

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
TÍTULOS PÚBLICOS			50.281.738,67	11,87%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	D+0	Não há	46.929.448,28	11,08%	195	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	20.755.582,04	4,90%	370	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.104.956,60	1,20%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA...	D+0	Não há	30.675.244,77	7,24%	33	3,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	37.732.662,41	8,91%	305	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	33.248.232,70	7,85%	442	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	71.444.759,37	16,86%	988	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	66.484.641,77	15,69%	395	1,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	10.332.259,28	2,44%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	D+0	Não se aplica	6.141.967,26	1,45%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	D+0	Não se aplica	4.095.607,58	0,97%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	452.208,40	0,11%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.225.953,88	1,00%	2.736	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.316.037,31	0,55%	1.159	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.325.394,53	0,55%	25.784	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.438.205,55	0,81%	2.092	1,82%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.048.064,64	0,48%	436	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.167.648,47	0,51%	127	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.172.807,17	0,51%	2.162	0,15%	Artigo 8º, Inciso I



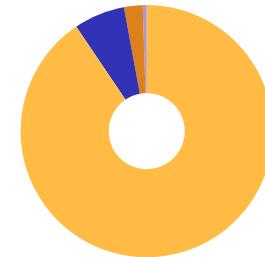
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento	
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	4.464.567,99	1,05%	35	0,99%	Artigo 8º, Inciso I	
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	2.294.909,28	0,54%	3.068	2,85%	Artigo 8º, Inciso I	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	2.259.314,76	0,53%	37	0,28%	Artigo 8º, Inciso I	
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	5.279.170,80	1,25%	124	0,40%	Artigo 9º, Inciso II	
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO...	D+8	Não há	1.991.652,02	0,47%	3.846	0,34%	Artigo 9º, Inciso II	
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.877.046,32	0,68%	346	0,44%	Artigo 9º, Inciso III	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.149.019,48	0,51%	26.410	0,26%	Artigo 10º, Inciso I	
Total para cálculo dos limites da Resolução			423.689.101,33					



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	50.281.738,67	11,87%	1,00%	7,00%	15,00%	13.271.626,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	141.197.894,10	33,33%	20,00%	23,00%	70,00%	155.384.476,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	171.177.633,84	40,40%	10,00%	30,00%	50,00%	40.666.916,83
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	20.569.834,12	4,85%	0,00%	3,25%	10,00%	21.799.076,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	452.208,40	0,11%	0,00%	0,25%	0,25%	607.014,35
Total Renda Fixa	100,00%	383.679.309,13	90,56%	31,00%	63,50%	145,25%	



- █ RENDA FIXA 383.679.309,13
- █ RENDA VARIÁVEL 27.712.903,58
- █ EXTERIOR 10.147.869,14
- █ ESTRUTURADOS 2.149.019,48

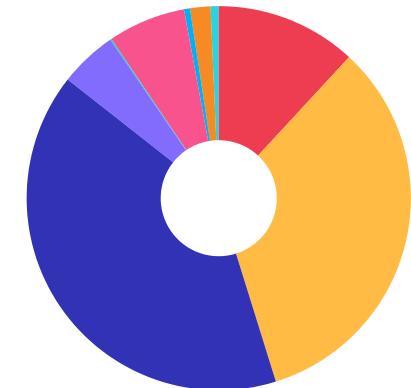
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



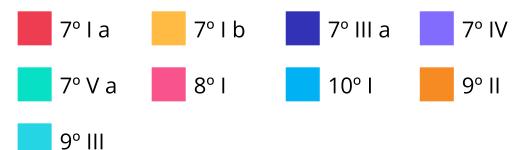


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	27.712.903,58	6,54%	10,00%	20,00%	28,00%	90.920.044,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.149.019,48	0,51%	6,00%	9,50%	10,00%	40.219.890,65
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	29.861.923,06	7,05%	16,00%	29,50%	38,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	7.270.822,82	1,72%	2,00%	3,00%	10,00%	35.098.087,31
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.877.046,32	0,68%	1,00%	4,00%	10,00%	39.491.863,81
Total Exterior	10,00%	10.147.869,14	2,40%	3,00%	7,00%	20,00%	





