

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

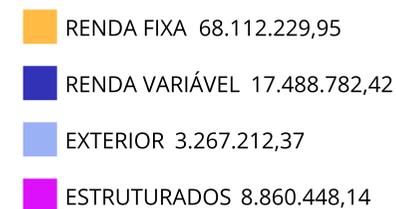
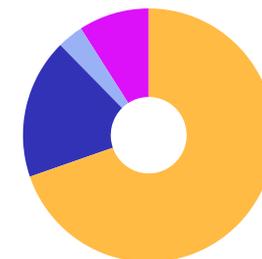
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.146.673,30	4,24%	884	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.523.042,17	1,56%	789	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	483.572,19	0,49%	1.141	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	9.962.560,39	10,19%	314	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.200.207,44	1,23%	788	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	150.477,47	0,15%	850	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	953.884,67	0,98%	769	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.815.038,09	3,90%	1.190	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.801.949,88	4,91%	445	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.045.073,27	1,07%	76	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	8.759.128,53	8,96%	216	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	6.778.490,36	6,94%	90	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.732.469,54	7,91%	989	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	706.819,81	0,72%	245	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.903.007,41	1,95%	99	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	123.491,15	0,13%	362	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.593.575,56	3,68%	224	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	D+7	Não há	10.432.768,72	10,68%	6.195	2,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.416.366,27	3,50%	2.736	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.064.560,90	4,16%	1.330	0,46%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24	Não há	4.069.767,89	4,16%	13.834	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.500.073,35	2,56%	3.996	1,83%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	3.438.014,01	3,52%	33	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	3.267.212,37	3,34%	79	0,65%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.590.634,40	3,67%	4.969	0,25%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.411.121,77	3,49%	111	0,60%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.858.691,97	1,90%	2.628	0,14%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			97.728.672,88				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			217.427,47				Artigo 6º
PL Total			97.946.100,35				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,75%	59,24%	57.894.465,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	43.620.097,76	44,63%	14,81%	18,75%	59,24%	14.274.368,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	70,00%	24.492.132,19	25,06%	13,13%	17,50%	60,00%	34.145.071,54
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,50%	20,00%	19.545.734,58
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	10,00%	9.772.867,29
Total Renda Fixa	100,00%	68.112.229,95	69,70%	27,94%	77,28%	208,48%	



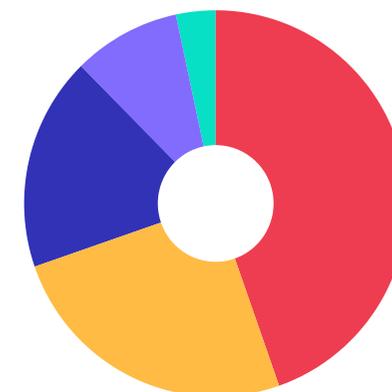
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	17.488.782,42	17,90%	11,21%	12,70%	40,00%	21.602.686,73
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,24%	30,00%	29.318.601,86
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	8.860.448,14	9,07%	2,09%	2,78%	10,00%	912.419,15
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	26.349.230,56	26,96%	13,30%	17,72%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.267.212,37	3,34%	1,88%	2,50%	10,00%	6.505.654,92
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	1,88%	2,50%	10,00%	9.772.867,29
Total Exterior	10,00%	3.267.212,37	3,34%	3,76%	5,00%	20,00%	



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	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	43.620.097,76	44,63	14,81	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	24.492.132,19	25,06	13,13	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I	17.488.782,42	17,90	11,21	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	3.267.212,37	3,34	1,88	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	1,88	10,00
Artigo 10º, Inciso I	8.860.448,14	9,07	2,09	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.886.910,67	32,63	-
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	24.246.035,61	24,81	-
CAIXA DTVM	19.905.496,84	20,37	0,08
V8 CAPITAL	10.432.768,72	10,68	-
TRÍGONO CAPITAL	3.438.014,01	3,52	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.416.366,27	3,50	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.500.073,35	2,56	0,00
BANCO BRADESCO	1.903.007,41	1,95	0,04

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
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	11,90%	2,86%	4,97%	11,90%	22,02%	0,43%	1,99%
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%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,45%	11,92%	2,92%	4,65%	11,92%	22,66%	0,49%	1,97%
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%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,72%	15,83%	4,68%	3,91%	15,83%	22,72%	1,44%	4,52%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,84%	15,65%	4,53%	3,50%	15,65%	21,36%	1,58%	4,77%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,73%	15,86%	4,71%	4,15%	15,86%	23,03%	1,44%	4,47%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,75%	15,77%	4,70%	4,00%	15,77%	22,78%	1,47%	4,50%
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%

