

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.329.514,53	1,70%	694	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.043.080,11	1,33%	884	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.222.940,35	1,56%	789	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.018.172,29	1,30%	289	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.439.852,98	1,84%	649	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	50.573,92	0,06%	1.141	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.050.723,00	1,34%	91	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	600.264,93	0,77%	633	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	2.891.730,66	3,69%	314	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	1.806.052,79	2,31%	198	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	1.116.169,74	1,42%	43	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	6.266.695,25	8,00%	370	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	3.930.399,60	5,02%	207	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	1.449.891,06	1,85%	50	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.597.873,38	4,59%	788	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.705.121,65	3,45%	850	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.728.087,09	2,21%	248	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.889.921,99	4,97%	445	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.387.080,72	3,05%	30	1,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.149.808,93	6,57%	989	0,13%	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
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.636.821,91	3,37%	161	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.817.344,26	6,15%	437	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.497.887,75	1,91%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	318.075,55	0,41%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	265.630,51	0,34%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.314.566,67	1,68%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	Não se ...	Não se aplica	46.762,77	0,06%	20	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	99.618,32	0,13%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	7.625,20	0,01%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.287.110,09	2,92%	18.137	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.835.907,87	2,34%	204	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	222.376,44	0,28%	82	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.430.567,36	3,10%	2.445	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	1.707.823,76	2,18%	295	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	D+4	Não há	638.205,42	0,81%	7	1,77%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	D+3	Não há	667.435,35	0,85%	345	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	509.280,08	0,65%	8.999	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.820.005,39	2,32%	22	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	1.333.105,97	1,70%	33	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	446.587,77	0,57%	52	0,11%	Artigo 9º, Inciso II

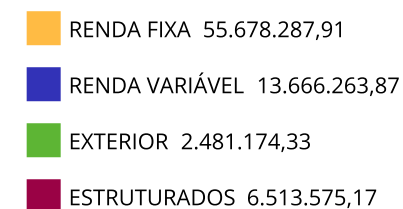
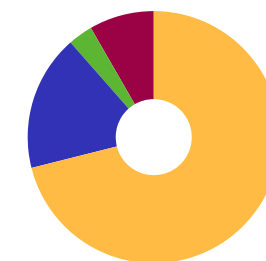
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	542.440,83	0,69%	20.096	0,16%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	963.720,41	1,23%	143	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	528.425,32	0,67%	468	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.948.995,51	2,49%	88	1,57%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.309.516,59	1,67%	41.223	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.601.753,74	2,04%	4.969	0,11%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	959.047,02	1,22%	6.530	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	694.262,31	0,89%	595	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	214.446,14	0,27%		0,00%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			78.339.301,28				



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	15.667.860,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	39.524.146,04	50,45%	15,00%	54,00%	90,00%	30.981.225,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	14.685.568,91	18,75%	4,00%	10,00%	60,00%	32.318.011,86
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.916.965,06
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.468.572,96	1,87%	0,00%	2,50%	5,00%	2.448.392,10
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	2.350.179,04
Total Renda Fixa	100,00%	55.678.287,91	71,07%	19,00%	69,50%	183,00%	

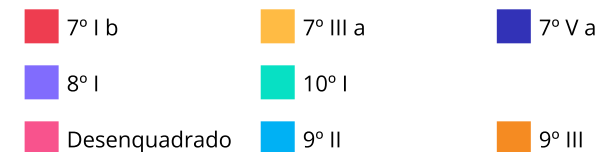
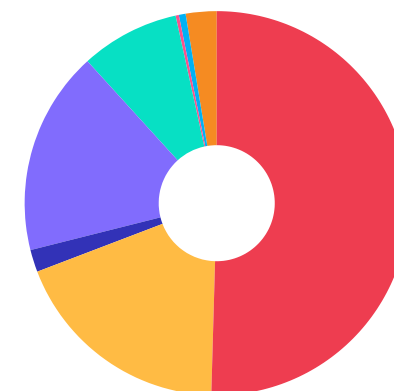




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	13.451.817,73	17,17%	0,00%	18,00%	30,00%	10.049.972,65
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	6.513.575,17	8,31%	0,00%	6,00%	10,00%	1.320.354,96
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.916.965,06
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.916.965,06
Desenquadrado - RV	0,00%	214.446,14	0,27%	0,00%	0,00%	0,00%	-214.446,14
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	20.179.839,04	25,76%	0,00%	27,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	446.587,77	0,57%	0,00%	0,50%	10,00%	7.387.342,36
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.034.586,56	2,60%	0,00%	3,00%	10,00%	5.799.343,57
Total Exterior	10,00%	2.481.174,33	3,17%	0,00%	3,50%	20,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.120.772,59	44,83	-
CAIXA DTVM	27.266.149,42	34,81	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.590.623,11	4,58	-
TRÍGONO CAPITAL	3.153.111,36	4,02	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.919.697,94	3,73	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.430.567,36	3,10	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	1.707.823,76	2,18	-
ITAÚ UNIBANCO	1.305.640,77	1,67	-
RJI CORRETORA DE VALORES	318.075,55	0,41	-
PLURAL	312.393,28	0,40	-
CADENCE GESTORA	214.446,14	0,27	-

