

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2024

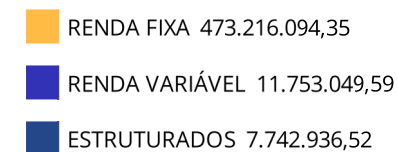
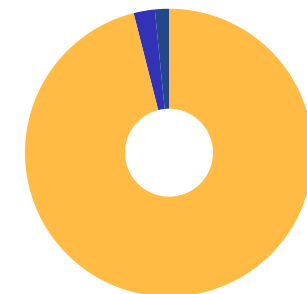


Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			215.999.206,53	43,84%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.477.136,17	0,50%	884	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.703.516,45	0,95%	795	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	13.023.608,19	2,64%	1.152	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.942.001,95	0,39%	843	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.412.724,22	0,69%	913	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	41.226.391,80	8,37%	734	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	4.133.491,32	0,84%	93	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.671.286,96	0,34%	75	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	10.947.205,59	2,22%	3.090	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	11.953.682,13	2,43%	123	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	36.304.563,21	7,37%	1.139	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	37.349.407,25	7,58%	149	4,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.320.346,73	2,30%	30	5,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	75.630.756,77	15,35%	449	0,75%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.120.769,08	0,23%	4.909	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.071.882,67	1,23%	87	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	D+92	Não há	5.681.166,92	1,15%	16	6,41%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTI...	D+1	1185 dias	7.742.936,52	1,57%	12	14,71%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			492.712.080,46				

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

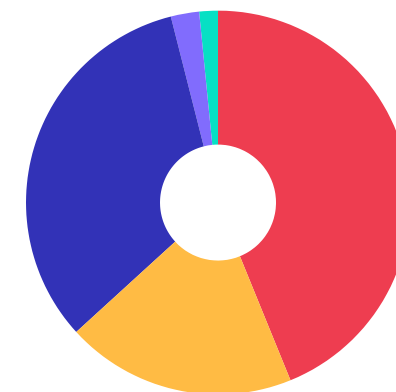
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	215.999.206,53	43,84%	0,00%	40,00%	100,00%	276.712.873,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	95.491.044,78	19,38%	0,00%	24,00%	100,00%	397.221.035,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	492.712.080,46
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.635.604,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	161.725.843,04	32,82%	0,00%	21,00%	60,00%	133.901.405,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	295.627.248,28
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	98.542.416,09
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.635.604,02
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	24.635.604,02
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.635.604,02
Total Renda Fixa	100,00%	473.216.094,35	96,04%	0,00%	87,00%	460,00%	



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%	11.753.049,59	2,39%	0,00%	4,00%	30,00%	136.060.574,55
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	147.813.624,14
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	7.742.936,52	1,57%	0,00%	4,00%	10,00%	41.528.271,53
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.635.604,02
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.635.604,02
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	24.635.604,02
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	19.495.986,11	3,96%	0,00%	11,00%	85,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	49.271.208,05
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	49.271.208,05
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	49.271.208,05
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	



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 '	215.999.206,53	43,84	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	95.491.044,78	19,38	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	161.725.843,04	32,82	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	11.753.049,59	2,39	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	7.742.936,52	1,57	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	215.999.206,53	43,84	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	124.300.510,75	25,23	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.508.824,02	11,47	-
CAIXA DTVM	46.581.117,97	9,45	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	16.751.983,87	3,40	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	11.953.682,13	2,43	-
BANCO J. SAFRA S/A	7.742.936,52	1,57	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	6.071.882,67	1,23	-
TARPON INVESTIMENTOS	5.681.166,92	1,15	-
WESTERN ASSET	1.120.769,08	0,23	-

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 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%
IMA Geral (Benchmark)	0,64%	1,11%	2,75%	5,15%	14,09%	26,08%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,59%	1,01%	2,61%	4,65%	13,26%	24,73%	0,42%	2,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,76%	1,61%	2,53%	5,52%	12,71%	27,14%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,61%	2,51%	5,41%	12,42%	26,44%	0,09%	0,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,75%	1,58%	2,51%	5,41%	12,49%	26,67%	0,09%	0,29%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,59%	1,28%	2,76%	4,42%	10,44%	23,21%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,56%	1,22%	2,68%	4,27%	10,16%	22,36%	0,42%	1,77%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,58%	1,24%	2,71%	4,33%	10,23%	22,77%	0,41%	1,76%
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%
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,62%	1,66%	2,72%	5,91%	12,72%	24,89%	0,36%	1,05%
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%