CRÉDITO
& MERCADO

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	109.177.421,78	25,77	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	77.605.632,96	18,32	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	66.484.641,77	15,69	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...)	50.281.738,67	11,87	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	37.463.945,81	8,84	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	32.848.051,94	7,75	0,01
BANCO BTG PACTUAL	20.569.834,12	4,85	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	5.104.956,60	1,20	0,00
ITAÚ DTVM	4.464.567,99	1,05	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.225.953,88	1,00	0,01
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.438.205,55	0,81	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	2.877.046,32	0,68	-
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.294.909,28	0,54	0,00
VINCI PARTNERS	2.259.314,76	0,53	-
WESTERN ASSET	2.149.019,48	0,51	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.991.652,02	0,47	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	452.208,40	0,11	0,52

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
IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	5,16%	2,16%	2,60%	5,16%	8,48%	0,34%	0,04%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	3,87%	2,20%	2,22%	3,87%	-45,15%	0,32%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,49%	-14,39%	-5,66%	-6,95%	-14,39%	-61,62%	0,08%	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92%	13,32%	2,94%	6,48%	13,32%	27,68%	0,02%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94%	13,63%	3,01%	6,66%	13,63%	28,40%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	13,57%	3,03%	6,68%	13,57%	28,48%	0,02%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,90%	12,98%	2,81%	6,10%	12,98%	26,98%	0,01%	0,00%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	13,02%	2,81%	6,13%	13,02%	27,01%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	-	-	-	-	-	-	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	11,17%	2,16%	5,32%	11,17%	-	0,34%	0,01%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5,32%	14,64%	10,05%	7,28%	14,64%	18,54%	5,44%	0,17%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5,25%	23,85%	12,28%	11,24%	23,85%	18,20%	6,39%	0,18%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	5,32%	18,69%	13,55%	11,09%	18,69%	15,05%	6,14%	0,17%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5,36%	19,09%	13,13%	11,03%	19,09%	24,69%	6,27%	0,16%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	5,52%	20,23%	14,07%	12,88%	20,23%	23,14%	6,19%	0,17%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5,60%	17,09%	13,30%	13,96%	17,09%	5,21%	6,53%	0,17%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,83%	15,82%	12,82%	8,59%	15,82%	10,41%	6,78%	0,17%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	6,26%	12,50%	11,91%	6,57%	12,50%	20,56%	6,34%	0,17%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,42%	24,23%	11,24%	7,18%	24,23%	0,08%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5,17%	33,02%	12,97%	10,80%	33,02%	17,07%	4,22%	0,13%
SMLL (Benchmark)	7,05%	17,12%	11,48%	3,40%	17,12%	-0,52%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5,76%	3,50%	10,29%	-0,68%	3,50%	-5,04%	8,94%	0,22%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,24%	15,29%	8,91%	5,20%	15,29%	5,27%	7,97%	0,16%

