

Relatório Analítico dos Investimentos

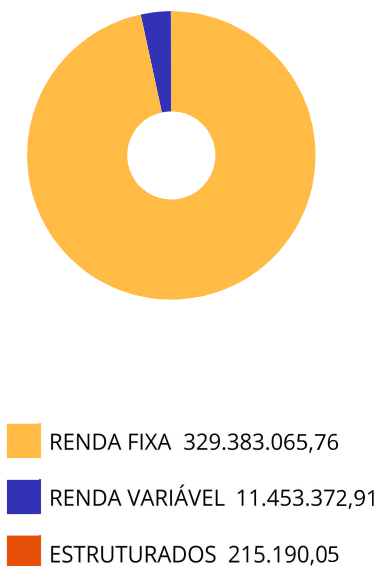
em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.708.736,54	0,79%	649	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.410.830,55	2,17%	1.141	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	580.867,22	0,17%	140	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	81.312.480,03	23,84%	370	2,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	40.441.749,87	11,86%	305	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.043.420,51	0,60%	282	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.677.844,13	1,66%	769	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	5.293.387,51	1,55%	248	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	26.758.656,89	7,85%	161	1,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	43.771.101,08	12,83%	1.133	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	56.454.070,09	16,55%	442	0,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	54.724.799,33	16,05%	988	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	353.871,40	0,10%	26	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	753.135,43	0,22%	31	1,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	1.098.115,18	0,32%	70	1,52%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	11.453.372,91	3,36%	204	1,38%	Artigo 8º, Inciso I
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	215.190,05	0,06%	41	5,89%	Artigo 10º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			341.051.628,72				

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%	1,80%	20,00%	68.210.325,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	145.469.316,36	42,65%	35,00%	73,00%	90,00%	161.477.149,49
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	34.105.162,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	182.815.634,22	53,60%	10,00%	15,00%	60,00%	21.815.343,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.821.032,57
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	34.105.162,87
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.098.115,18	0,32%	0,00%	0,50%	1,00%	2.312.401,11
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	10.231.548,86
Total Renda Fixa	100,00%	329.383.065,76	96,58%	45,00%	92,30%	196,00%	

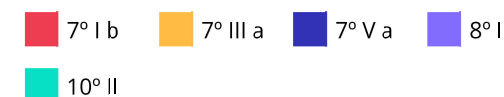
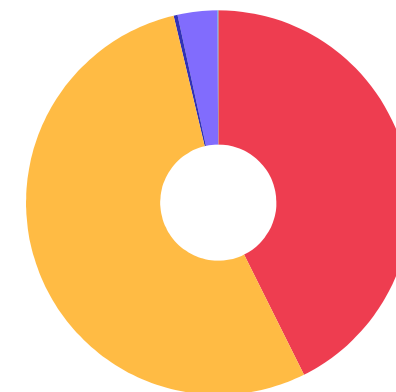




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	11.453.372,91	3,36%	0,00%	5,00%	30,00%	90.862.115,71
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	34.105.162,87
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	215.190,05	0,06%	0,00%	0,20%	1,00%	3.195.326,24
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	17.052.581,44
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	11.668.562,96	3,42%	0,00%	6,70%	46,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	34.105.162,87
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	162.542.672,31	47,66	-
CAIXA DTVM	119.634.574,26	35,08	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	56.454.070,09	16,55	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.313.305,23	0,39	-
PLURAL	753.135,43	0,22	-
RJI CORRETORA DE VALORES	353.871,40	0,10	-

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 '	145.469.316,36	42,65	35,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	182.815.634,22	53,60	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.098.115,18	0,32	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	11.453.372,91	3,36	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	215.190,05	0,06	0,00	1,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	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
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,10%	11,85%	2,81%	5,20%	11,94%	26,71%	-	-
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,94%	19,28%	6,42%	3,80%	19,28%	23,21%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,93%	18,90%	6,40%	3,87%	18,90%	22,53%	2,38%	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%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	5,16%	2,16%	2,60%	5,16%	8,48%	0,34%	0,04%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-9,60%	-18,89%	-9,67%	-20,99%	-18,89%	-15,58%	16,71%	0,19%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-18,39%	-23,70%	-18,64%	-19,20%	-23,70%	-38,78%	31,01%	0,19%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,73%	15,86%	4,71%	4,15%	15,86%	23,03%	1,44%	0,04%
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%

