

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

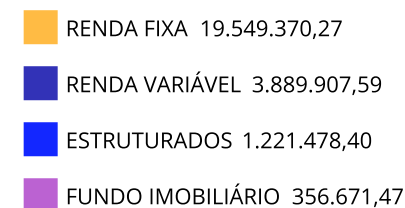
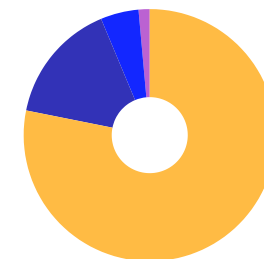
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			3.746.605,75	14,98%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	837.077,24	3,35%	694	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	481.763,17	1,93%	884	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	65.470,28	0,26%	789	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.002.200,60	8,00%	649	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	100.854,85	0,40%	1.141	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	239.154,69	0,96%	633	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.061.662,33	8,24%	788	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.624.896,67	6,50%	850	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.065.646,20	4,26%	914	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.411,03	0,01%	769	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	421.677,21	1,69%	1.190	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	320.540,82	1,28%	445	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.670.324,69	6,68%	1.133	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.960.166,36	11,83%	988	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	D+7	Não há	41.452,87	0,17%	6.195	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CDB - BANCO DAYCOVAL	S/Info	Não Há	292.310,70	1,17%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	D+0	Não se aplica	499.526,82	2,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	1.116.627,99	4,46%	105	0,50%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	383.685,41	1,53%	938	0,06%	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
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	421.767,31	1,69%	10.880	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.479.476,99	5,91%	392	1,11%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+3	Não há	437.696,14	1,75%	3.747	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	284.542,55	1,14%	3.939	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
TARUÁ FIC AÇÕES	D+32	Não há	226.381,21	0,90%	105	1,23%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	656.357,98	2,62%	33	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.090.736,23	4,36%	5.128	0,20%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	130.742,17	0,52%	4.757	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	39.142,27	0,16%		0,01%	Artigo 11º
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	280.350,00	1,12%		0,20%	Artigo 11º
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	Não se ...	Não se aplica	37.179,20	0,15%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			25.017.427,73				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			166.915,00				Artigo 6º
PL Total			25.184.342,73				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	3.746.605,75	14,98%	11,00%	15,21%	81,95%	16.755.176,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	9.222.355,09	36,86%	20,31%	21,13%	81,95%	11.279.426,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	4.671.943,92	18,67%	12,71%	27,62%	60,00%	10.338.512,72
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	791.837,52	3,17%	1,26%	1,68%	20,00%	4.211.648,03
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	1.116.627,99	4,46%	4,50%	5,00%	5,00%	134.243,40
Total Renda Fixa	100,00%	19.549.370,27	78,14%	49,78%	70,64%	248,90%	



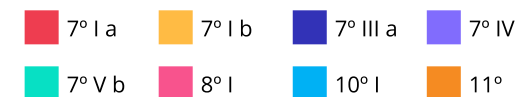
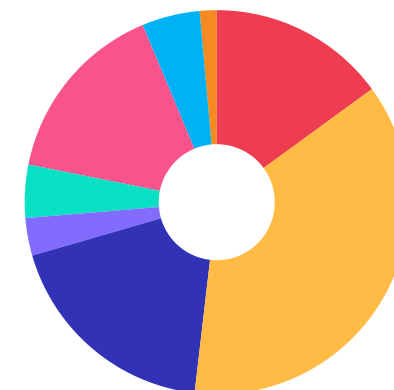
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	3.889.907,59	15,55%	1,89%	16,46%	20,00%	1.113.577,96
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.221.478,40	4,88%	3,75%	5,00%	10,00%	1.280.264,37
Artigo 11º	5,00%	356.671,47	1,43%	1,43%	1,90%	5,00%	894.199,92
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	5.468.057,46	21,86%	7,07%	23,36%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	2.501.742,77
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	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 '	3.746.605,75	14,98	11,00	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	9.222.355,09	36,86	20,31	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.671.943,92	18,67	12,71	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	1.116.627,99	4,46	4,50	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.889.907,59	15,55	1,89	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.221.478,40	4,88	3,75	10,00
Artigo 11º	356.671,47	1,43	1,43	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	11.749.167,56	46,96	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.396.845,52	21,57	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	3.746.605,75	14,98	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.479.476,99	5,91	0,02
BANCO DAYCOVAL	791.837,52	3,17	0,01
TRÍGONO CAPITAL	656.357,98	2,62	-
GENIAL INVESTIMENTOS	437.696,14	1,75	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	284.542,55	1,14	0,00
TARUÁ CAPITAL	226.381,21	0,90	-
SICREDI	130.742,17	0,52	0,00
V8 CAPITAL	41.452,87	0,17	-
ZION INVEST	39.142,27	0,16	-
BV ASSET	37.179,20	0,15	-