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

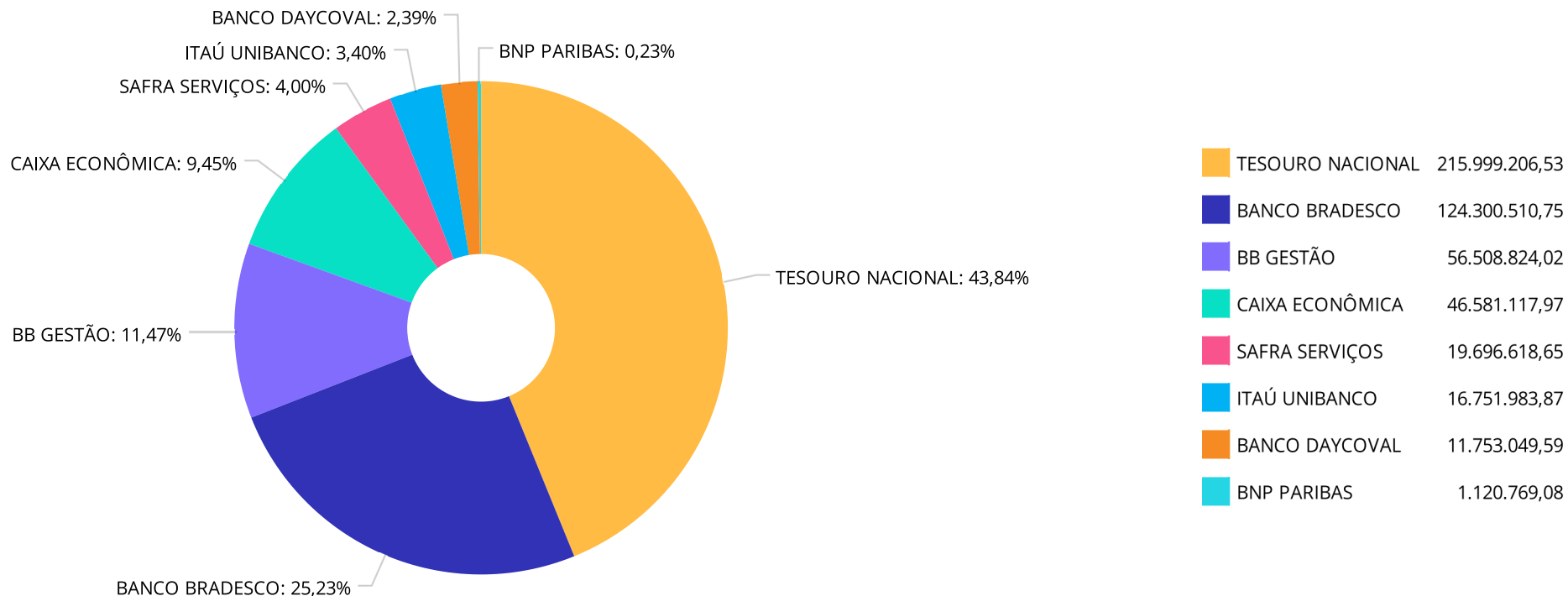
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	1,74%	2,66%	5,58%	12,63%	27,10%	0,05%	0,09%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,80%	1,77%	2,67%	5,63%	12,64%	27,16%	0,00%	0,05%
BRAPREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	1,99%	2,95%	6,17%	13,60%	28,88%	0,05%	0,09%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,80%	1,76%	2,66%	5,60%	12,55%	27,01%	0,01%	0,05%

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

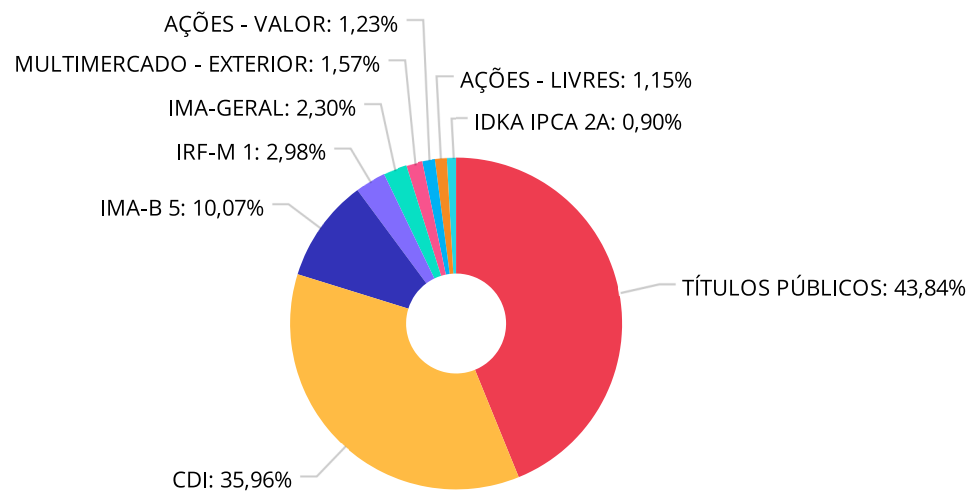
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,97%	5,22%	10,20%	11,05%	31,71%	-	5,30%	9,29%

