

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			58.897.865,89	7,40%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	27.583.866,65	3,46%	694	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	85.986.868,26	10,80%	884	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.424.059,01	1,56%	789	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	42.196.207,66	5,30%	649	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	166.609.066,50	20,92%	1.141	2,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.641.290,89	0,33%	788	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.988.305,80	0,50%	914	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.953.611,16	0,37%	1.190	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.717.482,80	0,47%	445	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ICATU VANGUARDA SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	3.166.544,38	0,40%	41	1,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	3.499.721,08	0,44%	216	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.967.589,65	0,25%	50.745	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.047.175,62	1,51%	989	0,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	146.359.490,62	18,38%	1.133	0,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.658.483,68	0,33%	149	0,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	15.075.174,58	1,89%	117	2,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	4.782.601,46	0,60%	362	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	16.816.826,23	2,11%	988	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.392.799,66	2,81%	437	0,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

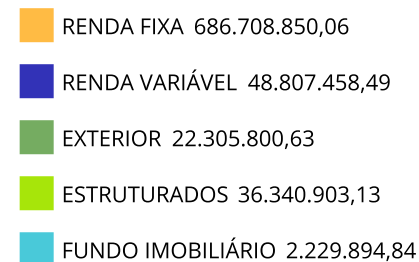
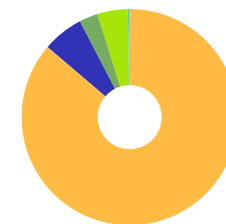
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	9.898.859,96	1,24%	224	0,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.021.314,71	0,63%	5.141	1,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	6.687.710,06	0,84%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	2.394,63	0,00%	35	0,21%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA...	D+31	Não há	16.260.074,31	2,04%	4.141	0,58%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	11.021.025,86	1,38%	105	4,94%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
XP BANCOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO ...	D+0	Não há	2.052.438,95	0,26%	793	0,10%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.675.183,22	0,34%	436	0,36%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	7.412.301,71	0,93%	2.162	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	6.809.566,23	0,86%	204	0,82%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	624.031,46	0,08%	82	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	2.810.035,41	0,35%	10.880	0,91%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	378.311,76	0,05%	1.667	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.980.913,11	0,25%	5.427	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.298.861,96	0,79%	2.173	0,88%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	18.571.758,51	2,33%	13.834	1,10%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.246.495,12	0,16%	65	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕ...	D+6 du	Não há	11.358.343,10	1,43%	7	6,90%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	10.507.961,25	1,32%	124	0,80%	Artigo 9º, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	439.496,28	0,06%	60.597	0,03%	Artigo 9º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	8.192.087,82	1,03%	2.510	1,56%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	4.940.950,12	0,62%	111	0,86%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	21.703.758,70	2,73%	6.530	1,33%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	1.504.106,49	0,19%	643	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	374.593,55	0,05%		0,00%	Artigo 11º
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.855.301,29	0,23%		1,31%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			796.392.907,15				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.182,22	Artigo 6º			
PL Total			796.394.089,37				

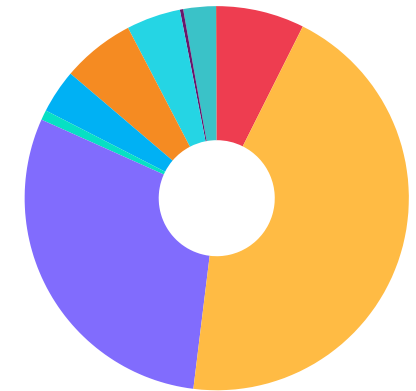
Enquadramento e Política de Investimento (REDA FIXA) - base (Dezembro / 2023)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	58.897.865,89	7,40%	0,00%	12,00%	100,00%	737.495.041,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	354.767.024,19	44,55%	0,00%	35,00%	100,00%	441.625.882,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	796.392.907,15
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	39.819.645,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	237.020.316,17	29,76%	0,00%	30,00%	60,00%	240.815.428,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	477.835.744,29
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	6.687.710,06	0,84%	0,00%	1,00%	20,00%	152.590.871,37
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	2.394,63	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	39.817.250,73
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	29.333.539,12	3,68%	0,00%	5,00%	5,00%	10.486.106,24
Artigo 7º, Inciso V, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	39.819.645,36
Total Renda Fixa	100,00%	686.708.850,06	86,23%	0,00%	84,00%	460,00%	

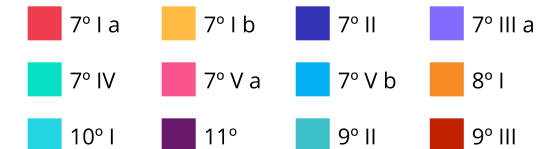


Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	48.807.458,49	6,13%	0,00%	8,00%	30,00%	190.110.413,66
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	159.278.581,43
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	36.340.903,13	4,56%	0,00%	5,00%	10,00%	43.298.387,59
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	39.819.645,36
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	39.819.645,36
Artigo 11º	5,00%	2.229.894,84	0,28%	0,00%	1,00%	5,00%	37.589.750,52
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	87.378.256,46	10,97%	0,00%	14,00%	75,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	79.639.290,72
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	21.866.304,35	2,75%	0,00%	1,00%	10,00%	57.772.986,37
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	439.496,28	0,06%	0,00%	1,00%	10,00%	79.199.794,44
Total Exterior	10,00%	22.305.800,63	2,80%	0,00%	2,00%	30,00%	



Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	39.819.645,36

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	58.897.865,89	7,40	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	354.767.024,19	44,55	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	237.020.316,17	29,76	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	6.687.710,06	0,84	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	2.394,63	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	29.333.539,12	3,68	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea c	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	48.807.458,49	6,13	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	21.866.304,35	2,75	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	439.496,28	0,06	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	36.340.903,13	4,56	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	2.229.894,84	0,28	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	517.040.628,32	64,92	-
CAIXA DTVM	124.491.986,52	15,63	0,50
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	58.897.865,89	7,40	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	33.216.834,67	4,17	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	31.864.463,84	4,00	0,01
ICATU VANGUARDA	10.969.512,83	1,38	0,02
BANCO BTG PACTUAL	6.687.710,06	0,84	0,00
WESTERN ASSET	5.460.810,99	0,69	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.333.666,90	0,67	0,00
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	2.052.438,95	0,26	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	374.593,55	0,05	0,02
GENIAL GESTÃO LTDA	2.394,63	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 Dezembro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,17%	16,96%	3,73%	7,99%	17,00%	36,08%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-7,33%	-58,73%	-87,97%	-10,66%	-58,73%	433,83%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,45%	12,13%	2,89%	5,00%	12,13%	22,60%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	11,72%	2,89%	4,84%	11,72%	22,14%	0,45%	2,00%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	10,82%	2,57%	4,71%	10,90%	24,35%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,43%	12,55%	3,04%	5,26%	12,55%	24,21%	0,47%	2,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,91%	13,25%	2,89%	6,16%	13,25%	26,86%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	13,02%	2,83%	6,04%	13,02%	26,29%	0,03%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	12,88%	2,80%	6,00%	12,88%	26,13%	0,04%	0,35%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,45%	11,93%	2,92%	4,62%	11,93%	22,58%	0,49%	1,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	11,96%	2,92%	4,64%	11,96%	22,79%	0,48%	1,97%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,74%	15,77%	4,71%	4,04%	15,77%	22,83%	1,46%	4,47%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	1,48%	16,51%	4,38%	6,28%	16,51%	26,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	16,32%	4,33%	6,17%	16,32%	26,46%	0,66%	2,64%

CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO ...	1,11%	13,15%	3,45%	8,65%	13,15%	29,26%	0,19%	1,08%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1,05%	11,52%	3,37%	6,61%	11,52%	24,48%	0,33%	1,19%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,81%	11,58%	2,59%	5,63%	11,58%	23,39%	0,01%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	12,98%	2,83%	6,15%	12,98%	27,20%	0,01%	0,08%
ICATU VANGUARDA SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	12,99%	2,78%	6,06%	12,99%	27,01%	0,02%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	11,93%	2,58%	5,62%	11,93%	24,53%	0,01%	0,04%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	-1,31%	8,93%	-1,27%	4,14%	8,93%	-	2,00%	2,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92%	13,32%	2,94%	6,48%	13,32%	27,68%	0,02%	0,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	14,99%	2,92%	5,73%	14,99%	25,68%	0,06%	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,13%	12,69%	3,08%	5,22%	12,69%	26,00%	0,25%	0,83%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,94%	13,39%	2,94%	6,46%	13,39%	27,85%	0,02%	0,09%

IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	1,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	3,29%
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,98%	12,80%	2,54%	4,68%	12,80%	24,96%	0,07%	1,07%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,55%	15,23%	3,64%	5,28%	15,23%	25,31%	0,56%	2,40%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
XP BANCOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,95%	13,60%	2,96%	6,54%	13,60%	28,33%	0,03%	0,12%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	3,79%	0,91%	14,84%	6,46%	0,91%	-	9,16%	29,94%

CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,54%	12,77%	5,01%	7,04%	12,77%	28,27%	1,46%	3,85%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO ...	1,11%	13,15%	3,45%	8,65%	13,15%	29,26%	0,19%	1,08%

Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,47%	7,41%	9,14%	3,37%	7,41%	-2,64%	7,40%	19,62%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,83%	15,82%	12,82%	8,59%	15,82%	10,41%	6,78%	17,46%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5,86%	18,24%	13,97%	10,67%	18,24%	18,14%	6,45%	16,90%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,66%	27,90%	14,41%	12,47%	27,90%	31,07%	4,77%	16,77%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,35%	11,45%	16,32%	13,22%	11,45%	17,20%	7,50%	15,76%

IBX-50 (Benchmark)	5,31%	20,06%	14,43%	14,39%	20,06%	26,93%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5,84%	17,91%	13,70%	11,79%	17,91%	20,64%	6,47%	16,82%

IDIV (Benchmark)	6,90%	26,84%	14,61%	16,04%	26,84%	42,88%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,80%	16,58%	12,12%	11,79%	16,58%	22,80%	5,23%	15,40%

