

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

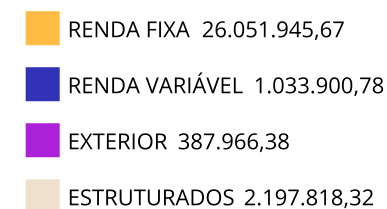
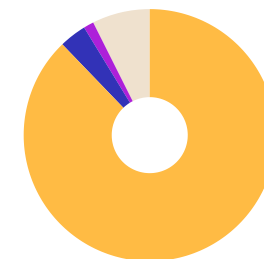
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB TESOIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	D+0	Não há	1.280.619,27	4,32%	103.817	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	380.194,09	1,28%	788	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.203.457,69	14,17%	850	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.912.230,22	13,19%	914	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	257.912,84	0,87%	282	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.282.662,96	14,43%	1.190	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	3.322.627,79	11,20%	248	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.276.312,65	14,41%	445	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	544.280,30	1,83%	216	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	320.775,04	1,08%	988	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	372.832,97	1,26%	437	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.898.039,85	9,77%	395	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	581.256,57	1,96%	2.603	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	D+4	Não há	452.644,21	1,53%	14.594	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	387.966,38	1,31%	143	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	857.476,27	2,89%	177.665	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	573.556,25	1,93%	2.628	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	766.785,80	2,58%	34	0,79%	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
Total para cálculo dos limites da Resolução			29.671.631,15				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.050.873,93				Artigo 6º
		PL Total	34.722.505,08				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	90,00%	26.704.468,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	22.460.297,81	75,70%	20,49%	52,50%	90,00%	4.244.170,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	3.591.647,86	12,10%	13,00%	15,00%	60,00%	14.211.330,83
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	5.934.326,23
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.483.581,56
Total Renda Fixa	100,00%	26.051.945,67	87,80%	33,49%	82,50%	265,00%	



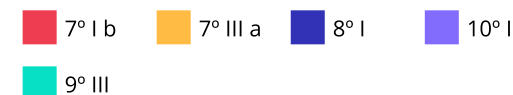
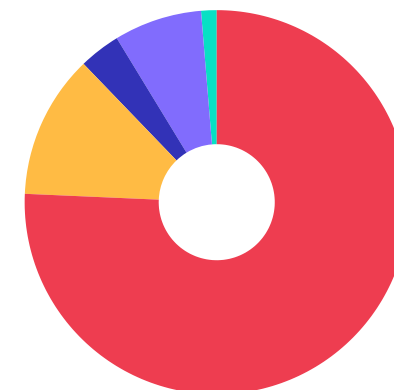
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	1.033.900,78	3,48%	1,50%	5,00%	30,00%	7.867.588,57
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.197.818,32	7,41%	6,00%	7,50%	10,00%	769.344,80
Artigo 11º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.483.581,56
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	3.231.719,10	10,89%	7,50%	12,50%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	387.966,38	1,31%	1,00%	3,00%	10,00%	2.579.196,74
Total Exterior	10,00%	387.966,38	1,31%	1,00%	3,00%	10,00%	



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	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	22.460.297,81	75,70	20,49	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	3.591.647,86	12,10	13,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	1.033.900,78	3,48	1,50	30,00
Artigo 9º, Inciso III	387.966,38	1,31	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.197.818,32	7,41	6,00	10,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	22.355.206,71	75,34	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	4.209.105,95	14,19	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.107.318,49	10,47	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,45%	12,13%	2,89%	5,00%	12,13%	22,60%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	11,90%	2,86%	4,97%	11,90%	22,02%	0,43%	1,99%
IRF-M 1+ (Benchmark)	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%	-	-
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%	-	-
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%
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%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,94%	13,39%	2,94%	6,46%	13,39%	27,85%	0,02%	0,09%

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92%	13,32%	2,94%	6,48%	13,32%	27,68%	0,02%	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	13,57%	3,03%	6,68%	13,57%	28,48%	0,02%	0,10%
BB TESOIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,88%	12,75%	2,75%	5,99%	12,75%	26,46%	0,01%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	1,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	3,29%

