

GJTPREVI - INSTITUTO DE PREV. S. DOS
SERVIDORES PÚBL. MUN. DE GOVERNADOR
JORGE TEIXEIRA

CNPJ 13.363.520/0001-00



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 FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	1.291.590,92	4,11%	1.015	0,03%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+2	835.161,48	2,66%	293	0,05%	Art. 7º, I, b
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	1.135.201,58	3,62%	99	0,43%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO	D+0	3.930.223,68	12,52%	1.152	0,05%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	1.320.660,71	4,21%	645	0,03%	Art. 7º, I, b
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	5.231.345,41	16,67%	1.139	0,03%	Art. 7º, III, a
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	D+1	1.054.092,59	3,36%	90	0,28%	Art. 7º, I, b
BB RF CP AUTOMÁTICO	D+0	506.192,25	1,61%	92.215	0,00%	Art. 7º, III, a
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	D+0	945.576,33	3,01%	993	0,01%	Art. 7º, III, a
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	D+0	1.710.721,48	5,45%	161	0,26%	Art. 7º, I, b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	D+0	4.156.131,28	13,24%	1.191	0,05%	Art. 7º, I, b
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	D+0	2.472.521,55	7,88%	441	0,04%	Art. 7º, III, a
CAIXA PRÁTICO FIC RF CP	D+0	12.352,54	0,04%	13.442	0,00%	Art. 7º, IV, a
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	D+4	726.775,90	2,32%	190	0,29%	Art. 8º, I
ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	D+0	1.228.245,60	3,91%	841	0,02%	Art. 7º, V, b
ITAÚ INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	D+1	2.419.526,76	7,71%	220	0,10%	Art. 7º, III, a

ITAÚ MM JUROS E MOEDAS	D+1	2.100.664,03	6,69%	33	2,17%	Art. 10º, I
LME REC MULTISSETORIAL IPCA	D+1260	129.519,31	0,41%	0	0,18%	Art. 7º, V, a
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RF	D+1471	76.768,68	0,24%	31	0,18%	Art. 7º, IV, a
TOWER II RF FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	D+1471	105.043,55	0,33%	26	0,26%	Art. 7º, I, b
TOTAL		31.388.315,63				

2. RENTABILIDADE DOS FUNDOS

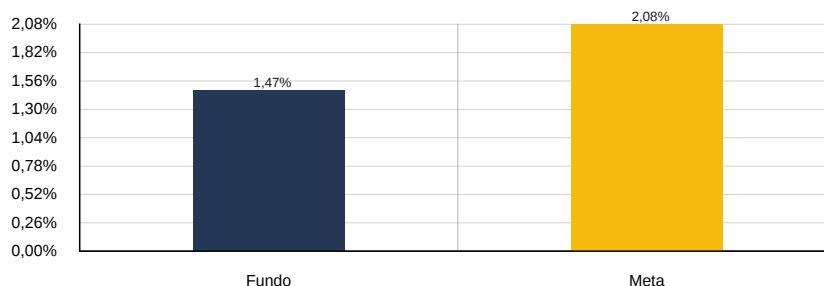
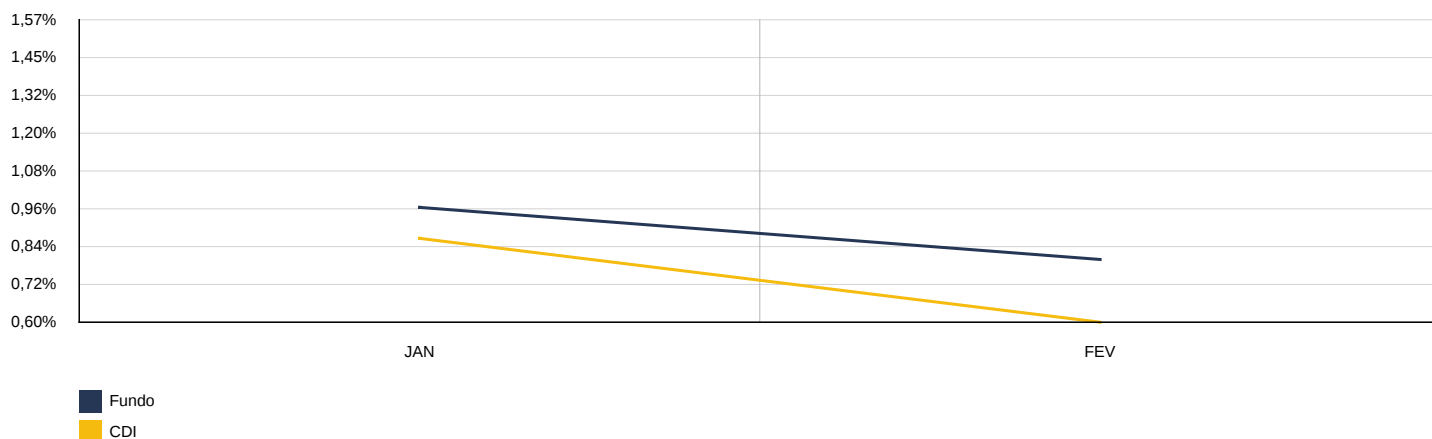
CNPJ	FUNDO	MÊS	ANTERIOR	6 MESES	ANO	12 MESES
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,73%	0,88%	5,17%	1,61%	11,62%
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,49%	-1,51%	3,22%	-1,03%	17,79%
14.964.240/0001-10	BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,63%	0,45%	5,06%	1,08%	13,89%
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%
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%
42.592.315/0001-15	BB RF CP AUTOMÁTICO	0,61%	0,74%	4,37%	1,35%	9,87%
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RF DI LP	0,82%	1,00%	5,90%	1,84%	13,25%
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	0,63%	0,45%	5,05%	1,08%	14,00%
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	0,74%	0,91%	5,48%	1,66%	12,54%
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	0,82%	1,01%	5,90%	1,83%	13,31%
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO FIC RF CP	0,62%	0,75%	4,39%	1,37%	9,87%
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	ITAÚ INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	0,51%	0,90%	4,98%	1,42%	12,14%
00.973.117/0001-51	ITAÚ MM JUROS E MOEDAS	0,77%	0,94%	5,65%	1,72%	13,16%
12.440.789/0001-80	LME REC MULTISSETORIAL IPCA	-0,41%	-0,64%	-2,70%	-1,05%	-4,53%

12.845.801/0001-37	TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RF	-0,40%	-20,05%	-35,38%	-20,37%	-36,15%
23.954.899/0001-87	TOWER II RF FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,25%	-9,23%	-17,44%	-9,01%	-26,87%

3. CARTEIRA DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

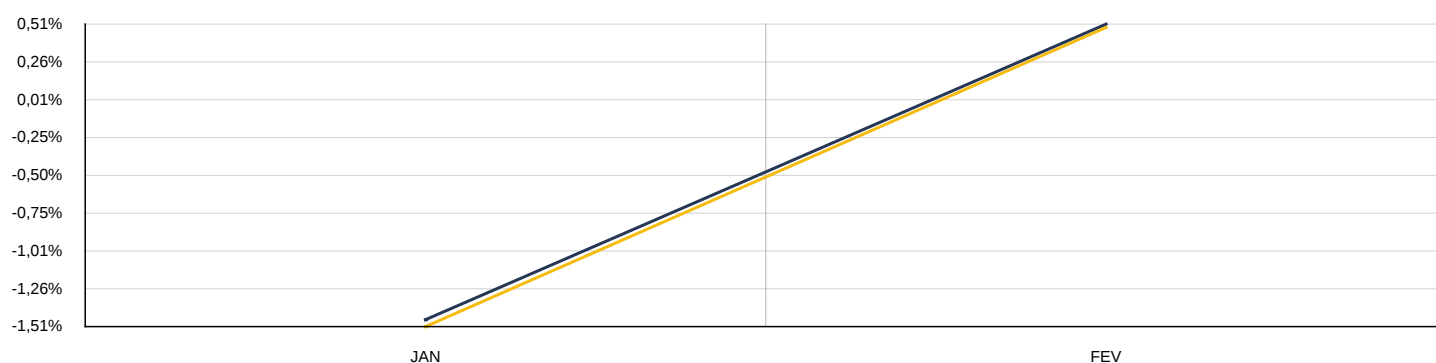
2024	BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.077.415/0001-05	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.335.847,07	3.345,05	193.565,97	1.157.246,54	11.620,39	0,87%	0,83%
Fevereiro	1.157.246,54	334.625,00	209.227,71	1.291.590,92	8.947,09	0,60%	1,24%
Acumulado no Ano					20.567,48	1,47%	2,08%

BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO



2024	BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.327.340/0001-73	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	843.868,13	0,00	0,00	831.098,29	-12.769,84	-1,51%	0,83%
Fevereiro	831.098,29	0,00	0,00	835.161,48	4.063,19	0,49%	1,24%
Acumulado no Ano					-8.706,65	-1,03%	2,08%

BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO

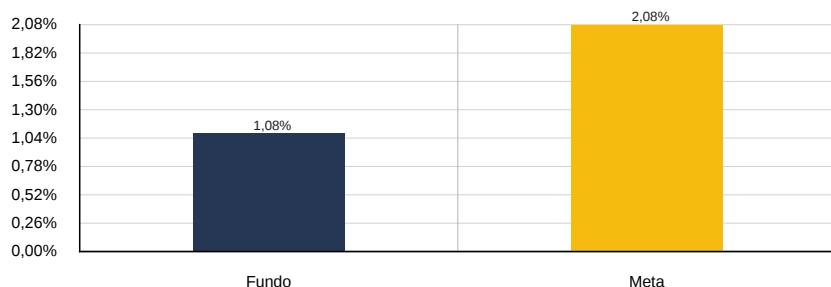
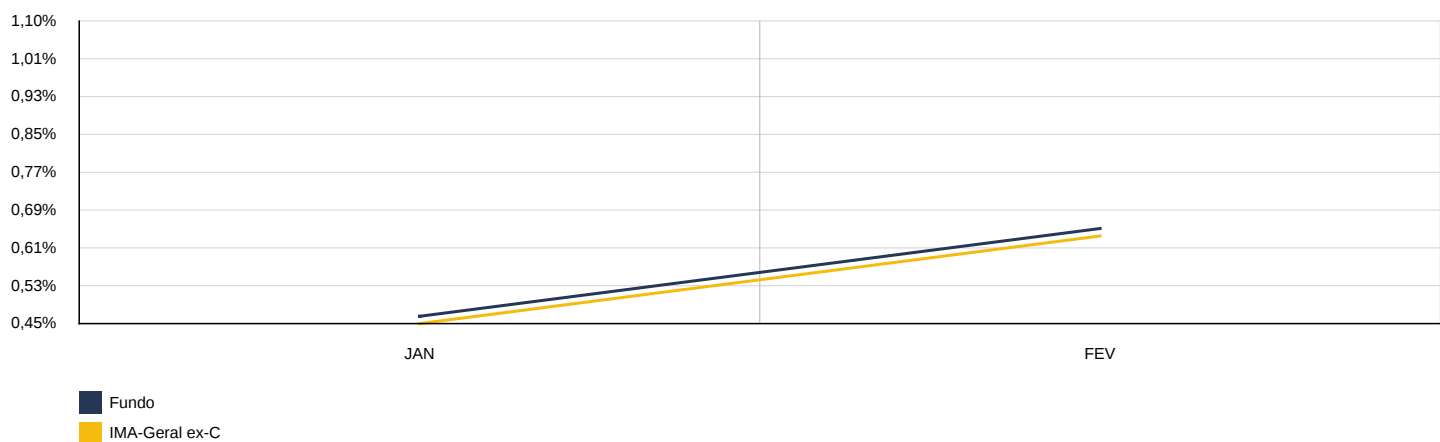


■ Fundo
■ IMA-B 5+



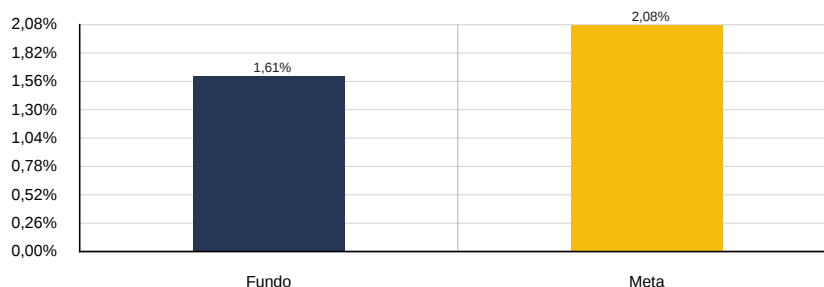
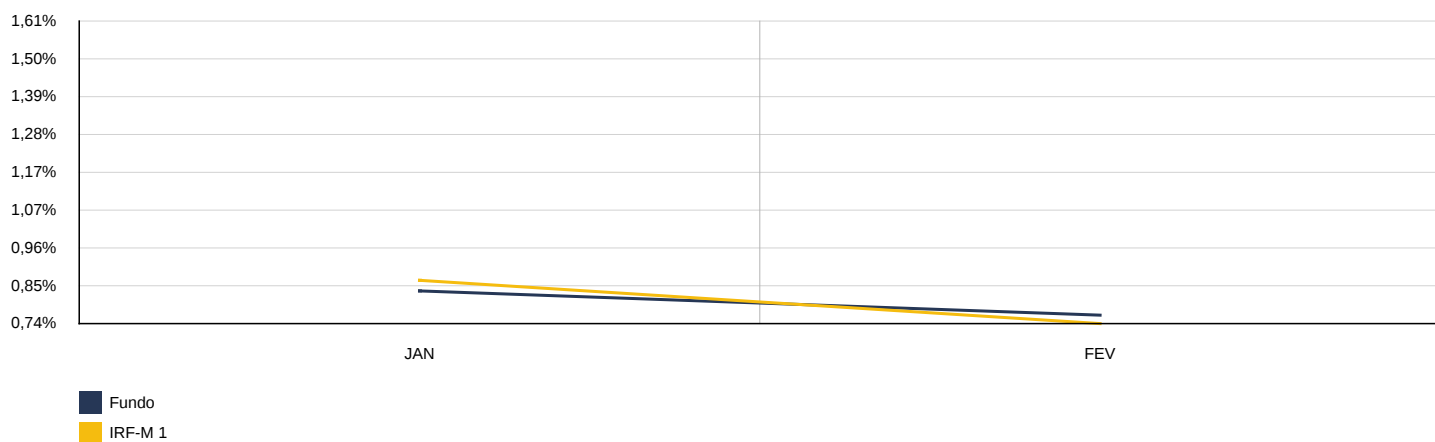
2024	BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 14.964.240/0001-10	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.123.044,14	0,00	0,00	1.128.049,94	5.005,80	0,45%	0,83%
Fevereiro	1.128.049,94	0,00	0,00	1.135.201,58	7.151,64	0,63%	1,24%
Acumulado no Ano					12.157,44	1,08%	2,08%

BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO



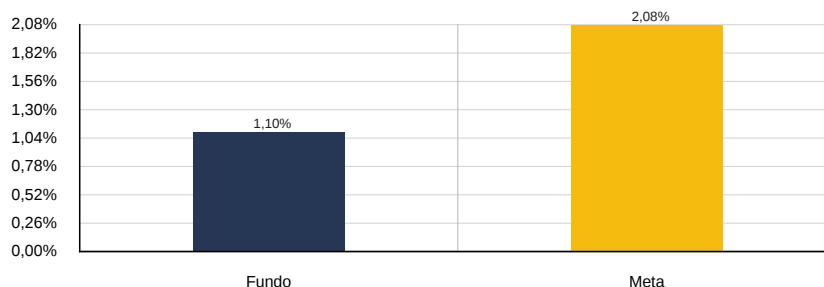
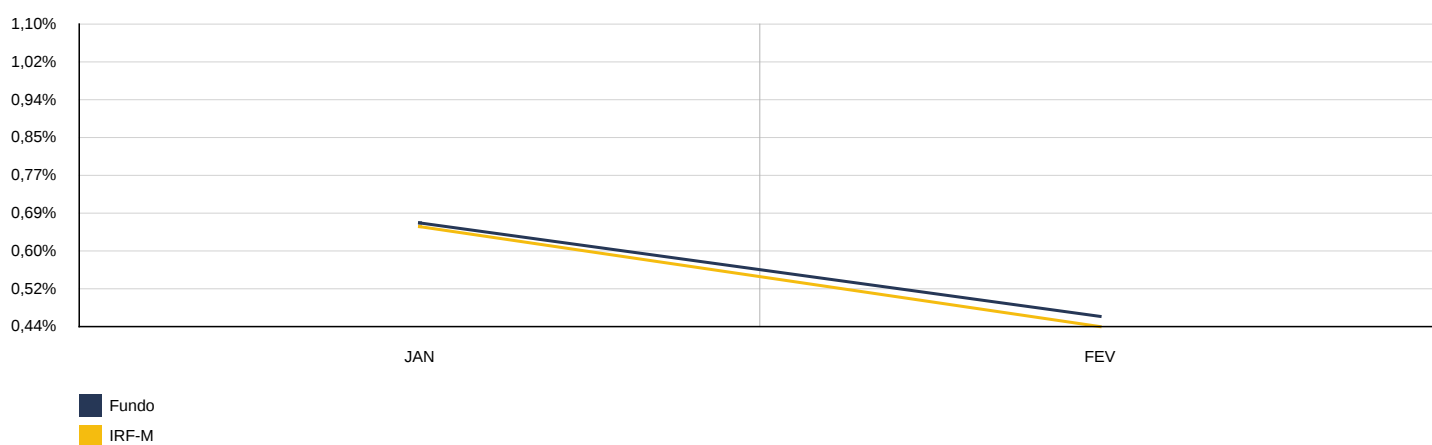
2024	BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO					CNPJ: 11.328.882/0001-35	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	3.867.877,85	0,00	0,00	3.901.319,45	33.441,60	0,86%	0,83%
Fevereiro	3.901.319,45	0,00	0,00	3.930.223,68	28.904,23	0,74%	1,24%
Acumulado no Ano					62.345,83	1,61%	2,08%

BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO



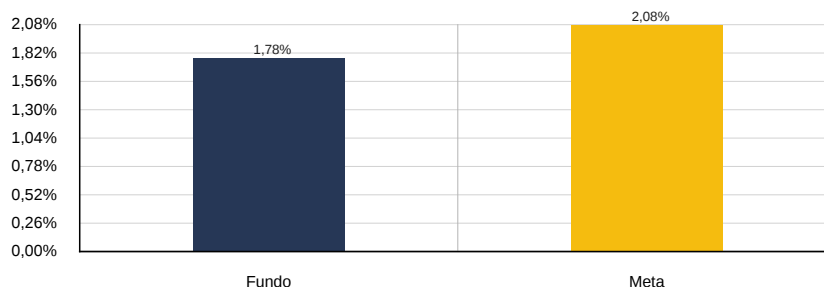
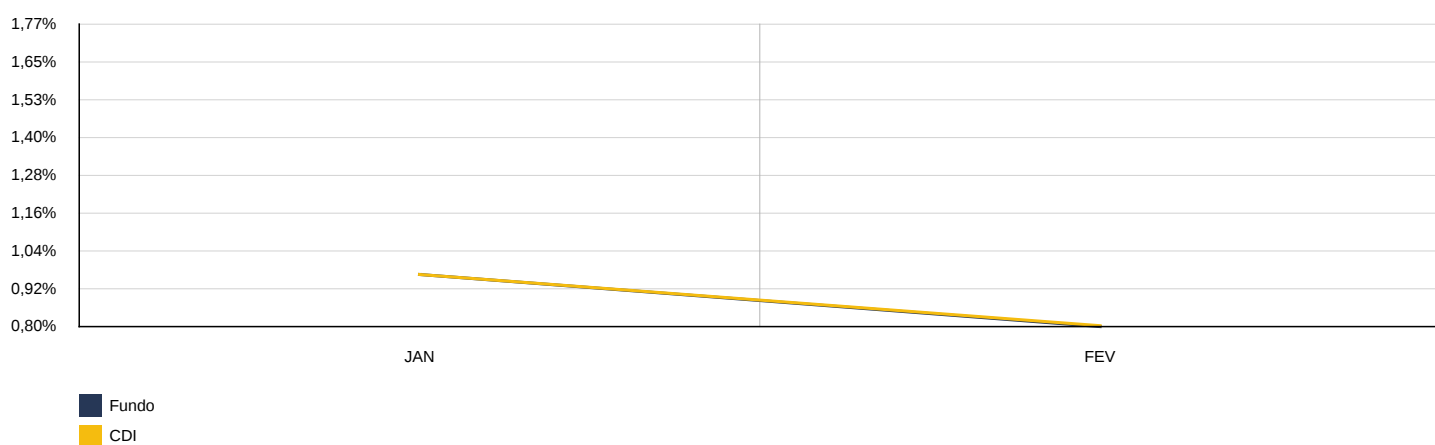
2024	BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 07.111.384/0001-69	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.306.304,99	0,00	0,00	1.314.903,06	8.598,07	0,66%	0,83%
Fevereiro	1.314.903,06	0,00	0,00	1.320.660,71	5.757,65	0,44%	1,24%
Acumulado no Ano					14.355,72	1,10%	2,08%

BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO



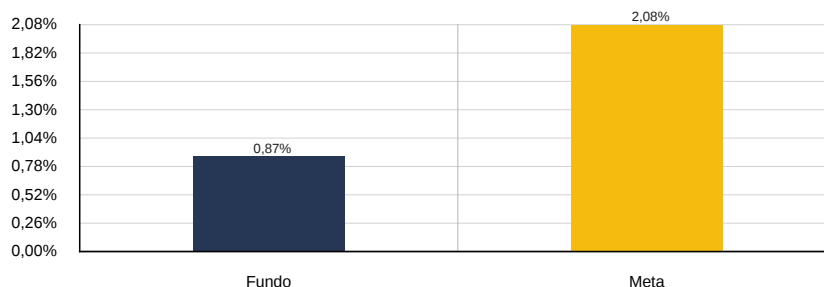
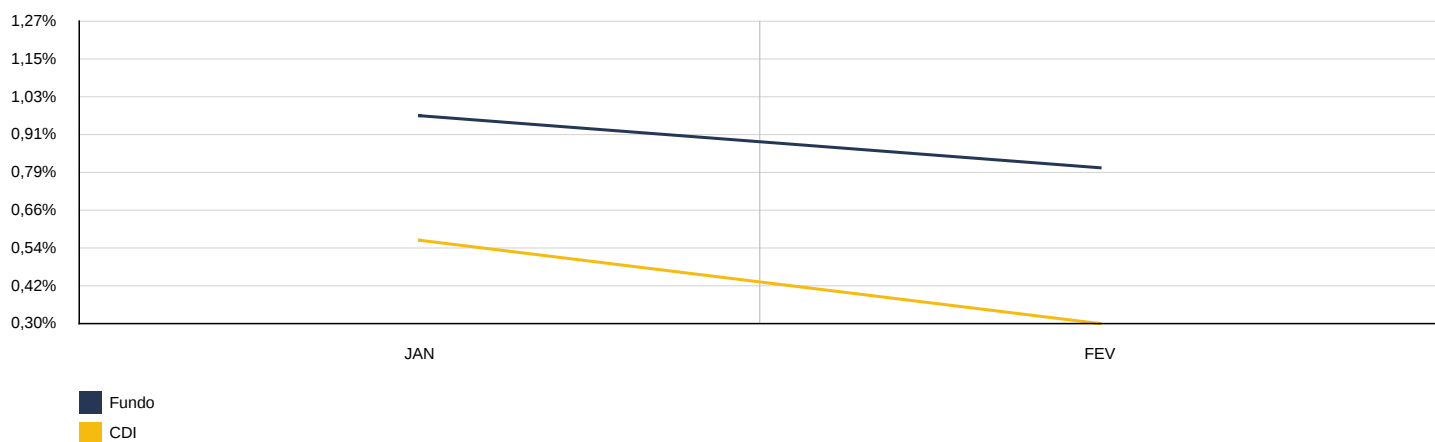
2024	BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.077.418/0001-49	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	5.139.976,17	0,00	0,00	5.189.666,20	49.690,03	0,97%	0,83%
Fevereiro	5.189.666,20	0,00	0,00	5.231.345,41	41.679,21	0,80%	1,24%
Acumulado no Ano					91.369,24	1,78%	2,08%

BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO



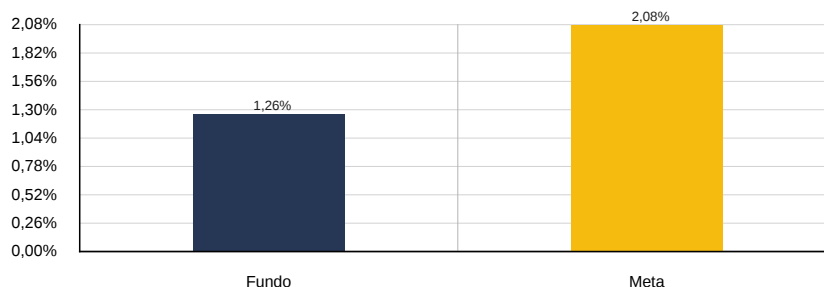
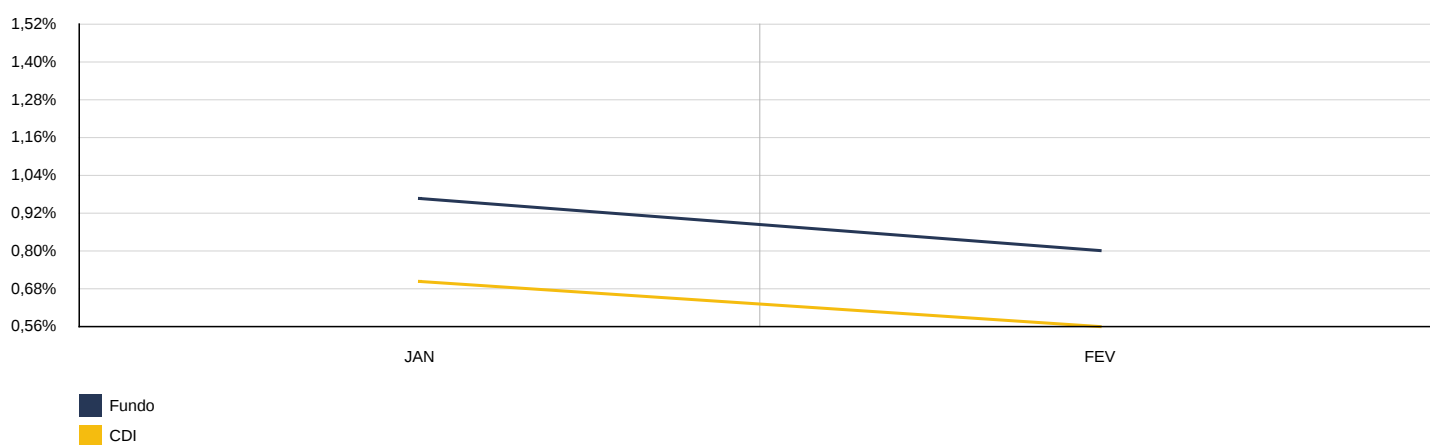
2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI					CNPJ: 32.161.826/0001-29	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.044.972,82	0,00	0,00	1.050.915,30	5.942,48	0,57%	0,83%
Fevereiro	1.050.915,30	0,00	0,00	1.054.092,59	3.177,29	0,30%	1,24%
Acumulado no Ano					9.119,77	0,87%	2,08%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI



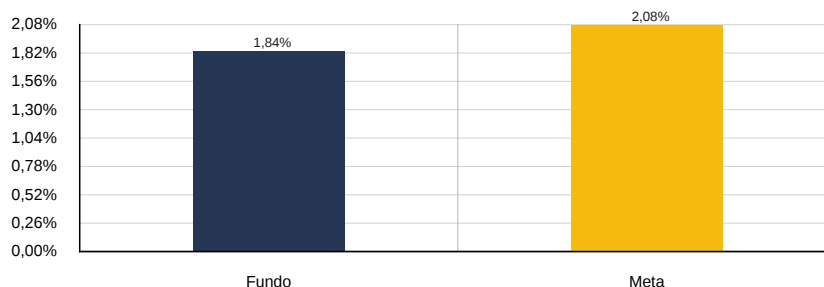
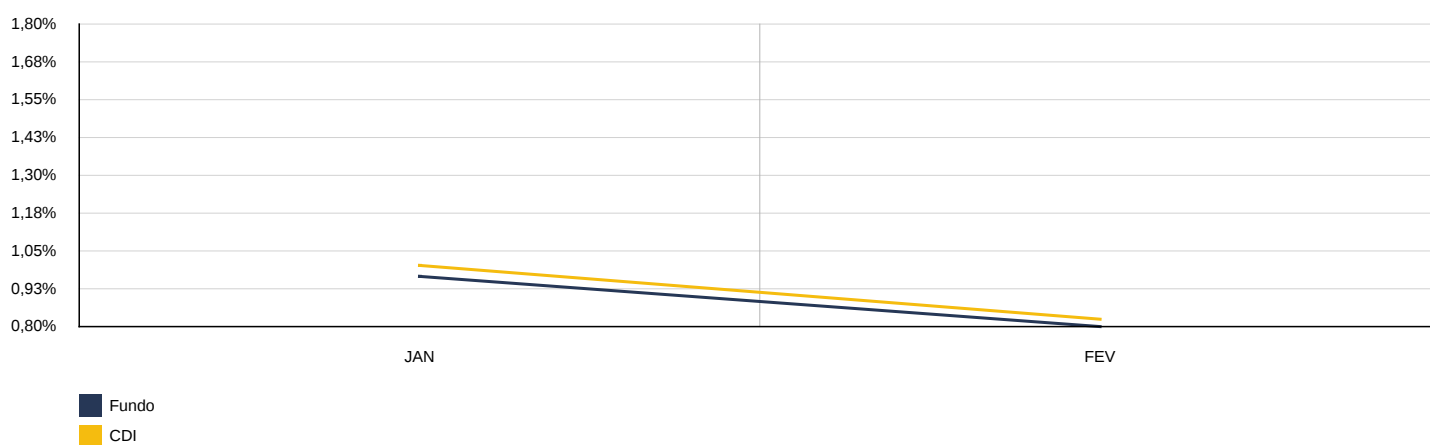
2024	BB RF CP AUTOMÁTICO					CNPJ: 42.592.315/0001-15	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	468.239,65	34.175,59	11.377,28	494.562,88	3.524,92	0,70%	0,83%
Fevereiro	494.562,88	32.759,79	24.069,38	506.192,25	2.938,96	0,56%	1,24%
Acumulado no Ano					6.463,88	1,26%	2,08%

