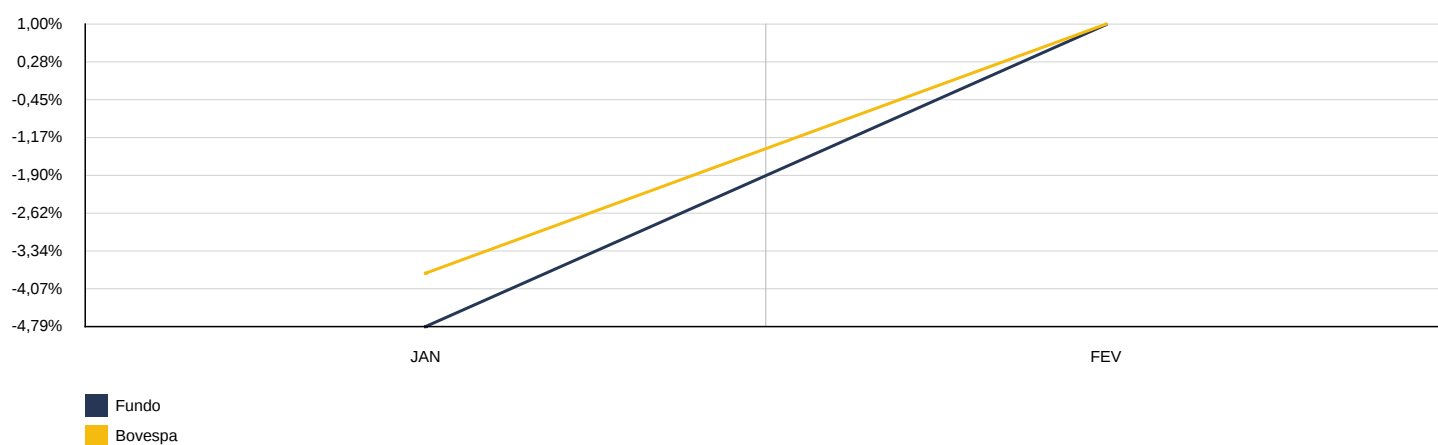
2024	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF					CNPJ: 23.215.008/0001-70	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	5.418.791,08	0,00	0,00	5.473.343,72	54.552,64	1,01%	0,83%
Fevereiro	5.473.343,72	0,00	0,00	5.518.170,59	44.826,87	0,82%	1,24%
Acumulado no Ano					99.379,51	1,83%	2,09%

CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF



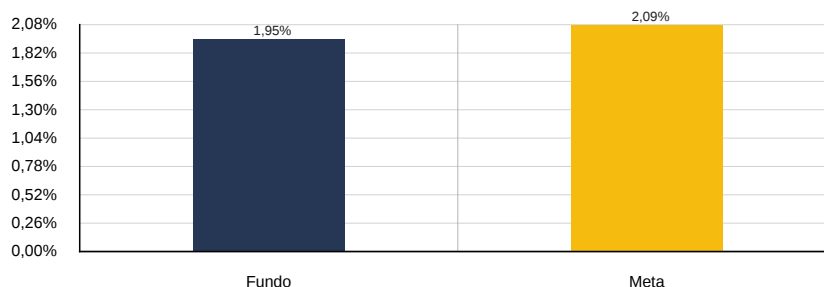
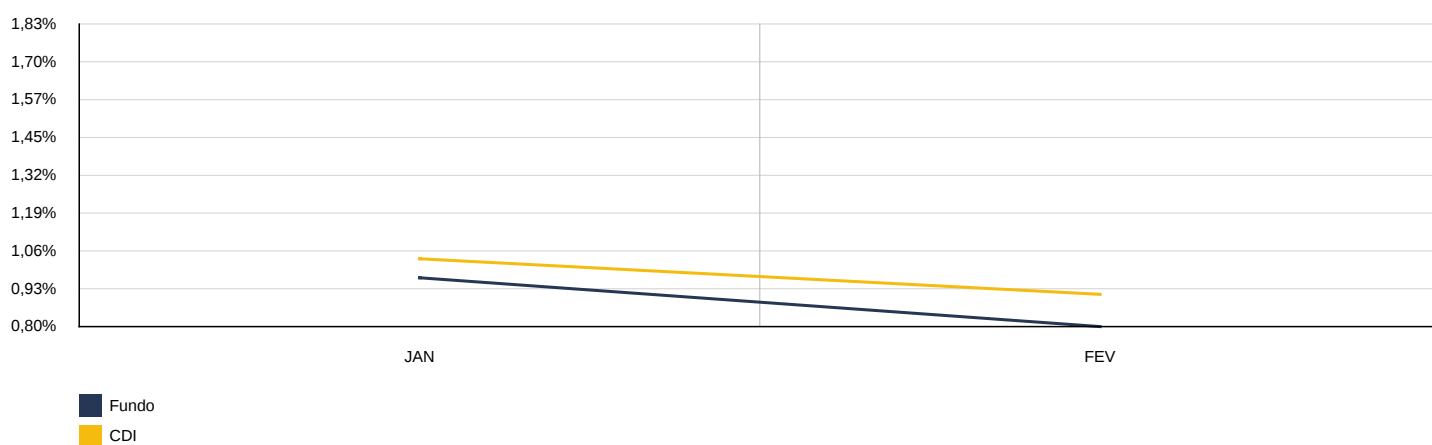
2024	ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI					CNPJ: 02.887.290/0001-62	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.263.203,01	0,00	0,00	1.215.559,02	-47.643,99	-3,77%	0,83%
Fevereiro	1.215.559,02	0,00	0,00	1.227.750,34	12.191,32	1,00%	1,24%
Acumulado no Ano					-35.452,67	-2,81%	2,09%

ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI

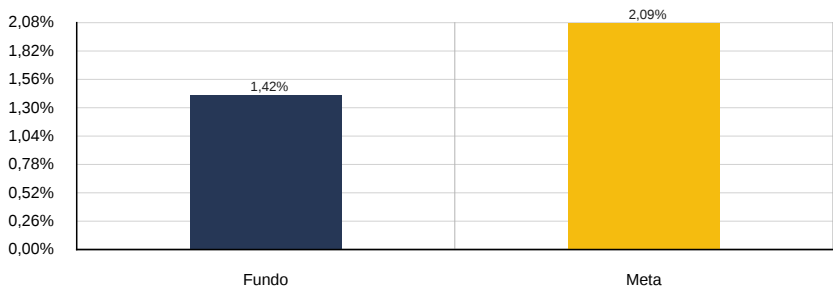
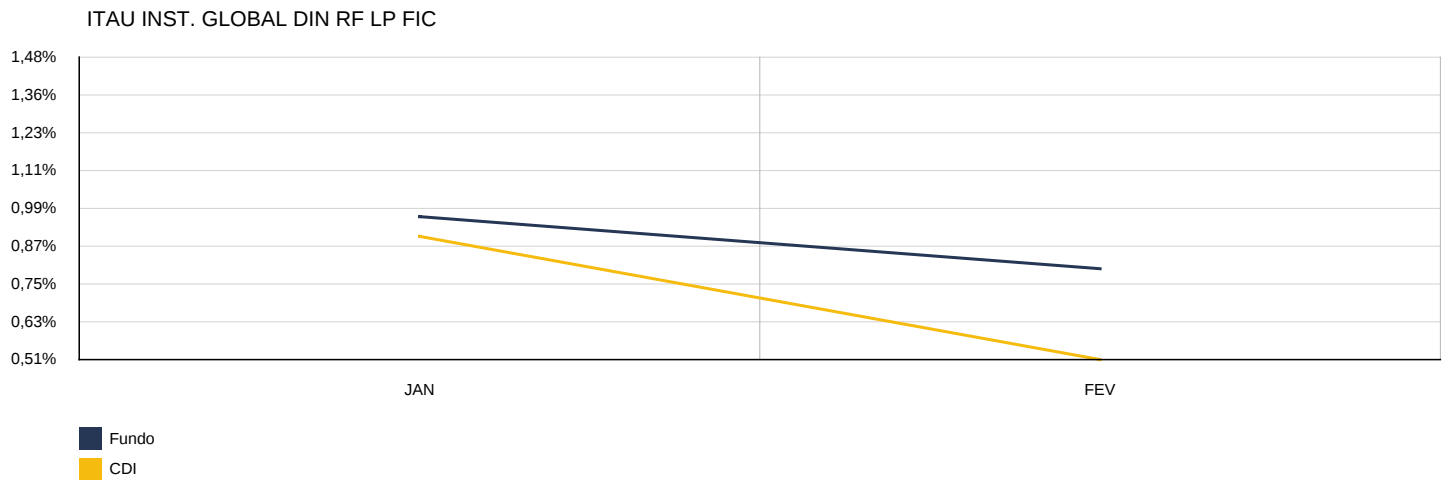