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)

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	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	39.524.146,04	50,45	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	14.685.568,91	18,75	4,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.468.572,96	1,87	0,00	5,00

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%	-	-
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%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	11,72%	2,89%	4,84%	11,72%	22,14%	0,45%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,01%	11,75%	2,71%	5,10%	11,84%	26,59%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,14%	-3,03%	-0,62%	-0,41%	-3,03%	-13,73%	0,04%	0,01%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,44%	-3,37%	-1,22%	-2,34%	-3,37%	-0,10%	0,63%	0,10%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,73%	18,52%	5,05%	6,37%	18,52%	27,30%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,71%	18,19%	5,00%	6,24%	18,19%	26,41%	0,94%	0,04%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,69%	18,06%	4,98%	6,19%	18,06%	26,40%	0,95%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,94%	19,28%	6,42%	3,80%	19,28%	23,21%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,93%	18,87%	6,38%	3,67%	18,87%	22,37%	2,40%	0,07%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,91%	13,25%	2,89%	6,16%	13,25%	26,86%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	12,88%	2,80%	6,00%	12,88%	26,13%	0,04%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-9,60%	-18,89%	-9,67%	-20,99%	-18,89%	-15,58%	16,71%	0,19%

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-18,39%	-23,70%	-18,64%	-19,20%	-23,70%	-38,78%	31,01%	0,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,45%	11,93%	2,92%	4,62%	11,93%	22,58%	0,49%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,51%	4,73%	1,14%	1,91%	4,73%	11,23%	0,13%	0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,74%	15,77%	4,71%	4,04%	15,77%	22,83%	1,46%	0,04%
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%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,46%	16,06%	4,33%	6,05%	16,06%	26,02%	0,66%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-1,12%	-17,21%	-2,15%	-3,75%	-17,21%	-21,65%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,94%	13,39%	2,94%	6,46%	13,39%	27,85%	0,02%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	11,93%	2,58%	5,62%	11,93%	24,53%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	14,99%	2,92%	5,73%	14,99%	25,68%	0,06%	0,02%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,00%	12,75%	3,01%	6,42%	12,75%	27,07%	0,12%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,49%	-14,39%	-5,66%	-6,95%	-14,39%	-61,62%	0,08%	0,08%
IPCA (Benchmark)	0,46%	4,52%	0,99%	1,60%	4,52%	10,57%	-	-

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	-	2,19%	5,37%	-	-	0,34%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,99%	-	3,79%	3,84%	-	-	1,06%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,69%	13,64%	3,22%	4,06%	13,64%	-	0,81%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	11,17%	2,16%	5,32%	11,17%	-	0,34%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,69%	-	0,33%	1,16%	-	-	0,81%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	-	2,19%	2,40%	-	-	0,34%	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,93%	-	2,17%	2,29%	-	-	0,34%	-

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

	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 ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,82%	13,64%	4,88%	6,55%	13,64%	26,09%	1,31%	0,04%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,23%	12,36%	3,60%	5,44%	12,36%	24,64%	0,42%	0,02%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,86%	10,53%	4,18%	5,00%	10,53%	22,09%	0,82%	0,02%

Global BDRX (Benchmark)	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,59%	24,92%	7,65%	9,07%	24,92%	-10,73%	4,08%	0,15%

Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,66%	27,90%	14,41%	12,47%	27,90%	31,07%	4,77%	0,17%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	5,22%	18,94%	13,89%	13,09%	18,94%	18,04%	6,39%	0,17%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	6,44%	25,94%	14,96%	12,30%	25,94%	30,85%	5,82%	0,16%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,77%	16,71%	-3,14%	5,39%	16,71%	33,07%	5,85%	0,19%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,58%	10,97%	-2,98%	4,93%	10,97%	16,93%	5,50%	0,19%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,50%	19,59%	11,92%	6,93%	19,59%	22,06%	5,41%	0,15%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	5,70%	21,84%	14,44%	13,58%	21,84%	25,79%	6,13%	0,17%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	5,49%	22,82%	15,27%	13,88%	22,82%	29,04%	6,18%	0,17%