BB RF CP AUTOMÁTICO



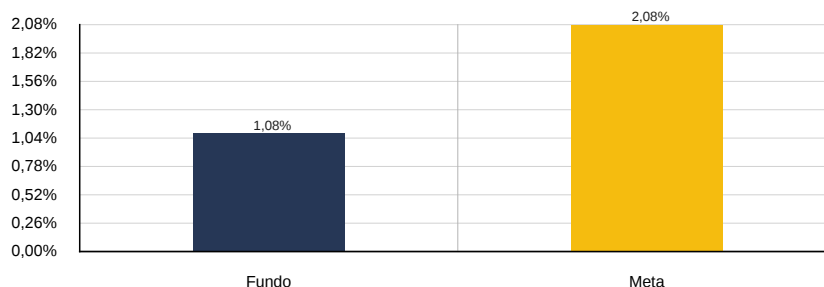
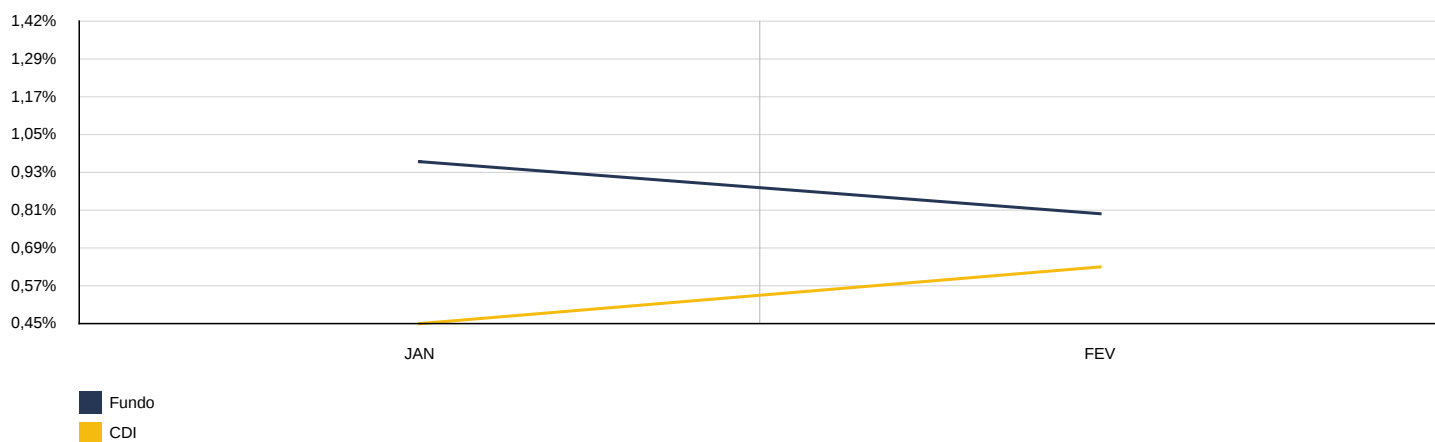
2024	CAIXA BRASIL FI RF DI LP					CNPJ: 03.737.206/0001-97	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	928.527,60	0,00	0,00	937.841,73	9.314,13	1,00%	0,83%
Fevereiro	937.841,73	0,00	0,00	945.576,33	7.734,60	0,82%	1,24%
Acumulado no Ano					17.048,73	1,84%	2,08%

CAIXA BRASIL FI RF DI LP



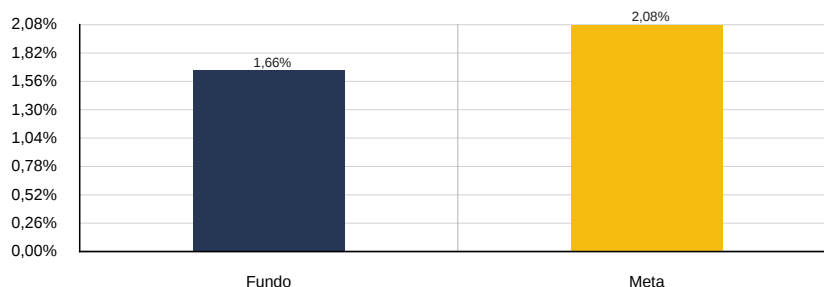
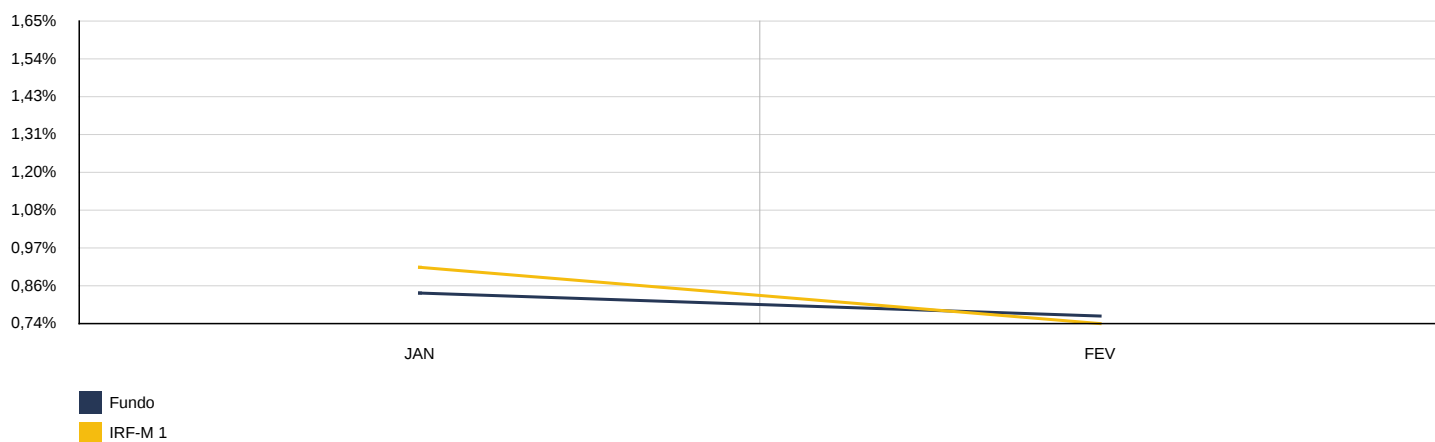
2024	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP					CNPJ: 11.061.217/0001-28	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.692.408,42	0,00	0,00	1.700.008,53	7.600,11	0,45%	0,83%
Fevereiro	1.700.008,53	0,00	0,00	1.710.721,48	10.712,95	0,63%	1,24%
Acumulado no Ano					18.313,06	1,08%	2,08%

CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP



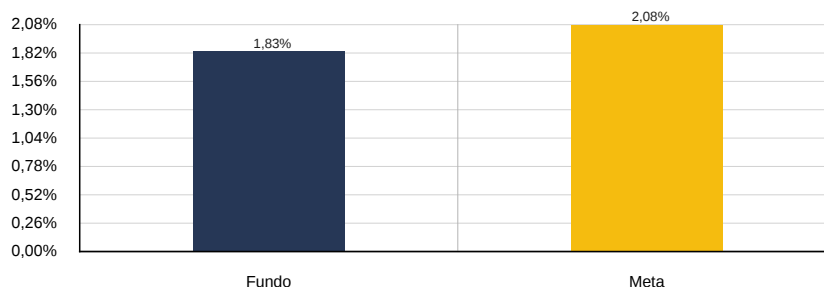
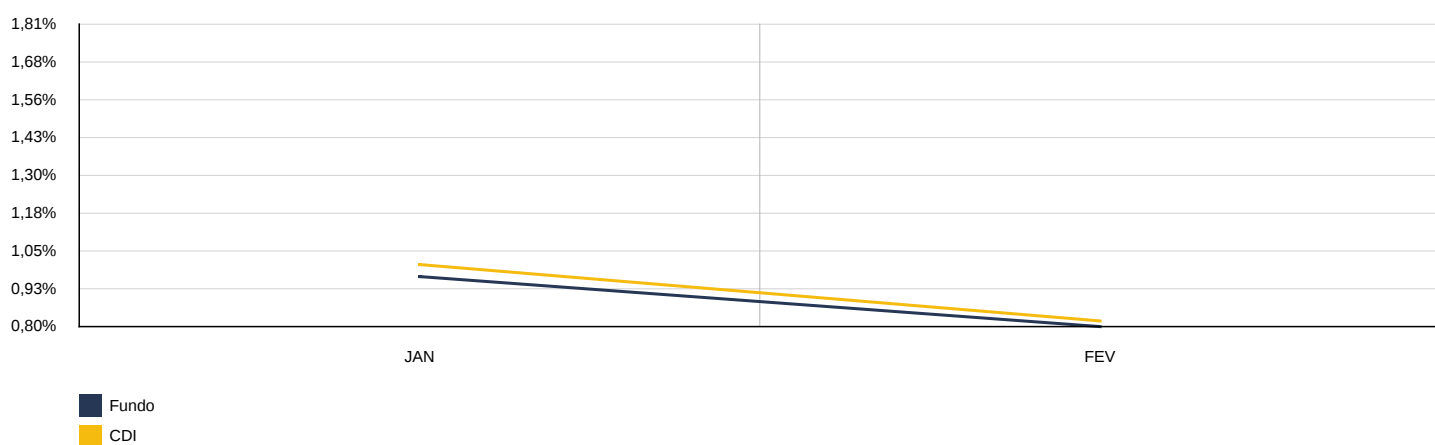
2024	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF					CNPJ: 10.740.670/0001-06	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	4.088.231,67	0,00	0,00	4.125.511,49	37.279,82	0,91%	0,83%
Fevereiro	4.125.511,49	0,00	0,00	4.156.131,28	30.619,79	0,74%	1,24%
Acumulado no Ano					67.899,61	1,66%	2,08%

CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF



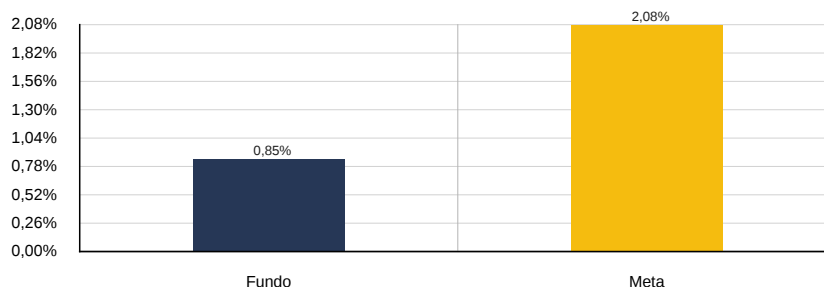
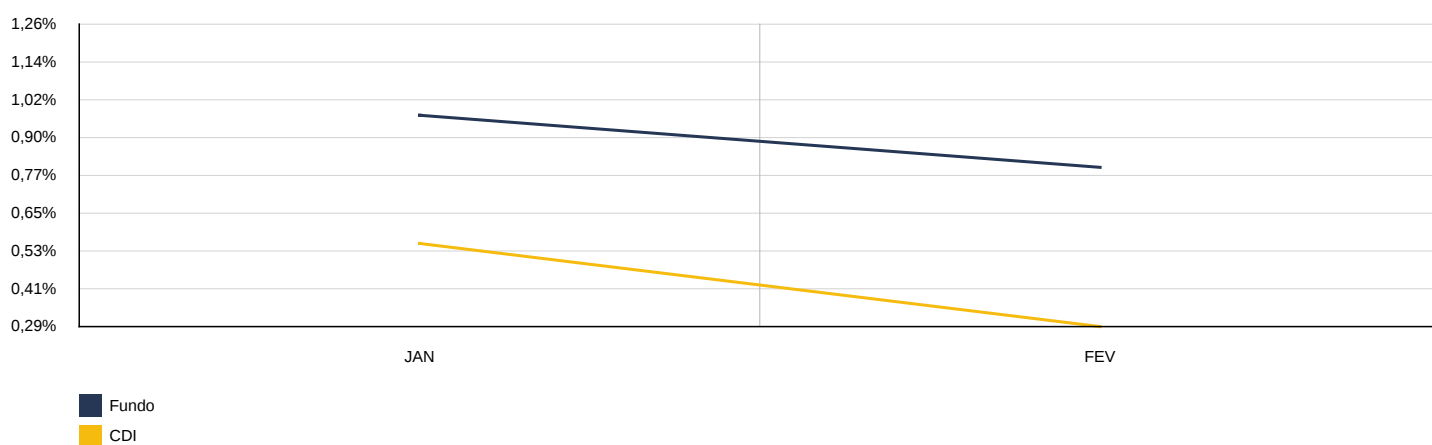
2024	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF					CNPJ: 23.215.008/0001-70	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	2.427.992,66	0,00	0,00	2.452.436,02	24.443,36	1,01%	0,83%
Fevereiro	2.452.436,02	0,00	0,00	2.472.521,55	20.085,53	0,82%	1,24%
Acumulado no Ano					44.528,89	1,83%	2,08%

CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF



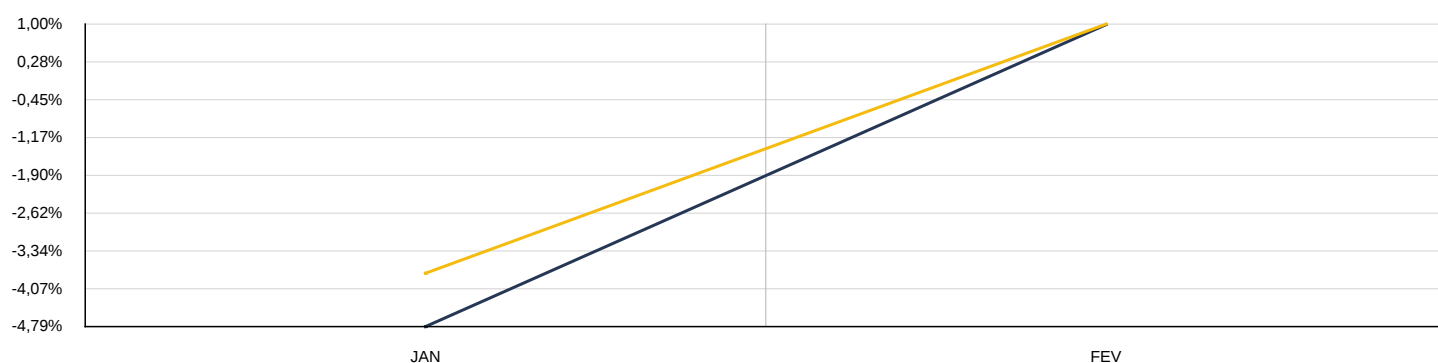
2024	CAIXA PRÁTICO FIC RF CP					CNPJ: 00.834.074/0001-23	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	5.470,80	1.955,61	0,00	7.467,78	41,37	0,56%	0,83%
Fevereiro	7.467,78	7.078,05	2.235,66	12.352,54	42,37	0,29%	1,24%
Acumulado no Ano					83,74	0,85%	2,08%

CAIXA PRÁTICO FIC RF CP

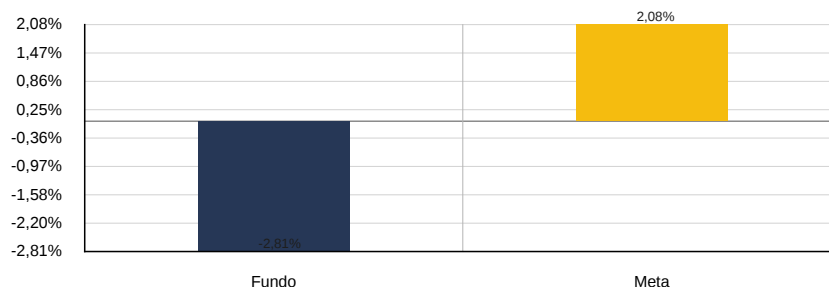


2024	ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI					CNPJ: 02.887.290/0001-62	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	747.762,37	0,00	0,00	719.559,16	-28.203,21	-3,77%	0,83%
Fevereiro	719.559,16	0,00	0,00	726.775,90	7.216,74	1,00%	1,24%
Acumulado no Ano					-20.986,47	-2,81%	2,08%

ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI

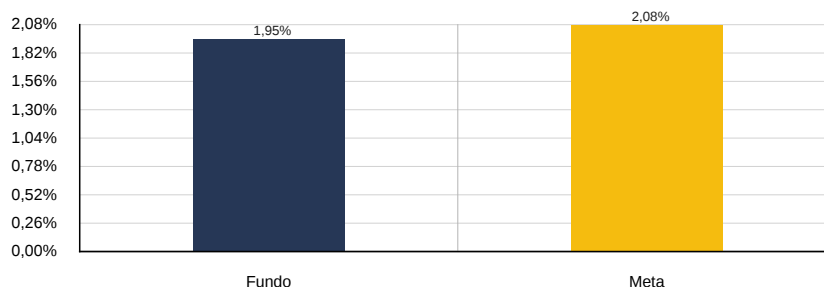
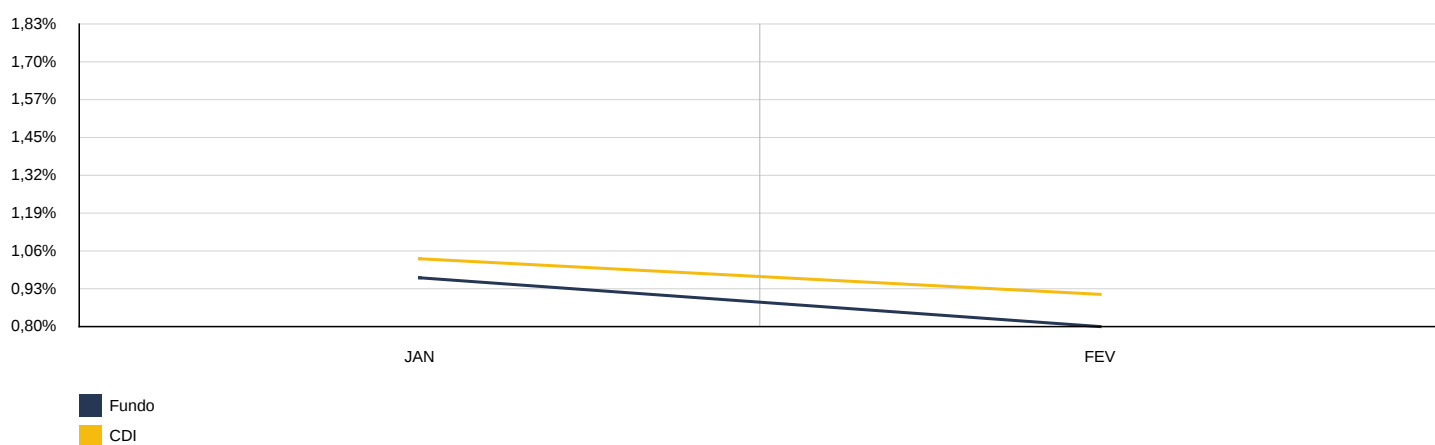