2024	ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI					CNPJ: 09.093.883/0001-04	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	2.026.676,20	0,00	0,00	2.047.582,68	20.906,48	1,03%	0,83%
Fevereiro	2.047.582,68	0,00	0,00	2.066.219,53	18.636,85	0,91%	1,24%
Acumulado no Ano					39.543,33	1,95%	2,09%

ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI

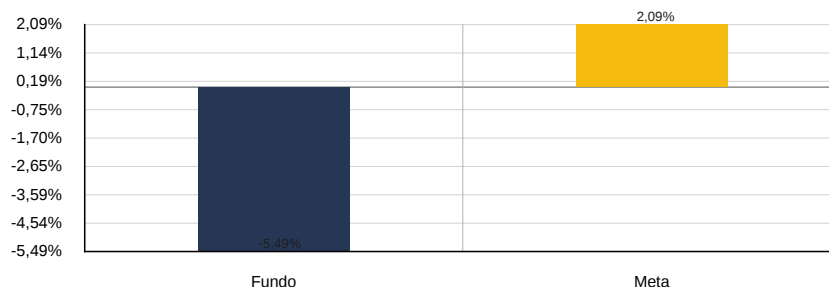
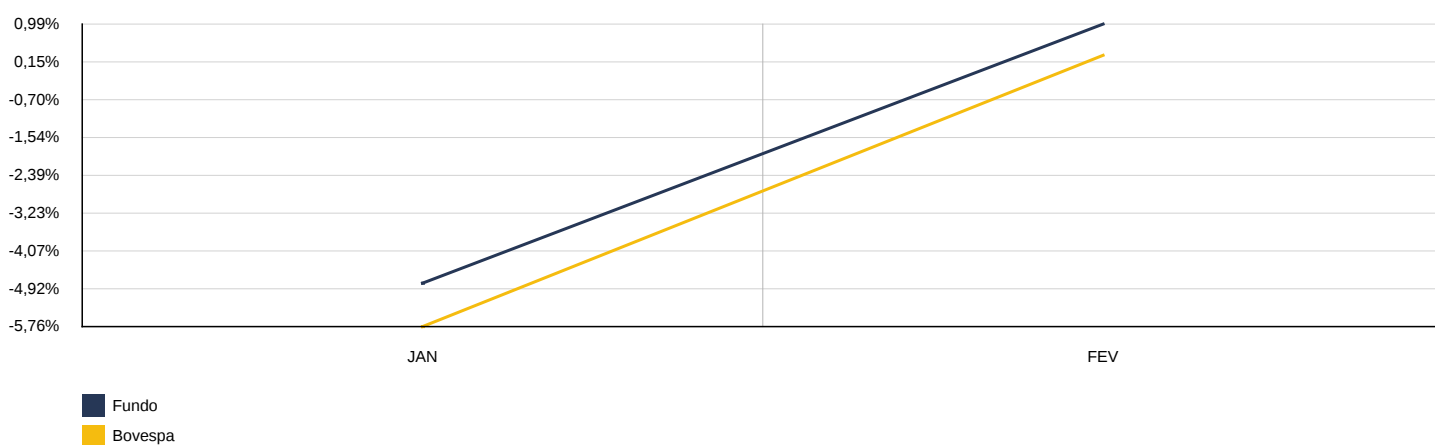


2024	ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC					CNPJ: 32.972.942/0001-28	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	4.577.009,48	0,00	0,00	4.618.369,18	41.359,70	0,90%	0,83%
Fevereiro	4.618.369,18	0,00	0,00	4.641.914,48	23.545,30	0,51%	1,24%
Acumulado no Ano					64.905,00	1,42%	2,09%



2024	ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES					CNPJ: 32.246.546/0001-13	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	525.806,48	0,00	0,00	495.501,50	-30.304,98	-5,76%	0,83%
Fevereiro	495.501,50	0,00	0,00	496.965,24	1.463,74	0,30%	1,24%
Acumulado no Ano					-28.841,24	-5,49%	2,09%