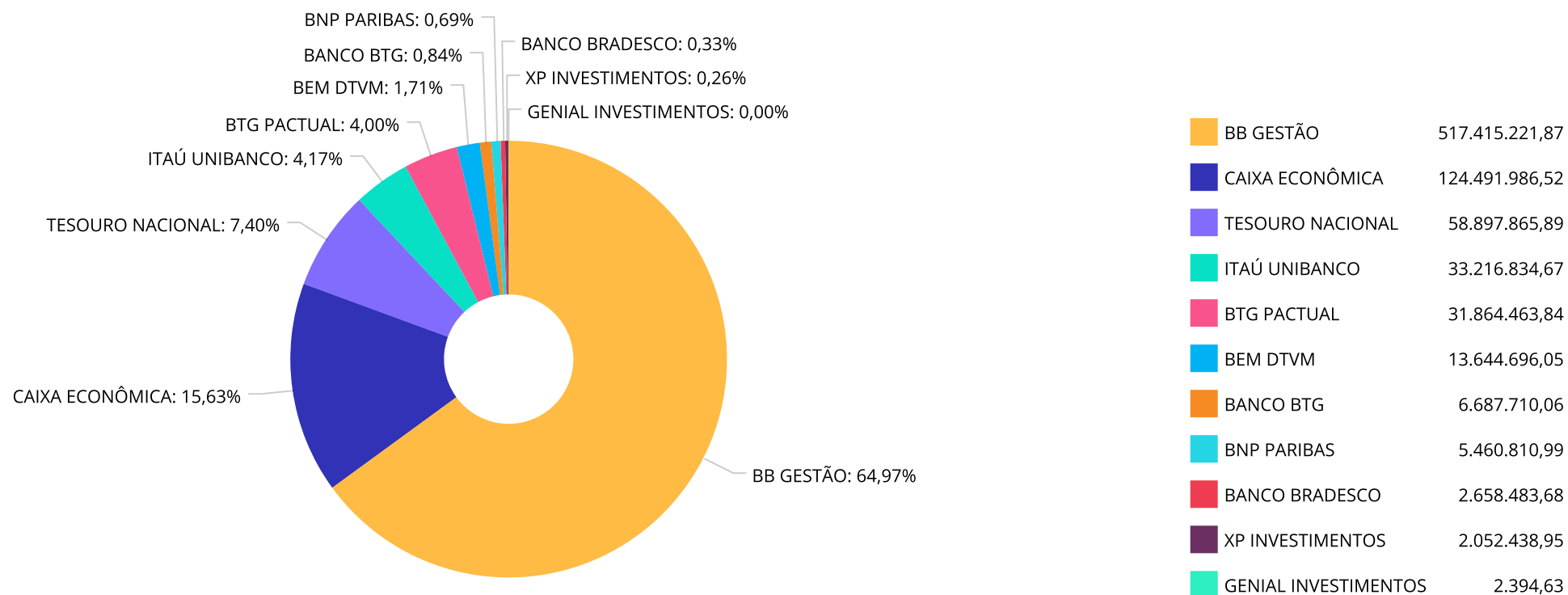
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	4,25%	15,50%	2,86%	4,95%	15,50%	18,06%	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,42%	27,14%	-1,79%	1,81%	27,14%	17,38%	17,81%	23,92%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	3,86%	21,42%	7,05%	8,00%	21,42%	42,06%	1,81%	5,51%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,70%	11,43%	7,01%	6,95%	11,43%	-16,44%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,19%	33,22%	12,99%	10,86%	33,22%	17,27%	4,22%	13,32%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,42%	24,23%	11,24%	7,18%	24,23%	0,08%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5,23%	33,78%	13,12%	11,13%	33,78%	23,09%	4,23%	13,30%
SMLL (Benchmark)	7,05%	17,12%	11,48%	3,40%	17,12%	-0,52%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6,93%	16,46%	11,06%	3,02%	16,46%	-1,39%	7,62%	22,17%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5,76%	3,50%	10,29%	-0,68%	3,50%	-5,04%	8,94%	21,72%

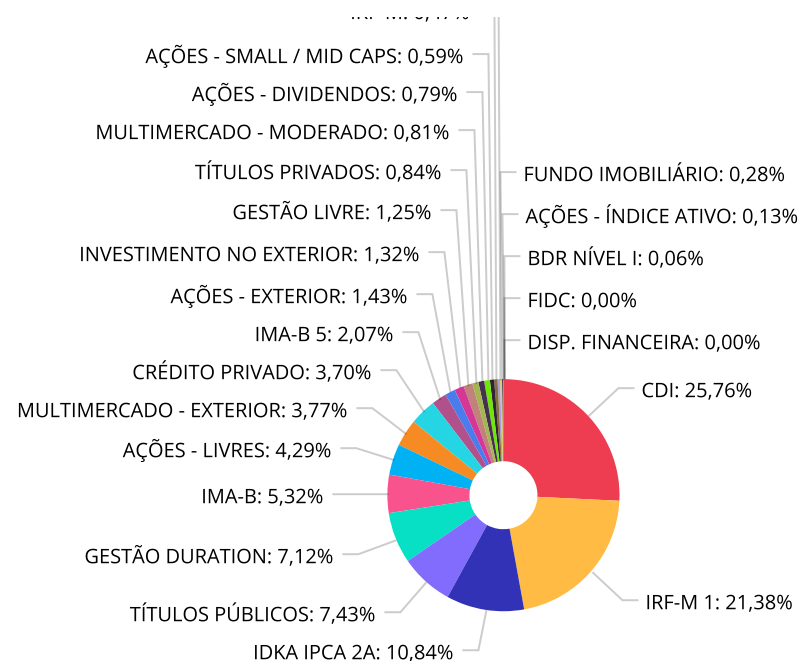
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%	-	-
WESTERN ASSET FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,77%	32,50%	12,06%	10,48%	32,50%	-16,96%	4,42%	16,594%
MSCI WORLD (Benchmark)	2,81%	12,98%	7,38%	7,31%	12,98%	-14,93%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	3,66%	16,01%	8,22%	11,24%	16,01%	-6,32%	5,44%	15,127%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,70%	11,43%	7,01%	6,95%	11,43%	-16,44%	-	-
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIAÇÕES	3,83%	20,88%	10,32%	10,84%	20,88%	-0,03%	2,73%	7,931%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2023)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2023)