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%	0,17%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	4,25%	15,50%	2,86%	4,95%	15,50%	18,06%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-	-	-	-	-	-	-	-
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%	0,13%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,42%	24,23%	11,24%	7,18%	24,23%	0,08%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	5,17%	33,07%	12,98%	10,83%	33,07%	17,21%	4,21%	0,13%
SMLL (Benchmark)	7,05%	17,12%	11,48%	3,40%	17,12%	-0,52%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	7,45%	15,07%	10,88%	3,49%	15,07%	4,20%	7,30%	0,21%

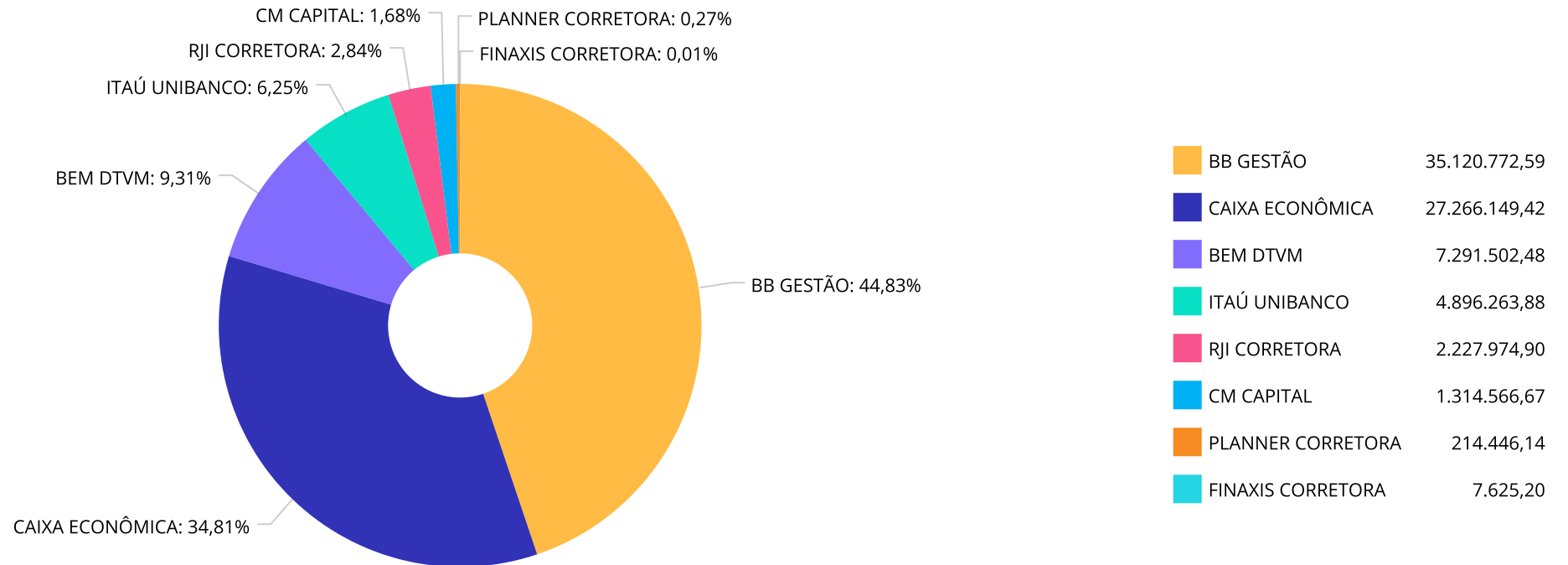


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,59%	24,92%	7,65%	9,07%	24,92%	-10,73%	4,08%	15,398%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,28%	19,43%	8,29%	5,98%	19,43%	3,81%	7,06%	14,278%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,03%	17,78%	7,61%	9,37%	17,78%	-11,84%	4,59%	14,099%
MSCI WORLD (Benchmark)	2,81%	12,98%	7,38%	7,31%	12,98%	-14,93%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	5,11%	1,50%	5,68%	3,41%	1,50%	-23,00%	6,49%	15,346%

