

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2026

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

Total para cálculo dos limites da Resolução: R\$ 38.153.965,81

Disponibilidades Financeiras: R\$ 0,00

PL Total: R\$ 38.153.965,81

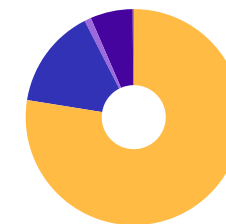
Fundo	Resgate Carência	Saldo	Particip. S/ PL	Cotistas	% PL Fundo	Lei
13.322.205/0001-35 BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1 Não há	908.139,23	2,38%	642	0,02%	7º I b
13.327.340/0001-73 BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2 Não há	1.626.236,91	4,26%	168	0,21%	7º I b
07.442.078/0001-05 BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1 Não há	2.237.074,59	5,86%	400	0,09%	7º I b
07.111.384/0001-69 BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1 Não há	1.656.852,88	4,34%	469	0,06%	7º I b
46.134.096/0001-81 BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 15/05/2027	1.122.101,59	2,94%	222	0,08%	7º I b
45.443.514/0001-50 CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0 16/05/2027	1.555.451,16	4,08%	87	0,31%	7º I b
56.134.800/0001-50 CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0 17/08/2026	3.738.719,19	9,80%	302	0,11%	7º I b
56.208.863/0001-03 CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0 17/05/2027	44.602,37	0,12%	97	0,01%	7º I b
23.215.097/0001-55 CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	D+0 Não há	941.743,80	2,47%	499	0,03%	7º I b
14.386.926/0001-71 CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	D+0 Não há	1.826.065,26	4,79%	618	0,07%	7º I b
11.060.913/0001-10 CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	D+0 Não há	1.368.923,08	3,59%	694	0,03%	7º I b
10.577.503/0001-88 CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	D+0 Não há	3.174.801,11	8,32%	177	0,35%	7º I b

Fundo	Resgate Carência	Saldo	Particip. S/ PL	Cotistas	% PL Fundo	Lei
10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	D+0 Não há	1.731.979,34	4,54%	464	0,07%	7º I b
10.740.670/0001-06 CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0 Não há	446.897,22	1,17%	1.123	0,00%	7º I b
10.577.519/0001-90 CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	D+0 Não há	818.488,96	2,15%	179	0,12%	7º I b
35.292.588/0001-89 BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3 Não há	1.191.754,72	3,12%	471	0,03%	7º III a
13.077.415/0001-05 BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0 Não há	395.863,38	1,04%	1.074	0,01%	7º III a
28.515.874/0001-09 BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	D+4 Não há	1.021.283,87	2,68%	81	0,29%	7º III a
14.508.643/0001-55 CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0 Não há	202.595,30	0,53%	381	0,01%	7º III a
03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0 Não há	2.846.438,15	7,46%	1.299	0,01%	7º III a
10.646.895/0001-90 CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	D+0 Não há	724.983,47	1,90%	149	0,12%	7º III a
06.018.364/0001-85 PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ... Não se aplica	60,43	0,00%	98	0,13%	7º V a
18.270.783/0001-99 BB ALOCAÇÃO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4 Não há	1.129.610,73	2,96%	320	0,85%	8º I
14.213.331/0001-14 BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4 Não há	467.044,94	1,22%	1.699	0,05%	8º I
00.822.059/0001-65 BB IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+4 Não há	413.158,46	1,08%	19.845	0,06%	8º I

