

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	5.603.337,19	3,64%	884	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	2.078.288,40	1,35%	96	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	2.553.263,73	1,66%	314	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	10.019.241,62	6,51%	370	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.728.319,71	1,77%	245	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	10.332.759,70	6,72%	207	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.710.998,14	3,06%	788	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.236.742,06	7,95%	850	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.359.556,77	5,43%	51	3,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.291.227,60	4,74%	914	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.303.539,31	4,10%	769	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	3.117.197,62	2,03%	157	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.654.164,95	4,33%	1.190	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.565.798,93	5,57%	445	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.223.483,61	0,80%	724	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	551.196,77	0,36%	216	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.092.592,51	0,71%	1.574	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	7.491.361,39	4,87%	149	1,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.250.241,61	1,46%	30	1,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.278.757,44	6,03%	442	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

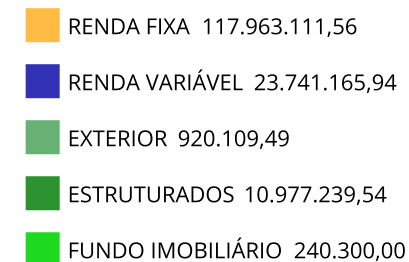
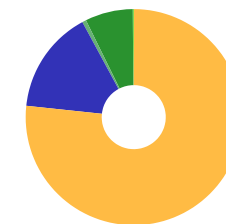
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.494.097,84	2,92%	117	0,60%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	948.131,68	0,62%	226	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	78.812,98	0,05%	98	0,27%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	451.108,86	0,29%	2.736	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	1.916.336,29	1,25%	19.333	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.311.634,57	0,85%	1.330	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.306.484,91	1,50%	436	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.893.011,79	1,88%	127	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.622.394,85	1,70%	938	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.828.457,70	2,49%	204	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	288.051,38	0,19%	6.142	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.385.188,45	1,55%	117	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	986.680,36	0,64%	13.834	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	508.925,30	0,33%	16.251	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.457.485,57	0,95%	3.939	0,63%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.785.405,91	1,81%	58	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	920.109,49	0,60%	468	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	824.119,65	0,54%	41.223	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.827.838,16	1,19%	4.969	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.288.357,80	1,49%	111	0,40%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	2.520.070,90	1,64%	583	1,25%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	3.516.853,03	2,29%	20	1,91%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	240.300,00	0,16%		0,17%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			153.841.926,53				

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

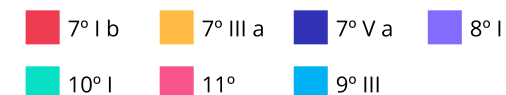
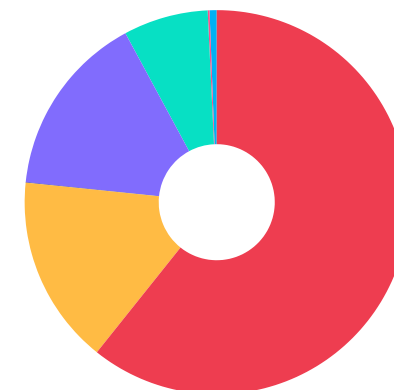
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	40,00%	61.536.770,61
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	93.421.708,62	60,73%	15,00%	58,00%	90,00%	45.036.025,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	15.384.192,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	24.462.589,96	15,90%	4,00%	15,00%	60,00%	67.842.565,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	3.076.838,53
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	7.692.096,33
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	78.812,98	0,05%	0,00%	0,10%	1,00%	1.459.606,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	3,00%	4.615.257,80
Total Renda Fixa	100,00%	117.963.111,56	76,68%	19,00%	76,60%	211,00%	