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

	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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,90%	12,51%	2,73%	5,58%	12,51%	27,64%	0,05%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,97%	13,30%	2,94%	6,15%	13,30%	27,56%	0,10%	0,36%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,94%	12,74%	3,13%	6,00%	12,74%	25,64%	0,14%	0,56%

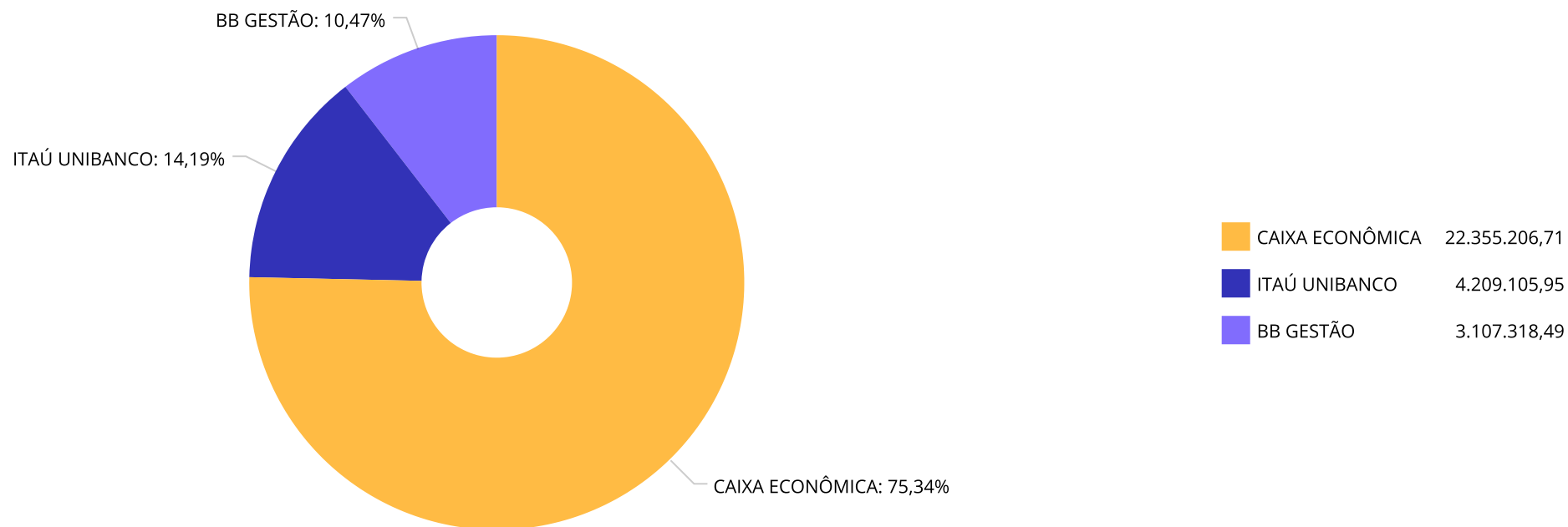
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	4,37%	-7,47%	17,25%	26,37%	-7,47%	14,01%	8,32%	26,17%

IDIV (Benchmark)	6,90%	26,84%	14,61%	16,04%	26,84%	42,88%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	8,14%	27,65%	11,41%	6,37%	27,65%	29,90%	5,30%	15,62%

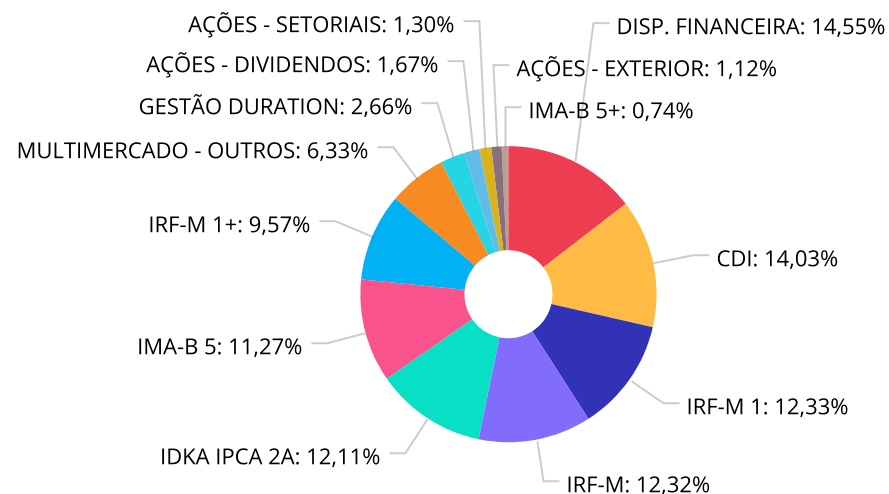
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3,03%	17,78%	7,61%	9,37%	17,78%	-11,84%	4,59%	14,099%