Fundo	Resgate Carência	Saldo	Particip. S/ PL	Cotistas	% PL Fundo	Lei
07.882.792/0001-14 BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3 Não há	491.929,04	1,29%	13.233	0,09%	8º I
29.258.294/0001-38 BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+33 Não há	680.630,71	1,78%	871	0,11%	8º I
30.068.224/0001-04 CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+25 Não há	408.303,77	1,07%	634	0,12%	8º I
03.737.217/0001-77 CAIXA BRASIL IBX-50 RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4 Não há	876.953,96	2,30%	61	0,41%	8º I
10.551.375/0001-01 CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4 Não há	233.724,97	0,61%	4.216	0,16%	8º I
10.551.382/0001-03 CAIXA INFRAESTRUTURA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4 Não há	310.190,30	0,81%	1.384	0,23%	8º I
15.154.220/0001-47 CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4 Não há	695.323,62	1,82%	3.223	0,13%	8º I
17.502.937/0001-68 CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 Não há	384.742,50	1,01%	365	0,02%	9º III
10.418.362/0001-50 BB RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4 Não há	587.843,84	1,54%	116	0,23%	10º I
08.070.841/0001-87 CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	D+4 Não há	1.825.242,96	4,78%	2.609	0,21%	10º I
17.098.794/0001-70 CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ... Não se aplica	68.210,00	0,18%		0,00%	11º

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2026) - Resolução CMN nº 4.963, 25/11/2021

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2026			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	40,00%	15.261.586,32
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	23.198.076,69	60,80%	0,00%	50,00%	90,00%	11.140.492,54
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.907.698,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	6.382.918,89	16,73%	0,00%	15,00%	40,00%	8.878.667,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.907.698,29
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,90%	20,00%	7.630.793,16
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	60,43	0,00%	0,00%	0,10%	5,00%	1.907.637,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	1.907.698,29
Total Renda Fixa	100,00%	29.581.056,01	77,53%	0,00%	75,00%	210,00%	



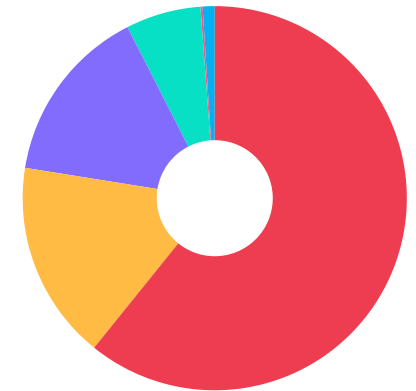
RENDA FIXA	29.581.056,01
RENDA VARIÁVEL	5.706.870,50
EXTERIOR	384.742,50
ESTRUTURADOS	2.413.086,80
FUNDO IMOBILIÁRIO	68.210,00

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!



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2026) - Resolução CMN nº 4.963, 25/11/2021

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2026			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	5.706.870,50	14,96%	0,00%	15,00%	35,00%	7.647.017,53
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.815.396,58
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.413.086,80	6,32%	0,00%	4,50%	10,00%	1.402.309,78
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.907.698,29
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.907.698,29
Artigo 11º	5,00%	68.210,00	0,18%	0,00%	0,00%	5,00%	1.839.488,29
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	8.188.167,30	21,46%	0,00%	19,50%	70,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º III a
 ■ 7º V a
 ■ 8º I
■ 10º I
 ■ 11º
 ■ 9º III

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2026			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.815.396,58
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.815.396,58
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	384.742,50	1,01%	0,00%	3,00%	10,00%	3.430.654,08
Total Exterior	10,00%	384.742,50	1,01%	0,00%	3,00%	30,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2026			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	3.815.396,58

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2026		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	23.198.076,69	60,80	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	6.382.918,89	16,73	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	60,43	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	5.706.870,50	14,96	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
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	384.742,50	1,01	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.413.086,80	6,32	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	68.210,00	0,18	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2026)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	24.224.380,49	63,49	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.908.241,02	33,83	-
BANCO BRADESCO	1.021.283,87	2,68	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	60,43	0,00	-