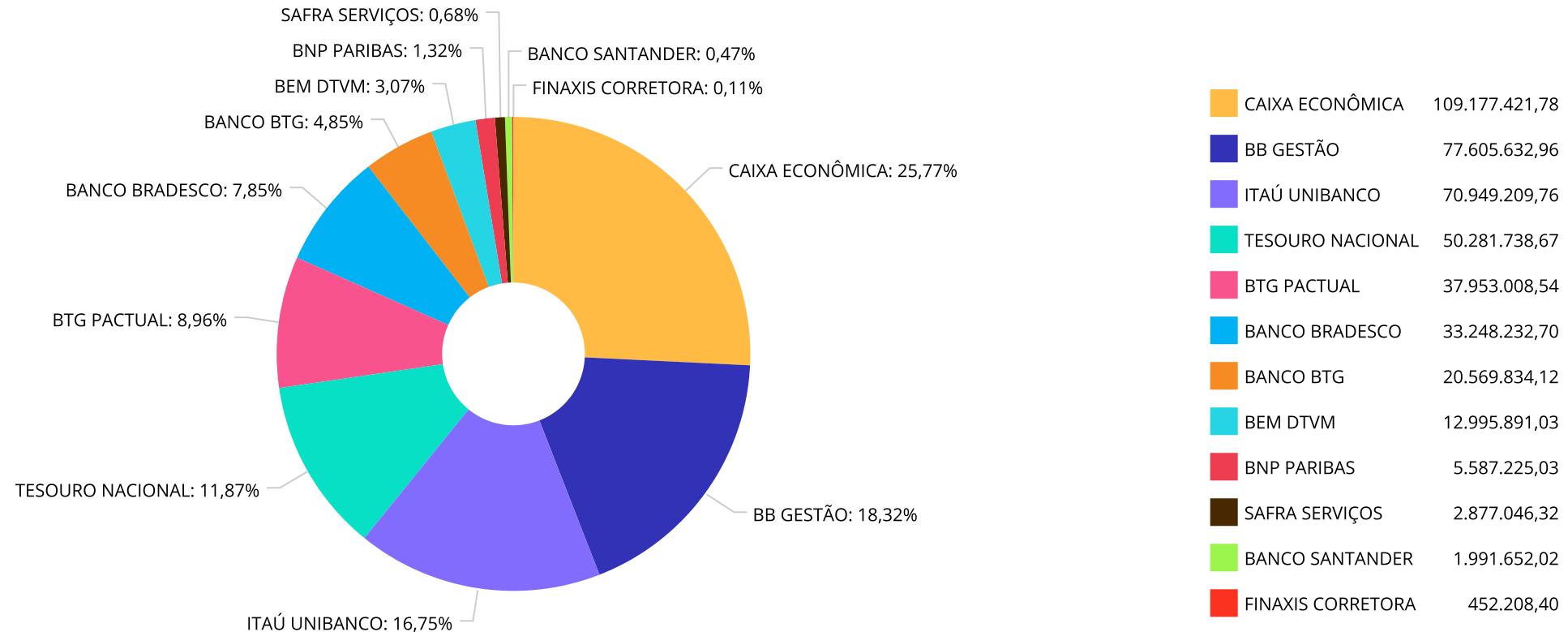


CRÉDITO
& MERCADO

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

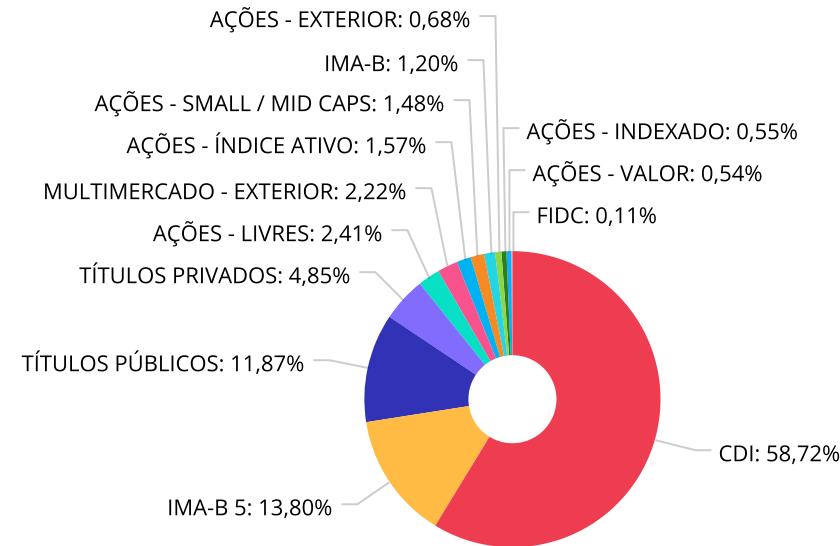
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,51%	17,40%	6,67%	9,25%	17,40%	-18,28%	5,59%	14,062%

MSCI WORLD (Benchmark)	2,81%	12,98%	7,38%	7,31%	12,98%	-14,93%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	3,66%	16,01%	8,22%	11,24%	16,01%	-6,32%	5,44%	15,127%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4,03%	9,37%	7,18%	8,26%	9,37%	-18,58%	4,75%	12,141%

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



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



■ CDI	248.782.326,89	■ IMA-B 5	58.488.244,45	■ TÍTULOS PÚBLICOS	50.281.738,67	■ TÍTULOS PRIVADOS	20.569.834,12
■ AÇÕES - LIVRES	10.195.722,01	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	9.419.842,30	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.632.216,46	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	6.274.018,52
■ IMA-B	5.104.956,60	■ AÇÕES - EXTERIOR	2.877.046,32	■ AÇÕES - INDEXADO	2.316.037,31	■ AÇÕES - VALOR	2.294.909,28
■ FIDC	452.208,40						



CRÉDITO
& MERCADO

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2023)

