

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	611.319,15	0,12%	694	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	7.899.715,71	1,60%	884	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	22.686.285,26	4,60%	789	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.870.433,73	1,19%	633	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.891.435,02	1,80%	105	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	22.762.611,11	4,61%	305	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.028.654,15	2,03%	788	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	17.026.802,57	3,45%	850	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.934.952,50	4,44%	914	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.465.747,50	2,12%	769	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.889.006,75	1,19%	445	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	8.239.435,10	1,67%	216	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	26.918.374,28	5,45%	989	0,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	41.058.008,49	8,32%	161	2,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.419.143,84	4,14%	442	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	76.538.580,17	15,50%	437	1,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	30.311.073,26	6,14%	5.910	6,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	16.845.889,03	3,41%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	44.351.910,04	8,98%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	6.528.035,85	1,32%	687	1,74%	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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	441.227,78	0,09%	3.130	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	783.649,34	0,16%	128	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	31.839,61	0,01%	2.092	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	11.342.538,72	2,30%	2.445	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.415.425,07	0,49%	81	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	D+3 du	Não há	721.495,70	0,15%	286	0,78%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.988.834,79	1,42%	1.768	2,05%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+92	Não há	4.178.593,74	0,85%	96	1,11%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	13.881.984,90	2,81%	22	1,50%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	14.446.156,64	2,93%	33	1,36%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	3.248.981,56	0,66%	124	0,25%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	3.479.535,04	0,70%	52	0,87%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+6 du	Não há	335.478,18	0,07%	11	1,66%	Artigo 9º, Inciso II
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INV...	D+6 du	Não há	324.967,41	0,07%	13	1,97%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.943.081,29	0,60%	346	0,45%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	6.581.325,05	1,33%	2.510	1,25%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.774.578,29	0,97%	4.969	0,33%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.837.564,52	1,18%	10	11,13%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	5.207.409,19	1,05%	71	0,91%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	469.714,09	0,10%		0,16%	Artigo 11º

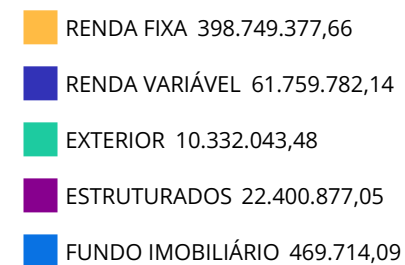
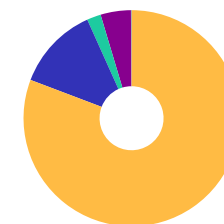


Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			493.711.794,42				

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

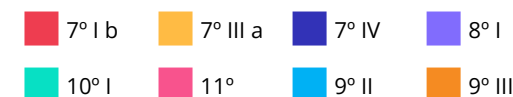
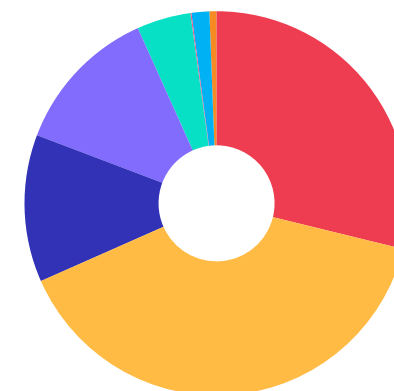
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	148.113.538,33
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	142.306.398,55	28,82%	30,00%	39,15%	90,00%	302.034.216,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	195.245.180,04	39,55%	15,00%	29,00%	60,00%	100.981.896,61
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	61.197.799,07	12,40%	0,00%	5,00%	20,00%	37.544.559,81
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.685.589,72
Total Renda Fixa	100,00%	398.749.377,66	80,77%	45,00%	76,15%	205,00%	