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

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2026 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,74%	0,74%	2,08%	3,81%	9,66%	20,40%	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	1,07%	1,07%	0,08%	3,02%	4,34%	-	0,31%	4,31%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	1,16%	1,16%	2,93%	3,05%	4,44%	-	0,07%	4,25%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	1,06%	1,06%	0,03%	2,94%	4,17%	4,15%	0,31%	4,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	1,06%	1,06%	3,09%	6,09%	10,65%	17,25%	0,31%	1,50%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,22%	1,22%	3,34%	6,46%	11,10%	19,05%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	1,22%	1,22%	3,27%	6,24%	10,65%	18,16%	0,55%	1,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	1,17%	1,17%	3,21%	6,21%	10,64%	18,78%	0,54%	1,58%
IRF-M 1+ (Benchmark)	2,28%	2,28%	4,20%	9,06%	18,77%	19,88%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	2,25%	2,25%	4,12%	8,93%	18,52%	19,27%	1,47%	4,15%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,84%	0,84%	3,46%	5,58%	14,66%	6,79%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	0,82%	0,82%	3,39%	5,48%	14,46%	6,44%	2,40%	5,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	0,83%	0,83%	3,42%	5,51%	14,47%	6,54%	2,36%	5,91%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,20%	1,20%	3,47%	7,38%	14,68%	26,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	1,19%	1,19%	3,43%	7,26%	14,44%	25,54%	0,10%	0,27%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2026 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	1,20%	1,20%	3,26%	6,25%	10,91%	19,15%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	1,19%	1,19%	3,21%	6,14%	10,70%	18,65%	0,54%	1,66%

IMA-B (Benchmark)	1,00%	1,00%	3,38%	5,90%	13,09%	12,01%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	1,03%	1,03%	3,32%	5,72%	13,02%	12,00%	1,42%	3,66%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,98%	0,98%	3,33%	5,80%	12,87%	11,46%	1,53%	3,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,98%	0,98%	3,30%	5,78%	12,89%	11,52%	1,53%	3,94%

IRF-M (Benchmark)	1,96%	1,96%	3,98%	8,50%	17,51%	21,96%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,94%	1,94%	3,92%	8,35%	17,21%	21,34%	1,06%	2,84%

CDI (Benchmark)	1,16%	1,16%	3,48%	7,31%	14,49%	26,99%	-	-
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,17%	1,17%	3,50%	7,31%	14,57%	27,30%	0,02%	0,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	1,09%	1,09%	3,22%	6,75%	13,30%	24,40%	0,00%	0,03%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,09%	1,09%	3,23%	6,78%	13,36%	24,52%	0,01%	0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	1,18%	1,18%	3,47%	7,06%	14,09%	23,80%	0,08%	0,26%

IPCA (Benchmark)	0,33%	0,33%	0,84%	1,31%	4,44%	9,20%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,97%	1,97%	3,83%	8,10%	14,45%	22,67%	0,99%	1,91%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,43%	1,43%	3,55%	7,08%	14,40%	18,74%	0,74%	1,74%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2026 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	0,32%	0,32%	-0,74%	-99,75%	-99,84%	-99,85%	0,01%	105,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2026 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,16%	1,16%	3,48%	7,31%	14,49%	26,99%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	1,45%	1,45%	3,63%	7,77%	14,55%	21,28%	0,40%	1,06%
BB RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2,37%	2,37%	4,65%	8,64%	14,24%	21,47%	1,85%	3,12%
Ibovespa (Benchmark)	12,56%	12,56%	21,28%	36,29%	43,79%	41,97%	-	-
BB ALOCAÇÃO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	10,38%	10,38%	16,47%	22,83%	14,28%	13,09%	7,62%	12,98%
CAIXA INFRAESTRUTURA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	10,67%	10,67%	15,77%	26,72%	39,28%	24,87%	9,15%	17,01%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL RESP LIMITADA FIF AÇÕES	11,52%	11,52%	16,50%	38,83%	66,83%	49,19%	13,10%	24,50%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,84%	8,84%	13,21%	25,03%	33,14%	20,19%	8,85%	16,37%
BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	12,37%	12,37%	19,88%	31,64%	34,01%	27,95%	8,88%	14,65%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,02%	8,02%	15,30%	26,08%	22,10%	15,20%	7,73%	14,74%
BB IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	13,16%	13,16%	23,72%	32,91%	38,30%	32,10%	9,33%	15,02%
IBX-50 (Benchmark)	13,15%	13,15%	22,00%	36,78%	42,61%	43,28%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 RESP LIMITADA FIF AÇÕES	11,76%	11,76%	18,87%	33,19%	39,08%	37,35%	8,93%	15,00%
IDIV (Benchmark)	10,56%	10,56%	18,13%	30,25%	38,85%	45,03%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	10,71%	10,71%	15,86%	24,52%	31,10%	25,92%	8,72%	17,82%
IFIX (Benchmark)	2,27%	2,27%	7,44%	12,36%	27,82%	15,82%	-	-