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 (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	0,89%	12,90%	2,74%	5,96%	12,90%	27,97%	0,04%	0,13%
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 DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,81%	11,58%	2,59%	5,63%	11,58%	23,39%	0,01%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	11,93%	2,58%	5,62%	11,93%	24,53%	0,01%	0,04%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	-	2,19%	5,37%	-	-	0,34%	-
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%

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
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%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,82%	13,64%	4,88%	6,55%	13,64%	26,09%	1,31%	3,76%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,90%	12,51%	2,73%	5,58%	12,51%	27,64%	0,05%	0,39%

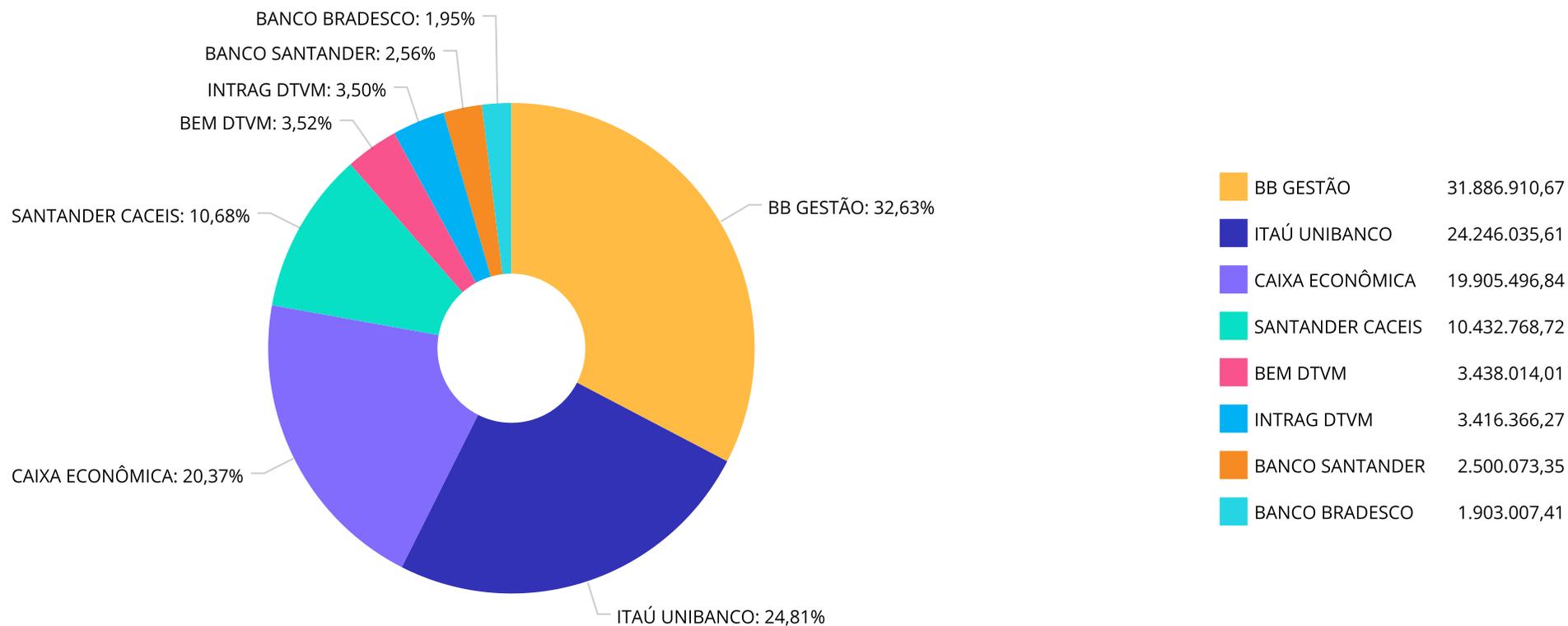
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,58%	10,97%	-2,98%	4,93%	10,97%	16,93%	5,50%	19,35%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6,96%	26,34%	14,28%	15,64%	26,34%	40,97%	4,74%	14,85%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	7,35%	11,45%	16,32%	13,22%	11,45%	17,20%	7,50%	15,76%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6,04%	16,67%	14,36%	12,12%	16,67%	12,62%	6,09%	16,85%