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



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

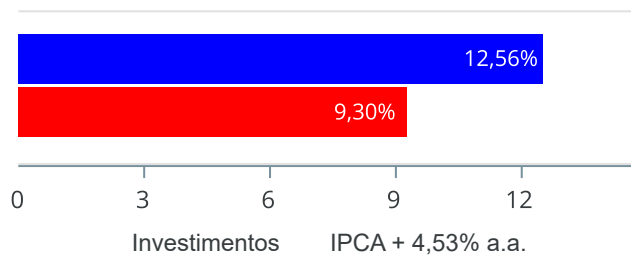


■ DISP. FINANCEIRA	5.050.873,93	■ CDI	4.872.267,13	■ IRF-M 1	4.282.662,96	■ IRF-M	4.276.312,65
■ IDKA IPCA 2A	4.203.457,69	■ IMA-B 5	3.912.230,22	■ IRF-M 1+	3.322.627,79	■ MULTIMERCADO - OUTROS	2.197.818,32
■ GESTÃO DURATION	924.474,39	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	581.256,57	■ AÇÕES - SETORIAIS	452.644,21	■ AÇÕES - EXTERIOR	387.966,38
■ IMA-B 5+	257.912,84						

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	19.813.126,30	2.280.900,00	1.144.499,98	21.193.736,71	244.210,39	244.210,39	1,17%	1,17%	0,92%	0,92%	126,76%	1,44%
Fevereiro	21.193.736,71	4.226.833,55	1.050.000,00	24.532.199,74	161.629,48	405.839,87	0,66%	1,84%	1,16%	2,09%	87,88%	1,43%
Março	24.532.199,74	7.257.437,35	3.651.689,00	28.477.701,45	339.753,36	745.593,23	1,21%	3,07%	1,12%	3,23%	94,89%	1,15%
Abril	28.477.701,45	3.311.280,47	5.161.996,38	26.807.587,66	180.602,12	926.195,35	0,63%	3,72%	0,93%	4,19%	88,78%	1,04%
Mai	26.807.587,66	3.348.124,18	2.090.931,36	28.389.702,09	324.921,61	1.251.116,96	1,16%	4,92%	0,62%	4,83%	101,78%	0,80%
Junho	28.389.702,09	2.965.231,52	1.294.000,03	30.493.101,48	432.167,90	1.683.284,86	1,44%	6,43%	0,29%	5,14%	125,13%	0,88%
Julho	30.493.101,48	2.972.736,11	1.680.000,00	32.104.527,90	318.690,31	2.001.975,17	1,00%	7,50%	0,49%	5,65%	132,59%	0,92%
Agosto	32.104.527,90	7.313.589,45	5.273.046,51	34.396.570,99	251.500,15	2.253.475,32	0,74%	8,29%	0,64%	6,33%	131,02%	0,94%
Setembro	34.396.570,99	3.001.700,00	5.105.878,79	32.414.807,05	122.414,85	2.375.890,17	0,36%	8,67%	0,61%	6,98%	124,30%	0,93%
Outubro	32.414.807,05	6.303.201,49	4.874.000,00	33.948.021,08	104.012,54	2.479.902,71	0,31%	9,01%	0,61%	7,63%	118,04%	1,39%
Novembro	33.948.021,08	3.541.104,89	1.826.000,00	36.344.945,62	681.819,65	3.161.722,36	1,91%	11,09%	0,63%	8,31%	133,43%	0,89%
Dezembro	36.344.945,62	0,00	7.154.255,37	29.671.631,15	480.940,90	3.642.663,26	1,32%	12,56%	0,91%	9,30%	135,03%	0,67%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