CDI	204.366.483,24	IRF-M 1	169.562.677,66	IDKA IPCA 2A	85.986.868,26	TÍTULOS PÚBLICOS	58.897.865,89
GESTÃO DURATION	56.479.851,59	IMA-B	42.196.207,66	AÇÕES - LIVRES	34.040.121,57	MULTIMERCADO - EXTERIOR	29.895.846,52
CRÉDITO PRIVADO	29.333.539,12	IMA-B 5	16.412.364,81	AÇÕES - EXTERIOR	11.358.343,10	INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.507.961,25
GESTÃO LIVRE	9.898.859,96	TÍTULOS PRIVADOS	6.687.710,06	MULTIMERCADO - MODERADO	6.445.056,61	AÇÕES - DIVIDENDOS	6.298.861,96
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.656.096,33	IRF-M	3.717.482,80	AÇÕES - SETORIAIS	2.810.035,41	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.229.894,84
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.002.343,22	BDR NÍVEL I	439.496,28	FIDC	2.394,63	DISP. FINANCEIRA	1.182,22

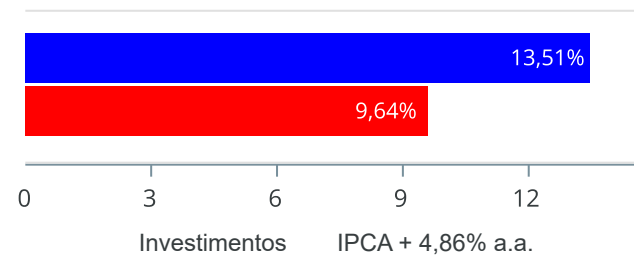
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	08/01/2020	1.250	3.992,416174	4.191,244158	4.990.520,22	5.239.055,19	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	08/01/2020	1.550	4.074,157576	4.242,856017	6.314.944,24	6.576.426,82	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	12/01/2022	2.500	3.968,766615	4.245,23109	9.921.916,54	10.613.077,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	12/01/2022	1.200	4.024,952392	4.207,221547	4.829.942,87	5.048.665,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	12/01/2022	1.200	4.086,293352	4.276,232493	4.903.552,02	5.131.478,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	05/01/2022	313	4.128,080622	4.383,441148	1.292.089,23	1.372.017,07	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	05/01/2022	1.450	4.082,738887	4.394,630756	5.919.971,39	6.372.214,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/03/2006	1.550	4.133,569525	4.291,013982	6.407.032,76	6.651.071,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/03/2006	1.200	4.136,453513	4.349,194926	4.963.744,22	5.219.033,91	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	15/09/2004	1.550	4.124,899182	4.303,315861	6.393.593,73	6.670.139,58	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