SMLL (Benchmark)	7,05%	17,12%	11,48%	3,40%	17,12%	-0,52%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,24%	15,29%	8,91%	5,20%	15,29%	5,27%	7,97%	16,43%

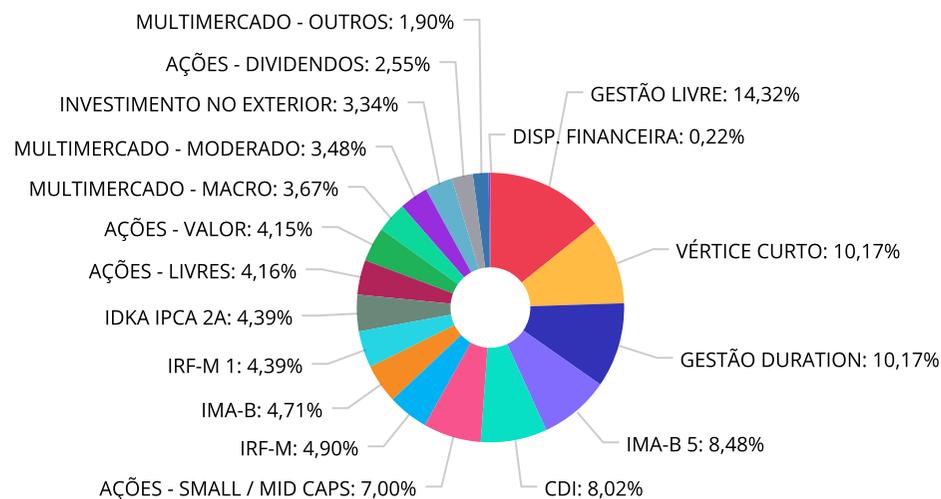
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	2,81%	12,98%	7,38%	7,31%	12,98%	-14,93%	-	-
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,53%	10,85%	5,97%	8,81%	10,85%	-12,51%	5,49%	15,268%

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



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



■ GESTÃO LIVRE	14.026.344,28	■ VÉRTICE CURTO	9.962.560,39	■ GESTÃO DURATION	9.959.335,97	■ IMA-B 5	8.301.532,53
■ CDI	7.855.960,69	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	6.854.380,28	■ IRF-M	4.801.949,88	■ IMA-B	4.608.785,16
■ IRF-M 1	4.298.610,28	■ IDKA IPCA 2A	4.297.150,77	■ AÇÕES - LIVRES	4.069.767,89	■ AÇÕES - VALOR	4.064.560,90
■ MULTIMERCADO - MACRO	3.590.634,40	■ MULTIMERCADO - MODERADO	3.411.121,77	■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.267.212,37	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.500.073,35
■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.858.691,97	■ DISP. FINANCEIRA	217.427,47				

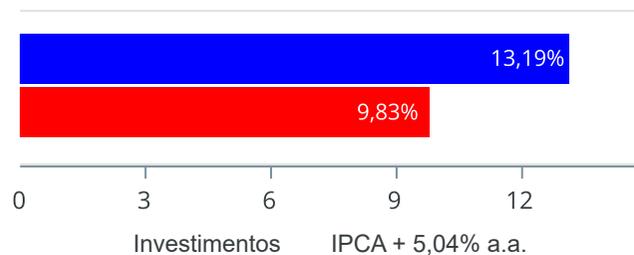
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

