

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023



Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

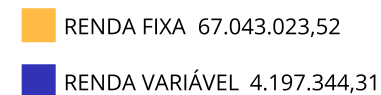
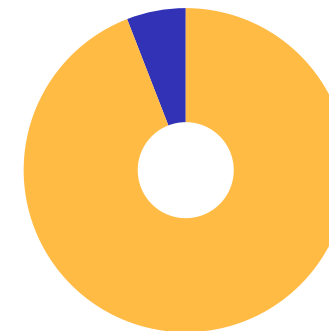
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.127.437,47	8,60%	884	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.519.053,90	4,94%	789	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	2.131.035,78	2,99%	289	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.333.066,99	3,27%	649	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.058.180,92	2,89%	1.141	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.369.555,15	4,73%	633	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	1.729.920,62	2,43%	370	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	5.810.215,90	8,16%	226	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	4.186.089,14	5,88%	305	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	3.055.983,34	4,29%	50	1,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.950.004,13	5,54%	914	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.845.849,11	6,80%	282	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	2.422.128,16	3,40%	157	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.606.989,47	6,47%	1.190	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.745.197,30	3,85%	248	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.378.454,12	1,93%	216	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	5.566.145,90	7,81%	1.133	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.144.977,98	8,63%	226	0,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	222.193,10	0,31%	18	0,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	505.970,79	0,71%	614	0,07%	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
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	282.351,41	0,40%	15	0,64%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	52.222,84	0,07%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.951.556,09	2,74%	82	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.175.547,49	1,65%	13.834	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.070.240,73	1,50%	65	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			71.240.367,83				

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%	0,00%	20,00%	14.248.073,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	54.269.161,50	76,18%	15,00%	60,50%	90,00%	9.847.169,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	12.721.639,18	17,86%	10,00%	26,00%	60,00%	30.022.581,52
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	14.248.073,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	52.222,84	0,07%	0,00%	0,10%	1,00%	660.180,84
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	3,00%	2.137.211,03
Total Renda Fixa	100,00%	67.043.023,52	94,11%	25,00%	88,10%	194,00%	

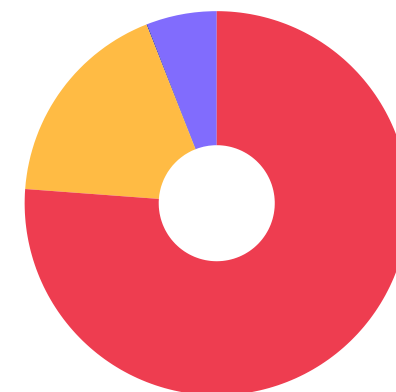


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	4.197.344,31	5,89%	0,00%	9,00%	20,00%	10.050.729,26
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,90%	8,00%	5.699.229,43
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	4.197.344,31	5,89%	0,00%	10,90%	28,00%	

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%	7.124.036,78
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.562.018,39



7º I b 7º III a 7º V a 8º I

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 '	54.269.161,50	76,18	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	12.721.639,18	17,86	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	52.222,84	0,07	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	4.197.344,31	5,89	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	8,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	39.718.990,62	55,75	0,16
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.834.396,73	37,67	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	3.624.242,34	5,09	0,00
SICREDI	505.970,79	0,71	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	504.544,51	0,71	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	52.222,84	0,07	0,06

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
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,95%	9,79%	2,32%	4,21%	9,85%	22,02%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,69%	-	0,33%	1,16%	-	-	0,81%	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,45%	12,13%	2,89%	5,00%	12,13%	22,60%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	11,72%	2,89%	4,84%	11,72%	22,14%	0,45%	2,00%
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%
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%	3,90%
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%	6,99%
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%	6,92%
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%	0,35%
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%

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
IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,30%	-44,48%	-7,38%	-10,72%	-44,48%	-57,27%	0,72%	32,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,45%	11,93%	2,92%	4,62%	11,93%	22,58%	0,49%	1,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	11,96%	2,92%	4,64%	11,96%	22,79%	0,48%	1,97%

IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-7,30%	-23,13%	-8,45%	-17,38%	-23,13%	-30,69%	14,14%	16,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,74%	15,77%	4,71%	4,04%	15,77%	22,83%	1,46%	4,47%
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%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,46%	16,06%	4,33%	6,05%	16,06%	26,02%	0,66%	2,64%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,46%	16,48%	4,34%	6,27%	16,48%	26,97%	0,69%	2,69%

CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	5,16%	2,16%	2,60%	5,16%	8,48%	0,34%	4,04%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,88%	12,79%	2,78%	6,03%	12,79%	26,45%	0,01%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	12,98%	2,83%	6,15%	12,98%	27,20%	0,01%	0,08%

IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
-------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

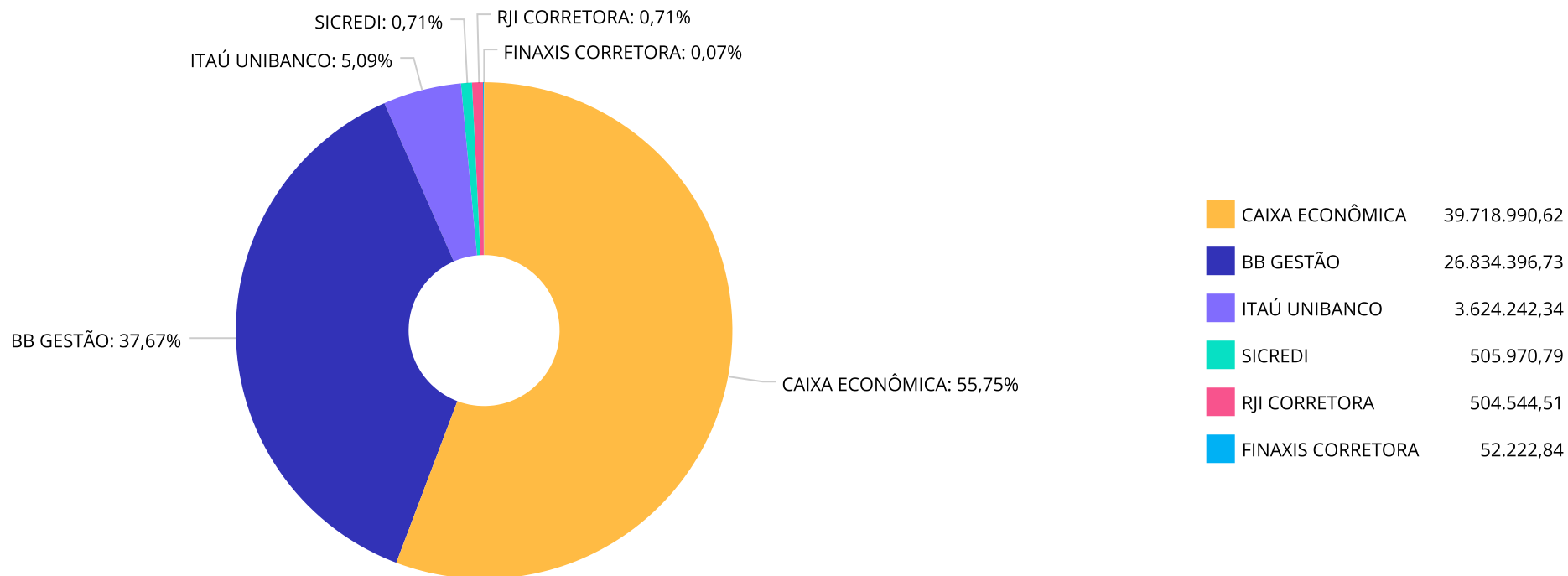
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	11,17%	2,16%	5,32%	11,17%	-	0,34%	1,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	3,29%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,49%	-14,39%	-5,66%	-6,95%	-14,39%	-61,62%	0,08%	7,78%