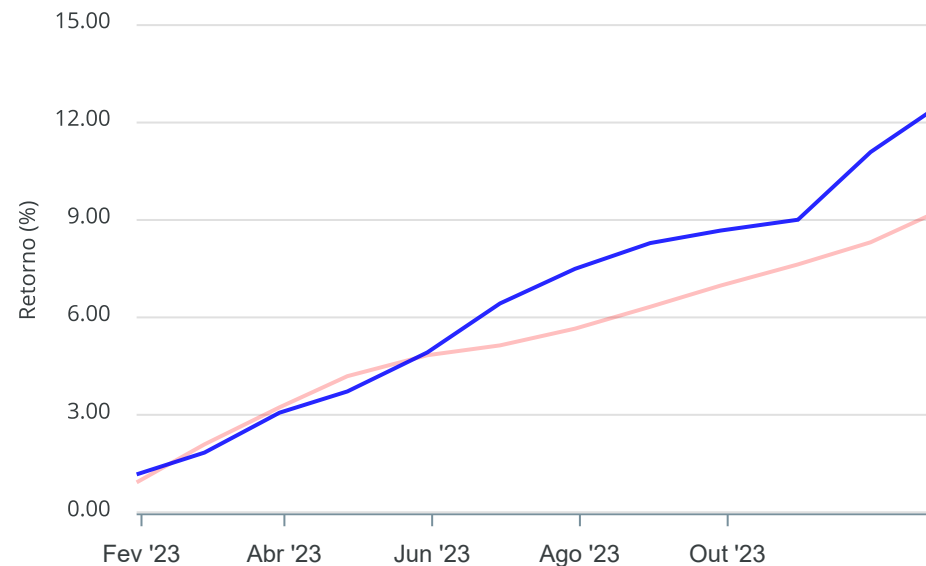
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	248.155,71	0,00	0,00	257.912,84	9.757,13	3,93%	3,93%	2,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.250.939,65	0,00	1.000.000,00	3.322.627,79	71.688,14	1,69%	1,71%	0,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	535.653,66	0,00	0,00	544.280,30	8.626,64	1,61%	1,61%	0,78%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.201.363,06	0,00	1.000.000,00	4.276.312,65	74.949,59	1,44%	1,46%	0,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.623.238,57	0,00	480.000,00	4.203.457,69	60.219,12	1,30%	1,40%	0,43%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	375.658,33	0,00	0,00	380.194,09	4.535,76	1,21%	1,21%	0,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.009.617,13	0,00	1.155.000,00	3.912.230,22	57.613,09	1,15%	1,44%	0,48%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	369.380,13	0,00	0,00	372.832,97	3.452,84	0,93%	0,93%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	317.837,25	0,00	0,00	320.775,04	2.937,79	0,92%	0,92%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.664.326,27	0,00	800.000,01	2.898.039,85	33.713,59	0,92%	0,95%	0,02%
BB TESOIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	1.269.465,68	0,00	0,00	1.280.619,27	11.153,59	0,88%	0,88%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.755.752,72	0,00	2.519.255,36	4.282.662,96	46.165,60	0,68%	0,89%	0,03%
Total Renda Fixa	32.621.388,16	0,00	6.954.255,37	26.051.945,67	384.812,88	1,18%		0,42%