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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	11,72%	2,89%	4,84%	11,72%	22,14%	0,45%	2,00%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	10,82%	2,57%	4,71%	10,90%	24,35%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,43%	12,55%	3,04%	5,26%	12,55%	24,21%	0,47%	2,05%
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	12,88%	2,80%	6,00%	12,88%	26,13%	0,04%	0,35%
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,45%	11,93%	2,92%	4,62%	11,93%	22,58%	0,49%	1,98%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
CDB - BANCO DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,73%	15,86%	4,71%	4,15%	15,86%	23,03%	1,44%	4,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,74%	15,77%	4,71%	4,04%	15,77%	22,83%	1,46%	4,47%

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
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%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,46%	16,06%	4,33%	6,05%	16,06%	26,02%	0,66%	2,64%
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
TARUÁ FIC AÇÕES	6,37%	13,90%	11,65%	4,79%	13,90%	19,95%	6,83%	18,90%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	14,99%	2,92%	5,73%	14,99%	25,68%	0,06%	1,59%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	12,98%	2,83%	6,15%	12,98%	27,20%	0,01%	0,08%
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	0,89%	12,90%	2,74%	5,96%	12,90%	27,97%	0,04%	0,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92%	13,32%	2,94%	6,48%	13,32%	27,68%	0,02%	0,07%
IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	1,29%

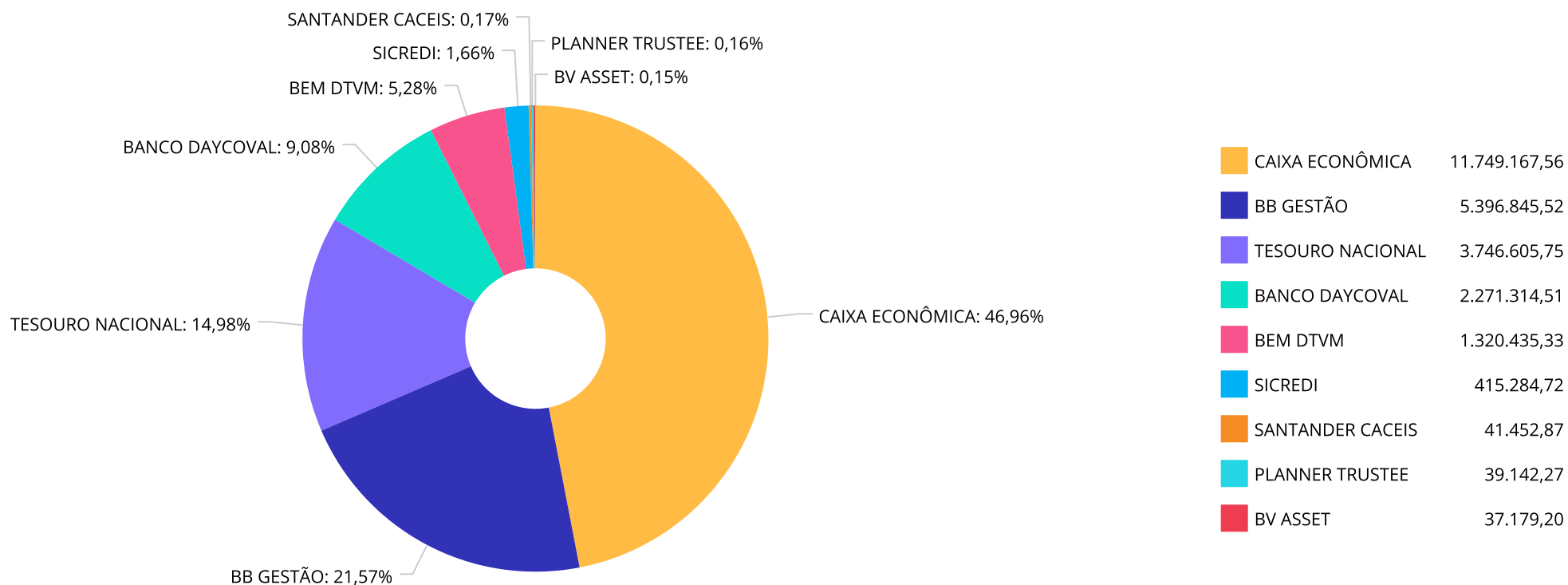
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	3,79%	0,91%	14,84%	6,46%	0,91%	-	9,16%	29,94%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,04%	14,50%	5,96%	8,00%	14,50%	28,27%	1,91%	4,89%
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,40%	17,15%	10,44%	8,41%	17,15%	15,05%	6,16%	16,61%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	6,11%	20,35%	14,96%	11,35%	20,35%	33,19%	6,42%	16,59%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,21%	23,96%	13,41%	12,65%	23,96%	47,34%	4,32%	14,34%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,58%	10,97%	-2,98%	4,93%	10,97%	16,93%	5,50%	19,35%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4,97%	15,79%	14,36%	11,97%	15,79%	23,25%	6,26%	16,95%
TARUÁ FIC AÇÕES	6,37%	13,90%	11,65%	4,79%	13,90%	19,95%	6,83%	18,90%
IFIX (Benchmark)	4,25%	15,50%	2,86%	4,95%	15,50%	18,06%	-	-
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	3,70%	14,43%	1,13%	-1,13%	14,43%	3,29%	4,12%	11,45%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-2,84%	-51,42%	-22,60%	-33,50%	-51,42%	-50,54%	16,49%	39,32%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,42%	27,14%	-1,79%	1,81%	27,14%	17,38%	17,81%	23,92%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,42%	24,23%	11,24%	7,18%	24,23%	0,08%	-	-