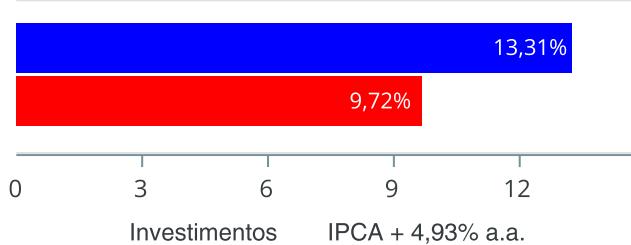
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	28/08/2023	7.088	4.232,219518	4.235,559355	29.997.971,94	30.021.644,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	26/09/2023	2.798	4.289,208164	4.394,551309	12.001.204,44	12.295.954,56	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	26/09/2023	1.846	4.332,972337	4.316,90145	7.998.666,93	7.969.000,07	Curva



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	442.489.269,76	80.207.800,23	71.481.073,23	461.039.580,19	9.823.583,43	9.823.583,43	2,18%	2,18%	0,95%	0,95%	228,39%	3,56%
Fevereiro	461.039.580,19	126.377.910,00	131.271.700,37	454.959.267,08	-1.186.522,74	8.637.060,69	-0,26%	1,91%	1,19%	2,15%	88,96%	2,30%
Março	454.959.267,08	23.290.659,62	28.735.277,12	452.472.867,08	2.958.217,50	11.595.278,19	0,65%	2,58%	1,15%	3,33%	77,38%	1,90%
Abril	452.472.867,08	23.491.509,52	28.468.206,39	451.454.306,49	3.958.136,28	15.553.414,47	0,87%	3,47%	0,96%	4,32%	80,45%	1,83%
Maio	451.454.306,49	107.420.294,47	118.068.793,83	446.828.593,72	6.022.786,59	21.576.201,06	1,33%	4,85%	0,65%	5,00%	97,12%	1,00%
Junho	446.828.593,72	79.517.474,01	82.544.489,71	451.478.882,89	7.677.304,87	29.253.505,93	1,72%	6,66%	0,32%	5,34%	124,74%	0,83%
Julho	451.478.882,89	20.149.376,20	36.742.804,61	440.674.135,31	5.788.680,83	35.042.186,76	1,28%	8,02%	0,52%	5,89%	136,32%	0,77%
Agosto	440.674.135,31	63.046.569,31	68.225.651,36	438.653.208,34	3.158.155,08	38.200.341,84	0,72%	8,80%	0,67%	6,60%	133,37%	1,17%
Setembro	438.653.208,34	50.270.404,36	55.855.184,94	436.416.172,03	3.347.744,27	41.548.086,11	0,76%	9,63%	0,64%	7,28%	132,20%	0,75%
Outubro	436.416.172,03	17.729.202,90	23.868.990,52	432.407.444,46	2.131.060,05	43.679.146,16	0,49%	10,16%	0,64%	7,97%	127,48%	0,87%
Novembro	432.407.444,46	89.012.285,02	95.668.724,71	432.644.750,81	6.893.746,04	50.572.892,20	1,59%	11,92%	0,66%	8,69%	137,18%	0,80%
Dezembro	432.644.750,81	42.293.775,21	56.624.216,59	423.689.101,33	5.374.791,90	55.947.684,10	1,24%	13,31%	0,94%	9,72%	136,99%	0,78%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