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

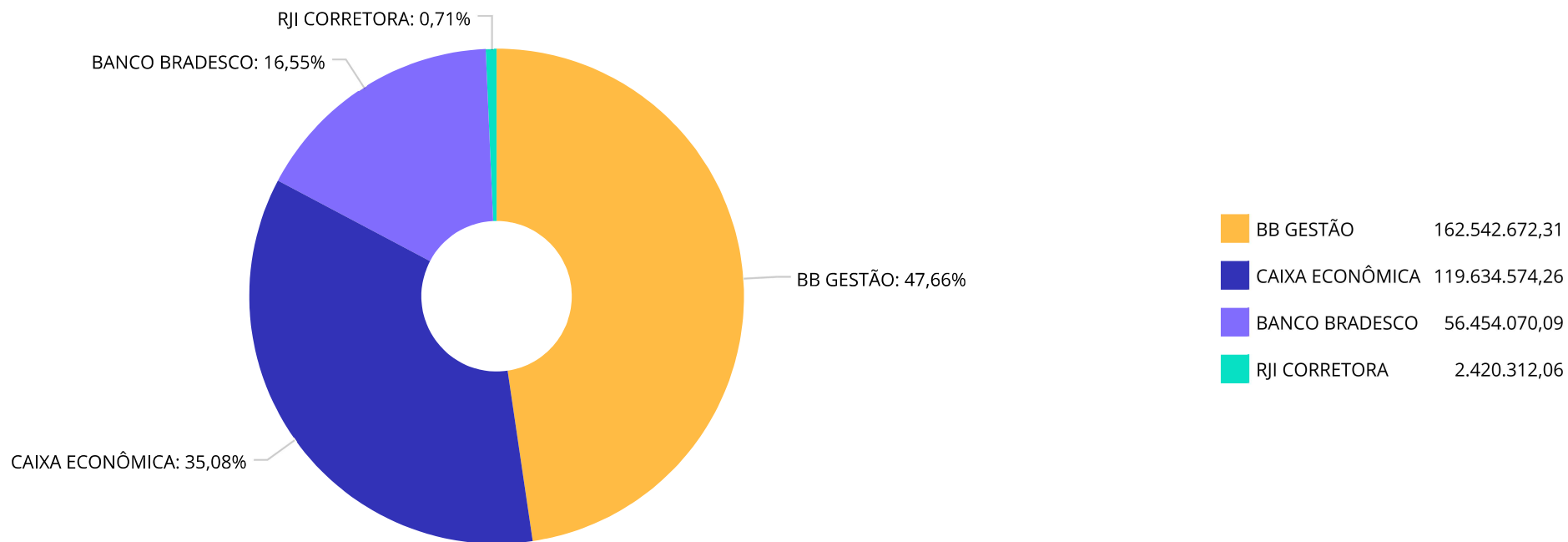
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,00%	12,75%	3,01%	6,42%	12,75%	27,07%	0,12%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	12,98%	2,83%	6,15%	12,98%	27,20%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92%	13,32%	2,94%	6,48%	13,32%	27,68%	0,02%	0,00%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94%	13,63%	3,01%	6,66%	13,63%	28,40%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	11,17%	2,16%	5,32%	11,17%	-	0,34%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	11,14%	2,15%	5,30%	11,14%	22,95%	0,33%	0,01%