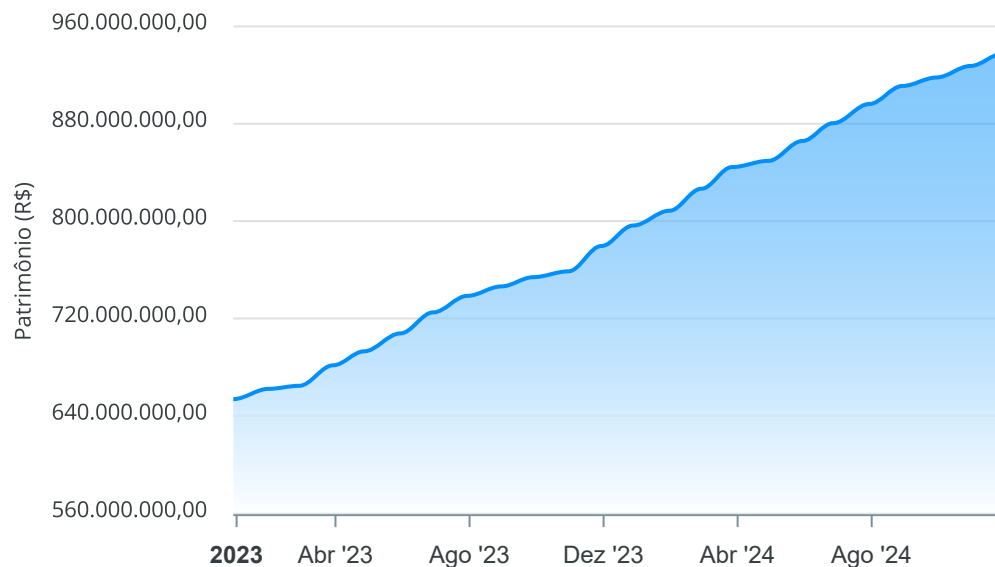
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	648.593.403,47	15.413.194,43	16.160.095,49	656.846.935,43	9.000.433,02	9.000.433,02	1,39%	1,39%	0,95%	0,95%	146,48%	1,87%
Fevereiro	656.846.935,43	8.005.170,74	7.860.109,49	659.055.884,18	2.063.887,50	11.064.320,52	0,31%	1,71%	1,18%	2,14%	79,69%	1,61%
Março	659.055.884,18	36.532.563,66	27.011.394,97	675.850.028,50	7.272.975,63	18.337.296,15	1,09%	2,81%	1,15%	3,31%	84,90%	1,57%
Abril	675.850.028,50	18.997.431,42	13.702.655,59	687.474.020,36	6.329.216,03	24.666.512,18	0,93%	3,77%	0,95%	4,30%	87,71%	1,29%
Maio	687.474.020,36	23.083.365,26	18.786.402,56	701.090.214,45	9.319.231,39	33.985.743,57	1,35%	5,17%	0,65%	4,97%	103,95%	1,27%
Junho	701.090.214,45	23.019.810,52	18.065.909,74	718.374.671,98	12.330.556,75	46.316.300,32	1,75%	7,00%	0,32%	5,30%	132,09%	1,25%
Julho	718.374.671,98	30.873.914,36	25.925.659,68	732.082.910,44	8.759.983,78	55.076.284,10	1,21%	8,30%	0,52%	5,85%	141,96%	1,13%
Agosto	732.082.910,44	25.701.773,79	21.143.886,82	739.436.155,64	2.795.358,23	57.871.642,33	0,38%	8,71%	0,67%	6,55%	132,98%	1,19%
Setembro	739.436.155,64	17.685.335,83	12.541.608,48	747.050.781,35	2.470.898,36	60.342.540,69	0,33%	9,07%	0,64%	7,23%	125,46%	1,14%
Outubro	747.050.781,35	13.941.714,74	9.778.207,80	752.044.803,02	830.514,73	61.173.055,42	0,11%	9,19%	0,64%	7,91%	116,15%	1,44%
Novembro	752.044.803,02	15.863.257,13	12.217.716,90	772.860.762,11	17.170.418,86	78.343.474,28	2,27%	11,67%	0,66%	8,62%	135,35%	1,24%
Dezembro	772.860.762,11	32.476.969,93	28.143.977,33	789.988.062,14	12.794.307,43	91.137.781,71	1,65%	13,51%	0,94%	9,64%	140,09%	1,01%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