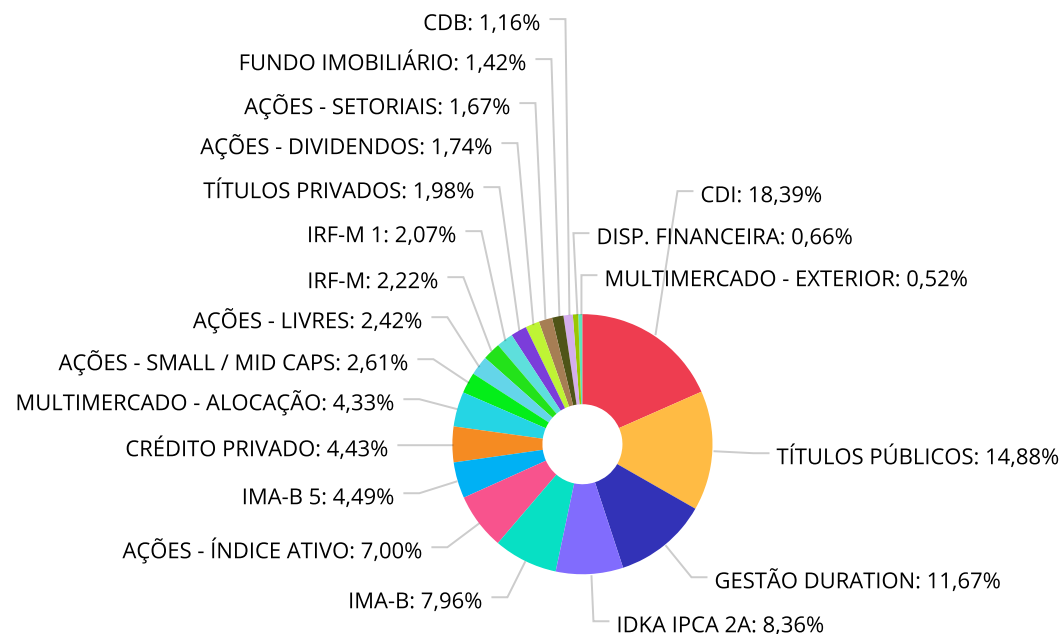
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	5,24%	33,76%	13,14%	11,11%	33,76%	18,05%	4,23%	13,28%