Ibovespa (Benchmark)	0,99%	-3,85%	1,33%	11,47%	22,96%	14,03%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	2,20%	-3,98%	5,46%	15,18%	50,22%	-	5,76%	18,58%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,90%	1,37%	4,08%	15,78%	50,26%	48,40%	5,44%	17,72%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	215.999.206,53	■ CDI	177.183.368,58	■ IMA-B 5	49.599.139,24	■ IRF-M 1	14.694.895,15
■ IMA-GERAL	11.320.346,73	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	7.742.936,52	■ AÇÕES - VALOR	6.071.882,67	■ AÇÕES - LIVRES	5.681.166,92
■ IDKA IPCA 2A	4.419.138,12						

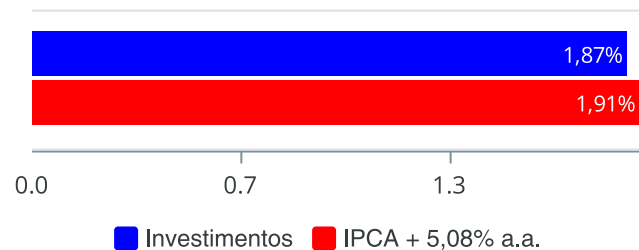
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	11/11/2022	4.935	4.051,963958	4.267,694579	19.996.442,13	21.061.072,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2022	3.829	3.917,193385	4.210,731149	14.998.933,47	16.122.889,56	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	13/10/2022	9.961	4.018,705600	4.376,991125	40.030.326,48	43.599.208,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/10/2022	12.654	4.109,188612	4.373,185388	51.997.672,70	55.338.287,89	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	07/10/2022	17.942	4.085,635525	4.451,997978	73.304.472,59	79.877.747,72	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

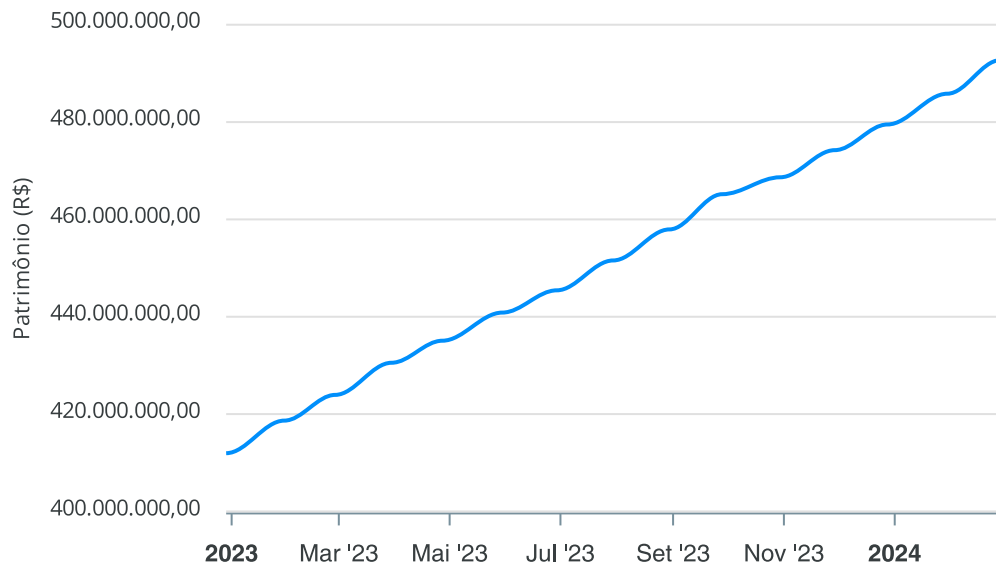
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	477.797.383,12	7.700.899,53	5.679.480,64	484.200.297,76	4.381.495,75	4.381.495,75	0,91%	0,91%	0,86%	0,86%	106,76%	0,57%
Fevereiro	484.200.297,76	7.230.105,72	5.048.772,90	490.986.740,40	4.605.109,82	8.986.605,57	0,95%	1,87%	1,05%	1,91%	97,84%	0,52%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