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%	61.759.782,14	12,51%	10,00%	16,00%	35,00%	111.039.345,91
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	22.400.877,05	4,54%	3,00%	5,00%	10,00%	26.970.302,39
Artigo 11º	5,00%	469.714,09	0,10%	0,00%	0,50%	2,00%	9.404.521,80
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	84.630.373,28	17,14%	13,00%	21,50%	47,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	7.388.962,19	1,50%	0,00%	1,70%	5,00%	17.296.627,53
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.943.081,29	0,60%	0,00%	0,65%	5,00%	21.742.508,43
Total Exterior	10,00%	10.332.043,48	2,09%	0,00%	2,35%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	178.312.368,06	36,12	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	111.772.653,22	22,64	-
BANCO DAYCOVAL	44.351.910,04	8,98	-
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	30.311.073,26	6,14	-
TRÍGONO CAPITAL	28.328.141,54	5,74	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	20.419.143,84	4,14	-
BANCO BTG PACTUAL	16.845.889,03	3,41	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	11.342.538,72	2,30	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	8.239.435,10	1,67	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	8.150.490,48	1,65	-
SOMMA INVESTIMENTOS	6.988.834,79	1,42	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	6.581.325,05	1,33	-
4UM INVESTIMENTOS	6.528.035,85	1,32	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.837.564,52	1,18	-
TARPON INVESTIMENTOS	4.178.593,74	0,85	-
GUEPARDO INVESTIMENTOS	2.415.425,07	0,49	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	783.649,34	0,16	-
PRÓPIO CAPITAL	721.495,70	0,15	-
MIRAE ASSET	660.445,59	0,13	-
ZION INVEST	469.714,09	0,10	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	441.227,78	0,09	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	31.839,61	0,01	-

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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	142.306.398,55	28,82	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	195.245.180,04	39,55	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	61.759.782,14	12,51	10,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	7.388.962,19	1,50	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	2.943.081,29	0,60	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	22.400.877,05	4,54	3,00	10,00
Artigo 11º	469.714,09	0,10	0,00	2,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	11,72%	2,89%	4,84%	11,72%	22,14%	0,45%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,45%	11,93%	2,92%	4,62%	11,93%	22,58%	0,49%	0,02%
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%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	5,19%	2,16%	2,63%	5,19%	8,46%	0,34%	0,04%
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%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,73%	15,86%	4,71%	4,15%	15,86%	23,03%	1,44%	0,04%
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%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	16,32%	4,33%	6,17%	16,32%	26,46%	0,66%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,00%	12,75%	3,01%	6,42%	12,75%	27,07%	0,12%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	11,93%	2,58%	5,62%	11,93%	24,53%	0,01%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	14,99%	2,92%	5,73%	14,99%	25,68%	0,06%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,94%	13,39%	2,94%	6,46%	13,39%	27,85%	0,02%	0,00%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	1,24%	14,48%	3,44%	6,90%	14,48%	25,79%	0,31%	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94%	13,63%	3,01%	6,66%	13,63%	28,40%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,84%	4,91%	1,37%	1,98%	4,91%	10,98%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	0,01%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	0,03%
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	0,55%	15,86%	3,91%	4,57%	15,86%	-	4,06%	0,14%

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
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	0,55%	15,86%	3,91%	4,57%	15,86%	-	4,06%	0,14%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,84%	55,29%	11,51%	24,35%	55,29%	78,59%	5,19%	0,19%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5,16%	32,77%	12,96%	10,79%	32,77%	16,94%	4,18%	0,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,82%	13,64%	4,88%	6,55%	13,64%	26,09%	1,31%	0,04%
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,50%	19,59%	11,92%	6,93%	19,59%	22,06%	5,41%	0,15%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,67%	41,44%	12,52%	16,24%	41,44%	47,88%	6,42%	0,19%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,77%	16,71%	-3,14%	5,39%	16,71%	33,07%	5,85%	0,19%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,58%	10,97%	-2,98%	4,93%	10,97%	16,93%	5,50%	0,19%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5,32%	14,64%	10,05%	7,28%	14,64%	18,54%	5,44%	0,17%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	5,56%	13,18%	13,72%	11,11%	13,18%	13,30%	6,15%	0,17%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	7,09%	30,61%	11,88%	12,98%	30,61%	24,77%	4,80%	0,16%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	6,28%	20,87%	7,54%	7,76%	20,87%	14,15%	9,33%	0,23%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5,44%	16,58%	10,83%	10,21%	16,58%	16,17%	7,67%	0,16%