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



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



CDI	4.630.491,05	TÍTULOS PÚBLICOS	3.746.605,75	GESTÃO DURATION	2.940.192,44	IDKA IPCA 2A	2.106.659,84
IMA-B	2.003.611,63	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.764.019,54	IMA-B 5	1.131.116,48	CRÉDITO PRIVADO	1.116.627,99
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.090.736,23	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	656.357,98	AÇÕES - LIVRES	610.066,62	IRF-M	559.695,51
IRF-M 1	522.532,06	TÍTULOS PRIVADOS	499.526,82	AÇÕES - DIVIDENDOS	437.696,14	AÇÕES - SETORIAIS	421.767,31
FUNDO IMOBILIÁRIO	356.671,47	CDB	292.310,70	DISP. FINANCEIRA	166.915,00	MULTIMERCADO - EXTERIOR	130.742,17

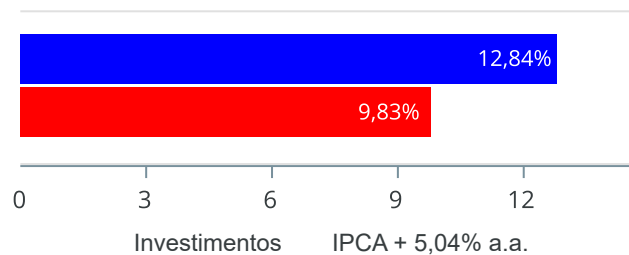
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	16/12/2022	118	4.027,194741	4.353,184047	475.208,98	513.675,72	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	06/05/2022	333	4209,710000	4.470,432406	1.401.833,43	1.488.653,99	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	16/05/2022	113	4152,810000	4.449,872129	469.267,53	502.835,55	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/10/2023	121	4.324,301327	4.419,673568	523.240,46	534.780,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	02/09/2022	118	4108,850000	4.555,613089	484.844,30	537.562,34	Mercado

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	21.160.591,24	1.591.733,85	2.291.390,99	20.742.705,88	281.771,78	281.771,78	1,33%	1,33%	0,96%	0,96%	138,35%	3,35%
Fevereiro	20.742.705,88	655.000,00	7.302,00	21.114.990,72	-275.413,16	6.358,62	-1,29%	0,03%	1,19%	2,17%	1,24%	2,71%
Março	21.114.990,72	743.802,64	676.331,55	21.268.875,69	86.413,88	92.772,50	0,41%	0,43%	1,16%	3,36%	12,96%	3,03%
Abril	21.268.875,69	522.000,00	553.302,00	21.411.108,24	173.534,55	266.307,05	0,82%	1,25%	0,96%	4,35%	28,81%	3,01%
Mai	21.411.108,24	657.000,00	566.302,00	21.973.564,94	471.758,70	738.065,75	2,19%	3,48%	0,66%	5,04%	68,92%	2,92%
Junho	21.973.564,94	1.514.000,00	1.374.954,38	22.899.740,85	787.130,29	1.525.196,04	3,56%	7,16%	0,33%	5,39%	132,82%	2,21%
Julho	22.899.740,85	899.300,00	1.255.293,35	22.801.914,65	258.167,15	1.783.363,19	1,13%	8,37%	0,53%	5,95%	140,63%	2,07%
Agosto	22.801.914,65	3.991.500,00	4.117.805,08	22.604.334,61	-71.274,96	1.712.088,23	-0,31%	8,03%	0,68%	6,67%	120,35%	2,41%
Setembro	22.604.334,61	484.376,91	591.337,00	22.520.704,58	23.330,06	1.735.418,29	0,10%	8,14%	0,65%	7,37%	110,50%	2,56%
Outubro	22.520.704,58	2.805.840,46	2.943.798,75	22.207.363,72	-175.382,57	1.560.035,72	-0,78%	7,30%	0,65%	8,07%	90,47%	2,37%
Novembro	22.207.363,72	473.168,06	613.784,32	22.750.737,41	683.989,95	2.244.025,67	3,08%	10,60%	0,67%	8,79%	120,59%	2,17%
Dezembro	22.750.737,41	3.015.000,00	1.245.375,80	25.017.427,73	497.066,12	2.741.091,79	2,03%	12,84%	0,95%	9,83%	130,67%	1,90%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