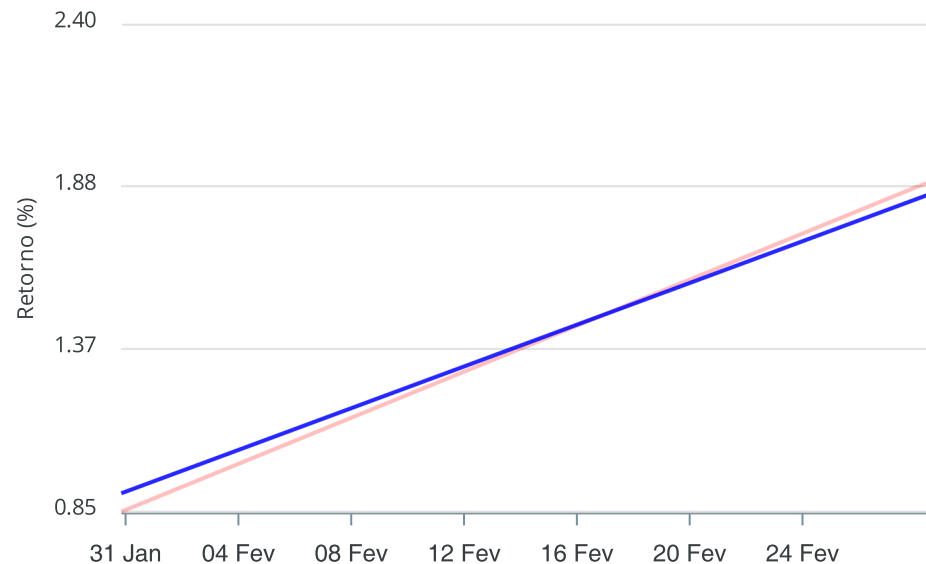
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	216.016.122,51	0,00	2.190.474,58	215.999.206,53	2.173.558,60	1,01%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	74.310.057,30	2.724.104,77	2.079.937,74	75.630.756,77	676.532,44	0,88%	0,90%	0,05%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	11.858.842,77	0,00	0,00	11.953.682,13	94.839,36	0,80%	0,80%	0,01%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	10.860.688,65	0,00	0,00	10.947.205,59	86.516,94	0,80%	0,80%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.951.536,25	116.413,81	163.171,04	41.226.391,80	321.612,78	0,78%	0,79%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	35.674.599,49	1.071.244,90	726.454,36	36.304.563,21	285.173,18	0,78%	0,80%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.658.903,93	0,00	0,00	1.671.286,96	12.383,03	0,75%	0,75%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.927.828,07	0,00	0,00	13.023.608,19	95.780,12	0,74%	0,74%	0,09%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1.113.886,24	0,00	0,00	1.120.769,08	6.882,84	0,62%	0,62%	0,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	11.253.536,60	0,00	0,00	11.320.346,73	66.810,13	0,59%	0,59%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	4.109.737,56	0,00	0,00	4.133.491,32	23.753,76	0,58%	0,58%	0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.393.155,62	0,00	0,00	3.412.724,22	19.568,60	0,58%	0,58%	0,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.676.595,42	0,00	0,00	4.703.516,45	26.921,03	0,58%	0,58%	0,41%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	35.824.739,38	1.322.917,08	0,00	37.349.407,25	201.750,79	0,54%	0,56%	0,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.466.165,54	0,00	0,00	2.477.136,17	10.970,63	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.933.513,29	0,00	0,00	1.942.001,95	8.488,66	0,44%	0,44%	0,48%
Total Renda Fixa	469.029.908,62	5.234.680,56	5.160.037,72	473.216.094,35	4.111.542,89	0,88%		0,14%

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
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIME...	7.519.688,22	0,00	0,00	7.742.936,52	223.248,30	2,97%	2,97%	5,30%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.820.810,59	1.095.237,29	0,00	6.071.882,67	155.834,79	2,63%	2,90%	5,44%
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	4.458.622,79	1.095.237,29	0,00	5.681.166,92	127.306,84	2,29%	2,20%	5,76%
Total Renda Variável	16.799.121,60	2.190.474,58	0,00	19.495.986,11	506.389,93	2,67%		5,48%

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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%