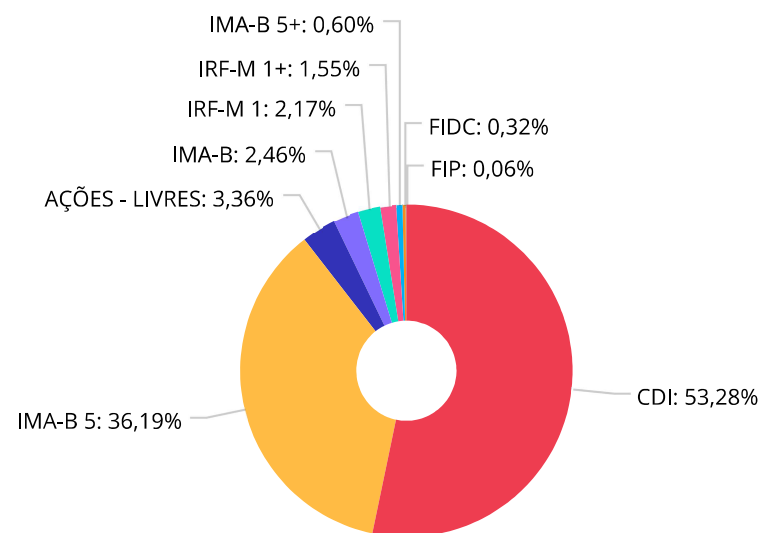
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,18%	12,89%	3,05%	5,69%	12,99%	29,09%	-	-
PUMA FIP MULTISTRATÉGIA	-0,10%	-1,18%	-0,29%	-0,59%	-1,18%	-3,21%	-	-

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



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

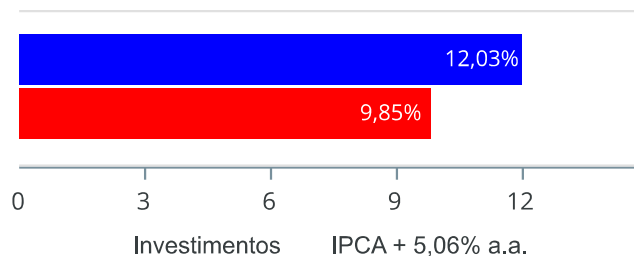


■ CDI	181.708.627,39	■ IMA-B 5	123.442.103,95	■ AÇÕES - LIVRES	11.453.372,91	■ IMA-B	8.386.580,67
■ IRF-M 1	7.410.830,55	■ IRF-M 1+	5.293.387,51	■ IMA-B 5+	2.043.420,51	■ FIDC	1.098.115,18
■ FIP	215.190,05						

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	288.183.261,81	53.082.304,08	52.580.501,19	292.328.916,92	3.643.852,22	3.643.852,22	1,26%	1,26%	0,96%	0,96%	130,92%	0,90%
Fevereiro	292.328.916,92	5.734.863,33	4.717.529,57	295.936.094,31	2.589.843,63	6.233.695,85	0,88%	2,16%	1,20%	2,17%	99,28%	1,48%
Março	295.936.094,31	2.800.000,00	1.950.000,00	300.136.590,49	3.350.496,18	9.584.192,03	1,13%	3,31%	1,16%	3,36%	98,44%	0,75%
Abril	300.136.590,49	2.694.976,10	1.970.000,00	303.185.410,02	2.323.843,43	11.908.035,46	0,77%	4,11%	0,97%	4,36%	94,21%	0,58%
Mai	303.185.410,02	17.642.515,00	16.677.502,40	306.505.210,68	2.354.788,06	14.262.823,52	0,77%	4,91%	0,66%	5,05%	97,27%	0,59%
Junho	306.505.210,68	7.975.109,11	3.130.000,00	315.386.820,02	4.036.500,23	18.299.323,75	1,30%	6,27%	0,33%	5,40%	116,18%	0,59%
Julho	315.386.820,02	51.793.654,26	50.901.585,70	319.830.107,07	3.551.218,49	21.850.542,24	1,12%	7,47%	0,53%	5,96%	125,25%	0,67%
Agosto	319.830.107,07	6.531.301,46	5.520.725,05	323.008.407,10	2.167.723,62	24.018.265,86	0,68%	8,19%	0,68%	6,68%	122,56%	1,26%
Setembro	323.008.407,10	3.575.985,83	2.130.000,00	326.506.854,04	2.052.461,11	26.070.726,97	0,63%	8,88%	0,65%	7,38%	120,26%	0,85%
Outubro	326.506.854,04	68.524.354,79	67.405.155,89	328.987.222,20	1.361.169,26	27.431.896,23	0,42%	9,33%	0,65%	8,08%	115,42%	0,59%
Novembro	328.987.222,20	3.261.980,80	2.180.000,00	334.502.667,51	4.433.464,51	31.865.360,74	1,34%	10,80%	0,67%	8,81%	122,55%	0,51%
Dezembro	334.502.667,51	4.975.733,52	2.170.000,00	341.051.628,72	3.743.227,69	35.608.588,43	1,11%	12,03%	0,95%	9,85%	122,11%	0,45%