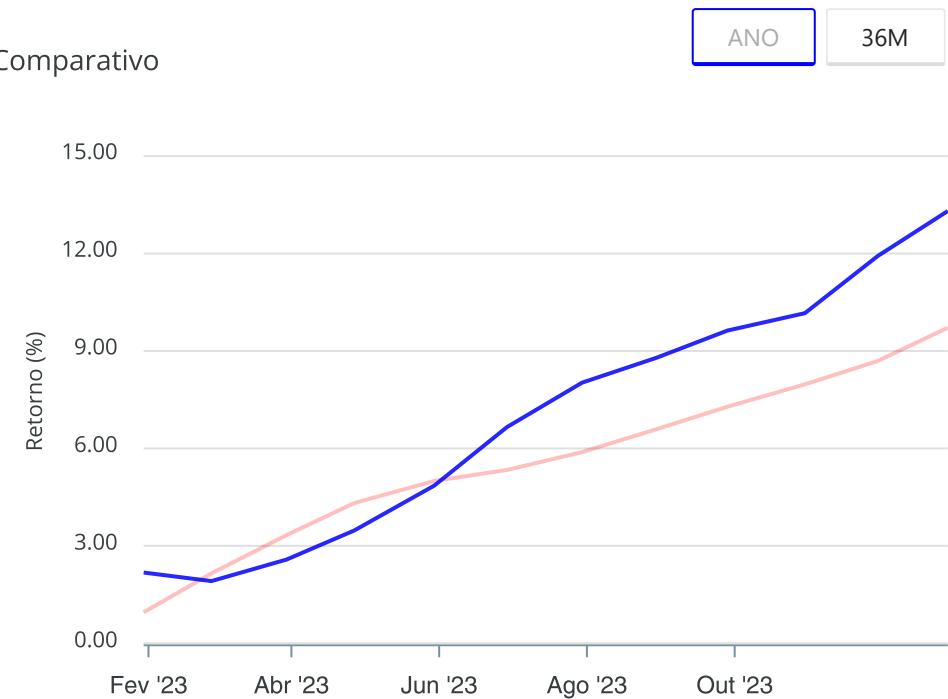
CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade

<input type="checkbox"/>	CDI	<input type="checkbox"/>	IMA-B
<input type="checkbox"/>	IMA-B 5	<input type="checkbox"/>	IMA-B 5+
<input type="checkbox"/>	IMA Geral	<input type="checkbox"/>	IRF-M
<input type="checkbox"/>	IRF-M 1	<input type="checkbox"/>	IRF-M 1+
<input type="checkbox"/>	Ibovespa	<input type="checkbox"/>	IBX
<input type="checkbox"/>	SMLL	<input type="checkbox"/>	IDIV



Retorno dos Investimentos apóas 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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	65.859.278,54	0,00	0,00	66.484.641,77	625.363,23	0,95%	0,95%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	20.565.728,01	0,00	0,00	20.755.582,04	189.854,03	0,92%	0,92%	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	37.387.570,75	0,00	0,00	37.732.662,41	345.091,66	0,92%	0,92%	0,34%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	30.402.449,71	0,00	0,00	30.675.244,77	272.795,06	0,90%	0,90%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	46.469.935,62	43.185,09	0,00	46.929.448,28	416.327,57	0,90%	0,90%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	49.838.663,55	0,00	0,00	50.281.738,67	443.075,12	0,89%	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.061.700,80	0,00	0,00	5.104.956,60	43.255,80	0,85%	0,85%	0,32%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	4.064.479,46	0,00	0,00	4.095.607,58	31.128,12	0,77%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	6.095.740,98	0,00	0,00	6.141.967,26	46.226,28	0,76%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	10.256.666,33	0,00	0,00	10.332.259,28	75.592,95	0,74%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	77.622.978,44	22.250.590,12	29.116.378,39	71.444.759,37	687.569,20	0,69%	0,92%	0,02%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	40.418.468,83	20.000.000,00	27.507.838,20	33.248.232,70	337.602,07	0,56%	0,94%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	454.416,07	0,00	0,00	452.208,40	-2.207,67	-0,49%	-0,49%	0,08%
Total Renda Fixa	394.498.077,09	42.293.775,21	56.624.216,59	383.679.309,13	3.511.673,42	0,89%		0,08%



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
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.040.044,18	0,00	0,00	2.167.648,47	127.604,29	6,25%	6,25%	6,34%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.936.491,92	0,00	0,00	2.048.064,64	111.572,72	5,76%	5,76%	8,94%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.202.056,53	0,00	0,00	2.325.394,53	123.338,00	5,60%	5,60%	6,53%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.194.884,56	0,00	0,00	2.316.037,31	121.152,75	5,52%	5,52%	6,19%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.237.271,45	0,00	0,00	4.464.567,99	227.296,54	5,36%	5,36%	6,27%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.178.974,47	0,00	0,00	2.294.909,28	115.934,81	5,32%	5,32%	6,14%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.264.702,29	0,00	0,00	3.438.205,55	173.503,26	5,31%	5,31%	5,44%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.146.677,39	0,00	0,00	2.259.314,76	112.637,37	5,25%	5,25%	6,39%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.015.592,04	0,00	0,00	4.225.953,88	210.361,84	5,24%	5,24%	7,97%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2.043.423,75	0,00	0,00	2.149.019,48	105.595,73	5,17%	5,17%	4,22%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.072.673,94	0,00	0,00	2.172.807,17	100.133,23	4,83%	4,83%	6,78%
Total Renda Variável	28.332.792,52	0,00	0,00	29.861.923,06	1.529.130,54	5,40%		6,50%