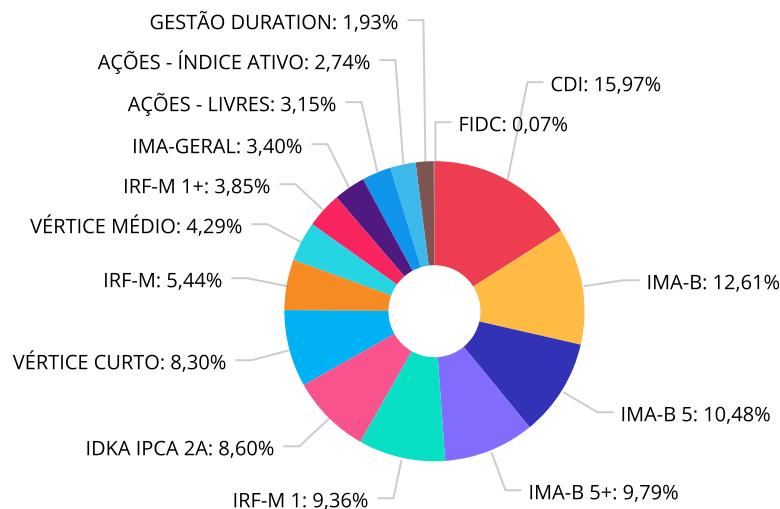
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,47%	7,41%	9,14%	3,37%	7,41%	-2,64%	7,40%	19,62%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,35%	11,45%	16,32%	13,22%	11,45%	17,20%	7,50%	15,76%
IBX-50 (Benchmark)	5,31%	20,06%	14,43%	14,39%	20,06%	26,93%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5,84%	17,91%	13,70%	11,79%	17,91%	20,64%	6,47%	16,82%

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



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

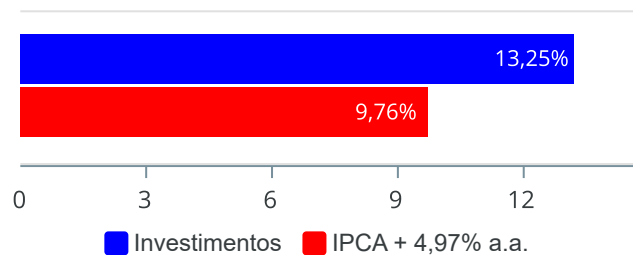


■ CDI	11.376.361,80	■ IMA-B	8.982.589,48	■ IMA-B 5	7.469.058,03	■ IMA-B 5+	6.976.884,89
■ IRF-M 1	6.665.170,39	■ IDKA IPCA 2A	6.127.437,47	■ VÉRTICE CURTO	5.916.009,76	■ IRF-M	3.875.525,94
■ VÉRTICE MÉDIO	3.055.983,34	■ IRF-M 1+	2.745.197,30	■ IMA-GERAL	2.422.128,16	■ AÇÕES - LIVRES	2.245.788,22
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.951.556,09	■ GESTÃO DURATION	1.378.454,12	■ FIDC	52.222,84		