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%	23.741.165,94	15,43%	0,00%	16,00%	30,00%	22.411.412,02
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.977.239,54	7,14%	0,00%	6,75%	10,00%	4.406.953,11
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.692.096,33
Artigo 11º	5,00%	240.300,00	0,16%	0,00%	0,15%	5,00%	7.451.796,33
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	34.958.705,48	22,72%	0,00%	22,90%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	15.384.192,65
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	920.109,49	0,60%	0,00%	0,50%	10,00%	14.464.083,16
Total Exterior	10,00%	920.109,49	0,60%	0,00%	0,50%	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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	93.421.708,62	60,73	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	24.462.589,96	15,90	4,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	78.812,98	0,05	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	23.741.165,94	15,43	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	920.109,49	0,60	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	10.977.239,54	7,14	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	240.300,00	0,16	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ASSET	91.158.466,94	59,25	0,01
BRANCO ASSET MANAGEMENT	26.948.176,85	17,52	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.306.221,45	15,80	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	3.516.853,03	2,29	0,21
TARPON INVESTIMENTOS	2.785.405,91	1,81	-
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	1.537.877,13	1,00	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.457.485,57	0,95	0,02
SICREDI	1.092.592,51	0,71	0,00
PLURAL	508.925,30	0,33	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	451.108,86	0,29	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	78.812,98	0,05	0,09

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 PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	1,50%	17,03%	4,33%	6,37%	17,03%	26,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	1,45%	16,49%	4,27%	6,18%	16,49%	-	0,78%	3,11%
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%	1,99%
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%
IMA Geral (Benchmark)	1,63%	14,80%	3,81%	5,67%	14,80%	25,89%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,60%	14,71%	3,78%	5,51%	14,71%	25,52%	0,58%	2,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,59%	13,99%	3,52%	5,10%	13,99%	24,59%	0,59%	2,22%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,60%	14,62%	3,77%	5,50%	14,62%	25,54%	0,58%	1,94%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,91%	13,25%	2,89%	6,16%	13,25%	26,86%	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	13,00%	2,81%	6,03%	13,00%	26,31%	0,04%	0,35%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	11,96%	2,92%	4,64%	11,96%	22,79%	0,48%	1,97%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,73%	15,86%	4,71%	4,15%	15,86%	23,03%	1,44%	4,47%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,77%	15,98%	4,76%	4,21%	15,98%	22,96%	1,48%	4,59%
IRF-M (Benchmark)	1,48%	16,51%	4,38%	6,28%	16,51%	26,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	16,32%	4,33%	6,17%	16,32%	26,46%	0,66%	2,64%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94%	13,63%	3,01%	6,66%	13,63%	28,40%	0,01%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	12,98%	2,79%	6,04%	12,98%	27,02%	0,01%	0,08%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,49%	-14,39%	-5,66%	-6,95%	-14,39%	-61,62%	0,08%	7,78%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,90%	13,01%	2,79%	6,12%	13,01%	26,95%	0,02%	0,05%
IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,55%	15,23%	3,64%	5,28%	15,23%	25,31%	0,56%	2,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	3,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	-	2,19%	5,37%	-	-	0,34%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	11,17%	2,16%	5,32%	11,17%	-	0,34%	1,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	1,29%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,98%	12,80%	2,54%	4,68%	12,80%	24,96%	0,07%	1,07%

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
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	-	2,19%	2,40%	-	-	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%	3,76%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,54%	12,77%	5,01%	7,04%	12,77%	28,27%	1,46%	3,85%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,86%	10,53%	4,18%	5,00%	10,53%	22,09%	0,82%	2,37%

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%	15,40%

Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	3,26%	25,46%	10,04%	13,01%	25,46%	-	3,55%	7,52%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,53%	14,06%	11,41%	12,64%	14,06%	-	3,75%	5,93%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,35%	11,45%	16,32%	13,22%	11,45%	17,20%	7,50%	15,76%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,40%	17,15%	10,44%	8,41%	17,15%	15,05%	6,16%	16,61%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,66%	27,90%	14,41%	12,47%	27,90%	31,07%	4,77%	16,77%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	9,85%	55,36%	11,54%	24,45%	55,36%	78,35%	5,20%	18,66%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	5,31%	17,76%	13,31%	12,39%	17,76%	15,97%	6,13%	17,25%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	6,11%	20,35%	14,96%	11,35%	20,35%	33,19%	6,42%	16,59%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	5,87%	20,61%	14,33%	12,31%	20,61%	26,38%	6,42%	17,37%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6,04%	16,67%	14,36%	12,12%	16,67%	12,62%	6,09%	16,85%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	6,26%	12,50%	11,91%	6,57%	12,50%	20,56%	6,34%	16,99%