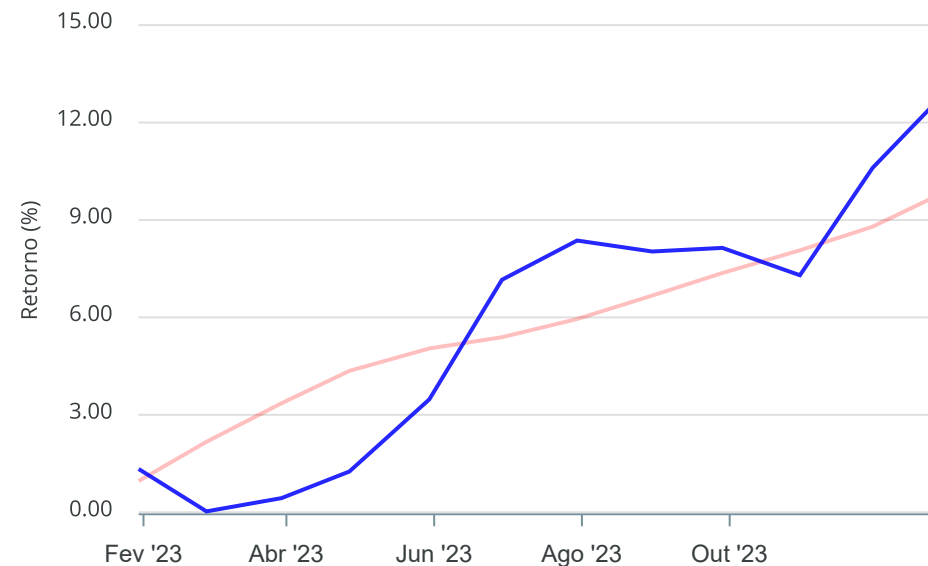
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	3.627.355,38	0,00	0,00	3.746.605,75	119.250,37	3,29%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.373,58	0,00	0,00	1.411,03	37,45	2,73%	2,73%	1,44%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	315.926,40	0,00	0,00	320.540,82	4.614,42	1,46%	1,46%	0,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	235.715,55	0,00	0,00	239.154,69	3.439,14	1,46%	1,46%	0,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	64.538,01	0,00	0,00	65.470,28	932,27	1,44%	1,44%	0,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.050.533,93	0,00	0,00	1.065.646,20	15.112,27	1,44%	1,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.100.914,90	0,00	0,00	1.116.627,99	15.713,09	1,43%	1,43%	0,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	475.043,28	0,00	0,00	481.763,17	6.719,89	1,41%	1,41%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.602.433,26	0,00	0,00	1.624.896,67	22.463,41	1,40%	1,40%	0,43%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.037.066,48	0,00	0,00	2.061.662,33	24.595,85	1,21%	1,21%	0,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	829.214,18	0,00	0,00	837.077,24	7.863,06	0,95%	0,95%	0,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	417.972,75	0,00	0,00	421.677,21	3.704,46	0,89%	0,89%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	99.969,39	0,00	0,00	100.854,85	885,46	0,89%	0,89%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.602.706,43	332.000,00	0,00	2.960.166,36	25.459,93	0,87%	0,92%	0,02%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	495.354,40	0,00	0,00	499.526,82	4.172,42	0,84%	-	-
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	41.108,25	0,00	0,00	41.452,87	344,62	0,84%	0,89%	0,04%
CDB - BANCO DAYCOVAL	290.052,97	0,00	0,00	292.310,70	2.257,73	0,78%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.211.704,08	686.000,00	1.243.000,00	1.670.324,69	15.620,61	0,54%	0,90%	0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	325,20	1.997.000,00	0,00	2.002.200,60	4.875,40	0,24%	2,74%	1,46%
Total Renda Fixa	17.499.308,42	3.015.000,00	1.243.000,00	19.549.370,27	278.061,85	1,44%		0,40%

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
TARUÁ FIC AÇÕES	212.831,15	0,00	0,00	226.381,21	13.550,06	6,37%	6,37%	6,83%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	268.169,38	0,00	0,00	284.542,55	16.373,17	6,11%	6,11%	6,42%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	364.016,42	0,00	0,00	383.685,41	19.668,99	5,40%	5,40%	6,16%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	124.238,12	0,00	0,00	130.742,17	6.504,05	5,24%	5,24%	4,23%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.409.412,06	0,00	0,00	1.479.476,99	70.064,93	4,97%	4,97%	6,26%
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	35.853,00	0,00	345,80	37.179,20	1.672,00	4,66%	4,71%	4,12%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	627.593,60	0,00	0,00	656.357,98	28.764,38	4,58%	4,58%	5,50%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	420.025,28	0,00	0,00	437.696,14	17.670,86	4,21%	4,21%	4,32%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	406.350,20	0,00	0,00	421.767,31	15.417,11	3,79%	3,79%	9,16%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	273.735,00	0,00	2.030,00	280.350,00	8.645,00	3,16%	3,18%	17,81%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.068.919,67	0,00	0,00	1.090.736,23	21.816,56	2,04%	2,04%	1,91%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	40.285,11	0,00	0,00	39.142,27	-1.142,84	-2,84%	-2,84%	16,49%
Total Renda Variável	5.251.428,99	0,00	2.375,80	5.468.057,46	219.004,27	4,17%		6,00%