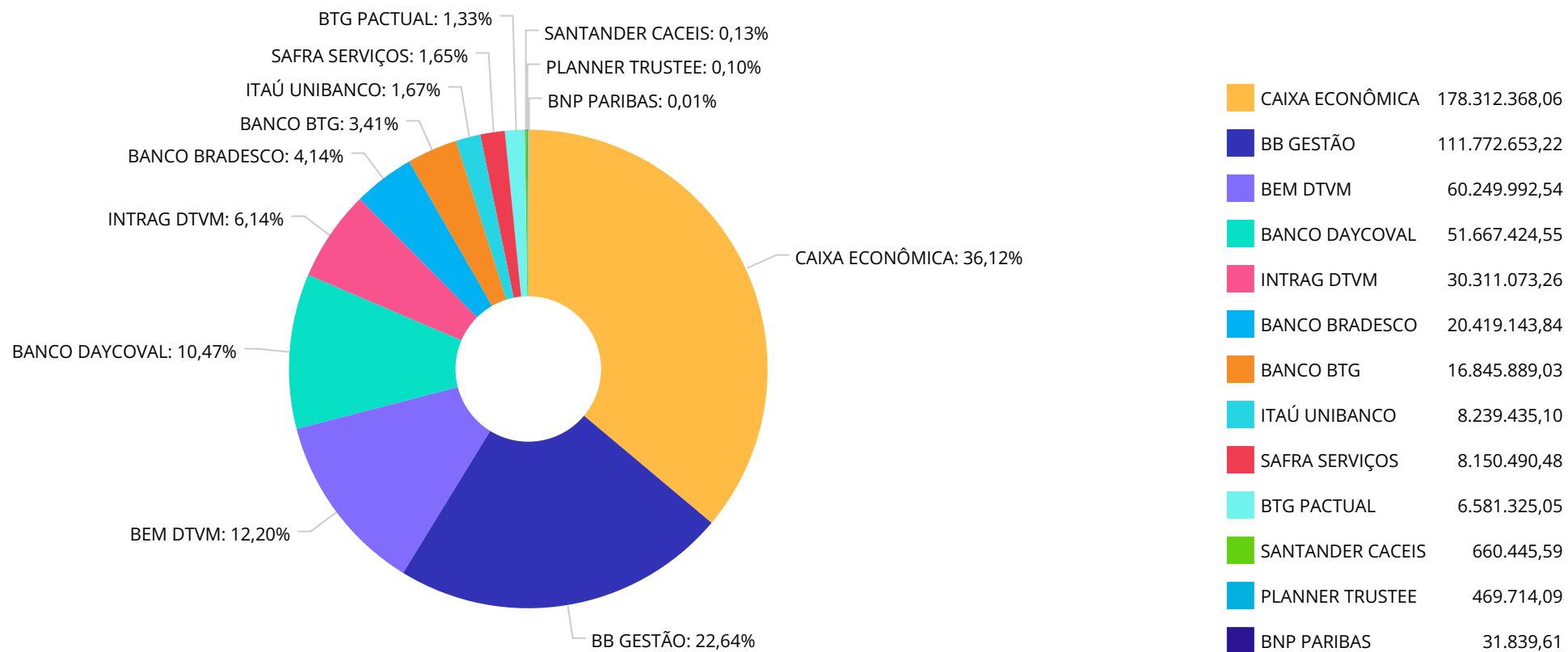
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	4,25%	15,50%	2,86%	4,95%	15,50%	18,06%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-	-	-	-	-	-	16,49%	0,39%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,42%	24,23%	11,24%	7,18%	24,23%	0,08%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5,23%	33,78%	13,12%	11,13%	33,78%	23,09%	4,23%	0,13%
SMLL (Benchmark)	7,05%	17,12%	11,48%	3,40%	17,12%	-0,52%	-	-
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	8,28%	40,01%	12,69%	23,43%	40,01%	23,44%	5,33%	0,21%

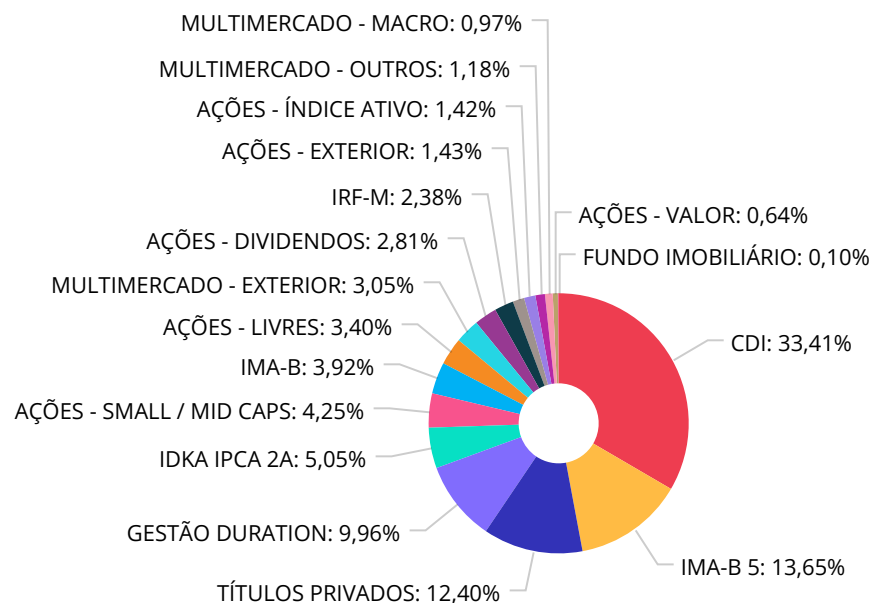
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	5,11%	1,50%	5,68%	3,41%	1,50%	-23,00%	6,49%	15,346%
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8,73%	29,38%	17,08%	16,29%	29,38%	-25,03%	7,68%	24,739%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO EXTE...	6,96%	26,22%	11,64%	0,33%	26,22%	-32,59%	7,85%	21,596%