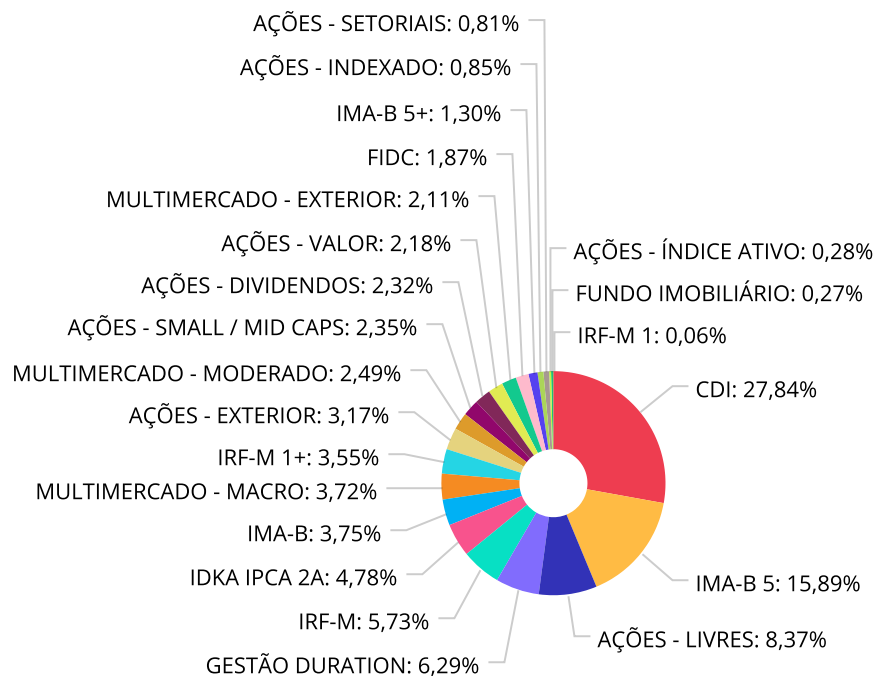


Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2023)





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



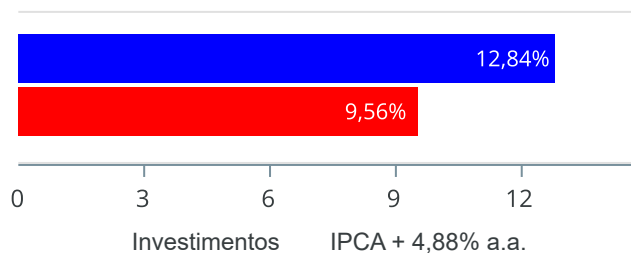
■ CDI	21.813.186,08	■ IMA-B 5	12.445.455,25	■ AÇÕES - LIVRES	6.553.585,32	■ GESTÃO DURATION	4.927.387,91
■ IRF-M	4.490.186,92	■ IDKA IPCA 2A	3.748.201,76	■ IMA-B	2.937.740,73	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.911.270,33
■ IRF-M 1+	2.778.810,09	■ AÇÕES - EXTERIOR	2.481.174,33	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.948.995,51	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.842.386,05
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.820.005,39	■ AÇÕES - VALOR	1.707.823,76	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.653.309,33	■ FIDC	1.468.572,96
■ IMA-B 5+	1.018.172,29	■ AÇÕES - INDEXADO	667.435,35	■ AÇÕES - SETORIAIS	638.205,42	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	222.376,44
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	214.446,14	■ IRF-M 1	50.573,92				



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	63.080.883,61	7.645.059,03	8.409.259,70	63.433.808,80	1.117.125,86	1.117.125,86	1,77%	1,77%	0,95%	0,95%	186,60%	3,03%
Fevereiro	63.433.808,80	6.748.190,39	6.107.126,78	63.714.242,22	-360.630,19	756.495,67	-0,56%	1,20%	1,18%	2,14%	55,88%	2,51%
Março	63.714.242,22	1.257.802,15	808.842,82	64.499.603,07	336.401,52	1.092.897,19	0,52%	1,73%	1,15%	3,32%	52,11%	2,44%
Abril	64.499.603,07	3.353.235,51	2.850.732,42	65.531.905,85	529.799,69	1.622.696,88	0,82%	2,56%	0,95%	4,30%	59,45%	2,28%
Mai	65.531.905,85	16.046.408,45	16.323.192,99	66.472.763,93	1.217.642,62	2.840.339,50	1,86%	4,46%	0,65%	4,98%	89,67%	2,43%
Junho	66.472.763,93	4.316.863,51	3.149.721,25	69.215.581,25	1.575.675,06	4.416.014,56	2,33%	6,90%	0,32%	5,31%	129,86%	2,12%
Julho	69.215.581,25	1.378.657,99	898.168,43	70.613.226,62	917.155,81	5.333.170,37	1,32%	8,30%	0,52%	5,86%	141,77%	1,99%
Agosto	70.613.226,62	5.609.333,87	5.174.293,67	70.986.266,53	-62.000,29	5.271.170,08	-0,09%	8,21%	0,67%	6,56%	125,08%	2,73%
Setembro	70.986.266,53	1.451.973,90	912.753,41	71.686.442,57	160.955,55	5.432.125,63	0,23%	8,45%	0,64%	7,24%	116,67%	2,37%
Outubro	71.686.442,57	1.364.030,10	905.140,70	71.465.551,90	-679.780,07	4.752.345,56	-0,94%	7,43%	0,64%	7,93%	93,71%	2,60%
Novembro	71.465.551,90	3.009.867,77	2.603.603,16	74.034.173,60	2.162.357,09	6.914.702,65	3,01%	10,66%	0,66%	8,64%	123,38%	2,26%
Dezembro	74.034.173,60	4.001.829,48	1.209.823,78	78.339.301,28	1.513.121,98	8.427.824,63	1,97%	12,84%	0,84%	9,56%	134,34%	1,78%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