CRÉDITO
& MERCADO

Retorno dos Investimentos apóas 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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	1.914.526,08	0,00	0,00	1.991.652,02	77.125,94	4,03%	4,03%	4,75%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	5.092.663,77	0,00	0,00	5.279.170,80	186.507,03	3,66%	3,66%	5,44%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.806.691,35	0,00	0,00	2.877.046,32	70.354,97	2,51%	2,51%	5,59%
Total Exterior	9.813.881,20	0,00	0,00	10.147.869,14	333.987,94	3,40%		5,35%



Retorno dos Investimentos apóas 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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	79.277.075,10	0,00	15.000.000,00	66.484.641,77	2.207.566,67	2,78%	3,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	77.057.530,76	57.291.819,15	65.067.938,09	71.444.759,37	2.163.347,55	1,61%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	75.102.195,17	137.289,31	30.000.000,00	46.929.448,28	1.689.963,80	2,25%	2,80%
TÍTULOS PÚBLICOS	50.181.077,48	0,00	1.098.709,30	50.281.738,67	1.199.370,49	2,39%	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	25.326.353,34	72.007.316,74	64.995.284,43	33.248.232,70	909.847,05	0,93%	3,01%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	36.934.667,49	0,00	0,00	37.732.662,41	797.994,92	2,16%	2,16%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	10.507.935,76	19.598.837,93	0,00	30.675.244,77	568.471,08	1,89%	2,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	20.316.651,05	0,00	0,00	20.755.582,04	438.930,99	2,16%	2,16%
LETRA FINANCEIRA BTG	10.107.581,41	0,00	0,00	10.332.259,28	224.677,87	2,22%	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	6.004.732,31	0,00	0,00	6.141.967,26	137.234,95	2,29%	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.994.982,00	0,00	0,00	5.104.956,60	109.974,60	2,20%	2,20%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	4.003.184,75	0,00	0,00	4.095.607,58	92.422,83	2,31%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	479.336,26	0,00	0,00	452.208,40	-27.127,86	-5,66%	-5,66%
Total Renda Fixa	400.293.302,88	149.035.263,13	176.161.931,82	383.679.309,13	10.512.674,94	1,91%	



Retorno dos Investimentos apóas 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
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3.946.384,33	0,00	0,00	4.464.567,99	518.183,66	13,13%	13,13%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.880.253,80	0,00	0,00	4.225.953,88	345.700,08	8,91%	8,91%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.124.306,02	0,00	0,00	3.438.205,55	313.899,53	10,05%	10,05%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.030.329,97	0,00	0,00	2.316.037,31	285.707,34	14,07%	14,07%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.020.981,05	0,00	0,00	2.294.909,28	273.928,23	13,55%	13,55%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2.052.500,10	0,00	0,00	2.325.394,53	272.894,43	13,30%	13,30%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.012.244,74	0,00	0,00	2.259.314,76	247.070,02	12,28%	12,28%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.925.994,52	0,00	0,00	2.172.807,17	246.812,65	12,81%	12,81%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.902.325,97	0,00	0,00	2.149.019,48	246.693,51	12,97%	12,97%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.937.041,72	0,00	0,00	2.167.648,47	230.606,75	11,91%	11,91%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.856.983,48	0,00	0,00	2.048.064,64	191.081,16	10,29%	10,29%
Total Renda Variável	26.689.345,70	0,00	0,00	29.861.923,06	3.172.577,36	11,89%	



CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4.877.963,36	0,00	0,00	5.279.170,80	401.207,44	8,22%	8,22%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.697.269,74	0,00	0,00	2.877.046,32	179.776,58	6,67%	6,67%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	1.858.290,35	0,00	0,00	1.991.652,02	133.361,67	7,18%	7,18%
Total Exterior	9.433.523,45	0,00	0,00	10.147.869,14	714.345,69	7,57%	