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	57.427.184,07	1.580.000,00	0,00	59.544.343,98	537.159,91	537.159,91	0,91%	0,91%	0,96%	0,96%	95,16%	2,16%
Fevereiro	59.544.343,98	2.000.000,00	1.148.101,79	60.696.412,85	300.170,66	837.330,57	0,50%	1,41%	1,19%	2,16%	65,43%	2,12%
Março	60.696.412,85	1.540.000,00	2.082.757,59	60.931.593,55	777.938,29	1.615.268,86	1,28%	2,71%	1,16%	3,34%	81,19%	1,67%
Abril	60.931.593,55	1.450.000,00	180.000,00	62.971.416,36	769.822,81	2.385.091,67	1,24%	3,98%	0,96%	4,33%	91,96%	1,38%
Mai	62.971.416,36	2.590.000,00	1.140.000,00	65.425.179,35	1.003.762,99	3.388.854,66	1,56%	5,60%	0,66%	5,01%	111,73%	1,20%
Junho	65.425.179,35	4.300.000,00	4.022.325,79	66.964.423,60	1.261.570,04	4.650.424,70	1,92%	7,63%	0,32%	5,36%	142,48%	1,48%
Julho	66.964.423,60	1.500.000,00	3.072.325,79	66.097.802,58	705.704,77	5.356.129,47	1,05%	8,76%	0,53%	5,91%	148,32%	1,33%
Agosto	66.097.802,58	1.530.000,00	154.103,14	67.482.822,21	9.122,77	5.365.252,24	0,01%	8,78%	0,67%	6,62%	132,55%	1,51%
Setembro	67.482.822,21	1.711.000,00	2.050.000,00	67.165.472,27	21.650,06	5.386.902,30	0,03%	8,81%	0,65%	7,31%	120,53%	1,62%
Outubro	67.165.472,27	1.580.000,00	1.111.288,46	67.465.152,78	-169.031,03	5.217.871,27	-0,25%	8,54%	0,65%	8,01%	106,69%	1,97%
Novembro	67.465.152,78	1.632.000,00	1.186.231,26	69.510.239,08	1.599.317,56	6.817.188,83	2,36%	11,10%	0,67%	8,73%	127,18%	1,57%
Dezembro	69.510.239,08	3.155.000,00	2.775.515,19	71.240.367,83	1.350.643,94	8.167.832,77	1,93%	13,25%	0,95%	9,76%	135,75%	1,14%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