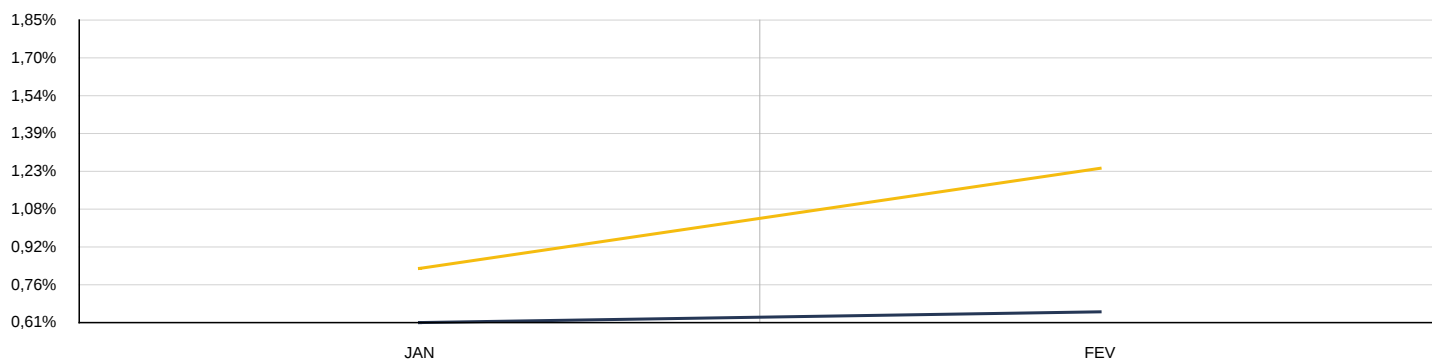
ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES



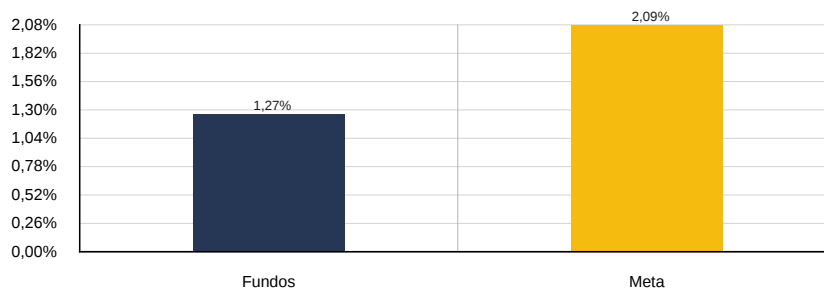
4. CONSOLIDADO

Como pode ser observado pela tabela abaixo a rentabilidade no acumulado do ano ficou em 1,27% enquanto que a meta atuarial acumulada foi de 2,09%, ou seja, o Instituto atingiu 60,74% da meta atuarial.

MÊS	ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META	GAP
Janeiro	61.167.783,63	661.993,29	352.307,00	61.851.939,38	374.469,46	0,61%	0,83%	73,25%
Fevereiro	61.851.939,38	661.803,04	333.768,84	62.586.254,59	406.281,01	0,65%	1,24%	52,56%
Acumulado no Ano					780.750,47	1,27%	2,09%	60,74%
Disponibilidade Financeira					R\$ 1,00			
Patrimônio Líquido					R\$ 62.586.255,59			