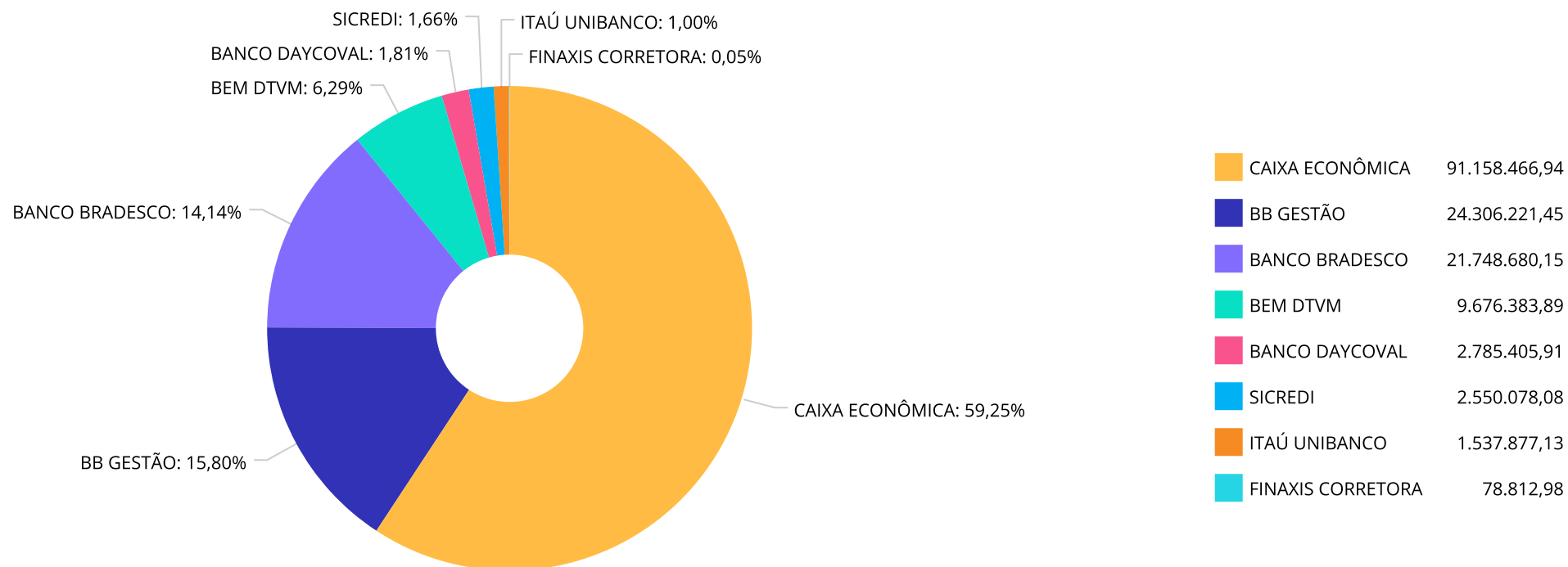
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	5,96%	5,54%	11,96%	-1,72%	5,54%	-22,24%	9,10%	24,25%
IFIX (Benchmark)	4,25%	15,50%	2,86%	4,95%	15,50%	18,06%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,42%	27,14%	-1,79%	1,81%	27,14%	17,38%	17,81%	23,92%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,42%	24,23%	11,24%	7,18%	24,23%	0,08%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5,08%	27,53%	12,14%	9,59%	27,53%	10,54%	4,63%	12,78%
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%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5,76%	3,50%	10,29%	-0,68%	3,50%	-5,04%	8,94%	21,72%