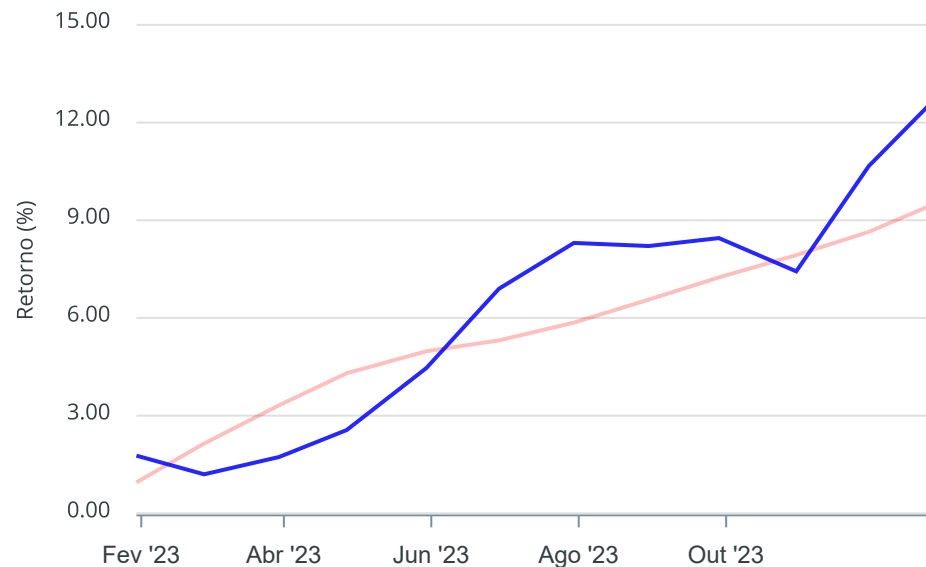
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	979.656,61	0,00	0,00	1.018.172,29	38.515,68	3,93%	3,93%	2,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.401.405,09	0,00	0,00	1.439.852,98	38.447,89	2,74%	2,74%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.094.441,26	0,00	0,00	1.116.169,74	21.728,48	1,99%	1,99%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.699.060,83	0,00	0,00	1.728.087,09	29.026,26	1,71%	1,71%	0,94%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.425.763,36	0,00	0,00	1.449.891,06	24.127,70	1,69%	1,69%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.776.002,10	0,00	0,00	1.806.052,79	30.050,69	1,69%	1,69%	0,81%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.033.242,14	0,00	0,00	1.050.723,00	17.480,86	1,69%	1,69%	0,95%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.833.923,71	0,00	0,00	3.889.921,99	55.998,28	1,46%	1,46%	0,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	591.632,89	0,00	0,00	600.264,93	8.632,04	1,46%	1,46%	0,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.205.526,22	0,00	0,00	1.222.940,35	17.414,13	1,44%	1,44%	0,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.028.530,69	0,00	0,00	1.043.080,11	14.549,42	1,41%	1,41%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.667.724,64	0,00	0,00	2.705.121,65	37.397,01	1,40%	1,40%	0,43%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.554.950,38	0,00	0,00	3.597.873,38	42.923,00	1,21%	1,21%	0,28%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.610.746,14	0,00	0,00	2.636.821,91	26.075,77	1,00%	1,00%	0,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.317.025,78	0,00	0,00	1.329.514,53	12.488,75	0,95%	0,95%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.772.730,45	0,00	0,00	4.817.344,26	44.613,81	0,93%	0,93%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.865.049,28	0,00	0,00	2.891.730,66	26.681,38	0,93%	0,93%	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.894.154,67	0,00	0,00	3.930.399,60	36.244,93	0,93%	0,93%	0,34%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	2.365.188,00	0,00	0,00	2.387.080,72	21.892,72	0,93%	0,93%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.209.372,97	0,00	0,00	6.266.695,25	57.322,28	0,92%	0,92%	0,34%