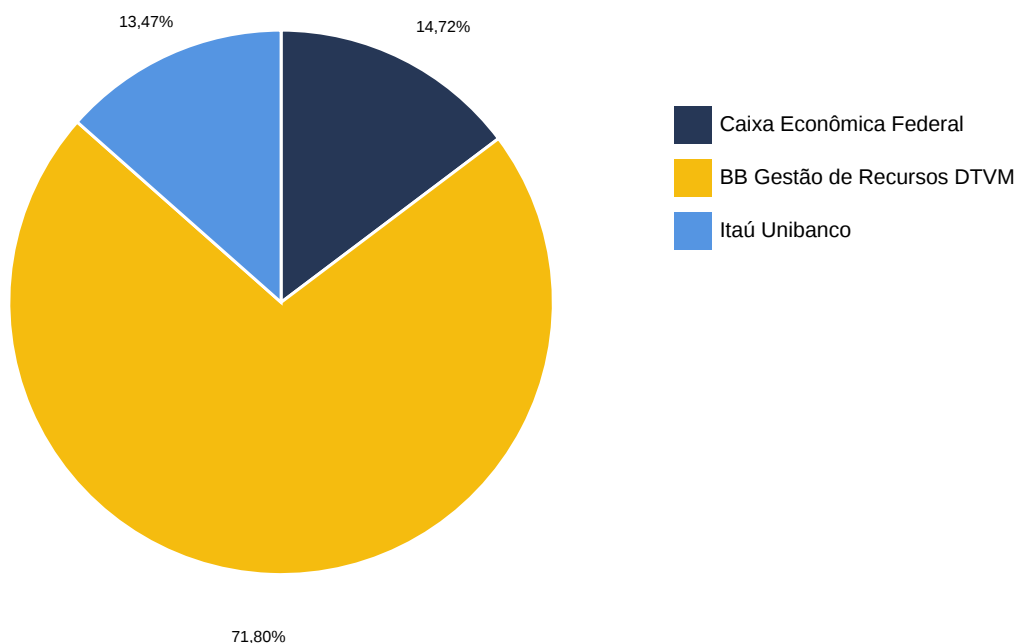


Retorno
Meta



5. CONSOLIDADO POR GESTOR

GESTÃO	VALOR	% S/ CARTEIRA	% S/ PL GESTÃO
Caixa Econômica Federal	9.214.949,74	14,72%	0,01%
BB Gestão de Recursos DTVM	44.938.455,26	71,80%	0,07%
Itaú Unibanco	8.432.849,59	13,47%	0,08%
Total da Carteira	62.586.254,59	100,00%	



6. RETORNO POR SEGMENTO

SEGMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
Renda Fixa	59.634.588,21	661.803,04	333.768,84	60.352.168,90	389.546,49	0,65%
Renda Variável	1.711.060,52	0,00	0,00	1.724.715,58	13.655,06	0,80%
Estruturado	506.290,65	0,00	0,00	509.370,11	3.079,46	0,61%

ATIVOS RENDA FIXA	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.	290.861,40	0,00	0,00	292.155,28	1.293,88	0,44%
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1.139.770,11	645.814,67	333.768,84	1.461.676,90	9.860,96	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	711.783,34	0,00	0,00	715.880,75	4.097,41	0,58%
BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.077.018,42	0,00	0,00	3.092.969,19	15.950,77	0,52%
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	6.745.628,52	0,00	0,00	6.788.394,64	42.766,12	0,63%
BB INSTITUCIONAL FI RF	6.377.650,02	0,00	0,00	6.432.564,27	54.914,25	0,86%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1.600.431,51	0,00	0,00	1.612.288,84	11.857,33	0,74%
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	4.821.988,22	0,00	0,00	4.843.102,56	21.114,34	0,44%
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	10.607.812,75	0,00	0,00	10.693.006,13	85.193,38	0,80%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	8.471.434,49	0,00	0,00	8.497.046,59	25.612,10	0,30%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	246.132,67	15.988,37	0,00	263.917,96	1.796,92	0,69%
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	3.404.781,18	0,00	0,00	3.432.861,19	28.080,01	0,82%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	5.473.343,72	0,00	0,00	5.518.170,59	44.826,87	0,82%

ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	2.047.582,68	0,00	0,00	2.066.219,53	18.636,85	0,91%
ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	4.618.369,18	0,00	0,00	4.641.914,48	23.545,30	0,51%

ATIVOS RENDA VARIÁVEL	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	1.215.559,02	0,00	0,00	1.227.750,34	12.191,32	1,00%
ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES	495.501,50	0,00	0,00	496.965,24	1.463,74	0,30%