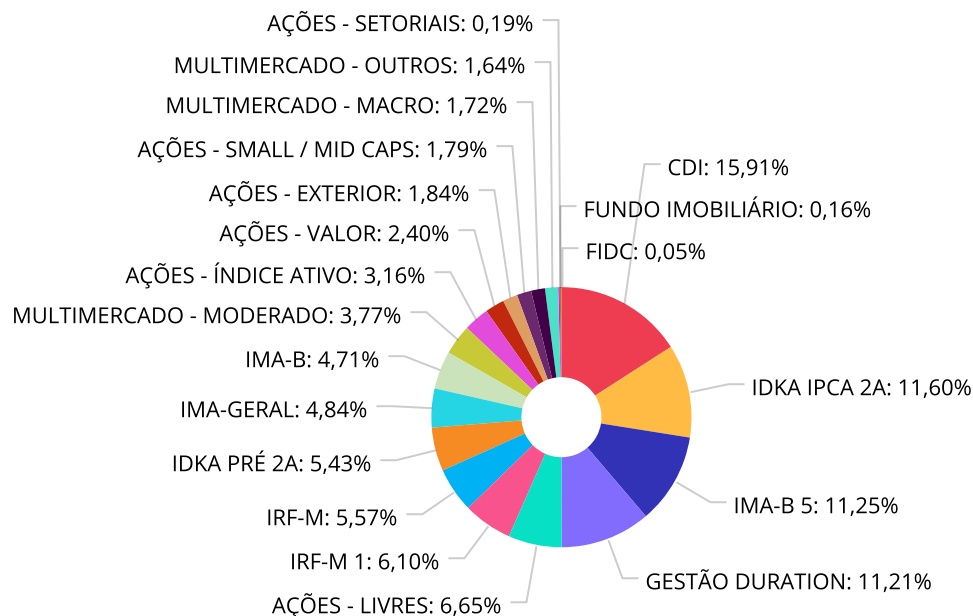
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,59%	24,92%	7,65%	9,07%	24,92%	-10,73%	4,08%	15,398%

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



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

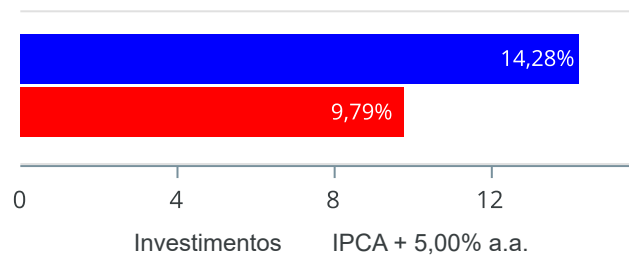


■ CDI	24.480.856,99	■ IDKA IPCA 2A	17.840.079,25	■ IMA-B 5	17.310.469,22	■ GESTÃO DURATION	17.247.654,14
■ AÇÕES - LIVRES	10.222.938,82	■ IRF-M 1	9.382.484,66	■ IRF-M	8.565.798,93	■ IDKA PRÉ 2A	8.359.556,77
■ IMA-GERAL	7.445.727,63	■ IMA-B	7.251.670,99	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.805.210,83	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	4.859.422,66
■ AÇÕES - VALOR	3.696.823,02	■ AÇÕES - EXTERIOR	2.836.445,78	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.757.593,77	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.651.957,81
■ MULTIMERCADO - OUTROS	2.520.070,90	■ AÇÕES - SETORIAIS	288.051,38	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	240.300,00	■ FIDC	78.812,98

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	126.374.466,93	1.150.000,00	757.680,00	128.711.354,14	1.944.567,21	1.944.567,21	1,53%	1,53%	0,96%	0,96%	159,94%	2,59%
Fevereiro	128.711.354,14	11.943.242,70	11.084.578,42	129.373.180,40	-196.838,02	1.747.729,19	-0,15%	1,38%	1,19%	2,16%	63,80%	2,11%
Março	129.373.180,40	1.357.908,81	825.680,00	130.873.446,51	968.037,30	2.715.766,49	0,75%	2,14%	1,16%	3,35%	63,79%	2,04%
Abril	130.873.446,51	1.688.092,15	842.680,00	132.940.924,33	1.222.065,67	3.937.832,16	0,93%	3,08%	0,96%	4,34%	71,02%	1,90%
Mai	132.940.924,33	19.057.821,72	18.573.731,59	135.728.100,16	2.303.085,70	6.240.917,86	1,73%	4,86%	0,66%	5,03%	96,72%	1,98%
Junho	135.728.100,16	1.533.359,66	862.680,00	139.604.414,46	3.205.634,64	9.446.552,50	2,35%	7,33%	0,33%	5,37%	136,42%	1,92%
Julho	139.604.414,46	1.539.953,63	1.341.800,00	141.753.241,31	1.950.673,22	11.397.225,72	1,40%	8,82%	0,53%	5,93%	148,89%	1,82%
Agosto	141.753.241,31	2.242.535,64	1.525.626,51	142.211.463,39	-258.687,05	11.138.538,67	-0,18%	8,63%	0,68%	6,64%	129,84%	2,03%
Setembro	142.211.463,39	10.402.164,03	9.401.710,00	143.708.928,05	497.010,63	11.635.549,30	0,35%	9,00%	0,65%	7,34%	122,73%	1,95%
Outubro	143.708.928,05	1.638.460,33	926.740,00	143.567.983,37	-852.665,01	10.782.884,29	-0,59%	8,36%	0,65%	8,03%	104,08%	2,35%
Novembro	143.567.983,37	1.637.586,86	1.865.740,00	147.995.273,25	4.655.443,02	15.438.327,31	3,24%	11,87%	0,67%	8,76%	135,62%	1,94%
Dezembro	147.995.273,25	2.604.573,21	1.740,00	153.841.926,53	3.243.820,07	18.682.147,38	2,15%	14,28%	0,95%	9,79%	145,92%	1,53%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