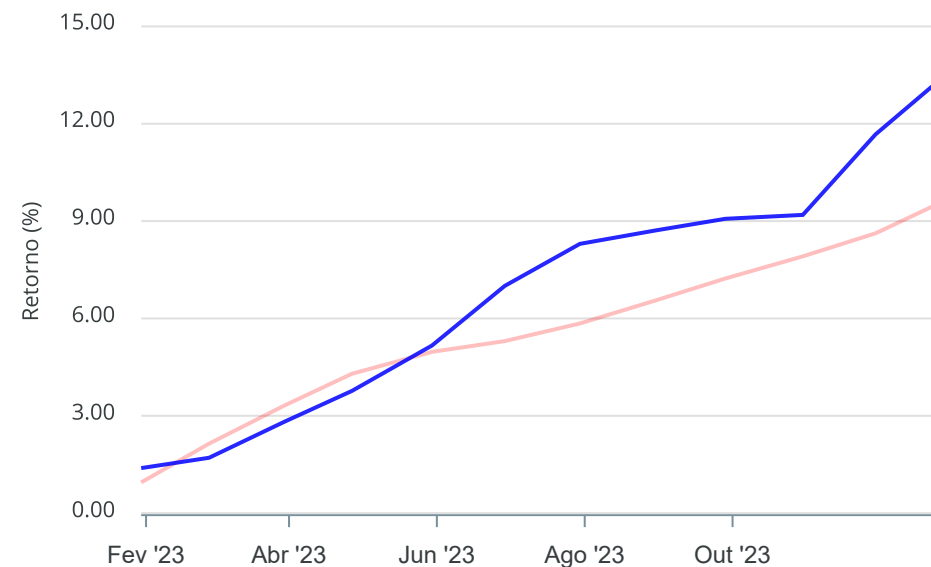
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Dezembro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	2.584,11	0,00	1.400,83	2.394,63	1.211,35	46,88%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	41.069.457,28	0,00	0,00	42.196.207,66	1.126.750,38	2,74%	2,74%	1,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	3.444.251,77	0,00	0,00	3.499.721,08	55.469,31	1,61%	1,61%	0,78%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.617.899,84	0,00	0,00	2.658.483,68	40.583,84	1,55%	1,55%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.663.966,91	0,00	0,00	3.717.482,80	53.515,89	1,46%	1,46%	0,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.247.145,88	0,00	0,00	12.424.059,01	176.913,13	1,44%	1,44%	0,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.931.746,38	0,00	0,00	3.988.305,80	56.559,42	1,44%	1,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	10.865.938,97	0,00	0,00	11.021.025,86	155.086,89	1,43%	1,43%	0,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	84.787.478,82	0,00	0,00	85.986.868,26	1.199.389,44	1,41%	1,41%	0,45%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.609.780,01	0,00	0,00	2.641.290,89	31.510,88	1,21%	1,21%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	9.788.341,28	0,00	0,00	9.898.859,96	110.518,68	1,13%	1,13%	0,25%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA C...	16.081.794,12	0,00	0,00	16.260.074,31	178.280,19	1,11%	1,11%	0,19%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	4.969.206,16	0,00	0,00	5.021.314,71	52.108,55	1,05%	1,05%	0,33%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	14.928.764,87	0,00	0,00	15.075.174,58	146.409,71	0,98%	0,98%	0,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	22.185.418,12	0,00	0,00	22.392.799,66	207.381,54	0,93%	0,93%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	25.333.193,60	2.000.000,00	0,00	27.583.866,65	250.673,05	0,92%	0,95%	0,06%
TÍTULOS PÚBLICOS	58.365.185,17	0,00	0,00	58.897.865,89	532.680,72	0,91%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	145.050.871,63	0,00	0,00	146.359.490,62	1.308.618,99	0,90%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.927.663,41	0,00	0,00	2.953.611,16	25.947,75	0,89%	0,89%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	165.146.321,23	0,00	0,00	166.609.066,50	1.462.745,27	0,89%	0,89%	0,04%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.671.435,05	2.000.000,00	0,00	16.816.826,23	145.391,18	0,87%	0,92%	0,02%
LETRA FINANCEIRA BTG	5.148.855,08	1.487.895,00	0,00	6.687.710,06	50.959,98	0,77%	-	-
ICATU VANGUARDA PLUS FI RENDA FIXA LP	3.373.121,74	0,00	3.397.584,17	0,00	24.462,43	0,73%	1,04%	0,11%
XP BANCOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PR...	1.039.323,68	1.000.000,00	0,00	2.052.438,95	13.115,27	0,64%	0,95%	0,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	4.494.195,75	5.410.585,00	5.161.069,65	4.782.601,46	38.890,36	0,39%	0,81%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.396.871,11	16.406.371,99	18.876.008,06	12.047.175,62	119.940,58	0,39%	0,82%	0,01%
ICATU VANGUARDA SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.161.069,65	0,00	3.166.544,38	5.474,73	0,17%	0,90%	0,02%
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS - BTG PACTUAL	1.482.493,18	0,00	1.482.493,18	0,00	0,00	0,00%	-	-
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.993.618,92	0,00	0,00	1.967.589,65	-26.029,27	-1,31%	-1,31%	2,00%
Total Renda Fixa	676.616.924,07	31.465.921,64	28.918.555,89	686.708.850,06	7.544.560,24	1,11%		0,23%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	17.299.471,72	0,00	0,00	18.571.758,51	1.272.286,79	7,35%	7,35%	7,50%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.852.567,00	0,00	0,00	1.980.913,11	128.346,11	6,93%	6,93%	7,62%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6.384.585,15	0,00	0,00	6.809.566,23	424.981,08	6,66%	6,66%	4,77%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	357.388,07	0,00	0,00	378.311,76	20.923,69	5,85%	5,85%	6,45%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	589.574,78	0,00	0,00	624.031,46	34.456,68	5,84%	5,84%	6,47%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.953.693,20	0,00	0,00	6.298.861,96	345.168,76	5,80%	5,80%	5,23%
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.529.446,88	0,00	0,00	2.675.183,22	145.736,34	5,76%	5,76%	8,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.181.837,49	0,00	0,00	1.246.495,12	64.657,63	5,47%	5,47%	7,40%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.784.729,10	0,00	0,00	8.192.087,82	407.358,72	5,23%	5,23%	4,23%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20.632.806,16	0,00	0,00	21.703.758,70	1.070.952,54	5,19%	5,19%	4,22%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.070.707,81	0,00	0,00	7.412.301,71	341.593,90	4,83%	4,83%	6,78%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.794.373,02	0,00	11.600,00	1.855.301,29	72.528,27	4,04%	3,18%	17,81%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.707.318,52	0,00	0,00	2.810.035,41	102.716,89	3,79%	3,79%	9,16%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	4.866.219,15	0,00	0,00	4.940.950,12	74.730,97	1,54%	1,54%	1,46%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.504.106,49	4.106,49	0,27%	3,86%	1,81%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	396.137,46	0,00	18.900,00	374.593,55	-2.643,91	-0,67%	-	-
Total Renda Variável	81.400.855,51	1.500.000,00	30.500,00	87.378.256,46	4.507.900,95	5,44%		5,80%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Dezembro / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIAÇÕES	10.939.406,30	0,00	0,00	11.358.343,10	418.936,80	3,83%	3,83%	2,73%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	10.136.727,09	0,00	0,00	10.507.961,25	371.234,16	3,66%	3,66%	5,44%
WESTERN ASSET FIAÇÕES BDR NÍVEL I	427.641,80	0,00	0,00	439.496,28	11.854,48	2,77%	2,77%	4,42%