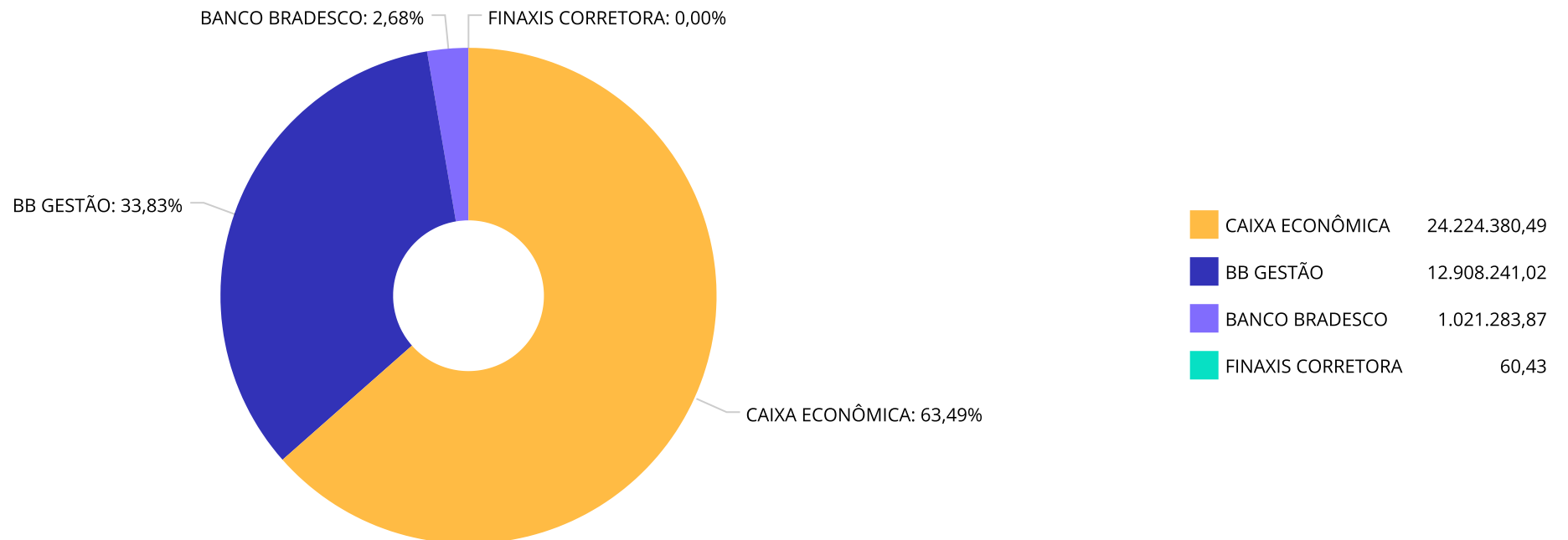
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2026 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-1,57%	-1,57%	1,91%	12,34%	1,81%	-19,09%	-	-
SMLL (Benchmark)	10,15%	10,15%	12,61%	21,61%	35,68%	15,49%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	10,12%	10,12%	11,70%	21,89%	33,97%	13,08%	9,97%	18,60%