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	84.090.119,38	1.401.193,21	1.448.059,73	85.237.935,13	1.194.682,27	1.194.682,27	1,42%	1,42%	0,96%	0,96%	147,61%	3,06%
Fevereiro	85.237.935,13	2.860.484,35	1.923.593,10	85.836.377,48	-338.448,90	856.233,37	-0,39%	1,02%	1,19%	2,17%	47,14%	2,44%
Março	85.836.377,48	2.651.042,41	1.631.446,03	87.294.421,86	438.448,00	1.294.681,37	0,50%	1,53%	1,16%	3,36%	45,65%	2,45%
Abril	87.294.421,86	2.715.315,83	2.131.011,50	88.633.063,35	754.337,16	2.049.018,53	0,86%	2,40%	0,96%	4,35%	55,22%	2,19%
Mai	88.633.063,35	26.635.316,62	26.501.490,19	90.386.657,85	1.619.768,07	3.668.786,60	1,82%	4,27%	0,66%	5,04%	84,72%	2,11%
Junho	90.386.657,85	11.631.428,15	12.193.234,33	91.794.269,99	1.969.418,32	5.638.204,92	2,18%	6,54%	0,33%	5,39%	121,41%	1,96%
Julho	91.794.269,99	1.909.392,42	1.634.962,53	93.379.758,15	1.311.058,27	6.949.263,19	1,42%	8,06%	0,53%	5,95%	135,49%	2,00%
Agosto	93.379.758,15	7.761.619,30	7.482.619,82	93.602.045,83	-56.711,80	6.892.551,39	-0,06%	8,00%	0,68%	6,67%	119,86%	2,05%
Setembro	93.602.045,83	2.082.488,90	1.620.794,08	94.454.118,93	390.378,28	7.282.929,67	0,42%	8,44%	0,65%	7,37%	114,63%	2,08%
Outubro	94.454.118,93	1.798.406,38	1.670.011,50	93.894.126,31	-688.387,50	6.594.542,17	-0,73%	7,66%	0,65%	8,07%	94,90%	2,27%
Novembro	93.894.126,31	2.549.614,65	2.529.275,90	96.692.953,61	2.778.488,55	9.373.030,72	2,96%	10,84%	0,67%	8,79%	123,29%	2,02%
Dezembro	96.692.953,61	9.610.248,50	10.624.507,41	97.728.672,88	2.049.978,18	11.423.008,90	2,12%	13,19%	0,95%	9,83%	134,19%	1,73%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



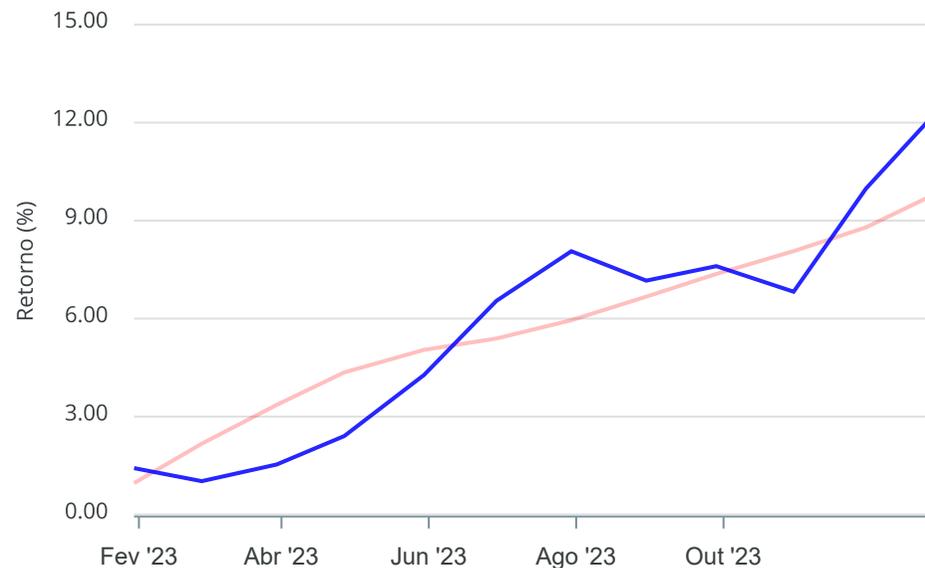
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1.016.250,12	0,00	0,00	1.045.073,27	28.823,15	2,84%	2,84%	1,58%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	687.936,02	0,00	0,00	706.819,81	18.883,79	2,74%	2,74%	1,47%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	928.566,47	0,00	0,00	953.884,67	25.318,20	2,73%	2,73%	1,44%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.852.654,33	0,00	0,00	1.903.007,41	50.353,08	2,72%	2,72%	1,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	8.620.299,50	0,00	0,00	8.759.128,53	138.829,03	1,61%	1,61%	0,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	6.681.958,14	0,00	0,00	6.778.490,36	96.532,22	1,44%	1,44%	0,49%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.501.354,71	0,00	0,00	1.523.042,17	21.687,46	1,44%	1,44%	0,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.088.833,34	0,00	0,00	4.146.673,30	57.839,96	1,41%	1,41%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	148.397,19	0,00	0,00	150.477,47	2.080,28	1,40%	1,40%	0,43%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.185.888,84	0,00	0,00	1.200.207,44	14.318,60	1,21%	1,21%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	8.302.111,54	0,00	4.800.000,00	3.593.575,56	91.464,02	1,10%	1,13%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	9.870.637,99	0,00	0,00	9.962.560,39	91.922,40	0,93%	0,93%	0,34%
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	10.340.915,16	0,00	0,00	10.432.768,72	91.853,56	0,89%	0,89%	0,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	481.968,52	0,00	2.650,00	483.572,19	4.253,67	0,88%	0,89%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.870.287,75	41.557,73	131.000,00	3.815.038,09	34.192,61	0,87%	0,89%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.164.508,37	3.101.253,99	2.600.000,00	7.732.469,54	66.707,18	0,65%	0,82%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.540.397,13	1.667.436,78	3.090.857,41	123.491,15	6.514,65	0,20%	0,81%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	4.800.000,00	0,00	4.801.949,88	1.949,88	0,04%	1,46%	0,66%
Total Renda Fixa	68.282.965,12	9.610.248,50	10.624.507,41	68.112.229,95	843.523,74	1,24%		0,41%