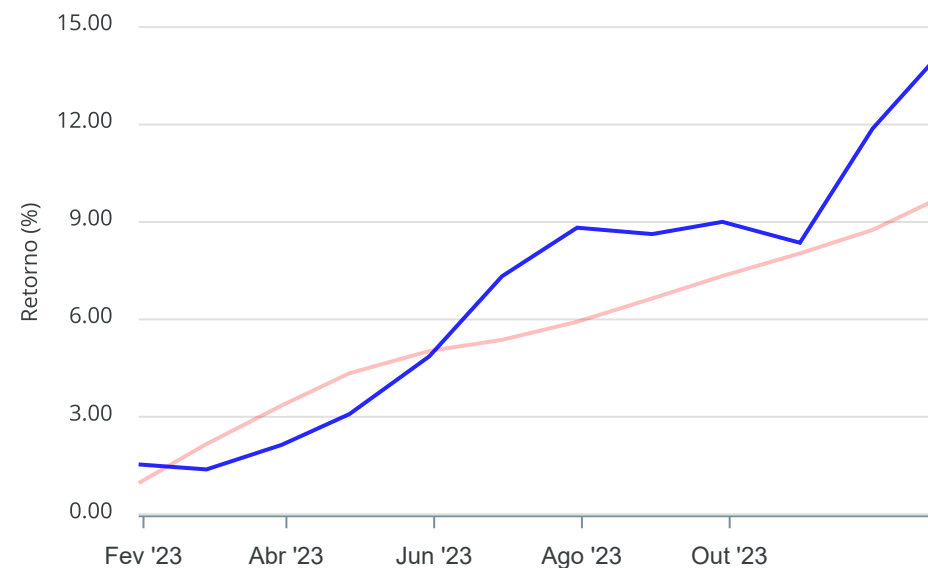
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	922.570,11	0,00	0,00	948.131,68	25.561,57	2,77%	2,77%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.117.775,24	1.030.000,00	0,00	6.303.539,31	155.764,07	2,53%	2,73%	1,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	542.460,50	0,00	0,00	551.196,77	8.736,27	1,61%	1,61%	0,78%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	3.068.139,16	0,00	0,00	3.117.197,62	49.058,46	1,60%	1,60%	0,58%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	2.045.595,46	0,00	0,00	2.078.288,40	32.692,94	1,60%	1,60%	0,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	2.215.036,71	0,00	0,00	2.250.241,61	35.204,90	1,59%	1,59%	0,59%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.376.999,85	0,00	0,00	7.491.361,39	114.361,54	1,55%	1,55%	0,56%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	8.239.992,65	0,00	0,00	8.359.556,77	119.564,12	1,45%	1,45%	0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.187.828,41	0,00	0,00	7.291.227,60	103.399,19	1,44%	1,44%	0,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.510.578,65	14.781,34	0,00	5.603.337,19	77.977,20	1,41%	1,41%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.067.574,99	0,00	0,00	12.236.742,06	169.167,07	1,40%	1,40%	0,43%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.959.747,38	1.500.000,00	0,00	8.565.798,93	106.051,55	1,25%	1,46%	0,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.654.795,46	0,00	0,00	4.710.998,14	56.202,68	1,21%	1,21%	0,28%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.450.451,27	0,00	0,00	4.494.097,84	43.646,57	0,98%	0,98%	0,07%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.192.557,28	0,00	0,00	9.278.757,44	86.200,16	0,94%	0,94%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.529.705,31	0,00	0,00	2.553.263,73	23.558,42	0,93%	0,93%	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.237.474,22	0,00	0,00	10.332.759,70	95.285,48	0,93%	0,93%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.927.594,30	0,00	0,00	10.019.241,62	91.647,32	0,92%	0,92%	0,34%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1.082.844,46	0,00	0,00	1.092.592,51	9.748,05	0,90%	0,90%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.212.606,02	0,00	0,00	1.223.483,61	10.877,59	0,90%	0,90%	0,01%