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



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

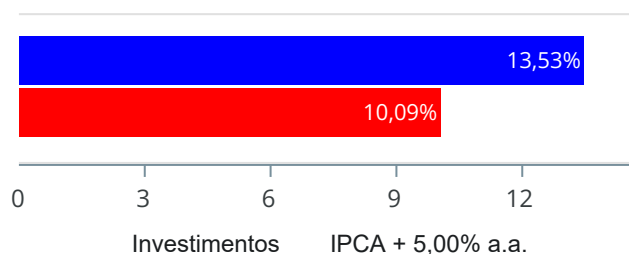


■ CDI	164.934.106,78	■ IMA-B 5	67.383.848,87	■ TÍTULOS PRIVADOS	61.197.799,07	■ GESTÃO DURATION	49.190.481,66
■ IDKA IPCA 2A	24.926.518,28	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	20.974.192,49	■ IMA-B	19.357.182,52	■ AÇÕES - LIVRES	16.777.849,19
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	15.037.715,80	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	13.881.984,90	■ IRF-M	11.759.440,48	■ AÇÕES - EXTERIOR	7.083.061,92
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.988.834,79	■ MULTIMERCADO - OUTROS	5.837.564,52	■ MULTIMERCADO - MACRO	4.774.578,29	■ AÇÕES - VALOR	3.136.920,77
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	469.714,09						

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	392.355.656,83	458.633,10	2.330.723,72	396.999.742,95	6.516.176,74	6.516.176,74	1,66%	1,66%	0,96%	0,96%	173,16%	2,55%
Fevereiro	396.999.742,95	6.812.733,03	3.327.223,55	399.934.272,51	-550.979,92	5.965.196,82	-0,14%	1,52%	1,19%	2,16%	70,33%	2,46%
Março	399.934.272,51	7.317.069,32	4.160.969,66	405.240.103,35	2.149.731,18	8.114.928,00	0,53%	2,06%	1,16%	3,35%	61,62%	2,40%
Abril	405.240.103,35	5.312.044,94	3.074.085,29	410.282.701,00	2.804.638,00	10.919.566,00	0,69%	2,76%	0,96%	4,34%	63,70%	2,03%
Mai	410.282.701,00	121.702.849,23	118.830.594,22	422.304.385,08	9.149.429,07	20.068.995,07	2,21%	5,04%	0,66%	5,03%	100,27%	2,43%
Junho	422.304.385,08	9.781.023,47	1.742.986,13	438.912.725,07	8.570.302,65	28.639.297,72	1,99%	7,13%	0,33%	5,37%	132,81%	1,92%
Julho	438.912.725,07	5.581.706,88	2.649.703,45	447.266.063,60	5.421.335,10	34.060.632,82	1,23%	8,45%	0,53%	5,93%	142,52%	1,79%
Agosto	447.266.063,60	7.156.025,40	3.423.479,57	453.470.582,57	2.471.973,14	36.532.605,96	0,55%	9,04%	0,68%	6,64%	136,08%	2,37%
Setembro	453.470.582,57	13.217.542,87	9.832.724,46	459.623.070,93	2.767.669,95	39.300.275,91	0,61%	9,70%	0,65%	7,34%	132,25%	1,94%
Outubro	459.623.070,93	10.228.179,39	6.644.897,79	460.819.861,27	-2.386.491,26	36.913.784,65	-0,52%	9,14%	0,65%	8,03%	113,75%	2,11%
Novembro	460.819.861,27	11.317.960,02	38.336.696,92	443.925.180,84	10.124.056,47	47.037.841,12	2,20%	11,53%	0,67%	8,76%	131,75%	2,01%
Dezembro	443.925.180,84	59.767.424,00	18.665.840,48	493.711.794,42	8.685.030,06	55.722.871,18	1,79%	13,53%	1,23%	10,09%	134,06%	1,37%