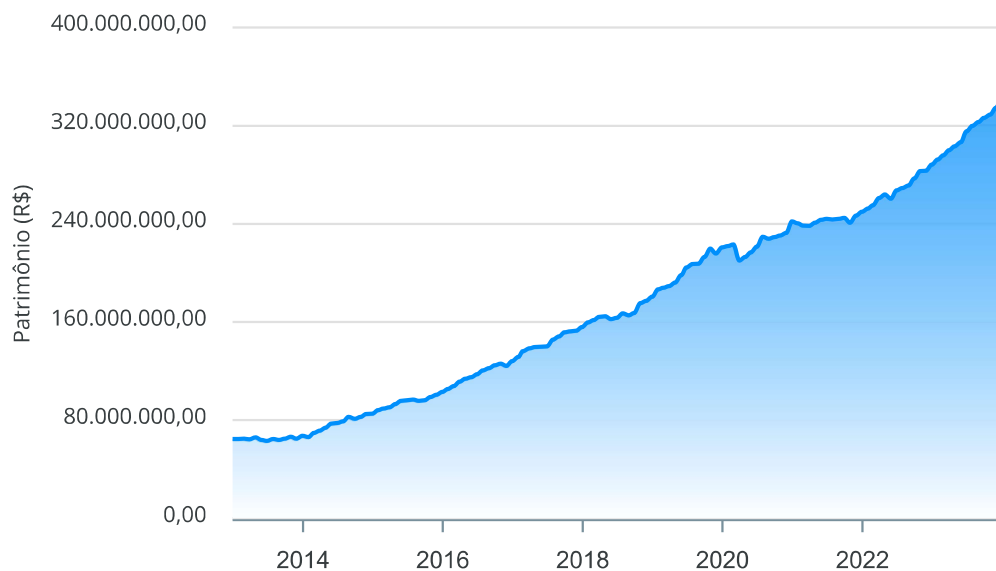
Investimentos x Meta de Rentabilidade



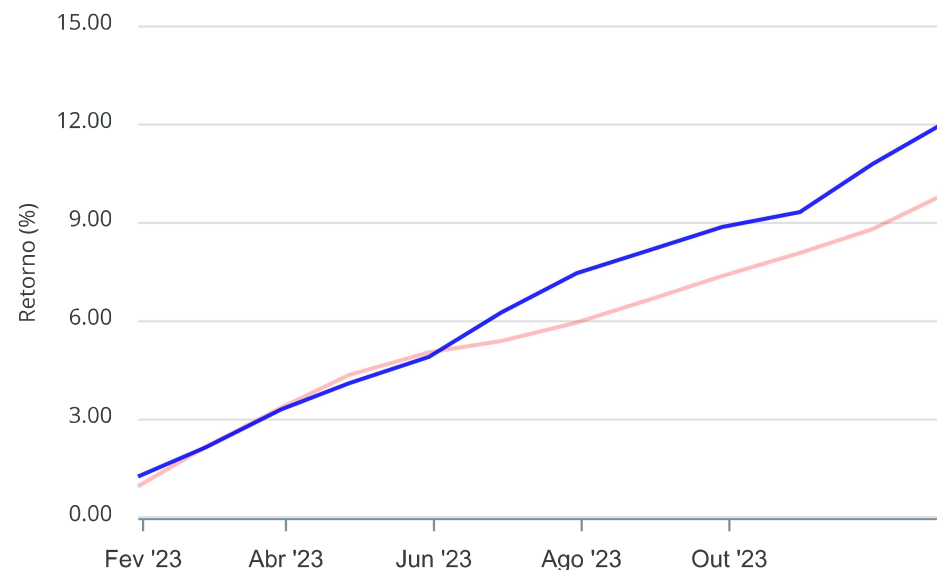
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.966.115,67	0,00	0,00	2.043.420,51	77.304,84	3,93%	3,93%	2,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.636.406,11	0,00	0,00	2.708.736,54	72.330,43	2,74%	2,74%	1,46%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.527.141,64	0,00	0,00	5.677.844,13	150.702,49	2,73%	2,73%	1,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.204.475,74	0,00	0,00	5.293.387,51	88.911,77	1,71%	1,71%	0,94%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	26.494.038,16	0,00	0,00	26.758.656,89	264.618,73	1,00%	1,00%	0,12%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	55.929.608,72	0,00	0,00	56.454.070,09	524.461,37	0,94%	0,94%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	80.568.704,13	0,00	0,00	81.312.480,03	743.775,90	0,92%	0,92%	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	40.071.881,70	0,00	0,00	40.441.749,87	369.868,17	0,92%	0,92%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	575.571,20	0,00	0,00	580.867,22	5.296,02	0,92%	0,92%	0,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	56.091.155,34	180.733,52	2.060.000,00	54.724.799,33	512.910,47	0,91%	0,92%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.245.726,59	210.000,00	110.000,00	7.410.830,55	65.103,96	0,87%	0,89%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	38.820.578,63	4.585.000,00	0,00	43.771.101,08	365.522,45	0,84%	0,90%	0,01%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.102.983,00	0,00	0,00	1.098.115,18	-4.867,82	-0,44%	-0,44%	0,63%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	391.431,89	0,00	0,00	353.871,40	-37.560,49	-9,60%	-9,60%	16,71%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	922.879,35	0,00	0,00	753.135,43	-169.743,92	-18,39%	-18,39%	31,01%
Total Renda Fixa	323.548.697,87	4.975.733,52	2.170.000,00	329.383.065,76	3.028.634,37	0,93%		0,30%



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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	10.738.574,55	0,00	0,00	11.453.372,91	714.798,36	6,66%	6,66%	4,77%
PUMA FIP MULTISTRATÉGIA	215.395,09	0,00	0,00	215.190,05	-205,04	-0,10%	-	-