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
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	50.129,91	0,00	0,00	50.573,92	444,01	0,89%	0,89%	0,04%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.490.253,51	0,00	0,00	1.497.887,75	7.634,24	0,51%	0,51%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.328.563,01	4.001.829,48	1.209.823,78	5.149.808,93	29.240,22	0,46%	0,82%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.316.383,58	0,00	0,00	1.314.566,67	-1.816,91	-0,14%	-0,14%	0,04%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	100.059,92	0,00	0,00	99.618,32	-441,60	-0,44%	-0,44%	0,63%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	7.662,42	0,00	0,00	7.625,20	-37,22	-0,49%	-0,49%	0,08%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	47.293,66	0,00	0,00	46.762,77	-530,89	-1,12%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	351.836,62	0,00	0,00	318.075,55	-33.761,07	-9,60%	-9,60%	16,71%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	325.499,11	0,00	0,00	265.630,51	-59.868,60	-18,39%	-18,39%	31,01%
Total Renda Fixa	52.343.808,95	4.001.829,48	1.209.823,78	55.678.287,91	542.473,26	0,98%		0,66%

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 SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	473.970,35	0,00	0,00	509.280,08	35.309,73	7,45%	7,45%	7,30%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.721.329,92	0,00	0,00	1.835.907,87	114.577,95	6,66%	6,66%	4,77%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.282.306,22	0,00	0,00	2.430.567,36	148.261,14	6,50%	6,50%	5,41%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.604.432,62	0,00	0,00	1.707.823,76	103.391,14	6,44%	6,44%	5,82%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	210.097,65	0,00	0,00	222.376,44	12.278,79	5,84%	5,84%	6,47%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	603.769,05	0,00	0,00	638.205,42	34.436,37	5,70%	5,70%	6,13%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	632.730,61	0,00	0,00	667.435,35	34.704,74	5,48%	5,48%	6,18%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.173.648,95	0,00	0,00	2.287.110,09	113.461,14	5,22%	5,22%	6,39%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	911.723,71	0,00	0,00	959.047,02	47.323,31	5,19%	5,19%	4,22%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	660.125,19	0,00	0,00	694.262,31	34.137,12	5,17%	5,17%	4,21%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.737.181,82	0,00	0,00	1.820.005,39	82.823,57	4,77%	4,77%	5,85%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.274.683,64	0,00	0,00	1.333.105,97	58.422,33	4,58%	4,58%	5,50%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.285.649,03	0,00	0,00	1.309.516,59	23.867,56	1,86%	1,86%	0,82%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.573.159,04	0,00	0,00	1.601.753,74	28.594,70	1,82%	1,82%	1,31%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.925.328,26	0,00	0,00	1.948.995,51	23.667,25	1,23%	1,23%	0,42%
OSASCO PROPERTIES FII	214.577,60	0,00	0,00	214.446,14	-131,46	-0,06%	-	-
Total Renda Variável	19.284.713,66	0,00	0,00	20.179.839,04	895.125,38	4,64%		4,44%



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 NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	424.870,62	0,00	0,00	446.587,77	21.717,15	5,11%	5,11%	6,49%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	935.351,54	0,00	0,00	963.720,41	28.368,87	3,03%	3,03%	4,59%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	515.092,27	0,00	0,00	528.425,32	13.333,05	2,59%	2,59%	4,08%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	530.336,56	0,00	0,00	542.440,83	12.104,27	2,28%	2,28%	7,06%
Total Exterior	2.405.650,99	0,00	0,00	2.481.174,33	75.523,34	3,14%		5,37%

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
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.728.616,51	0,00	0,00	3.889.921,99	161.305,48	4,33%	4,33%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.679.755,42	0,00	0,00	4.817.344,26	137.588,84	2,94%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.134.169,61	0,00	0,00	6.266.695,25	132.525,64	2,16%	2,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.495.691,97	0,00	0,00	3.597.873,38	102.181,41	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.846.366,25	0,00	0,00	3.930.399,60	84.033,35	2,18%	2,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.605.723,99	40.911,85	0,00	1.728.087,09	81.451,25	4,95%	5,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.559.682,78	0,00	0,00	2.636.821,91	77.139,13	3,01%	3,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.630.011,29	0,00	0,00	2.705.121,65	75.110,36	2,86%	2,86%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.418.918,05	6.739.454,90	3.082.295,19	5.149.808,93	73.731,17	0,90%	2,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.375.055,59	0,00	0,00	1.439.852,98	64.797,39	4,71%	4,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.829.902,89	0,00	0,00	2.891.730,66	61.827,77	2,18%	2,18%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	957.111,27	0,00	0,00	1.018.172,29	61.061,02	6,38%	6,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.799.298,97	0,00	49.930,26	1.806.052,79	56.684,08	3,15%	3,22%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	2.336.446,63	0,00	0,00	2.387.080,72	50.634,09	2,17%	2,17%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.000.887,37	0,00	0,00	1.050.723,00	49.835,63	4,98%	4,98%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.445.133,60	0,00	40.911,85	1.449.891,06	45.669,31	3,16%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	1.075.452,94	0,00	0,00	1.116.169,74	40.716,80	3,79%	3,79%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.291.791,32	0,00	0,00	1.329.514,53	37.723,21	2,92%	2,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.188.211,61	0,00	0,00	1.222.940,35	34.728,74	2,92%	2,92%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.013.833,75	0,00	0,00	1.043.080,11	29.246,36	2,88%	2,88%