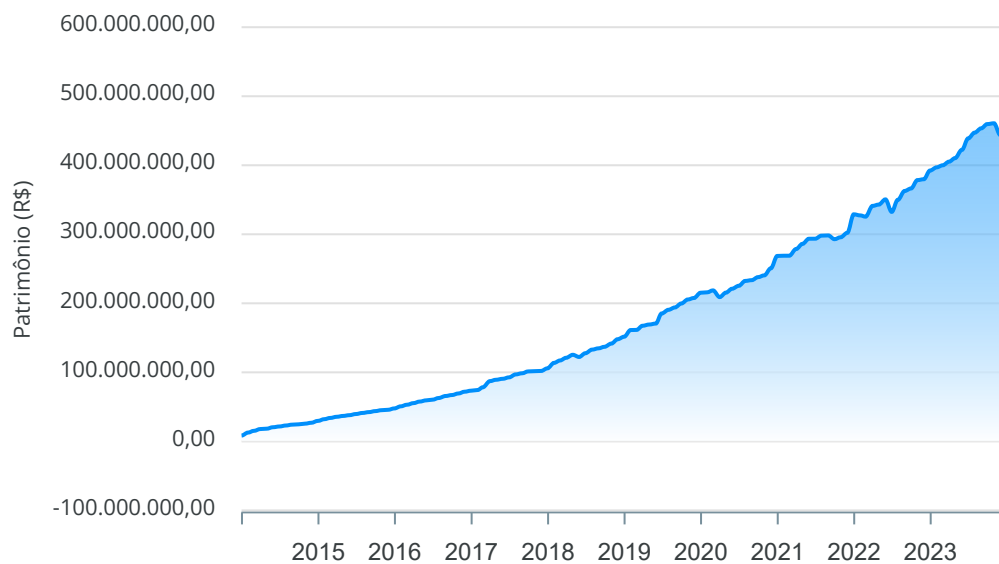
Investimentos x Meta de Rentabilidade



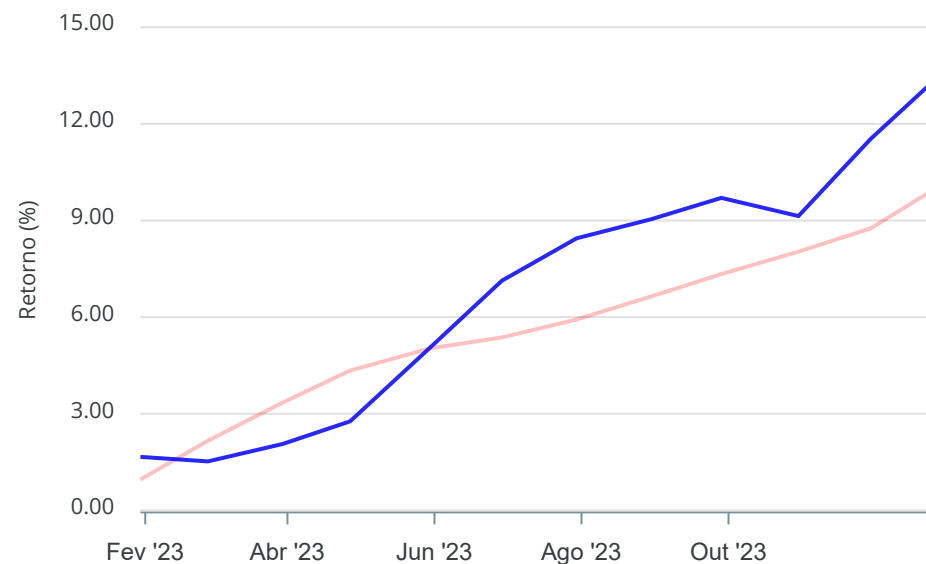
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1

IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.187.963,50	0,00	0,00	10.465.747,50	277.784,00	2,73%	2,73%	1,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	8.108.843,02	0,00	0,00	8.239.435,10	130.592,08	1,61%	1,61%	0,78%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.804.230,17	0,00	0,00	5.889.006,75	84.776,58	1,46%	1,46%	0,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.786.014,63	0,00	0,00	5.870.433,73	84.419,10	1,46%	1,46%	0,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	22.363.242,53	0,00	0,00	22.686.285,26	323.042,73	1,44%	1,44%	0,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.623.886,03	0,00	0,00	21.934.952,50	311.066,47	1,44%	1,44%	0,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.789.526,38	0,00	0,00	7.899.715,71	110.189,33	1,41%	1,41%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.791.415,22	0,00	0,00	17.026.802,57	235.387,35	1,40%	1,40%	0,43%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.909.011,25	0,00	0,00	10.028.654,15	119.642,90	1,21%	1,21%	0,28%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	0,00	30.000.000,00	0,00	30.311.073,26	311.073,26	1,04%	1,24%	0,31%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	40.651.982,20	0,00	0,00	41.058.008,49	406.026,29	1,00%	1,00%	0,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	605.576,75	0,00	0,00	611.319,15	5.742,40	0,95%	0,95%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	75.500.396,55	332.000,00	0,00	76.538.580,17	706.183,62	0,93%	0,93%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.554.431,07	0,00	0,00	22.762.611,11	208.180,04	0,92%	0,92%	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.810.202,87	0,00	0,00	8.891.435,02	81.232,15	0,92%	0,92%	0,34%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	43.972.196,71	0,00	0,00	44.351.910,04	379.713,33	0,86%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	16.714.087,94	0,00	0,00	16.845.889,03	131.801,09	0,79%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.164.836,53	13.102.433,06	0,00	20.419.143,84	151.874,25	0,75%	0,94%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	29.094.953,72	16.332.990,94	18.665.840,48	26.918.374,28	156.270,10	0,34%	0,82%	0,01%
Total Renda Fixa	353.432.797,07	59.767.424,00	18.665.840,48	398.749.377,66	4.214.997,07	1,07%		0,27%

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 FIC AÇÕES	3.804.323,51	0,00	0,00	4.178.593,74	374.270,23	9,84%	9,84%	5,19%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	6.028.868,84	0,00	0,00	6.528.035,85	499.167,01	8,28%	8,28%	5,33%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	731.746,12	0,00	0,00	783.649,34	51.903,22	7,09%	7,09%	4,80%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.650.660,10	0,00	0,00	11.342.538,72	691.878,62	6,50%	6,50%	5,41%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	678.855,55	0,00	0,00	721.495,70	42.640,15	6,28%	6,28%	9,33%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6.620.910,51	0,00	0,00	6.988.834,79	367.924,28	5,56%	5,56%	6,15%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	418.446,00	0,00	0,00	441.227,78	22.781,78	5,44%	5,44%	7,67%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	30.232,87	0,00	0,00	31.839,61	1.606,74	5,31%	5,31%	5,44%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6.254.062,92	0,00	0,00	6.581.325,05	327.262,13	5,23%	5,23%	4,23%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	4.951.733,48	0,00	0,00	5.207.409,19	255.675,71	5,16%	5,16%	4,18%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.250.252,97	0,00	0,00	13.881.984,90	631.731,93	4,77%	4,77%	5,85%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	13.813.065,07	0,00	0,00	14.446.156,64	633.091,57	4,58%	4,58%	5,50%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.352.612,49	0,00	0,00	2.415.425,07	62.812,58	2,67%	2,67%	6,42%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.689.341,95	0,00	0,00	4.774.578,29	85.236,34	1,82%	1,82%	1,31%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.805.837,62	0,00	0,00	5.837.564,52	31.726,90	0,55%	0,55%	4,06%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	483.428,37	0,00	0,00	469.714,09	-13.714,28	-2,84%	-2,84%	16,49%
Total Renda Variável	80.564.378,37	0,00	0,00	84.630.373,28	4.065.994,91	5,05%		5,18%

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
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	308.553,70	0,00	0,00	335.478,18	26.924,48	8,73%	8,73%	7,68%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	303.812,92	0,00	0,00	324.967,41	21.154,49	6,96%	6,96%	7,85%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	3.310.328,48	0,00	0,00	3.479.535,04	169.206,56	5,11%	5,11%	6,49%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3.134.198,78	0,00	0,00	3.248.981,56	114.782,78	3,66%	3,66%	5,44%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.871.111,52	0,00	0,00	2.943.081,29	71.969,77	2,51%	2,51%	5,59%
Total Exterior	9.928.005,40	0,00	0,00	10.332.043,48	404.038,08	4,07%		5,99%