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
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	537.490,99	0,00	0,00	581.256,57	43.765,58	8,14%	8,14%	5,30%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	433.704,90	0,00	0,00	452.644,21	18.939,31	4,37%	4,37%	8,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	759.453,11	0,00	0,00	766.785,80	7.332,69	0,97%	0,97%	0,10%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	849.475,91	0,00	0,00	857.476,27	8.000,36	0,94%	0,94%	0,14%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	766.886,66	0,00	200.000,00	573.556,25	6.669,59	0,87%	0,90%	0,05%
Total Renda Variável	3.347.011,57	0,00	200.000,00	3.231.719,10	84.707,53	2,53%		2,19%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	376.545,89	0,00	0,00	387.966,38	11.420,49	3,03%	3,03%	4,59%
Total Exterior	376.545,89	0,00	0,00	387.966,38	11.420,49	3,03%		4,59%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.715.562,74	1.356.600,00	1.000.000,00	4.276.312,65	204.149,91	4,02%	4,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.958.240,48	0,00	1.837.000,00	3.322.627,79	201.387,31	4,06%	5,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.798.142,17	6.707.706,38	8.382.255,36	4.282.662,96	159.069,77	1,27%	2,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.235.283,90	700.000,00	1.155.000,00	3.912.230,22	131.946,32	2,67%	2,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.557.880,30	0,00	480.000,00	4.203.457,69	125.577,39	2,76%	2,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.106.934,93	490.000,00	800.000,01	2.898.039,85	101.104,93	2,81%	3,03%
BB TESOUREO FIC RENDA FIXA SELIC LP	1.246.322,80	0,00	0,00	1.280.619,27	34.296,47	2,75%	2,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	523.170,18	0,00	0,00	544.280,30	21.110,12	4,04%	4,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	242.398,84	0,00	0,00	257.912,84	15.514,00	6,40%	6,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	369.396,38	0,00	0,00	380.194,09	10.797,71	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	362.184,43	0,00	0,00	372.832,97	10.648,54	2,94%	2,94%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	311.625,04	0,00	0,00	320.775,04	9.150,00	2,94%	2,94%
Total Renda Fixa	29.427.142,19	9.254.306,38	13.654.255,37	26.051.945,67	1.024.752,47	2,65%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	581.256,57	81.256,57	16,25%	11,41%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	386.039,22	0,00	0,00	452.644,21	66.604,99	17,25%	17,25%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	831.494,63	0,00	0,00	857.476,27	25.981,64	3,12%	3,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	656.359,39	90.000,00	0,00	766.785,80	20.426,41	2,74%	2,93%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	753.231,71	0,00	200.000,00	573.556,25	20.324,54	2,70%	2,73%
Total Renda Variável	2.627.124,95	590.000,00	200.000,00	3.231.719,10	214.594,15	7,11%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	360.539,91	0,00	0,00	387.966,38	27.426,47	7,61%	7,61%
Total Exterior	360.539,91	0,00	0,00	387.966,38	27.426,47	7,61%	

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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.844.836,00	6.707.523,43	5.863.878,78	3.322.627,79	634.147,14	15,89%	18,18%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.473.991,75	10.714.004,26	10.516.996,38	4.276.312,65	605.313,02	12,74%	16,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.728.384,38	13.013.269,88	13.007.255,36	4.282.662,96	548.264,06	10,22%	13,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.371.658,33	7.399.810,11	6.331.494,61	3.912.230,22	472.256,39	10,04%	11,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.218.118,19	2.579.600,00	980.000,00	4.203.457,69	385.739,50	11,10%	11,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.259.143,20	2.140.000,00	1.859.241,03	2.898.039,85	358.137,68	12,98%	13,57%
BB TESOUREO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,00	1.187.931,33	0,00	1.280.619,27	92.687,94	9,12%	12,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	669.529,26	0,00	200.000,00	544.280,30	74.751,04	15,71%	15,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	443.175,92	0,00	109.499,93	380.194,09	46.518,10	13,56%	13,59%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	340.000,00	0,00	372.832,97	32.832,97	9,66%	13,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	312.971,61	500.000,00	837.931,33	0,00	24.959,72	4,59%	13,43%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	300.000,00	0,00	320.775,04	20.775,04	6,94%	13,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	250.000,00	0,00	257.912,84	7.912,84	3,17%	18,90%
Total Renda Fixa	17.321.808,64	45.132.139,01	39.706.297,42	26.051.945,67	3.304.295,44	14,53%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	474.191,14	300.000,00	0,00	857.476,27	83.285,13	12,40%	12,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	893.910,93	90.000,00	300.000,00	766.785,80	82.874,87	13,09%	13,30%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	581.256,57	81.256,57	16,24%	27,65%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	304.640,51	500.000,00	300.000,00	573.556,25	68.915,74	11,68%	12,51%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	489.162,46	0,00	0,00	452.644,21	-36.518,25	-7,47%	-7,47%
Total Renda Variável	2.161.905,04	1.390.000,00	600.000,00	3.231.719,10	279.814,06	9,48%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	329.412,62	0,00	0,00	387.966,38	58.553,76	17,76%	17,78%
Total Exterior	329.412,62	0,00	0,00	387.966,38	58.553,76	17,78%	

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.