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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	575.378,43	0,00	0,00	600.264,93	24.886,50	4,33%	4,33%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.481.056,55	0,00	0,00	1.497.887,75	16.831,20	1,14%	1,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	49.930,26	0,00	50.573,92	643,66	1,29%	2,80%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.082,63	0,00	0,00	7.625,20	-457,43	-5,66%	-5,66%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	47.792,41	0,00	0,00	46.762,77	-1.029,64	-2,15%	-2,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	100.844,75	0,00	0,00	99.618,32	-1.226,43	-1,22%	-1,22%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.322.740,13	0,00	0,00	1.314.566,67	-8.173,46	-0,62%	-0,62%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	352.127,80	0,00	0,00	318.075,55	-34.052,25	-9,67%	-9,67%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	326.475,83	0,00	0,00	265.630,51	-60.845,32	-18,64%	-18,64%
Total Renda Fixa	50.626.560,34	6.830.297,01	3.173.137,30	55.678.287,91	1.394.567,86	2,57%	

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
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.008.147,33	0,00	0,00	2.287.110,09	278.962,76	13,89%	13,89%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.171.666,27	0,00	0,00	2.430.567,36	258.901,09	11,92%	11,92%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.604.737,87	0,00	0,00	1.835.907,87	231.170,00	14,41%	14,41%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	1.545.430,34	0,00	1.707.823,76	162.393,42	10,51%	14,96%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	848.787,87	0,00	0,00	959.047,02	110.259,15	12,99%	12,99%
ITAU PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	579.033,23	0,00	0,00	667.435,35	88.402,12	15,27%	15,27%
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	557.673,43	0,00	0,00	638.205,42	80.531,99	14,44%	14,44%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	614.515,43	0,00	0,00	694.262,31	79.746,88	12,98%	12,98%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.527.231,92	0,00	0,00	1.601.753,74	74.521,82	4,88%	4,88%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.881.276,77	0,00	0,00	1.948.995,51	67.718,74	3,60%	3,60%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.256.951,55	0,00	0,00	1.309.516,59	52.565,04	4,18%	4,18%
ITAU SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	459.321,17	0,00	0,00	509.280,08	49.958,91	10,88%	10,88%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	195.578,27	0,00	0,00	222.376,44	26.798,17	13,70%	13,70%
OSASCO PROPERTIES FII	214.848,77	0,00	0,00	214.446,14	-402,63	-0,19%	-
META VALOR FI AÇÕES	1.577.030,92	0,00	1.545.430,34	0,00	-31.600,58	-2,00%	13,31%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.374.059,21	0,00	0,00	1.333.105,97	-40.953,24	-2,98%	-2,98%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.879.039,26	0,00	0,00	1.820.005,39	-59.033,87	-3,14%	-3,14%
Total Renda Variável	18.749.899,27	1.545.430,34	1.545.430,34	20.179.839,04	1.429.939,77	7,05%	



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 AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	895.592,20	0,00	0,00	963.720,41	68.128,21	7,61%	7,61%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	500.913,63	0,00	0,00	542.440,83	41.527,20	8,29%	8,29%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	490.884,11	0,00	0,00	528.425,32	37.541,21	7,65%	7,65%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	422.593,02	0,00	0,00	446.587,77	23.994,75	5,68%	5,68%
Total Exterior	2.309.982,96	0,00	0,00	2.481.174,33	171.191,37	7,41%	

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
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	5.742.274,83	1.500.000,00	4.817.344,26	575.069,43	10,01%	13,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.507.329,62	3.500.000,00	284.228,36	6.266.695,25	543.593,99	9,05%	11,17%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.110.811,06	0,00	4.000.000,00	3.597.873,38	487.062,32	6,85%	13,59%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.959.137,11	1.501.173,39	0,00	3.889.921,99	429.611,49	12,42%	16,32%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	4.220.877,06	2.000.000,00	2.636.821,91	415.944,85	9,85%	12,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.417.440,13	0,00	0,00	2.705.121,65	287.681,52	11,90%	11,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.082.732,36	0,00	2.000.000,00	1.329.514,53	246.782,17	8,01%	14,99%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.670.070,14	0,00	4.916.497,06	0,00	246.426,92	5,28%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.808.761,59	110.165,29	3.930.399,60	231.803,30	6,09%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.700.000,00	99.402,56	1.806.052,79	205.455,35	12,09%	13,64%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.625.619,33	21.498.702,95	19.178.042,61	5.149.808,93	203.529,26	0,84%	11,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.803.736,14	0,00	4.005.125,52	0,00	201.389,38	5,29%	13,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.243.670,32	0,00	0,00	1.439.852,98	196.182,66	15,77%	15,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	2.800.000,00	82.413,92	2.891.730,66	174.144,58	6,22%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.770.110,18	0,00	1.700.000,00	1.222.940,35	152.830,17	5,52%	11,93%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,00	2.314.038,75	68.445,46	2.387.080,72	141.487,43	6,11%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.413.332,26	0,00	1.500.000,00	1.043.080,11	129.747,85	5,38%	11,72%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.676.267,44	0,00	1.772.360,64	0,00	96.093,20	5,73%	11,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.013.984,80	0,00	500.000,00	600.264,93	86.280,13	8,51%	16,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	1.651.077,14	0,00	1.728.087,09	77.009,95	4,66%	18,18%