Total Exterior	21.503.775,19	0,00	0,00	22.305.800,63	802.025,44	3,73%		4,04%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	162.065.867,66	0,00	0,00	166.609.066,50	4.543.198,84	2,80%	2,80%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	142.329.935,37	0,00	0,00	146.359.490,62	4.029.555,25	2,83%	2,83%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	83.575.928,20	0,00	0,00	85.986.868,26	2.410.940,06	2,88%	2,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	40.297.260,92	0,00	0,00	42.196.207,66	1.898.946,74	4,71%	4,71%
TÍTULOS PÚBLICOS	59.017.007,76	0,00	1.475.768,07	58.897.865,89	1.356.626,20	2,30%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	24.847.804,89	2.000.000,00	0,00	27.583.866,65	736.061,76	2,74%	2,92%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	21.753.235,77	0,00	0,00	22.392.799,66	639.563,89	2,94%	2,94%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA C...	14.241.117,20	1.500.000,00	0,00	16.260.074,31	518.957,11	3,30%	3,45%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.412.644,00	4.000.000,00	0,00	16.816.826,23	404.182,23	2,46%	2,94%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	12.204.432,90	37.190.261,75	37.725.085,86	12.047.175,62	377.566,83	0,76%	2,58%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	14.701.574,83	0,00	0,00	15.075.174,58	373.599,75	2,54%	2,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.071.243,83	0,00	0,00	12.424.059,01	352.815,18	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	10.695.900,50	0,00	0,00	11.021.025,86	325.125,36	3,04%	3,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	9.603.191,25	0,00	0,00	9.898.859,96	295.668,71	3,08%	3,08%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	4.857.855,60	0,00	0,00	5.021.314,71	163.459,11	3,36%	3,36%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.563.327,93	0,00	0,00	3.717.482,80	154.154,87	4,33%	4,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	3.363.983,06	0,00	0,00	3.499.721,08	135.738,02	4,04%	4,04%
LETRA FINANCEIRA BTG	4.871.329,53	1.682.895,00	0,00	6.687.710,06	133.485,53	2,04%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	4.319.960,11	8.277.129,00	7.932.015,80	4.782.601,46	117.528,15	0,93%	2,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.875.180,21	0,00	0,00	3.988.305,80	113.125,59	2,92%	2,92%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.565.033,77	0,00	0,00	2.658.483,68	93.449,91	3,64%	3,64%
ICATU VANGUARDA PLUS FI RENDA FIXA LP	3.305.449,55	0,00	3.397.584,17	0,00	92.134,62	2,79%	3,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.872.453,54	0,00	0,00	2.953.611,16	81.157,62	2,83%	2,83%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.566.276,90	0,00	0,00	2.641.290,89	75.013,99	2,92%	2,92%
XP BANCOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PR...	1.019.118,66	1.000.000,00	0,00	2.052.438,95	33.320,29	1,65%	2,95%
ICATU VANGUARDA SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.161.069,65	0,00	3.166.544,38	5.474,73	0,17%	2,78%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	19.908,27	0,00	19.567,41	2.394,63	2.053,77	10,32%	-87,97%
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS - BTG PACTUAL	0,00	1.482.493,18	1.482.493,18	0,00	0,00	0,00%	-
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.967.589,65	-32.410,35	-1,62%	-1,27%
Total Renda Fixa	657.017.022,21	62.293.848,58	52.032.514,49	686.708.850,06	19.430.493,76	2,91%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	15.966.284,28	0,00	0,00	18.571.758,51	2.605.474,23	16,32%	16,32%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19.208.533,64	0,00	0,00	21.703.758,70	2.495.225,06	12,99%	12,99%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.241.952,47	0,00	0,00	8.192.087,82	950.135,35	13,12%	13,12%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.952.133,57	0,00	0,00	6.809.566,23	857.432,66	14,41%	14,41%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.570.326,50	0,00	0,00	7.412.301,71	841.975,21	12,81%	12,81%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.618.239,55	0,00	0,00	6.298.861,96	680.622,41	12,11%	12,11%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.446.978,01	0,00	0,00	2.810.035,41	363.057,40	14,84%	14,84%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.425.592,90	0,00	0,00	2.675.183,22	249.590,32	10,29%	10,29%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	4.705.445,35	0,00	0,00	4.940.950,12	235.504,77	5,00%	5,00%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.783.695,44	0,00	0,00	1.980.913,11	197.217,67	11,06%	11,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.142.123,42	0,00	0,00	1.246.495,12	104.371,70	9,14%	9,14%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	548.830,59	0,00	0,00	624.031,46	75.200,87	13,70%	13,70%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.838.401,13	0,00	34.800,00	1.855.301,29	51.700,16	2,81%	-1,79%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	331.936,40	0,00	0,00	378.311,76	46.375,36	13,97%	13,97%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.504.106,49	4.106,49	0,27%	7,05%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	512.034,27	0,00	21.900,00	374.593,55	-115.540,72	-22,57%	-
Total Renda Variável	76.292.507,52	1.500.000,00	56.700,00	87.378.256,46	9.642.448,94	12,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIAÇÕES	10.295.361,53	0,00	0,00	11.358.343,10	1.062.981,57	10,32%	10,32%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	9.709.375,19	0,00	0,00	10.507.961,25	798.586,06	8,22%	8,22%
WESTERN ASSET FIAÇÕES BDR NÍVEL I	392.185,55	0,00	0,00	439.496,28	47.310,73	12,06%	12,06%
Total Exterior	20.396.922,27	0,00	0,00	22.305.800,63	1.908.878,36	9,36%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	137.445.978,05	10.500.000,00	0,00	166.609.066,50	18.663.088,45	12,83%	12,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	126.260.366,26	3.505.141,70	0,00	146.359.490,62	16.593.982,66	12,96%	12,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	72.673.887,33	4.500.000,00	0,00	85.986.868,26	8.812.980,93	11,66%	11,72%