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 MATRIZ FI RENDA FIXA	79.537.173,71	446.000,00	5.650.994,93	76.538.580,17	2.206.401,39	2,76%	2,94%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	39.856.873,62	0,00	0,00	41.058.008,49	1.201.134,87	3,01%	3,01%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	43.299.272,41	0,00	0,00	44.351.910,04	1.052.637,63	2,43%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	32.655.057,93	32.159.651,42	38.646.896,16	26.918.374,28	750.561,09	1,16%	2,58%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	22.042.046,05	0,00	0,00	22.686.285,26	644.239,21	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.312.782,41	0,00	0,00	21.934.952,50	622.170,09	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.281.212,59	0,00	0,00	22.762.611,11	481.398,52	2,16%	2,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.554.036,69	0,00	0,00	17.026.802,57	472.765,88	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.995.406,33	0,00	0,00	10.465.747,50	470.341,17	4,71%	4,71%
LETRA FINANCEIRA BTG	16.470.409,76	0,00	0,00	16.845.889,03	375.479,27	2,28%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	7.919.865,46	0,00	0,00	8.239.435,10	319.569,64	4,04%	4,04%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	0,00	30.000.000,00	0,00	30.311.073,26	311.073,26	1,04%	3,44%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.020.648,04	13.102.433,06	0,00	20.419.143,84	296.062,74	1,47%	3,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.743.835,33	0,00	0,00	10.028.654,15	284.818,82	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.644.804,12	0,00	0,00	5.889.006,75	244.202,63	4,33%	4,33%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.627.050,27	0,00	0,00	5.870.433,73	243.383,46	4,33%	4,33%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.678.219,78	0,00	0,00	7.899.715,71	221.495,93	2,88%	2,88%
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.882.701,79	0,00	13.102.433,06	0,00	219.731,27	1,71%	2,97%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.703.604,11	0,00	0,00	8.891.435,02	187.830,91	2,16%	2,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	593.973,79	0,00	0,00	611.319,15	17.345,36	2,92%	2,92%



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
Total Renda Fixa	369.818.974,19	75.708.084,48	57.400.324,15	398.749.377,66	10.622.643,14	2,74%	

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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.134.345,26	0,00	0,00	11.342.538,72	1.208.193,46	11,92%	11,92%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6.145.864,57	0,00	0,00	6.988.834,79	842.970,22	13,72%	13,72%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5.818.009,31	0,00	0,00	6.581.325,05	763.315,74	13,12%	13,12%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	5.793.056,96	0,00	0,00	6.528.035,85	734.978,89	12,69%	12,69%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	3.503.835,26	0,00	4.178.593,74	674.758,48	19,26%	11,50%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	4.609.833,66	0,00	0,00	5.207.409,19	597.575,53	12,96%	12,96%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.873.959,53	0,00	6.247.111,04	0,00	373.151,51	6,35%	14,36%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.101.643,67	0,00	2.415.425,07	313.781,40	14,93%	12,52%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.552.440,32	0,00	0,00	4.774.578,29	222.137,97	4,88%	4,88%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.617.707,58	0,00	0,00	5.837.564,52	219.856,94	3,91%	3,91%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	700.414,93	0,00	0,00	783.649,34	83.234,41	11,88%	11,88%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	670.900,95	0,00	0,00	721.495,70	50.594,75	7,54%	7,54%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	398.104,65	0,00	0,00	441.227,78	43.123,13	10,83%	10,83%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	28.932,73	0,00	0,00	31.839,61	2.906,88	10,05%	10,05%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	606.856,89	0,00	0,00	469.714,09	-137.142,80	-22,60%	-
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	14.889.945,08	0,00	0,00	14.446.156,64	-443.788,44	-2,98%	-2,98%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.332.262,30	0,00	0,00	13.881.984,90	-450.277,40	-3,14%	-3,14%
Total Renda Variável	80.172.634,72	5.605.478,93	6.247.111,04	84.630.373,28	5.099.370,67	5,94%	

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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3.002.064,83	0,00	0,00	3.248.981,56	246.916,73	8,22%	8,22%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	3.292.582,83	0,00	0,00	3.479.535,04	186.952,21	5,68%	5,68%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.759.178,42	0,00	0,00	2.943.081,29	183.902,87	6,67%	6,67%
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	286.538,43	0,00	0,00	335.478,18	48.939,75	17,08%	17,08%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	291.097,51	0,00	0,00	324.967,41	33.869,90	11,64%	11,64%
Total Exterior	9.631.462,02	0,00	0,00	10.332.043,48	700.581,46	7,27%	