Total Renda Variável	10.953.969,64	0,00	0,00	11.668.562,96	714.593,32	6,52%		4,77%



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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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 TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	79.592.915,28	0,00	0,00	81.312.480,03	1.719.564,75	2,16%	2,16%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	29.391.708,47	25.643.166,29	0,00	56.454.070,09	1.419.195,33	2,58%	3,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.096.648,51	35.073.490,78	4.785.000,00	54.724.799,33	1.339.660,04	2,30%	2,94%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	28.856.711,45	15.200.000,00	1.300.000,00	43.771.101,08	1.014.389,63	2,30%	2,83%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	39.586.461,42	0,00	0,00	40.441.749,87	855.288,45	2,16%	2,16%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	25.975.843,57	0,00	0,00	26.758.656,89	782.813,32	3,01%	3,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	20.399.319,11	0,00	15.000.000,00	5.677.844,13	278.525,02	1,37%	4,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.041.194,39	0,00	0,00	5.293.387,51	252.193,12	5,00%	5,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.836.932,49	790.000,00	415.000,00	7.410.830,55	198.898,06	2,61%	2,80%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	25.459.155,00	0,00	25.643.166,29	0,00	184.011,29	0,72%	4,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.913.302,13	0,00	4.000.000,00	2.043.420,51	130.118,38	2,20%	6,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.596.814,74	0,00	5.000.000,00	2.708.736,54	111.921,80	1,47%	4,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.535.159,43	55.412,04	15.611.989,60	0,00	21.418,13	0,14%	2,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	568.622,10	0,00	0,00	580.867,22	12.245,12	2,15%	2,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.111.634,31	0,00	0,00	1.098.115,18	-13.519,13	-1,22%	-1,22%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	391.755,85	0,00	0,00	353.871,40	-37.884,45	-9,67%	-9,67%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	925.648,60	0,00	0,00	753.135,43	-172.513,17	-18,64%	-18,64%
Total Renda Fixa	316.279.826,85	76.762.069,11	71.755.155,89	329.383.065,76	8.096.325,69	2,52%	