■ Fundo
■ Bovespa



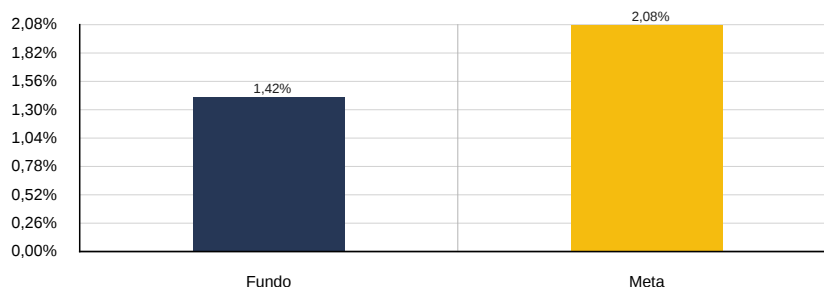
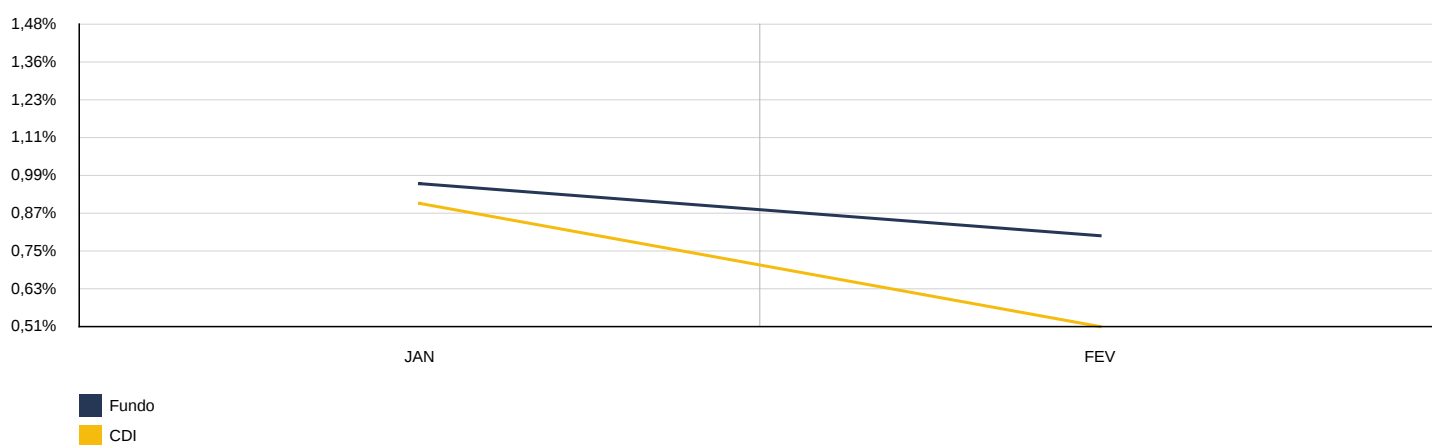
2024	ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI					CNPJ: 09.093.883/0001-04	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.204.739,42	0,00	0,00	1.217.167,08	12.427,66	1,03%	0,83%
Fevereiro	1.217.167,08	0,00	0,00	1.228.245,60	11.078,52	0,91%	1,24%
Acumulado no Ano					23.506,18	1,95%	2,08%

ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI



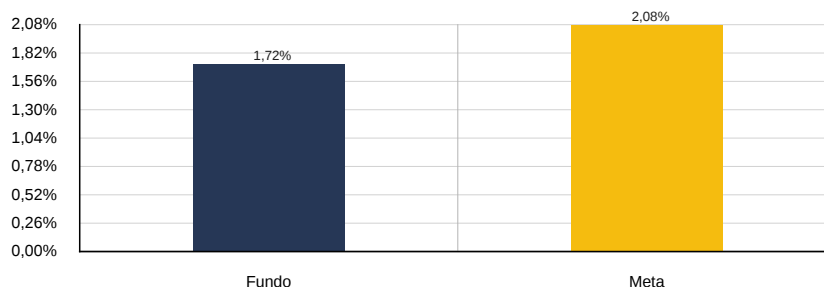
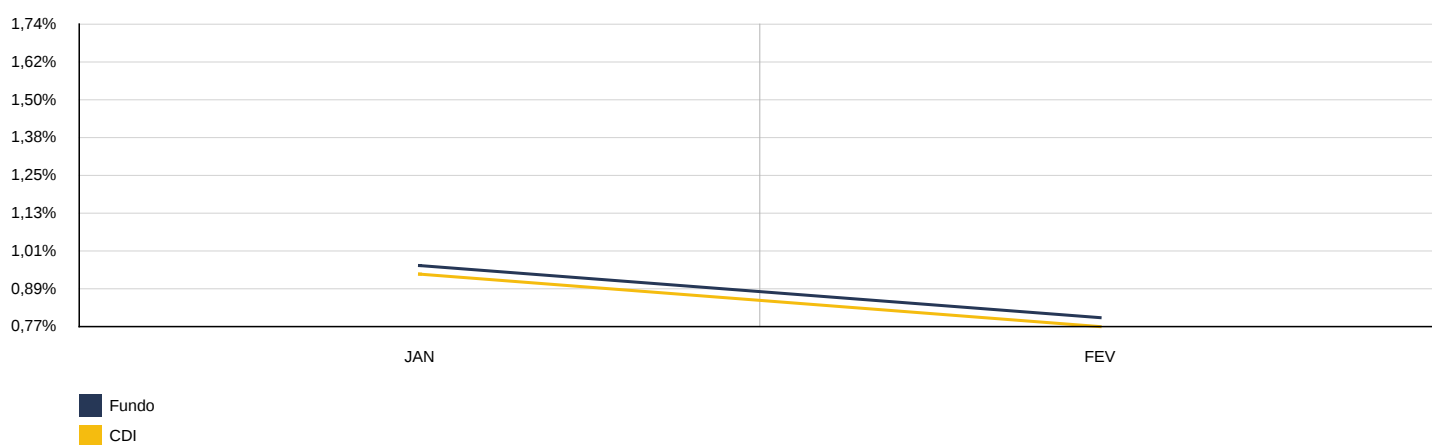
2024	ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC					CNPJ: 32.972.942/0001-28	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	2.385.696,02	0,00	0,00	2.407.254,13	21.558,11	0,90%	0,83%
Fevereiro	2.407.254,13	0,00	0,00	2.419.526,76	12.272,63	0,51%	1,24%
Acumulado no Ano					33.830,74	1,42%	2,08%

ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC

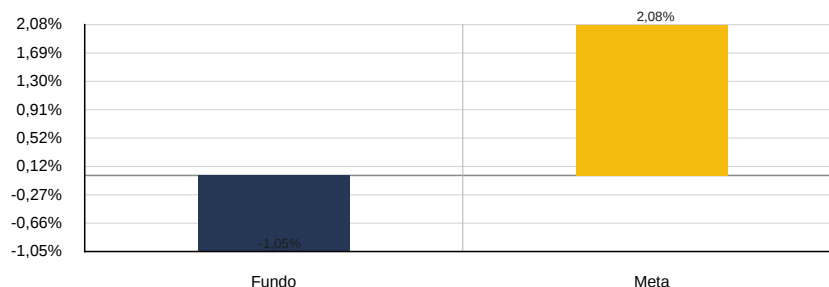
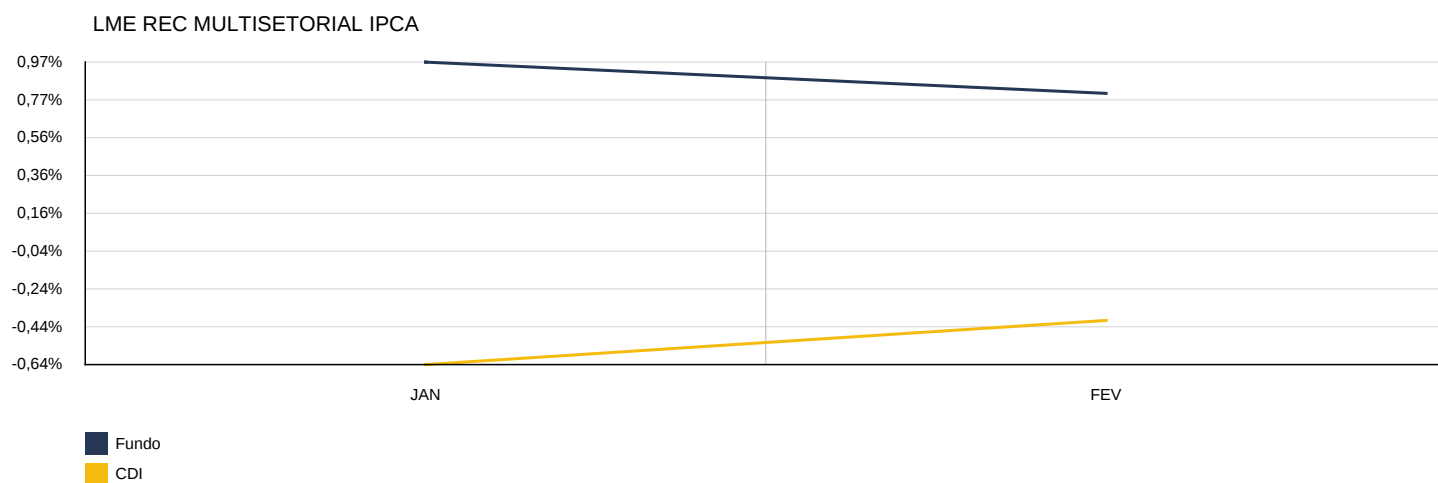


2024	ITAÚ MM JUROS E MOEDAS					CNPJ: 00.973.117/0001-51	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	2.065.181,31	0,00	0,00	2.084.580,36	19.399,05	0,94%	0,83%
Fevereiro	2.084.580,36	0,00	0,00	2.100.664,03	16.083,67	0,77%	1,24%
Acumulado no Ano					35.482,72	1,72%	2,08%