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
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.644.340,95	59.791,87	0,00	2.728.319,71	24.186,89	0,89%	0,90%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.595.707,52	0,00	0,00	6.654.164,95	58.457,43	0,89%	0,89%	0,03%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	79.197,75	0,00	0,00	78.812,98	-384,77	-0,49%	-0,49%	0,08%
Total Renda Fixa	113.861.573,65	2.604.573,21	0,00	117.963.111,56	1.496.964,70	1,29%		0,45%

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.535.710,67	0,00	0,00	2.785.405,91	249.695,24	9,85%	9,85%	5,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	919.086,31	0,00	0,00	986.680,36	67.594,05	7,35%	7,35%	7,50%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.589.525,87	0,00	0,00	3.828.457,70	238.931,83	6,66%	6,66%	4,77%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.722.707,10	0,00	0,00	2.893.011,79	170.304,69	6,25%	6,25%	6,34%
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.373.618,86	0,00	0,00	1.457.485,57	83.866,71	6,11%	6,11%	6,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.236.951,86	0,00	0,00	1.311.634,57	74.682,71	6,04%	6,04%	6,09%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	271.841,53	0,00	0,00	288.051,38	16.209,85	5,96%	5,96%	9,10%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.253.024,61	0,00	0,00	2.385.188,45	132.163,84	5,87%	5,87%	6,42%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.180.834,20	0,00	0,00	2.306.484,91	125.650,71	5,76%	5,76%	8,94%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.487.962,21	0,00	0,00	2.622.394,85	134.432,64	5,40%	5,40%	6,16%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	483.248,57	0,00	0,00	508.925,30	25.676,73	5,31%	5,31%	6,13%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	428.653,32	0,00	0,00	451.108,86	22.455,54	5,24%	5,24%	7,97%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.823.738,43	0,00	0,00	1.916.336,29	92.597,86	5,08%	5,08%	4,63%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3.396.799,83	0,00	0,00	3.516.853,03	120.053,20	3,53%	3,53%	3,75%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	2.440.419,42	0,00	0,00	2.520.070,90	79.651,48	3,26%	3,26%	3,55%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	234.630,00	0,00	1.740,00	240.300,00	7.410,00	3,16%	3,18%	17,81%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	809.099,05	0,00	0,00	824.119,65	15.020,60	1,86%	1,86%	0,82%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.795.207,37	0,00	0,00	1.827.838,16	32.630,79	1,82%	1,82%	1,31%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.253.746,81	0,00	0,00	2.288.357,80	34.610,99	1,54%	1,54%	1,46%
Total Renda Variável	33.236.806,02	0,00	1.740,00	34.958.705,48	1.723.639,46	5,19%		5,12%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	896.893,58	0,00	0,00	920.109,49	23.215,91	2,59%	2,59%	4,08%
Total Exterior	896.893,58	0,00	0,00	920.109,49	23.215,91	2,59%		4,08%