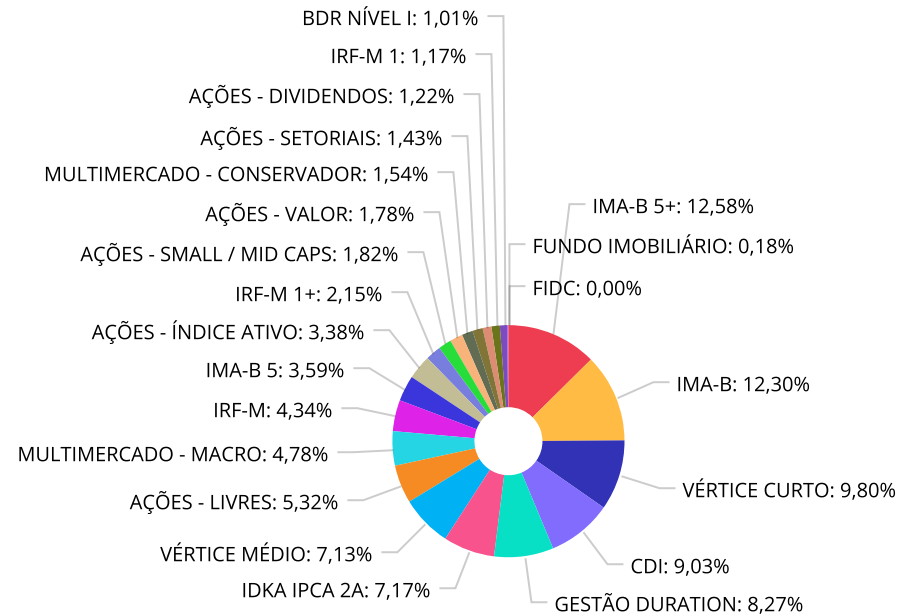
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2026 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,05%	-3,05%	-2,27%	6,93%	9,76%	71,14%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,21%	-3,21%	-2,47%	6,46%	8,74%	67,52%	5,12%	19,387%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2026)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2026)

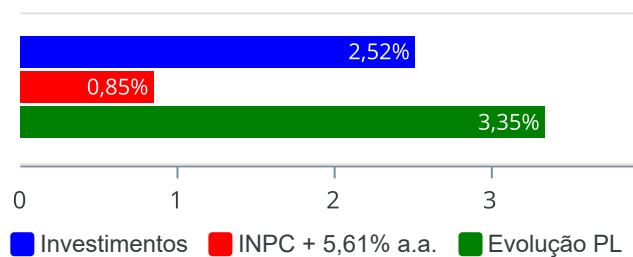


IMA-B 5+	4.801.038,02	IMA-B	4.694.037,40	VÉRTICE CURTO	3.738.719,19	CDI	3.444.896,83
GESTÃO DURATION	3.154.782,39	IDKA IPCA 2A	2.734.204,49	VÉRTICE MÉDIO	2.722.155,12	AÇÕES - LIVRES	2.029.843,54
MULTIMERCADO - MACRO	1.825.242,96	IRF-M	1.656.852,88	IMA-B 5	1.368.923,08	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.290.112,42
IRF-M 1+	818.488,96	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	695.323,62	AÇÕES - VALOR	680.630,71	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	587.843,84
AÇÕES - SETORIAIS	543.915,27	AÇÕES - DIVIDENDOS	467.044,94	IRF-M 1	446.897,22	BDR NÍVEL I	384.742,50
FUNDO IMOBILIÁRIO	68.210,00	FIDC	60,43				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2026

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	36.917.601,80	1.498.879,42	1.200.032,40	38.153.965,81	937.516,99	937.516,99	2,52%	2,52%	0,85%	0,85%	297,18%	2,13%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