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
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.416.497,06	40.911,85	1.449.891,06	74.305,85	5,25%	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.430.309,43	0,00	0,00	1.497.887,75	67.578,32	4,72%	4,72%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	948.282,74	0,00	1.014.038,75	0,00	65.756,01	6,93%	15,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.083.026,74	30.849,27	1.116.169,74	63.992,27	5,91%	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.050.723,00	50.723,00	5,07%	18,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.036.000,30	49.930,26	2.053.983,31	50.573,92	18.626,67	0,89%	12,88%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.018.172,29	18.172,29	1,82%	18,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	314.063,00	0,00	318.975,18	0,00	4.912,18	1,56%	12,98%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.355.566,47	0,00	42.061,51	1.314.566,67	1.061,71	0,08%	-3,02%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.906,55	0,00	0,00	7.625,20	-1.281,35	-14,39%	-14,39%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	56.482,78	0,00	6.297,04	46.762,77	-3.422,97	-6,06%	-17,21%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	103.094,80	0,00	0,00	99.618,32	-3.476,48	-3,37%	-3,37%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	392.147,47	0,00	67.836,87	318.075,55	-6.235,05	-1,59%	-18,89%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	348.149,07	0,00	15.593,57	265.630,51	-66.924,99	-19,22%	-23,70%
Total Renda Fixa	44.287.243,50	53.286.359,77	47.307.228,77	55.678.287,91	5.411.913,41	10,77%	

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 BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.435.379,44	0,00	0,00	1.835.907,87	400.528,43	27,90%	27,90%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.032.448,99	0,00	0,00	2.430.567,36	398.118,37	19,59%	19,59%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.649.214,76	283.016,58	0,00	2.287.110,09	354.878,75	18,37%	18,94%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	719.907,92	0,00	0,00	959.047,02	239.139,10	33,22%	33,22%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.099.930,36	500.000,00	0,00	1.820.005,39	220.075,03	13,76%	16,71%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.734.564,94	0,00	0,00	1.948.995,51	214.430,57	12,36%	12,36%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.409.444,37	0,00	0,00	1.601.753,74	192.309,37	13,64%	13,64%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	521.727,65	0,00	0,00	694.262,31	172.534,66	33,07%	33,07%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	1.545.430,34	0,00	1.707.823,76	162.393,42	10,51%	25,94%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.184.790,39	0,00	0,00	1.309.516,59	124.726,20	10,53%	10,53%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	543.420,20	0,00	0,00	667.435,35	124.015,15	22,82%	22,82%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	523.827,89	0,00	0,00	638.205,42	114.377,53	21,83%	21,83%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	722.868,85	500.000,00	0,00	1.333.105,97	110.237,12	9,01%	10,97%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	380.257,77	68.445,46	0,00	509.280,08	60.576,85	13,50%	15,07%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	188.601,43	0,00	0,00	222.376,44	33.775,01	17,91%	17,91%
OSASCO PROPERTIES FII	216.105,14	0,00	0,00	214.446,14	-1.659,00	-0,77%	-
META VALOR FI AÇÕES	2.295.669,94	0,00	2.045.430,34	0,00	-250.239,60	-10,90%	1,25%
Total Renda Variável	16.658.160,04	2.896.892,38	2.045.430,34	20.179.839,04	2.670.216,96	15,25%	



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 AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	818.271,05	0,00	0,00	963.720,41	145.449,36	17,78%	17,78%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	423.005,24	0,00	0,00	528.425,32	105.420,08	24,92%	24,92%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	454.209,58	0,00	0,00	542.440,83	88.231,25	19,43%	19,43%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	439.994,20	0,00	0,00	446.587,77	6.593,57	1,50%	1,50%
Total Exterior	2.135.480,07	0,00	0,00	2.481.174,33	345.694,26	16,19%	

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.