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 IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	8.017.247,08	0,00	0,00	8.359.556,77	342.309,69	4,27%	4,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.848.256,72	0,00	952.000,00	12.236.742,06	340.485,34	2,65%	2,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.768.582,48	1.500.000,00	0,00	8.565.798,93	297.216,45	3,59%	4,33%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.007.562,00	0,00	0,00	9.278.757,44	271.195,44	3,01%	3,01%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.228.028,16	0,00	0,00	7.491.361,39	263.333,23	3,64%	3,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.021.046,96	1.030.000,00	0,00	6.303.539,31	252.492,35	4,17%	4,71%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.111.841,61	0,00	0,00	10.332.759,70	220.918,09	2,18%	2,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.807.358,58	0,00	0,00	10.019.241,62	211.883,04	2,16%	2,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.988.238,10	0,00	900.000,00	7.291.227,60	202.989,50	2,54%	2,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.584.881,57	2.910.000,00	0,00	6.654.164,95	159.283,38	2,45%	2,83%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.409.651,78	36.953,35	0,00	5.603.337,19	156.732,06	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.577.203,44	0,00	0,00	4.710.998,14	133.794,70	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	3.003.757,50	0,00	0,00	3.117.197,62	113.440,12	3,78%	3,78%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.382.723,09	0,00	0,00	4.494.097,84	111.374,75	2,54%	2,54%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	2.173.650,72	0,00	0,00	2.250.241,61	76.590,89	3,52%	3,52%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	2.002.717,27	0,00	0,00	2.078.288,40	75.571,13	3,77%	3,77%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.253.102,94	403.667,05	0,00	2.728.319,71	71.549,72	2,69%	2,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	2.498.672,68	0,00	0,00	2.553.263,73	54.591,05	2,18%	2,18%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.110.033,68	0,00	937.000,00	1.223.483,61	50.449,93	2,39%	2,79%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	905.034,77	0,00	0,00	948.131,68	43.096,91	4,76%	4,76%

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
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1.062.989,19	0,00	0,00	1.092.592,51	29.603,32	2,78%	2,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	529.818,39	0,00	0,00	551.196,77	21.378,38	4,04%	4,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	83.540,94	0,00	0,00	78.812,98	-4.727,96	-5,66%	-5,66%
Total Renda Fixa	111.375.939,65	5.880.620,40	2.789.000,00	117.963.111,56	3.495.551,51	3,05%	

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	3.346.394,01	0,00	0,00	3.828.457,70	482.063,69	14,41%	14,41%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3.156.773,07	0,00	0,00	3.516.853,03	360.079,96	11,41%	11,41%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.585.236,78	0,00	0,00	2.893.011,79	307.775,01	11,91%	11,91%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.086.170,07	0,00	0,00	2.385.188,45	299.018,38	14,33%	14,33%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.497.312,30	0,00	0,00	2.785.405,91	288.093,61	11,54%	11,54%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.374.598,91	0,00	0,00	2.622.394,85	247.795,94	10,44%	10,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	2.290.161,92	0,00	0,00	2.520.070,90	229.908,98	10,04%	10,04%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.091.293,55	0,00	0,00	2.306.484,91	215.191,36	10,29%	10,29%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.708.880,75	0,00	0,00	1.916.336,29	207.455,54	12,14%	12,14%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.267.807,63	0,00	0,00	1.457.485,57	189.677,94	14,96%	14,96%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.146.922,16	0,00	0,00	1.311.634,57	164.712,41	14,36%	14,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	848.256,72	0,00	0,00	986.680,36	138.423,64	16,32%	16,32%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.179.285,83	0,00	0,00	2.288.357,80	109.071,97	5,00%	5,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.742.797,72	0,00	0,00	1.827.838,16	85.040,44	4,88%	4,88%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	449.141,06	0,00	0,00	508.925,30	59.784,24	13,31%	13,31%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	414.206,34	0,00	0,00	451.108,86	36.902,52	8,91%	8,91%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	791.038,83	0,00	0,00	824.119,65	33.080,82	4,18%	4,18%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	257.289,11	0,00	0,00	288.051,38	30.762,27	11,96%	11,96%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	244.680,00	0,00	5.220,00	240.300,00	840,00	0,34%	-1,79%
Total Renda Variável	31.478.246,76	0,00	5.220,00	34.958.705,48	3.485.678,72	11,07%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	854.741,64	0,00	0,00	920.109,49	65.367,85	7,65%	7,65%
Total Exterior	854.741,64	0,00	0,00	920.109,49	65.367,85	7,65%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.885.523,36	2.190.000,00	7.660.000,00	12.236.742,06	1.821.218,70	11,56%	11,90%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	10.164.865,91	2.000.000,00	9.278.757,44	1.113.891,53	11,55%	13,63%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.953.743,94	507.102,84	10.000.000,00	7.491.361,39	1.030.514,61	14,72%	15,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.265.531,56	265.898,42	537.301,48	10.019.241,62	1.025.113,12	11,12%	11,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.887.064,59	500.000,00	5.090.000,00	7.291.227,60	994.163,01	11,46%	11,96%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	1.689.070,66	5.800.000,00	0,00	8.359.556,77	870.486,11	15,57%	16,49%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.051.302,90	4.725.000,00	0,00	8.565.798,93	789.496,03	15,39%	16,32%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.775.476,87	0,00	15.555.138,68	0,00	779.661,81	5,28%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.774.603,85	90.911,48	2.000.000,00	5.603.337,19	737.821,86	11,67%	11,72%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	289.617,21	10.332.759,70	622.376,91	6,31%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.594.266,56	600.000,00	0,00	4.710.998,14	516.731,58	13,56%	13,59%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.984.017,38	0,00	0,00	4.494.097,84	510.080,46	12,79%	12,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.972.222,62	3.940.000,00	1.718.000,00	6.654.164,95	459.942,33	12,27%	13,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	422.852,18	5.550.000,00	0,00	6.303.539,31	330.687,13	14,96%	15,86%
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.575.988,99	893.543,85	0,00	2.728.319,71	258.786,87	12,96%	13,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.919.712,61	0,00	937.000,00	1.223.483,61	240.771,00	12,99%	12,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	2.474.212,21	62.896,24	2.553.263,73	141.947,76	6,08%	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	0,00	3.000.000,00	0,00	3.117.197,62	117.197,62	3,90%	14,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.032.311,85	0,00	2.139.912,91	0,00	107.601,06	5,29%	13,43%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.092.592,51	92.592,51	9,26%	13,01%