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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	10.011.211,14	0,00	0,00	11.453.372,91	1.442.161,77	14,41%	14,41%
PUMA FIP MULTISTRATÉGIA	215.816,05	0,00	0,00	215.190,05	-626,00	-0,29%	-0,29%
Total Renda Variável	10.227.027,19	0,00	0,00	11.668.562,96	1.441.535,77	14,10%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	77.361.991,13	0,00	4.422.710,11	81.312.480,03	8.373.199,01	10,82%	11,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	36.048.123,19	46.848.503,38	33.335.000,00	54.724.799,33	5.163.172,76	6,23%	13,32%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	38.456.787,02	0,00	2.177.144,90	40.441.749,87	4.162.107,75	10,82%	5,16%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.096.949,58	42.327.728,49	0,00	56.454.070,09	4.029.392,02	7,69%	13,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	29.615.342,32	37.125.096,51	26.050.000,00	43.771.101,08	3.080.662,25	4,62%	12,98%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	23.832.878,55	0,00	26.758.656,89	2.925.778,34	12,28%	12,74%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	6.053.990,05	18.415.207,88	25.643.166,29	0,00	1.173.968,36	4,80%	16,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	15.481.256,15	2.380.000,00	18.979.330,41	0,00	1.118.074,26	6,26%	11,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	22.962.249,38	120.000,00	23.952.255,29	0,00	870.005,91	3,77%	11,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.378.342,56	3.080.000,00	1.810.000,00	7.410.830,55	762.487,99	9,01%	12,88%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.783.056,98	74.702,76	14.587.502,40	0,00	729.742,66	5,27%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	15.166.405,42	15.611.989,60	0,00	445.584,18	2,94%	11,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.293.387,51	293.387,51	5,87%	18,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	20.457.255,29	15.000.000,00	5.677.844,13	220.588,84	1,08%	15,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	553.904,10	0,00	32.755,27	580.867,22	59.718,39	10,78%	11,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	6.040.000,00	4.000.000,00	2.043.420,51	3.420,51	0,06%	18,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.926.414,06	0,00	3.926.900,12	0,00	486,06	0,01%	15,77%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	436.279,28	0,00	75.471,15	353.871,40	-6.936,73	-1,59%	-18,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	7.725.000,00	5.000.000,00	2.708.736,54	-16.263,46	-0,21%	15,77%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.136.437,19	0,00	0,00	1.098.115,18	-38.322,01	-3,37%	-3,37%



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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	16.732.620,88	0,00	16.684.562,20	0,00	-48.058,68	-0,29%	15,71%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	987.098,19	0,00	44.212,06	753.135,43	-189.750,70	-19,22%	-23,70%
Total Renda Fixa	279.010.842,06	228.592.778,28	211.332.999,80	329.383.065,76	33.112.445,22	11,18%	



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	8.954.662,92	0,00	0,00	11.453.372,91	2.498.709,99	27,90%	27,90%
PUMA FIP MULTISTRATÉGIA	217.756,83	0,00	0,00	215.190,05	-2.566,78	-1,18%	-1,18%
Total Renda Variável	9.172.419,75	0,00	0,00	11.668.562,96	2.496.143,21	27,21%	

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.