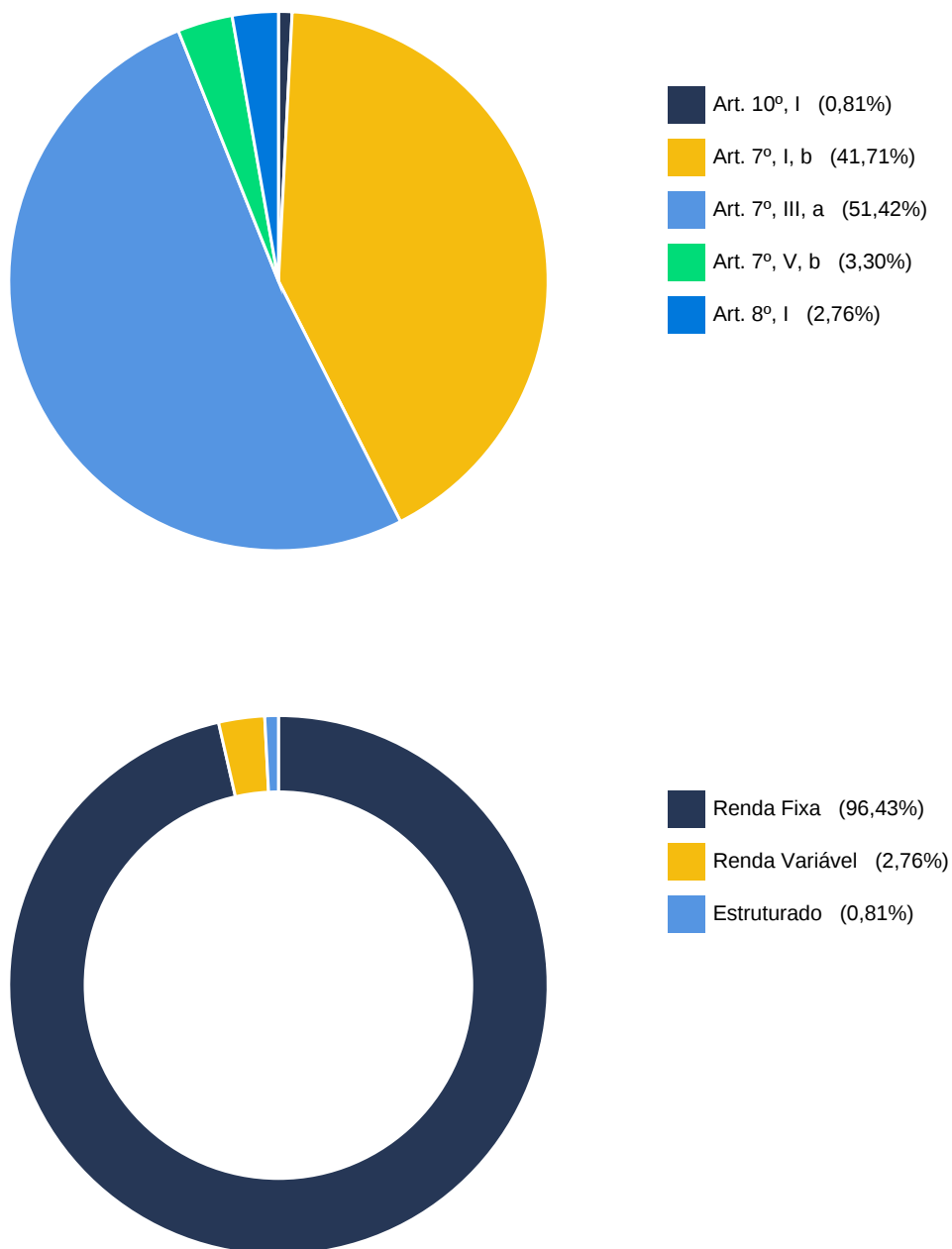
ATIVOS ESTRUTURADO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	260.120,81	0,00	0,00	261.979,78	1.858,97	0,71%
BB MULTIMERCADO MACRO LP	246.169,84	0,00	0,00	247.390,33	1.220,49	0,50%

7. ENQUADRAMENTO

O enquadramento da carteira é com base na legislação vigente, a proposta de estratégia para o exercício é deliberada pelo colegiado, a carteira deve seguir a PAI - Política Anual de Investimento considerando limites mínimos e máximos.