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 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.790.962,20	0,00	0,00	4.069.767,89	278.805,69	7,35%	7,35%	7,50%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.337.430,21	0,00	0,00	2.500.073,35	162.643,14	6,96%	6,96%	4,74%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.833.130,23	0,00	0,00	4.064.560,90	231.430,67	6,04%	6,04%	6,09%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.246.304,53	0,00	0,00	3.416.366,27	170.061,74	5,24%	5,24%	7,97%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	3.287.345,72	0,00	0,00	3.438.014,01	150.668,29	4,58%	4,58%	5,50%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.526.533,98	0,00	0,00	3.590.634,40	64.100,42	1,82%	1,82%	1,31%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.359.529,17	0,00	0,00	3.411.121,77	51.592,60	1,54%	1,54%	1,46%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.842.082,54	0,00	0,00	1.858.691,97	16.609,43	0,90%	0,90%	0,05%
Total Renda Variável	25.223.318,58	0,00	0,00	26.349.230,56	1.125.911,98	4,46%		4,67%

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 SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	3.186.669,91	0,00	0,00	3.267.212,37	80.542,46	2,53%	2,53%	5,49%
Total Exterior	3.186.669,91	0,00	0,00	3.267.212,37	80.542,46	2,53%		5,49%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	8.419.402,38	0,00	0,00	8.759.128,53	339.726,15	4,04%	4,04%
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	10.154.651,88	0,00	0,00	10.432.768,72	278.116,84	2,74%	2,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	8.145.074,08	0,00	4.800.000,00	3.593.575,56	248.501,48	3,05%	3,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	9.749.552,02	0,00	0,00	9.962.560,39	213.008,37	2,18%	2,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.633.700,30	6.226.643,94	6.321.315,20	7.732.469,54	193.440,50	1,40%	2,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	6.586.107,41	0,00	0,00	6.778.490,36	192.382,95	2,92%	2,92%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.030.406,93	0,00	0,00	4.146.673,30	116.266,37	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.989.793,32	86.467,39	371.000,00	3.815.038,09	109.777,38	2,69%	2,83%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.817.929,00	0,00	0,00	1.903.007,41	85.078,41	4,68%	4,68%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	999.819,44	0,00	0,00	1.045.073,27	45.253,83	4,53%	4,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.479.791,22	0,00	0,00	1.523.042,17	43.250,95	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	911.016,14	0,00	0,00	953.884,67	42.868,53	4,71%	4,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.166.120,94	0,00	0,00	1.200.207,44	34.086,50	2,92%	2,92%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	675.106,98	0,00	0,00	706.819,81	31.712,83	4,70%	4,70%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	579.684,75	2.845.158,20	3.317.590,61	123.491,15	16.238,81	0,47%	2,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	484.007,79	0,00	13.889,00	483.572,19	13.453,40	2,78%	2,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	146.299,32	0,00	0,00	150.477,47	4.178,15	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	4.800.000,00	0,00	4.801.949,88	1.949,88	0,04%	4,33%
Total Renda Fixa	66.968.463,90	13.958.269,53	14.823.794,81	68.112.229,95	2.009.291,33	2,48%	

