



SUPSSP-FORTIM

 Janeiro a Março de 2024

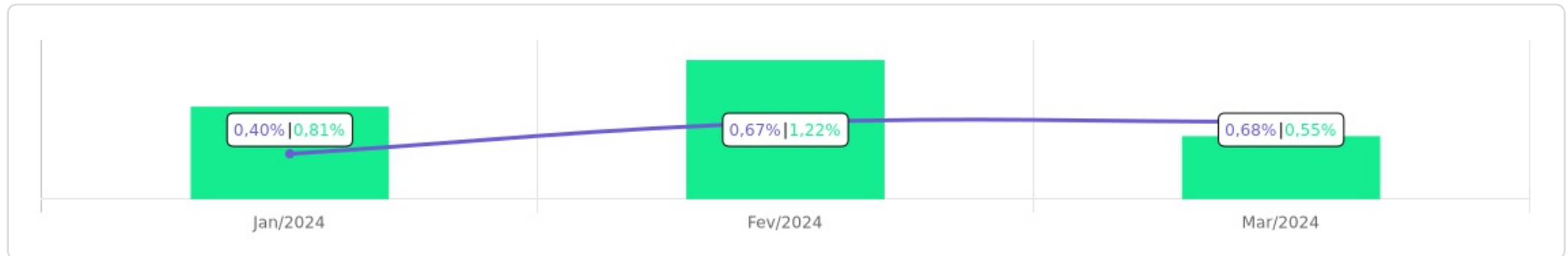


<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 27.947.712,90</p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,68%</td> <td>1,77%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,68%	1,77%	<p>Meta</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,55%</td> <td>2,62%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,55%	2,62%	<p>Gap</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,13p.p.</td> <td>-0,85p.p.</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,13p.p.	-0,85p.p.	<p>VaR_{1,252}</p> <p>0,23%</p>
Mês	Acum.															
0,68%	1,77%															
Mês	Acum.															
0,55%	2,62%															
Mês	Acum.															
0,13p.p.	-0,85p.p.															




Evolução do Patrimônio

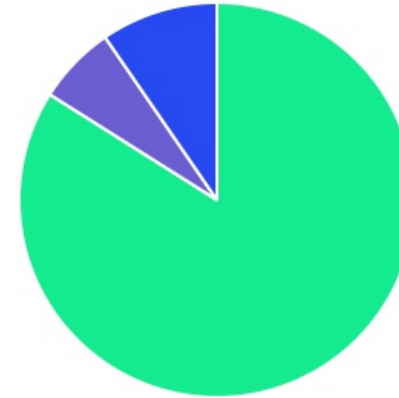






Comparativo (Rentabilidades | Metas)

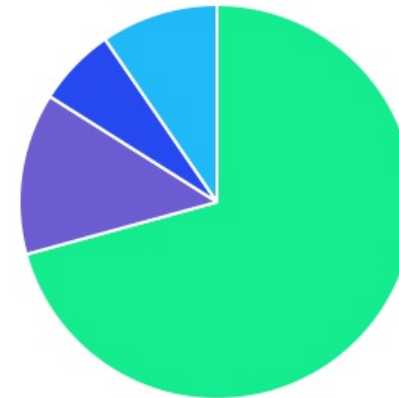


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 3.827.041,67	13,70%	D+0	7, I "b"	R\$ 92.194,36	2,47%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 4.958.797,41	17,75%	D+0	7, I "b"	R\$ 87.598,55	1,80%	0,40%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID LP	R\$ 2.999.090,24	10,74%	D+1	7, I "b"	R\$ 58.819,69	2,00%	0,20%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 287.652,37	1,03%	D+1	7, I "b"	R\$ 8.499,57	1,61%	0,20%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 443.034,21	1,59%	D+1	7, I "b"	R\$ 469,63	0,11%	0,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF...	R\$ 1.700.547,26	6,09%	D+3	7, I "b"	R\$ 39.991,52	2,41%	0,30%
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	R\$ 5.543.067,77	19,84%	D+1	7, I "b"	R\$ 111.166,01	2,05%	0,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 97.826,90	0,35%	D+0	7, III "a"	R\$ 3.722,46	0,84%	1,00%
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 252.053,71	0,90%	D+0	7, III "a"	R\$ 6.496,42	2,65%	0,20%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	R\$ 3.351.195,37	12,00%	D+0	7, III "a"	R\$ 88.754,78	2,72%	0,20%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	R\$ 800.496,05	2,87%	D+3	8, I	R\$ -33.191,85	-3,98%	1,50%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FI...	R\$ 1.002.033,28	3,59%	D+15	8, I	R\$ 8.423,17	0,85%	2,00%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 2.032.028,19	7,27%	D+3	10, I	R\$ 1.125,28	0,06%	1,00%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO...	R\$ 5.194,91	0,02%	D+1	10, I	R\$ 520,19	11,13%	0,80%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	R\$ 635.693,90	2,28%	D+0	10, I	R\$ 14.470,29	2,33%	0,70%
Total investimentos	R\$ 27.935.753,24	100.00%			R\$ 489.060,07	1,77%	
Disponibilidade	R\$ 11.959,66	-			-	-	
Total patrimônio	R\$ 27.947.712,90	100.00%			-	-	

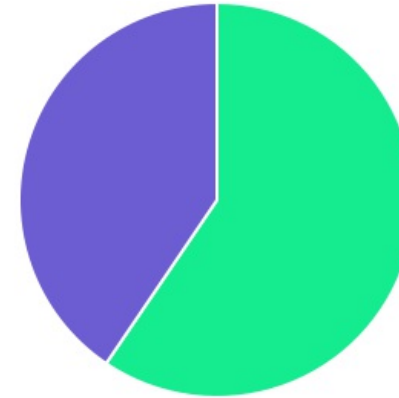
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	83,98%	R\$ 23.460.306,91	
Estruturados	9,57%	R\$ 2.672.917,00	
Renda Variável	6,45%	R\$ 1.802.529,33	
Total	100,00%	R\$ 27.935.753,24	