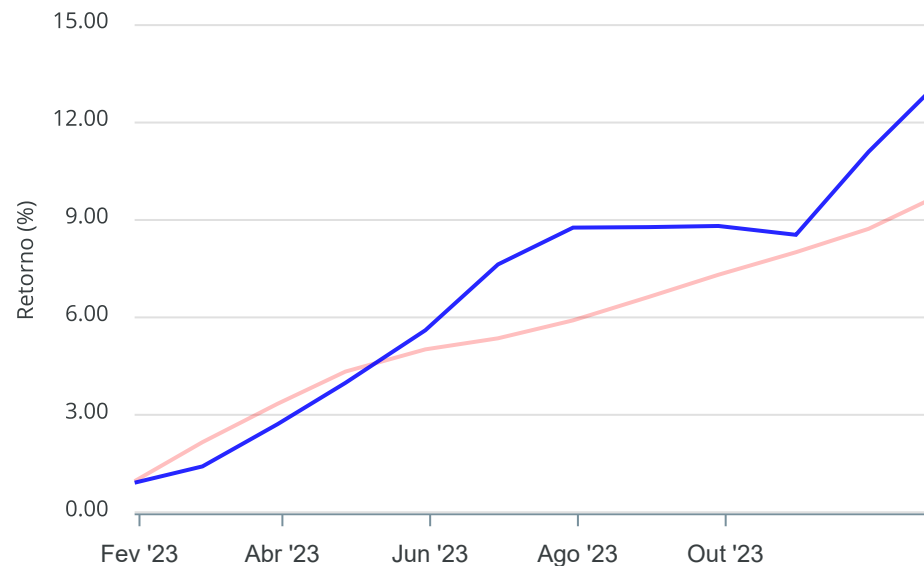
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.662.525,33	0,00	0,00	4.845.849,11	183.323,78	3,93%	3,93%	2,38%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.050.422,42	0,00	0,00	2.131.035,78	80.613,36	3,93%	3,93%	2,40%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5.979.309,80	0,00	0,00	6.144.977,98	165.668,18	2,77%	2,77%	1,48%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.270.767,93	0,00	0,00	2.333.066,99	62.299,06	2,74%	2,74%	1,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.699.086,87	0,00	0,00	2.745.197,30	46.110,43	1,71%	1,71%	0,94%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.005.128,58	0,00	0,00	3.055.983,34	50.854,76	1,69%	1,69%	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.356.606,12	0,00	0,00	1.378.454,12	21.848,00	1,61%	1,61%	0,78%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	2.384.008,71	0,00	0,00	2.422.128,16	38.119,45	1,60%	1,60%	0,58%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.468.944,11	0,00	0,00	3.519.053,90	50.109,79	1,44%	1,44%	0,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.893.987,89	0,00	0,00	3.950.004,13	56.016,24	1,44%	1,44%	0,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.041.968,80	0,00	0,00	6.127.437,47	85.468,67	1,41%	1,41%	0,45%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.167.680,17	155.000,00	0,00	3.369.555,15	46.874,98	1,41%	1,46%	0,66%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,00	500.000,00	0,00	505.970,79	5.970,79	1,19%	1,46%	0,69%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	304.587,99	0,00	25.515,19	282.351,41	3.278,61	1,08%	-7,30%	14,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.714.096,81	0,00	0,00	1.729.920,62	15.823,81	0,92%	0,92%	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.147.804,42	0,00	0,00	4.186.089,14	38.284,72	0,92%	0,92%	0,34%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.516.378,27	0,00	0,00	5.566.145,90	49.767,63	0,90%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.566.516,64	0,00	0,00	4.606.989,47	40.472,83	0,89%	0,89%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.040.111,11	0,00	0,00	2.058.180,92	18.069,81	0,89%	0,89%	0,04%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	6.011.433,01	2.500.000,00	2.750.000,00	5.810.215,90	48.782,89	0,57%	0,88%	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
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	222.857,33	0,00	0,00	222.193,10	-664,23	-0,30%	-0,30%	0,72%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	52.477,79	0,00	0,00	52.222,84	-254,95	-0,49%	-0,49%	0,08%
Total Renda Fixa	65.556.700,10	3.155.000,00	2.775.515,19	67.043.023,52	1.106.838,61	1,68%		0,78%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.095.014,80	0,00	0,00	1.175.547,49	80.532,69	7,35%	7,35%	7,50%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1.843.798,49	0,00	0,00	1.951.556,09	107.757,60	5,84%	5,84%	6,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.014.725,69	0,00	0,00	1.070.240,73	55.515,04	5,47%	5,47%	7,40%
Total Renda Variável	3.953.538,98	0,00	0,00	4.197.344,31	243.805,33	6,17%		7,00%

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.554.361,02	0,00	0,00	4.845.849,11	291.488,09	6,40%	6,40%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5.865.660,73	0,00	0,00	6.144.977,98	279.317,25	4,76%	4,76%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.955.633,51	0,00	0,00	6.127.437,47	171.803,96	2,88%	2,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.412.899,31	0,00	0,00	5.566.145,90	153.246,59	2,83%	2,83%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	5.089.452,15	5.525.000,00	4.950.000,00	5.810.215,90	145.763,75	1,37%	2,78%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.954.628,21	282.000,00	0,00	3.369.555,15	132.926,94	4,11%	4,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.614.407,73	0,00	0,00	2.745.197,30	130.789,57	5,00%	5,00%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.003.235,00	0,00	0,00	2.131.035,78	127.800,78	6,38%	6,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.480.401,26	0,00	0,00	4.606.989,47	126.588,21	2,83%	2,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.778.438,34	60.000,00	0,00	3.950.004,13	111.565,79	2,91%	2,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.228.072,48	0,00	0,00	2.333.066,99	104.994,51	4,71%	4,71%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.419.120,72	0,00	0,00	3.519.053,90	99.933,18	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.045.955,88	0,00	86.231,26	3.055.983,34	96.258,72	3,16%	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.097.559,00	0,00	0,00	4.186.089,14	88.530,14	2,16%	2,16%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	2.333.982,80	0,00	0,00	2.422.128,16	88.145,36	3,78%	3,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.002.057,18	0,00	0,00	2.058.180,92	56.123,74	2,80%	2,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.324.990,25	0,00	0,00	1.378.454,12	53.463,87	4,04%	4,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.693.336,93	0,00	0,00	1.729.920,62	36.583,69	2,16%	2,16%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,00	500.000,00	0,00	505.970,79	5.970,79	1,19%	4,34%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	308.400,35	0,00	25.515,19	282.351,41	-533,75	-0,17%	-8,45%