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 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.498.810,90	0,00	0,00	4.069.767,89	570.956,99	16,32%	16,32%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.554.141,56	0,00	0,00	4.064.560,90	510.419,34	14,36%	14,36%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.187.600,26	0,00	0,00	2.500.073,35	312.473,09	14,28%	14,28%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.136.893,73	0,00	0,00	3.416.366,27	279.472,54	8,91%	8,91%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.423.579,60	0,00	0,00	3.590.634,40	167.054,80	4,88%	4,88%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.248.534,51	0,00	0,00	3.411.121,77	162.587,26	5,00%	5,00%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.809.282,99	0,00	0,00	1.858.691,97	49.408,98	2,73%	2,73%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	3.543.630,40	0,00	0,00	3.438.014,01	-105.616,39	-2,98%	-2,98%
Total Renda Variável	24.402.473,95	0,00	0,00	26.349.230,56	1.946.756,61	7,98%	

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 SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	3.083.181,08	0,00	0,00	3.267.212,37	184.031,29	5,97%	5,97%
Total Exterior	3.083.181,08	0,00	0,00	3.267.212,37	184.031,29	5,97%	

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	11.799.986,13	0,00	4.500.000,00	8.759.128,53	1.459.142,40	15,17%	15,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.073.086,41	29.476.124,47	29.872.754,85	7.732.469,54	1.056.013,51	9,31%	11,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	7.450.612,16	0,00	4.800.000,00	3.593.575,56	942.963,40	12,65%	12,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	6.056.754,49	0,00	0,00	6.778.490,36	721.735,87	11,91%	11,92%
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	0,00	9.801.147,03	0,00	10.432.768,72	631.621,69	6,45%	12,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.137.571,90	0,00	1.500.000,00	4.146.673,30	509.101,40	11,64%	11,72%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.294.786,72	0,00	9.801.147,03	0,00	506.360,31	5,46%	11,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	9.632.379,32	132.379,32	9.962.560,39	462.560,39	5,91%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	656.548,88	3.387.880,11	541.000,00	3.815.038,09	311.609,10	12,40%	13,02%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.643.007,37	0,00	0,00	1.903.007,41	260.000,04	15,84%	15,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.360.674,49	0,00	0,00	1.523.042,17	162.367,68	11,93%	11,93%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.056.650,42	0,00	0,00	1.200.207,44	143.557,02	13,58%	13,59%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	903.679,90	0,00	0,00	1.045.073,27	141.393,37	15,66%	15,65%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	39.319,30	16.491.856,54	16.544.175,84	123.491,15	136.491,15	6,55%	11,58%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	923.661,15	0,00	101.000,00	953.884,67	131.223,52	15,95%	15,86%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	610.540,71	0,00	0,00	706.819,81	96.279,10	15,77%	15,77%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	424.070,16	17.163,25	13.889,00	483.572,19	56.227,78	12,85%	12,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.440.212,62	0,00	1.300.000,00	150.477,47	10.264,85	10,04%	11,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	4.800.000,00	0,00	4.801.949,88	1.949,88	0,04%	16,32%
Total Renda Fixa	55.871.162,81	73.606.550,72	69.106.346,04	68.112.229,95	7.740.862,46	12,82%	

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.483.712,95	0,00	0,00	4.064.560,90	580.847,95	16,68%	16,67%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.978.918,56	0,00	0,00	2.500.073,35	521.154,79	26,35%	26,34%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.963.259,61	0,00	0,00	3.416.366,27	453.106,66	15,28%	15,29%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.159.536,51	0,00	0,00	3.590.634,40	431.097,89	13,65%	13,64%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.651.721,98	0,00	0,00	4.069.767,89	418.045,91	11,45%	11,45%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.024.923,94	0,00	0,00	3.411.121,77	386.197,83	12,77%	12,77%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	3.098.202,32	0,00	0,00	3.438.014,01	339.811,69	10,96%	10,97%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.652.006,93	0,00	0,00	1.858.691,97	206.685,04	12,51%	12,51%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.259.379,84	0,00	2.284.660,08	0,00	25.280,24	1,13%	14,49%
Total Renda Variável	25.271.662,64	0,00	2.284.660,08	26.349.230,56	3.362.228,00	13,30%	

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 SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	2.947.293,93	0,00	0,00	3.267.212,37	319.918,44	10,87%	10,85%
Total Exterior	2.947.293,93	0,00	0,00	3.267.212,37	319.918,44	10,85%	

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 E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. 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.