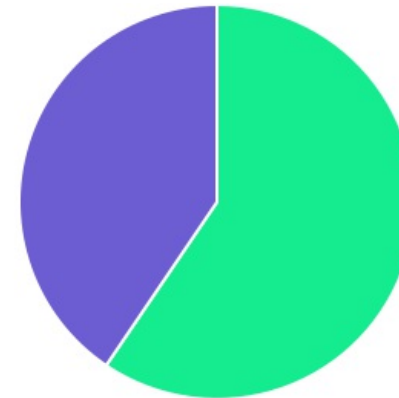
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	70,73%	R\$ 19.759.230,93	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	13,25%	R\$ 3.701.075,98	
Artigo 10, Inciso I	9,57%	R\$ 2.672.917,00	
Artigo 8º, Inciso I	6,45%	R\$ 1.802.529,33	
Total	100,00%	R\$ 27.935.753,24	














GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	59,47%	R\$ 16.612.480,78	■
BB GESTAO	40,53%	R\$ 11.323.272,46	■
Total	100,00%	R\$ 27.935.753,24	



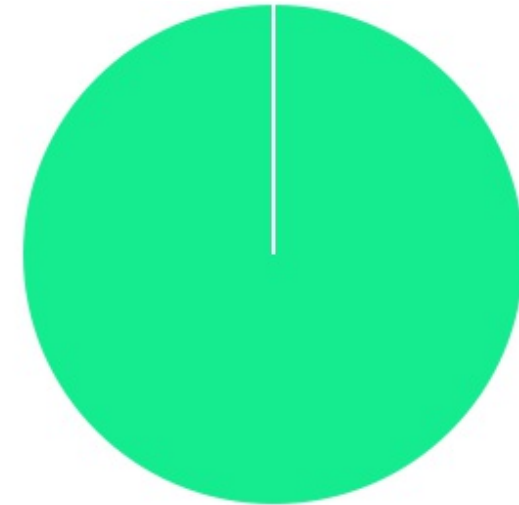
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	59,47%	R\$ 16.612.480,78	■
BB GESTAO	40,53%	R\$ 11.323.272,46	■
Total	100,00%	R\$ 27.935.753,24	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	23,84%	R\$ 6.659.344,67	
IDKA IPCA 2A	19,84%	R\$ 5.543.067,77	
IRF-M 1	13,70%	R\$ 3.827.041,67	
CDI	13,25%	R\$ 3.701.075,98	
IMA-B 5	10,74%	R\$ 2.999.090,24	
125% do CDI	9,55%	R\$ 2.667.722,09	
IBOVESPA	3,59%	R\$ 1.002.033,28	
IDIV	2,87%	R\$ 800.496,05	
IMA-B	1,59%	R\$ 443.034,21	
IRF-M	1,03%	R\$ 287.652,37	
S&P 500	0,02%	R\$ 5.194,91	
Total	100,00%	R\$ 27.935.753,24	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 27.935.753,24	■
Total	100,00%	R\$ 27.935.753,24	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	3,00%	15,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 19.759.230,93	70.73%	20,00%	60,00%	90,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 3.701.075,98	13.25%	5,00%	20,00%	50,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	10,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa		R\$ 23.460.306,91	83,98%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 1.802.529,33	6.45%	0,00%	5,00%	20,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável		R\$ 1.802.529,33	6,45%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Ações - BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 0,00	0,00%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 2.672.917,00	9,57%	0,00%	7,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Fundos Estruturados		R\$ 2.672.917,00	9,57%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 27.935.753,24	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2024			IPCA + 4.84% a.a.			
Janeiro	R\$ 27.804.409,06	R\$ 27.872.562,65	0,81%	R\$ 111.267,46	0,40%	-0,41p.p.
Fevereiro	R\$ 27.872.562,65	R\$ 27.922.083,21	1,22%	R\$ 188.121,47	0,67%	-0,55p.p.
Março	R\$ 27.922.083,21	R\$ 27.947.712,90	0,55%	R\$ 189.671,14	0,68%	0,13p.p.
Total	R\$ 27.922.083,21	R\$ 27.947.712,90	2,62%	R\$ 489.060,07	1,77%	-0,85p.p.

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE			
		Jan (%)	Fev (%)	Mar (%)	Trimestre (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP FI...	10.577.519/0001-90	-	-	-	-
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,14%	0,55%	0,15%	0,84%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	1,00%	0,82%	0,87%	2,72%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	0,97%	0,80%	0,85%	2,65%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	0,71%	0,44%	0,88%	2,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	0,66%	0,55%	0,58%	1,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	0,91%	0,74%	0,80%	2,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	-	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	0,66%	0,58%	0,75%	2,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	-	-	-	-
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	0,66%	0,44%	0,50%	1,61%
BB IMA-B TP FI RF	07.442.078/0001-05	-0,48%	0,53%	0,06%	0,11%
CAIXA JUROS E...	14.120.520/0001-42	0,93%	0,68%	0,70%	2,33%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	-3,54%	0,79%	-1,24%	-3,98%
CAIXA RV 30...	03.737.188/0001-43	-0,68%	0,49%	0,24%	0,06%
CAIXA BOLSA AMERICANA...	30.036.235/0001-02	1,69%	5,70%	3,39%	11,13%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	0,85%	0,77%	0,77%	2,41%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	30.068.169/0001-44	-2,73%	2,29%	1,36%	0,85%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U.		MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
				COMPRA	ATUAL				
Total Públicos							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Privados							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Global							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)