Retorno dos Investimentos apóas 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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	64.923.654,78	21.500.000,00	30.000.000,00	66.484.641,77	10.060.986,99	13,25%	13,57%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.850.240,91	233.464.473,32	202.021.707,54	71.444.759,37	9.151.752,68	10,43%	13,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	0,00	83.818.371,64	42.950.000,00	46.929.448,28	6.061.076,64	10,32%	12,98%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.121.088,20	196.485.864,83	175.409.328,89	33.248.232,70	5.050.608,56	10,50%	13,63%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	34.664.077,56	1.212.432,50	1.995.205,48	37.732.662,41	3.851.357,83	11,12%	5,16%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC INSTITUCIONAL FI RENDA F...	0,00	68.321.082,77	40.000.000,00	30.675.244,77	2.354.162,00	7,28%	13,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	19.195.086,77	550.852,73	1.113.083,76	20.755.582,04	2.122.726,30	11,11%	11,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	35.916.589,98	0,00	37.818.199,20	0,00	1.901.609,22	5,29%	13,43%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	49.997.843,31	1.098.709,30	50.281.738,67	1.382.604,66	0,03%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	59.176.707,28	25.797.206,37	86.135.435,60	0,00	1.161.521,95	1,82%	11,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	26.117.171,31	0,00	26.965.105,00	0,00	847.933,69	8,44%	15,77%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	20.558.697,56	0,00	558.697,56	2,80%	16,49%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.915.015,20	0,00	329.826,01	5.104.956,60	519.767,41	10,95%	3,86%
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	10.000.000,00	0,00	10.332.259,28	332.259,28	3,33%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.037.193,85	1.659.133,38	5.858.568,35	0,00	162.241,12	2,96%	11,72%
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,29%	0,00	6.000.000,00	0,00	6.141.967,26	141.967,26	2,37%	-
LETRA FINANCEIRA BTG TAXA 6,39%	0,00	4.000.000,00	0,00	4.095.607,58	95.607,58	2,40%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	528.198,61	0,00	0,00	452.208,40	-75.990,21	-14,39%	-14,39%
Total Renda Fixa	287.445.024,45	722.807.260,85	672.253.866,69	383.679.309,13	45.680.890,52	13,52%	



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
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	14.861.431,70	0,00	16.211.968,37	0,00	1.350.536,67	13,04%	32,77%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9.388.058,04	0,00	10.676.961,99	0,00	1.288.903,95	25,99%	33,78%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.475.774,39	0,00	7.500.000,00	2.149.019,48	1.173.245,09	33,66%	33,02%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11.186.654,27	0,00	7.500.000,00	4.464.567,99	777.913,72	22,19%	19,09%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12.153.968,78	0,00	8.650.000,00	4.225.953,88	721.985,10	14,18%	15,29%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.866.671,44	0,00	5.000.000,00	3.438.205,55	571.534,11	13,68%	14,64%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.531.693,01	0,00	3.750.000,00	2.259.314,76	477.621,75	24,08%	23,85%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.926.570,58	0,00	6.000.000,00	2.316.037,31	389.466,73	23,79%	20,23%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.891.179,16	0,00	2.100.000,00	2.172.807,17	381.628,01	15,02%	15,82%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	8.160.205,97	0,00	6.150.000,00	2.325.394,53	315.188,56	19,24%	17,09%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.182.572,94	0,00	5.200.000,00	2.294.909,28	312.336,34	19,63%	18,69%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	12.922.482,88	0,00	10.850.000,00	2.167.648,47	95.165,59	13,27%	12,50%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	8.168.647,92	0,00	8.262.316,33	0,00	93.668,41	3,72%	14,49%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.271.499,79	0,00	3.150.000,00	2.048.064,64	-73.435,15	2,07%	3,50%
Total Renda Variável	122.987.410,87	0,00	101.001.246,69	29.861.923,06	7.875.758,88	6,40%	



CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	11.900.468,98	0,00	7.800.000,00	5.279.170,80	1.178.701,82	15,93%	16,01%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.446.903,18	0,00	15.600.000,00	2.877.046,32	1.030.143,14	14,12%	17,40%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.709.462,28	0,00	900.000,00	1.991.652,02	182.189,74	9,19%	9,37%
Total Exterior	32.056.834,44	0,00	24.300.000,00	10.147.869,14	2.391.034,70	7,46%	

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.