ITAÚ MM JUROS E MOEDAS

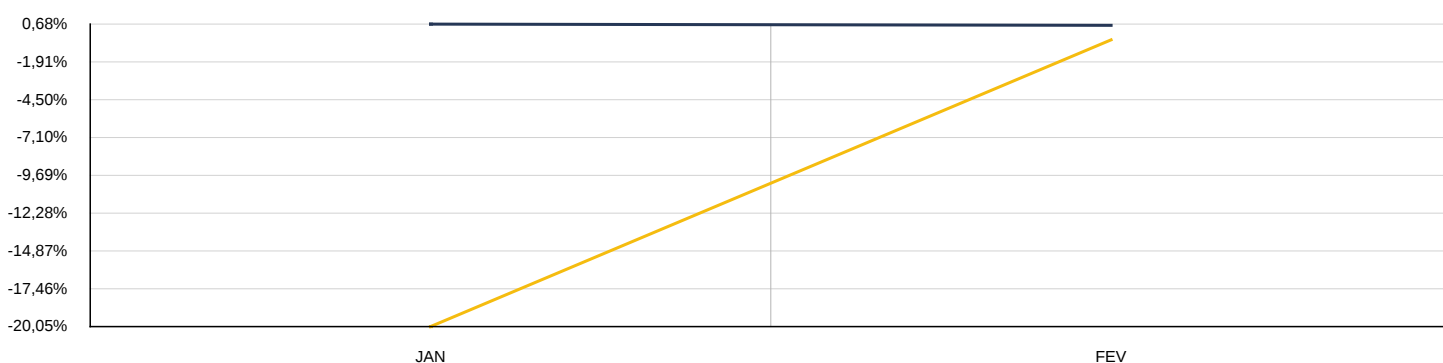


2024	LME REC MULTISSETORIAL IPCA					CNPJ: 12.440.789/0001-80	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	130.892,73	0,00	0,00	130.050,42	-842,31	-0,64%	0,83%
Fevereiro	130.050,42	0,00	0,00	129.519,31	-531,11	-0,41%	1,24%
Acumulado no Ano					-1.373,42	-1,05%	2,08%

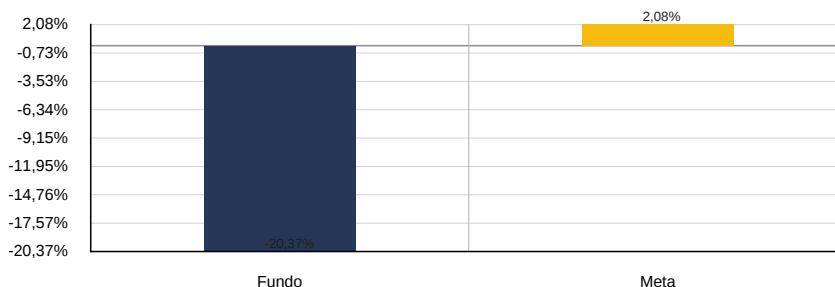


2024	TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RF					CNPJ: 12.845.801/0001-37	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	96.409,31	0,00	0,00	77.077,57	-19.331,74	-20,05%	0,83%
Fevereiro	77.077,57	0,00	0,00	76.768,68	-308,89	-0,40%	1,24%
Acumulado no Ano					-19.640,63	-20,37%	2,08%

TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RF

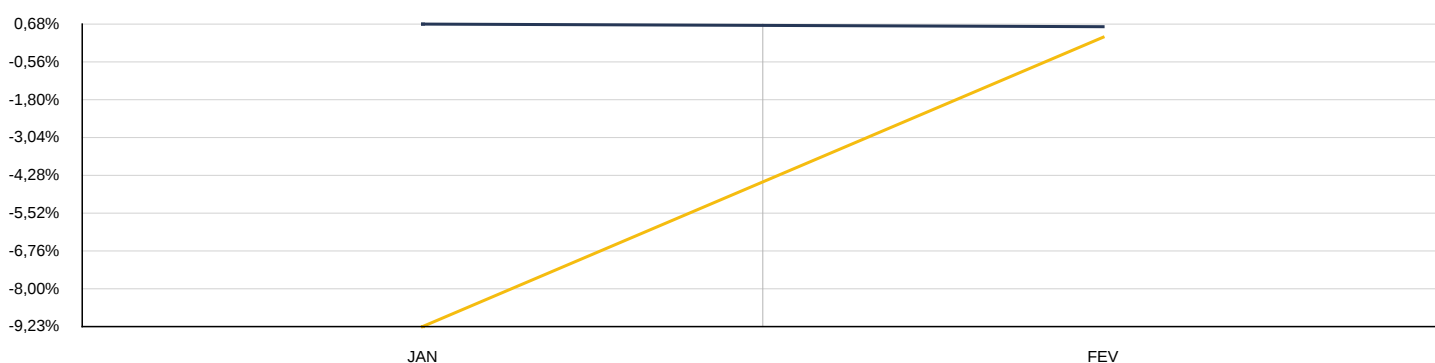


Fundo
IMA-B 5

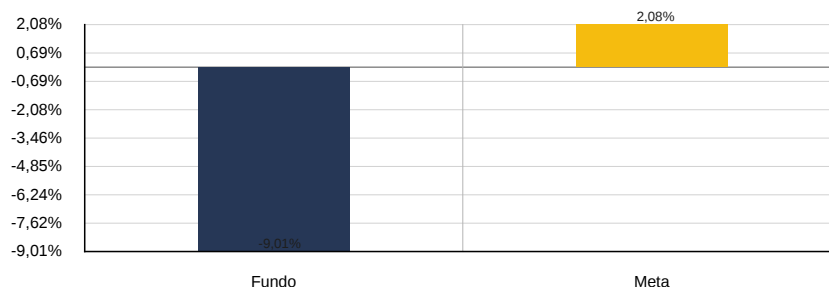


2024	TOWER II RF FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5					CNPJ: 23.954.899/0001-87	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	115.443,98	0,00	0,00	104.783,41	-10.660,57	-9,23%	0,83%
Fevereiro	104.783,41	0,00	0,00	105.043,55	260,14	0,25%	1,24%
Acumulado no Ano					-10.400,43	-9,01%	2,08%

TOWER II RF FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5



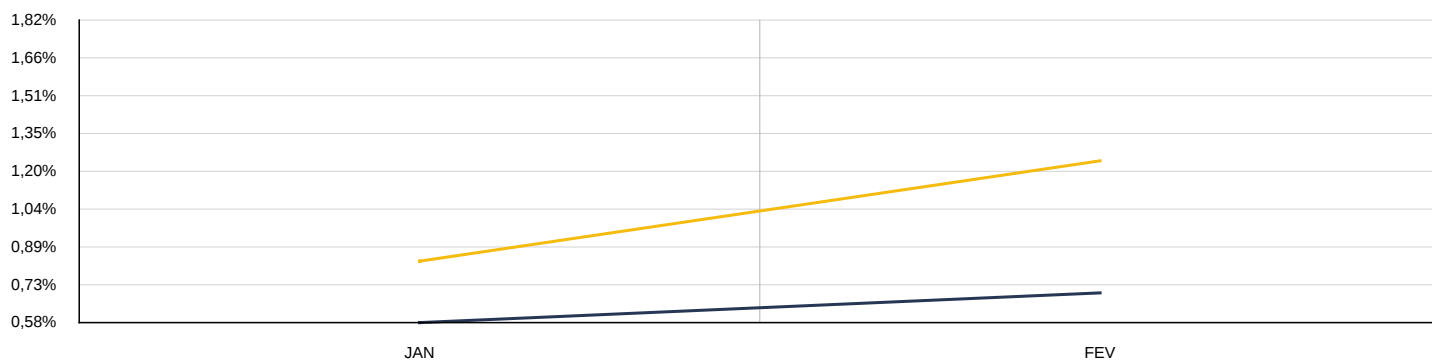
■ Fundo
■ IMA-B 5



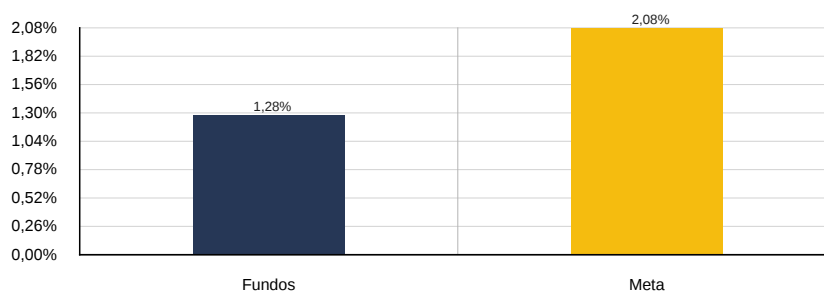
4. CONSOLIDADO

Como pode ser observado pela tabela abaixo a rentabilidade no acumulado do ano ficou em 1,28% enquanto que a meta atuarial acumulada foi de 2,08%, ou seja, o Instituto atingiu 61,54% da meta atuarial.