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 MATRIZ FI RENDA FIXA	64.781.757,89	40.351.649,61	37.564.944,54	76.538.580,17	8.970.117,21	8,53%	13,39%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	35.109.969,89	3.930.263,22	2.618.147,78	41.058.008,49	4.635.923,16	11,87%	12,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	20.267.757,68	0,00	0,00	22.686.285,26	2.418.527,58	11,93%	11,93%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	0,00	42.000.000,00	0,00	44.351.910,04	2.351.910,04	5,60%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.591.019,96	0,00	0,00	21.934.952,50	2.343.932,54	11,96%	11,96%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.645.376,13	0,00	1.225.404,51	22.762.611,11	2.342.639,49	10,82%	5,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.419.849,23	106.263.366,83	86.793.317,54	26.918.374,28	2.028.475,76	1,82%	11,93%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.216.053,59	0,00	0,00	17.026.802,57	1.810.748,98	11,90%	11,90%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	30.253.475,14	0,00	31.849.868,92	0,00	1.596.393,78	5,28%	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.033.310,30	0,00	0,00	10.465.747,50	1.432.437,20	15,86%	15,86%
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.688.446,46	0,00	13.102.433,06	0,00	1.413.986,60	12,10%	13,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	25.148.646,95	0,00	26.480.145,82	0,00	1.331.498,87	5,29%	13,43%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.829.125,08	0,00	0,00	10.028.654,15	1.199.529,07	13,59%	13,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	7.112.791,39	0,00	0,00	8.239.435,10	1.126.643,71	15,84%	15,84%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.364.782,00	13.102.433,06	0,00	20.419.143,84	951.928,78	4,89%	13,63%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.452.517,45	0,00	474.902,75	8.891.435,02	913.820,32	10,81%	5,19%
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	16.000.000,00	0,00	16.845.889,03	845.889,03	5,29%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.070.710,56	0,00	0,00	7.899.715,71	829.005,15	11,72%	11,72%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.062.887,90	0,00	0,00	5.889.006,75	826.118,85	16,32%	16,32%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.057.964,05	0,00	0,00	5.870.433,73	812.469,68	16,06%	16,06%

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
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	0,00	30.000.000,00	0,00	30.311.073,26	311.073,26	1,04%	14,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	531.647,37	0,00	0,00	611.319,15	79.671,78	14,99%	14,99%
Total Renda Fixa	306.638.089,02	251.647.712,72	200.109.164,92	398.749.377,66	40.572.740,84	11,33%	

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
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.894.013,70	0,00	0,00	13.881.984,90	1.987.971,20	16,71%	16,71%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	4.662.579,96	0,00	0,00	6.528.035,85	1.865.455,89	40,01%	40,01%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	9.484.670,86	0,00	0,00	11.342.538,72	1.857.867,86	19,59%	19,59%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	4.919.624,94	0,00	0,00	6.581.325,05	1.661.700,11	33,78%	33,78%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	13.018.305,27	0,00	0,00	14.446.156,64	1.427.851,37	10,97%	10,97%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	3.922.220,50	0,00	0,00	5.207.409,19	1.285.188,69	32,77%	32,77%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6.174.841,56	0,00	0,00	6.988.834,79	813.993,23	13,18%	13,18%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	5.038.457,48	0,00	0,00	5.837.564,52	799.107,04	15,86%	15,86%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	3.503.835,26	0,00	4.178.593,74	674.758,48	19,26%	55,29%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6.018.434,15	0,00	6.663.649,28	0,00	645.215,13	10,72%	16,46%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.201.379,22	0,00	0,00	4.774.578,29	573.199,07	13,64%	13,64%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.757.561,57	0,00	6.247.111,04	0,00	489.549,47	8,50%	16,67%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.101.643,67	0,00	2.415.425,07	313.781,40	14,93%	41,44%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,00	700.000,00	0,00	783.649,34	83.649,34	11,95%	30,61%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	378.483,29	0,00	0,00	441.227,78	62.744,49	16,58%	16,58%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	0,00	700.000,00	0,00	721.495,70	21.495,70	3,07%	20,87%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	27.773,80	0,00	0,00	31.839,61	4.065,81	14,64%	14,64%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	966.856,74	0,00	0,00	469.714,09	-497.142,65	-51,42%	-
Total Renda Variável	76.465.203,04	7.005.478,93	12.910.760,32	84.630.373,28	14.070.451,63	16,86%	

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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.800.498,65	0,00	0,00	3.248.981,56	448.482,91	16,01%	16,01%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.506.934,73	0,00	0,00	2.943.081,29	436.146,56	17,40%	17,40%
SOMMA CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	259.298,09	0,00	0,00	335.478,18	76.180,09	29,38%	29,38%
SOMMA ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVES...	257.471,26	0,00	0,00	324.967,41	67.496,15	26,22%	26,22%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	3.428.162,04	0,00	0,00	3.479.535,04	51.373,00	1,50%	1,50%
Total Exterior	9.252.364,77	0,00	0,00	10.332.043,48	1.079.678,71	11,67%	

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.