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 IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.078.288,40	78.288,40	3,92%	14,62%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,00	2.172.164,03	0,00	2.250.241,61	78.077,58	3,60%	13,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	475.827,23	0,00	0,00	551.196,77	75.369,54	15,83%	15,84%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,00	922.000,00	0,00	948.131,68	26.131,68	2,84%	15,98%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	92.056,91	0,00	0,00	78.812,98	-13.243,93	-14,39%	-14,39%
Total Renda Fixa	96.351.574,06	56.795.698,74	47.989.866,52	117.963.111,56	12.805.705,28	12,18%	

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	1.792.901,10	0,00	0,00	2.785.405,91	992.504,81	55,38%	55,36%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.993.227,27	0,00	0,00	3.828.457,70	835.230,43	27,90%	27,90%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	2.008.728,28	0,00	0,00	2.520.070,90	511.342,62	25,45%	25,46%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3.083.404,60	0,00	0,00	3.516.853,03	433.448,43	14,06%	14,06%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.502.681,18	0,00	0,00	1.916.336,29	413.655,11	27,51%	27,53%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.977.629,10	0,00	0,00	2.385.188,45	407.559,35	20,60%	20,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.238.598,34	0,00	0,00	2.622.394,85	383.796,51	17,14%	17,14%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.571.521,72	0,00	0,00	2.893.011,79	321.490,07	12,50%	12,50%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.029.276,23	0,00	0,00	2.288.357,80	259.081,57	12,77%	12,77%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.211.040,54	0,00	0,00	1.457.485,57	246.445,03	20,37%	20,35%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.608.384,69	0,00	0,00	1.827.838,16	219.453,47	13,65%	13,64%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.124.194,84	0,00	0,00	1.311.634,57	187.439,73	16,68%	16,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	885.328,71	0,00	0,00	986.680,36	101.351,65	11,45%	11,45%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	745.625,56	0,00	0,00	824.119,65	78.494,09	10,54%	10,53%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.228.422,73	0,00	0,00	2.306.484,91	78.062,18	3,50%	3,50%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	432.161,70	0,00	0,00	508.925,30	76.763,60	17,76%	17,76%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	189.000,00	0,00	20.520,00	240.300,00	71.820,00	39,67%	27,14%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	391.279,09	0,00	0,00	451.108,86	59.829,77	15,28%	15,29%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	272.938,20	0,00	0,00	288.051,38	15.113,18	5,53%	5,54%

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
Total Renda Variável	29.286.343,88	0,00	20.520,00	34.958.705,48	5.692.881,60	19,44%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	736.548,99	0,00	0,00	920.109,49	183.560,50	24,92%	24,92%
Total Exterior	736.548,99	0,00	0,00	920.109,49	183.560,50	24,92%	

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.