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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	55.355,67	0,00	0,00	52.222,84	-3.132,83	-5,66%	-5,66%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	239.891,61	0,00	11.288,46	222.193,10	-6.410,05	-2,67%	-7,38%
Total Renda Fixa	63.457.840,13	6.367.000,00	5.073.034,91	67.043.023,52	2.291.218,30	3,54%	

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 IBX-50 FI AÇÕES	1.716.377,71	0,00	0,00	1.951.556,09	235.178,38	13,70%	13,70%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.010.627,25	0,00	0,00	1.175.547,49	164.920,24	16,32%	16,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	980.627,18	0,00	0,00	1.070.240,73	89.613,55	9,14%	9,14%
Total Renda Variável	3.707.632,14	0,00	0,00	4.197.344,31	489.712,17	13,21%	

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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5.298.363,28	0,00	0,00	6.144.977,98	846.614,70	15,97%	15,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.075.666,86	0,00	0,00	4.845.849,11	770.182,25	18,89%	18,90%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	5.513.672,56	17.865.000,00	18.310.000,00	5.810.215,90	741.543,34	10,08%	12,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.484.417,21	0,00	0,00	6.127.437,47	643.020,26	11,73%	11,72%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.926.754,69	0,00	0,00	5.566.145,90	639.391,21	12,96%	12,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.076.248,05	0,00	0,00	4.606.989,47	530.741,42	13,03%	13,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.980.627,42	0,00	225.354,31	4.186.089,14	430.816,03	11,16%	5,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.322.798,14	0,00	0,00	2.745.197,30	422.399,16	18,17%	18,18%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.242.091,88	809.000,00	90.000,00	3.369.555,15	408.463,27	15,85%	16,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.585.134,54	1.000.000,00	10.000,00	3.950.004,13	374.869,59	11,72%	11,96%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.792.785,92	0,00	0,00	2.131.035,78	338.249,86	18,87%	18,87%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.015.182,25	0,00	0,00	2.333.066,99	317.884,74	15,78%	15,77%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.807.936,34	1.394.000,00	0,00	3.519.053,90	317.117,56	11,64%	11,93%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	2.111.506,77	0,00	0,00	2.422.128,16	310.621,39	14,72%	14,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.823.282,60	0,00	0,00	2.058.180,92	234.898,32	12,89%	12,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.189.967,09	0,00	0,00	1.378.454,12	188.487,03	15,83%	15,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.645.874,09	0,00	94.093,03	1.729.920,62	178.139,56	11,15%	11,17%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	86.231,26	3.055.983,34	142.214,60	4,79%	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	367.309,43	0,00	95.681,95	282.351,41	10.723,93	2,47%	-23,13%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,00	500.000,00	0,00	505.970,79	5.970,79	1,19%	16,48%

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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	60.998,49	0,00	0,00	52.222,84	-8.775,65	-14,39%	-14,39%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	400.235,86	0,00	11.288,46	222.193,10	-166.754,30	-41,72%	-44,48%
Total Renda Fixa	53.720.853,47	5.080.000,00	0,00	59.217.929,03	417.075,56	0,71%	

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 IBX-50 FI AÇÕES	1.655.149,59	0,00	0,00	1.951.556,09	296.406,50	17,91%	17,91%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.054.795,44	0,00	0,00	1.175.547,49	120.752,05	11,45%	11,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	996.385,57	0,00	0,00	1.070.240,73	73.855,16	7,41%	7,41%
Total Renda Variável	3.706.330,60	0,00	0,00	3.853.260,43	146.929,83	3,96%	

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.