TÍTULOS PÚBLICOS	56.313.473,54	0,00	3.351.902,91	58.897.865,89	5.936.295,26	0,11%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.257.215,61	8.000.000,00	0,00	42.196.207,66	4.938.992,05	15,69%	15,77%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	14.976.808,77	9.500.000,00	0,00	27.583.866,65	3.107.057,88	14,56%	14,99%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	14.949.878,18	5.000.000,00	0,00	22.392.799,66	2.442.921,48	13,34%	13,39%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA C...	13.020.075,16	1.500.000,00	0,00	16.260.074,31	1.739.999,15	13,09%	13,15%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	13.364.141,10	0,00	0,00	15.075.174,58	1.711.033,48	12,79%	12,80%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	18.843.230,62	171.841.427,86	180.298.213,72	12.047.175,62	1.660.730,86	6,18%	11,93%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.905.550,12	5.500.000,00	5.500,00	16.816.826,23	1.416.776,11	13,18%	13,32%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.167.665,52	0,00	68.698,98	12.424.059,01	1.325.092,47	11,93%	11,93%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	9.792.295,72	0,00	0,00	11.021.025,86	1.228.730,14	12,54%	12,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.042.603,67	8.000.000,00	0,00	9.898.859,96	856.256,29	11,64%	12,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	6.005.127,35	2.000.000,00	5.000.000,00	3.499.721,08	494.593,73	14,93%	15,84%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	4.011.207,75	19.174.170,29	18.871.846,74	4.782.601,46	469.070,16	9,29%	11,58%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	3.568.683,77	1.000.000,00	0,00	5.021.314,71	452.630,94	11,53%	11,52%
LETRA FINANCEIRA BTG	2.459.458,55	3.796.420,57	0,00	6.687.710,06	431.830,94	11,86%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.562.122,08	0,00	0,00	3.988.305,80	426.183,72	11,97%	11,96%
ICATU VANGUARDA PLUS FI RENDA FIXA LP	3.039.843,28	0,00	3.397.584,17	0,00	357.740,89	11,80%	12,12%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.307.100,23	0,00	0,00	2.658.483,68	351.383,45	15,25%	15,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.613.344,75	0,00	0,00	2.953.611,16	340.266,41	13,03%	13,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.325.365,62	0,00	0,00	2.641.290,89	315.925,27	13,58%	13,59%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	457.541,84	3.000.000,00	0,00	3.717.482,80	259.940,96	16,34%	16,32%
BB CORPORATE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	3.307.380,19	0,00	3.505.141,70	0,00	197.761,51	5,98%	13,00%
XP BANCOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PR...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.052.438,95	52.438,95	4,60%	13,60%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	5.801,59	0,00	31.322,76	2.394,63	27.915,80	8.929,67%	-58,72%
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	314.159,51	0,00	329.859,61	0,00	15.700,10	5,93%	-
ICATU VANGUARDA SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.161.069,65	0,00	3.166.544,38	5.474,73	0,17%	12,99%
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS - BTG PACTUAL	0,00	3.386.098,54	3.386.160,58	0,00	62,04	1,02%	-
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.967.589,65	-32.410,35	-1,63%	8,93%
Total Renda Fixa	562.990.306,16	267.364.328,61	218.246.231,17	686.708.850,06	74.600.446,46	12,19%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16.291.910,09	0,00	0,00	21.703.758,70	5.411.848,61	33,21%	33,22%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6.123.690,78	0,00	0,00	8.192.087,82	2.068.397,04	33,78%	33,78%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	16.664.070,45	0,00	0,00	18.571.758,51	1.907.688,06	11,45%	11,45%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.323.966,20	0,00	0,00	6.809.566,23	1.485.600,03	27,90%	27,90%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.399.921,74	0,00	0,00	7.412.301,71	1.012.379,97	15,84%	15,82%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.402.987,48	0,00	0,00	6.298.861,96	895.874,48	16,57%	16,58%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	4.381.549,34	0,00	0,00	4.940.950,12	559.400,78	12,77%	12,77%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.653.001,03	0,00	136.800,00	1.855.301,29	339.100,26	21,42%	27,14%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.700.969,54	0,00	0,00	1.980.913,11	279.943,57	16,44%	16,46%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	529.252,24	0,00	0,00	624.031,46	94.779,22	17,91%	17,91%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.584.642,61	0,00	0,00	2.675.183,22	90.540,61	3,50%	3,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.160.477,01	0,00	0,00	1.246.495,12	86.018,11	7,41%	7,41%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	319.963,59	0,00	0,00	378.311,76	58.348,17	18,23%	18,24%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.784.582,58	0,00	0,00	2.810.035,41	25.452,83	0,94%	0,91%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.504.106,49	4.106,49	0,27%	21,42%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	901.239,83	0,00	58.200,00	374.593,55	-468.446,28	-54,14%	-
Total Renda Variável	72.222.224,51	1.500.000,00	195.000,00	87.378.256,46	13.851.031,95	18,84%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIAÇÕES	9.396.747,27	0,00	0,00	11.358.343,10	1.961.595,83	20,87%	20,88%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	9.057.463,31	0,00	0,00	10.507.961,25	1.450.497,94	16,01%	16,01%
WESTERN ASSET FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	400.000,00	0,00	439.496,28	39.496,28	9,87%	32,50%
Total Exterior	18.454.210,58	400.000,00	0,00	22.305.800,63	3.451.590,05	18,31%	

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.

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

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.