MÊS	ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META	GAP
Janeiro	31.018.887,11	39.476,25	204.943,25	31.031.499,34	178.079,23	0,58%	0,83%	69,61%
Fevereiro	31.031.499,34	374.462,84	235.532,75	31.388.315,63	217.886,20	0,70%	1,24%	56,34%
Acumulado no Ano					395.965,43	1,28%	2,08%	61,54%
Disponibilidade Financeira					R\$ 437,47			
Patrimônio Líquido					R\$ 31.388.753,10			

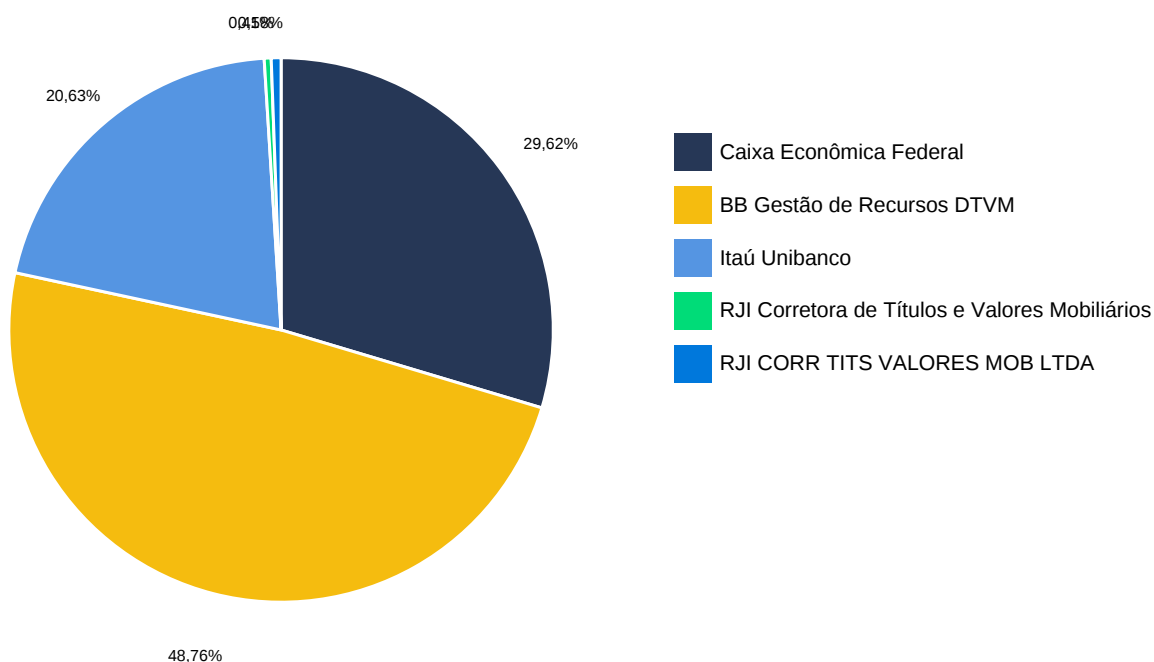


Retorno
Meta



5. CONSOLIDADO POR GESTOR

GESTÃO	VALOR	% S/ CARTEIRA	% S/ PL GESTÃO
Caixa Econômica Federal	9.297.303,18	29,62%	0,02%
BB Gestão de Recursos DTVM	15.304.468,62	48,76%	0,01%
Itaú Unibanco	6.475.212,29	20,63%	0,06%
RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários	129.519,31	0,41%	0,18%
RJI CORR TITS VALORES MOB LTDA	181.812,23	0,58%	0,22%
Total da Carteira	31.388.315,63	100,00%	



6. RETORNO POR SEGMENTO

SEGMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
Renda Fixa	28.227.359,82	374.462,84	235.532,75	28.560.875,70	194.585,79	0,69%
Renda Variável	719.559,16	0,00	0,00	726.775,90	7.216,74	1,00%
Estruturado	2.084.580,36	0,00	0,00	2.100.664,03	16.083,67	0,77%

ATIVOS RENDA FIXA	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1.157.246,54	334.625,00	209.227,71	1.291.590,92	8.947,09	0,60%
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	831.098,29	0,00	0,00	835.161,48	4.063,19	0,49%
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.128.049,94	0,00	0,00	1.135.201,58	7.151,64	0,63%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	3.901.319,45	0,00	0,00	3.930.223,68	28.904,23	0,74%
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.314.903,06	0,00	0,00	1.320.660,71	5.757,65	0,44%
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	5.189.666,20	0,00	0,00	5.231.345,41	41.679,21	0,80%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	1.050.915,30	0,00	0,00	1.054.092,59	3.177,29	0,30%
BB RF CP AUTOMÁTICO	494.562,88	32.759,79	24.069,38	506.192,25	2.938,96	0,56%
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	937.841,73	0,00	0,00	945.576,33	7.734,60	0,82%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	1.700.008,53	0,00	0,00	1.710.721,48	10.712,95	0,63%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	4.125.511,49	0,00	0,00	4.156.131,28	30.619,79	0,74%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	2.452.436,02	0,00	0,00	2.472.521,55	20.085,53	0,82%
CAIXA PRÁTICO FIC RF CP	7.467,78	7.078,05	2.235,66	12.352,54	42,37	0,29%

ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	1.217.167,08	0,00	0,00	1.228.245,60	11.078,52	0,91%
ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	2.407.254,13	0,00	0,00	2.419.526,76	12.272,63	0,51%
LME REC MULTISSETORIAL IPCA	130.050,42	0,00	0,00	129.519,31	-531,11	-0,41%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RF	77.077,57	0,00	0,00	76.768,68	-308,89	-0,40%
TOWER II RF FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	104.783,41	0,00	0,00	105.043,55	260,14	0,25%

ATIVOS RENDA VARIÁVEL	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	719.559,16	0,00	0,00	726.775,90	7.216,74	1,00%

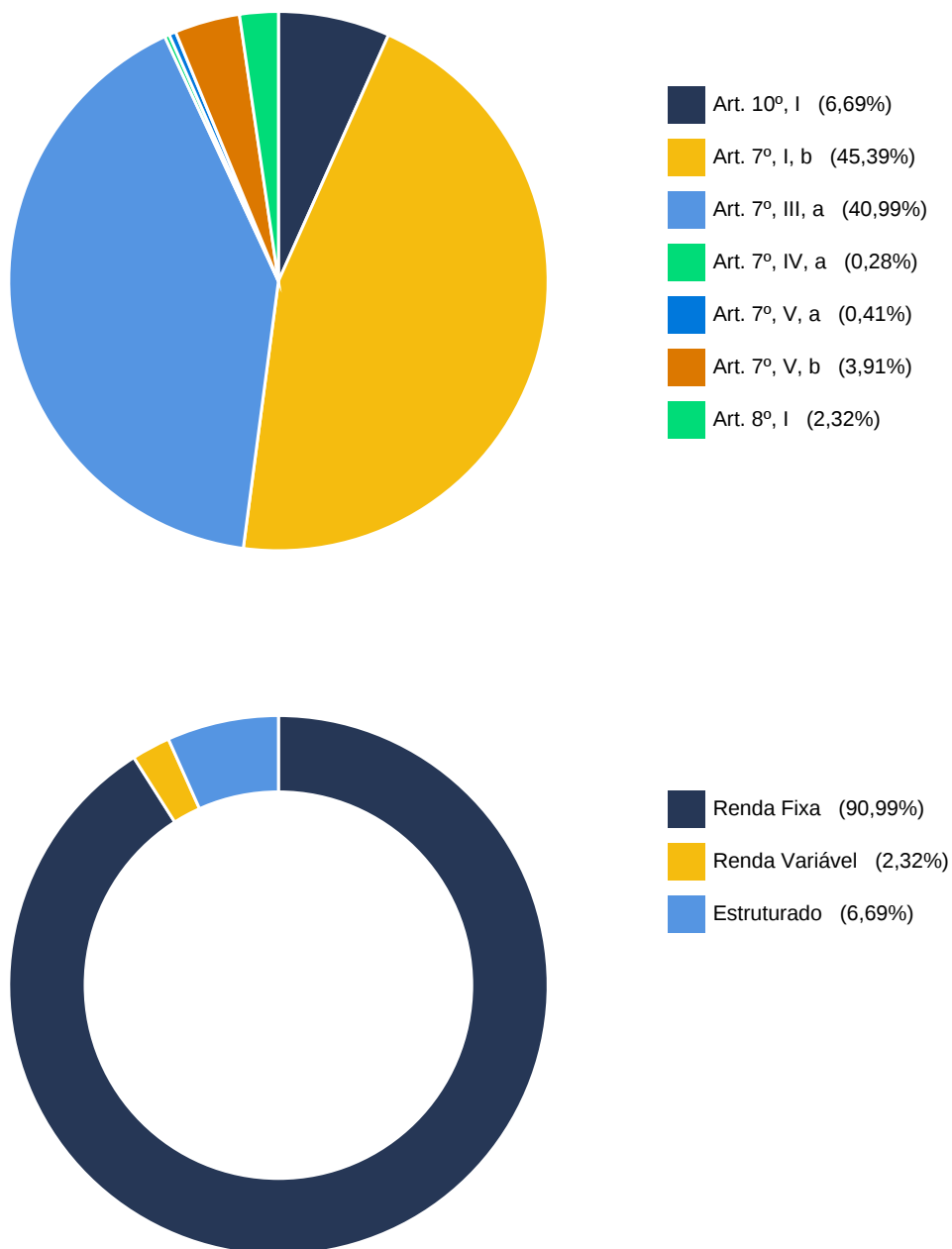
ATIVOS ESTRUTURADO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
ITAÚ MM JUROS E MOEDAS	2.084.580,36	0,00	0,00	2.100.664,03	16.083,67	0,77%

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"		0,00%	45,52%	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%	41,11%	60,00%
	FI de Índices Referenciado RF - Art. 7º, III, "b"		0,00%	0,00%	30,00%
	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%	0,41%	2,00%
	FI Renda Fixa "Credito Privado" - Art. 7º, V, "b"		0,00%	3,92%	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%	2,32%	10,00%
	ETF - Índices de ações - Art. 8º, II		0,00%	0,00%	2,00%
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%	6,71%	10,00%
	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			0,00%	100,00%	224,00%

8. ENQUADRAMENTO RESOLUÇÃO N. 4.963/2021



9. GERENCIAMENTO DE RISCO

Fundo	Sharpe	VAR	Modi M.	Sharpe M.
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,000	0,002%	0,12	0,00
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,021	0,015%	0,13	0,00
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,018	0,005%	0,13	0,00
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,000	0,002%	0,12	0,00
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,033	0,006%	0,13	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
BB RF CP AUTOMÁTICO	0,000	0,002%	0,09	0,00
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	0,041	0,002%	0,13	0,04
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	0,019	0,005%	0,13	0,02
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	0,000	0,002%	0,13	0,00
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	0,043	0,002%	0,13	0,04
CAIXA PRÁTICO FIC RF CP	0,000	0,002%	0,09	0,00
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 MM JUROS E MOEDAS	0,023	0,003%	0,13	0,02
LME REC MULTISSETORIAL IPCA	0,000	0,411%	0,00	0,00

TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RF	0,000	inf%	0,12	0,00
TOWER II RF FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,000	inf%	0,12	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%	5,15%	2,08%	9,72%

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