ALOCÇÃO ESTRATÉGICA PARA O EXERCÍCIO DE 2024					
SEGMENTO	ATIVO	Alocação dos Recursos			
		Limite da Resolução	Limite Inferior %	%	Limite Superior %
RENDA FIXA	Títulos TN SELIC - Art.7º, I, "a"	100%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, "b"		30,00%	41,71%	100,00%
	FI Ref em Índices de RF 100 TP - Art.7º, I, "c"		0,00%	0,00%	0,00%
	Oper. Compromissadas em TP TN - Art. 7º, II	5%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI referenciados RF - Art. 7º, III, "a"	60%	0,00%	51,42%	60,00%
	FI de Índices Referenciado RF - Art. 7º, III, "b"		0,00%	0,00%	0,00%
	Renda Fixa de emissão Bancária - Art. 7º, IV	20%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI em Direito Creditório - Sênior - Art. 7º, V, "a"	5%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI Renda Fixa "Credito Privado" - Art. 7º, V, "b"		0,00%	3,30%	5,00%
	FI de Debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, "c"		0,00%	0,00%	0,00%
RENDA VARIÁVEL	FI de Ações - Art. 8, I	30%	0,00%	2,76%	10,00%
	ETF - Índices de ações - Art. 8º, II		0,00%	0,00%	3,00%
EXTERIOR	Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	10%	0,00%	0,00%	0,00%
	Constituído no Brasil - Art. 9º, II		0,00%	0,00%	0,00%
	Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III		0,00%	0,00%	5,00%
ESTRUTURADO	FI Multimercados - Art. 10, I	10%	0,00%	0,81%	7,00%
	FI em Participações - Art. 10, II	5%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI Mercado de Acesso - Art. 10, III		0,00%	0,00%	0,00%
IMOBILIÁRIO	FI Imobiliários - Art. 11	5%	0,00%	0,00%	0,00%
CONSIGNADO	Empréstimos consignado - Art. 12	5%	0,00%	0,00%	0,00%
TOTAL GERAL			30,00%	100,00%	190,00%

8. ENQUADRAMENTO RESOLUÇÃO N. 4.963/2021



9. GERENCIAMENTO DE RISCO

Fundo	Sharpe	VAR	Modi M.	Sharpe M.
BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.	0,000	0,005%	0,12	0,00
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,001	0,003%	0,13	0,00
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,000	0,002%	0,12	0,00
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	0,000	0,005%	0,12	0,00
BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,011	0,010%	0,13	0,00
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,018	0,005%	0,13	0,00
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,039	0,002%	0,13	0,04
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO	0,000	0,002%	0,12	0,00
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,033	0,006%	0,13	0,00
BB MULTIMERCADO MACRO LP	0,000	0,004%	0,12	0,00
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,001	0,002%	0,13	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	0,040	0,009%	0,13	0,04
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	0,000	0,002%	0,11	0,00
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	0,041	0,002%	0,13	0,04
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	0,043	0,002%	0,13	0,04
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	0,026	0,041%	0,13	0,00
ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	0,100	0,002%	0,14	0,10
ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	0,000	0,003%	0,13	0,00

ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES	0,000	0,047%	0,13	0,00
-----------------------------	-------	--------	------	------

10. ÍNDICES ECONÔMICOS

ÍNDICE	MÊS	ANTERIOR	6 MESES	ANO	12 MESES
Bovespa	0,99%	-4,79%	9,18%	-3,85%	22,96%
CDI	0,80%	0,97%	6,88%	1,77%	13,77%
IMA-B	0,55%	-0,45%	3,87%	0,10%	14,70%
IMA-B 5	0,59%	0,68%	4,42%	1,28%	10,44%
IMA-B 5+	0,51%	-1,47%	3,37%	-0,96%	18,26%
IMA-Geral	0,64%	0,47%	5,15%	1,11%	14,09%
IMA-Geral ex-C	0,65%	0,46%	5,16%	1,11%	14,28%
IMA-S	0,82%	0,99%	5,74%	1,81%	12,91%
INPC	0,81%	0,57%	2,28%	1,38%	3,86%
IPCA	0,83%	0,42%	2,62%	1,25%	4,50%
IRF-M	0,46%	0,67%	5,74%	1,13%	15,85%
IRF-M 1	0,76%	0,83%	5,52%	1,61%	12,71%
IRF-M 1+	0,34%	0,60%	5,87%	0,94%	17,85%
Selic	0,80%	0,97%	6,88%	1,77%	13,77%
Meta Atuarial	1,24%	0,83%	5,17%	2,09%	9,75%

SÃO PAULO/SP, 12/03/2024

Thiago Matheus da Costa

THIAGO MATHEUS DA COSTA

Sócio Proprietário

Certificação CEA pela ANBIMA

Consultor de Valores Mobiliários

Atuário MIBA 2178