- ☒ 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

ANO 36M

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2026

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	800.520,77	0,00	0,00	818.488,96	17.968,19	2,24%	2,24%	1,47%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	923.520,72	0,00	0,00	941.743,80	18.223,08	1,97%	1,97%	0,99%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.625.334,19	0,00	0,00	1.656.852,88	31.518,69	1,94%	1,94%	1,06%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	1.006.868,85	0,00	0,00	1.021.283,87	14.415,02	1,43%	1,43%	0,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	1.902.935,66	0,00	100.000,00	1.826.065,26	23.129,60	1,22%	1,22%	0,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	1.177.840,63	0,00	0,00	1.191.754,72	13.914,09	1,18%	1,18%	0,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	639.408,44	0,00	200.000,00	446.897,22	7.488,78	1,17%	1,19%	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	897.628,05	0,00	0,00	908.139,23	10.511,18	1,17%	1,17%	0,54%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	2.802.482,75	11.159,50	0,00	2.846.438,15	32.795,90	1,17%	1,17%	0,02%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP L...	3.695.986,99	0,00	0,00	3.738.719,19	42.732,20	1,16%	1,16%	0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	1.305.459,83	48.000,00	0,00	1.368.923,08	15.463,25	1,14%	1,18%	0,54%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP L...	44.130,46	0,00	0,00	44.602,37	471,91	1,07%	1,07%	0,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 RESP LIMITADA FIF...	1.110.359,78	0,00	0,00	1.122.101,59	11.741,81	1,06%	1,06%	0,31%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA F...	1.539.196,49	0,00	0,00	1.555.451,16	16.254,67	1,06%	1,06%	0,31%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC REND...	717.614,85	0,00	0,00	724.983,47	7.368,62	1,03%	1,03%	1,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	2.782.529,91	361.042,38	0,00	3.174.801,11	31.228,82	0,99%	0,83%	2,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	1.715.167,09	0,00	0,00	1.731.979,34	16.812,25	0,98%	0,98%	1,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	2.193.672,94	22.000,00	0,00	2.237.074,59	21.401,65	0,97%	0,98%	1,53%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	209.387,81	356.637,70	175.091,55	395.863,38	4.929,42	0,87%	1,09%	0,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	1.613.061,57	0,00	0,00	1.626.236,91	13.175,34	0,82%	0,82%	2,40%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2026

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	221.633,06	700.039,84	724.340,85	202.595,30	5.263,25	0,57%	1,09%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	60,24	0,00	0,00	60,43	0,19	0,32%	0,32%	0,01%
Total Renda Fixa	28.924.801,08	1.498.879,42	1.199.432,40	29.581.056,01	356.807,91	1,22%		0,90%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2026

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	365.117,76	0,00	0,00	413.158,46	48.040,70	13,16%	13,16%	9,33%
BB VALOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	605.703,45	0,00	0,00	680.630,71	74.927,26	12,37%	12,37%	8,88%
CAIXA BRASIL IBX-50 RESP LIMITADA FIF AÇÕES	784.659,42	0,00	0,00	876.953,96	92.294,54	11,76%	11,76%	8,93%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL RESP LIMITADA FIF AÇÕES	209.574,45	0,00	0,00	233.724,97	24.150,52	11,52%	11,52%	13,10%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	421.860,73	0,00	0,00	467.044,94	45.184,21	10,71%	10,71%	8,72%
CAIXA INFRAESTRUTURA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	280.276,83	0,00	0,00	310.190,30	29.913,47	10,67%	10,67%	9,15%
BB ALOCAÇÃO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	1.023.409,31	0,00	0,00	1.129.610,73	106.201,42	10,38%	10,38%	7,62%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	631.440,16	0,00	0,00	695.323,62	63.883,46	10,12%	10,12%	9,97%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃOE...	375.154,92	0,00	0,00	408.303,77	33.148,85	8,84%	8,84%	8,85%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	455.394,49	0,00	0,00	491.929,04	36.534,55	8,02%	8,02%	7,73%
BB RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO L...	574.260,69	0,00	0,00	587.843,84	13.583,15	2,37%	2,37%	1,85%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	1.799.152,32	0,00	0,00	1.825.242,96	26.090,64	1,45%	1,45%	0,40%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	69.300,00	0,00	600,00	68.210,00	-490,00	-0,71%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	397.496,19	0,00	0,00	384.742,50	-12.753,69	-3,21%	-3,21%	5,12%
Total Renda Variável	7.992.800,72	0,00	600,00	8.572.909,80	580.709,08	7,27%		6,40%

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 & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. 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.

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.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

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.