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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	3.065.635,62	523.240,46	28.408,52	3.746.605,75	186.138,19	5,19%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.676.245,71	1.212.800,00	0,00	2.960.166,36	71.120,65	2,46%	2,94%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.003.110,08	0,00	0,00	2.061.662,33	58.552,25	2,92%	2,92%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	942.903,20	2.530.800,00	1.855.500,00	1.670.324,69	52.121,49	1,50%	2,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.579.779,79	0,00	0,00	1.624.896,67	45.116,88	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.083.686,95	0,00	0,00	1.116.627,99	32.941,04	3,04%	3,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.035.419,87	0,00	0,00	1.065.646,20	30.226,33	2,92%	2,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	813.326,28	0,00	0,00	837.077,24	23.750,96	2,92%	2,92%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	468.255,26	0,00	0,00	481.763,17	13.507,91	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	507.824,39	0,00	200.000,00	320.540,82	12.716,43	2,50%	4,33%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	487.683,42	0,00	0,00	499.526,82	11.843,40	2,43%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	410.090,60	0,00	0,00	421.677,21	11.586,61	2,83%	2,83%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	601.398,45	0,00	370.000,00	239.154,69	7.756,24	1,29%	4,33%
CDB - BANCO DAYCOVAL	285.596,82	0,00	0,00	292.310,70	6.713,88	2,35%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	98.104,67	0,00	0,00	100.854,85	2.750,18	2,80%	2,80%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	63.611,07	0,00	0,00	65.470,28	1.859,21	2,92%	2,92%
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	10.729,76	30.168,06	0,00	41.452,87	555,05	1,36%	2,74%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.273.798,71	1.997.000,00	1.268.926,75	2.002.200,60	328,64	0,01%	4,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.074.542,45	0,00	1.073.000,00	1.411,03	-131,42	-0,01%	4,71%

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	17.481.743,10	6.294.008,52	4.795.835,27	19.549.370,27	569.453,92	3,00%	

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
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.293.716,93	0,00	0,00	1.479.476,99	185.760,06	14,36%	14,36%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.029.428,38	0,00	0,00	1.090.736,23	61.307,85	5,96%	5,96%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	367.274,85	0,00	0,00	421.767,31	54.492,46	14,84%	14,84%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	385.957,88	0,00	0,00	437.696,14	51.738,26	13,41%	13,41%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	247.512,03	0,00	0,00	284.542,55	37.030,52	14,96%	14,96%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	347.430,12	0,00	0,00	383.685,41	36.255,29	10,44%	10,44%
TARUÁ FIC AÇÕES	202.768,55	0,00	0,00	226.381,21	23.612,66	11,65%	11,65%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	115.555,67	0,00	0,00	130.742,17	15.186,50	13,14%	13,14%
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	36.765,00	0,00	1.033,60	37.179,20	1.447,80	3,94%	1,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	285.460,00	0,00	6.090,00	280.350,00	980,00	0,34%	-1,79%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	50.570,67	0,00	0,00	39.142,27	-11.428,40	-22,60%	-22,60%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	676.521,40	0,00	0,00	656.357,98	-20.163,42	-2,98%	-2,98%
Total Renda Variável	5.038.961,48	0,00	7.123,60	5.468.057,46	436.219,58	8,66%	

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
TÍTULOS PÚBLICOS	2.746.334,21	523.240,46	87.376,60	3.746.605,75	564.407,68	0,17%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.708.251,96	0,00	940.000,00	2.061.662,33	293.410,37	13,34%	13,59%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.765.282,51	2.508.535,45	1.600.000,00	2.960.166,36	286.348,40	12,41%	13,32%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.388.581,76	6.764.265,89	6.715.278,30	1.670.324,69	232.755,34	9,34%	12,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.305.432,24	155.000,00	0,00	1.624.896,67	164.464,43	11,84%	11,90%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	992.135,55	0,00	0,00	1.116.627,99	124.492,44	12,54%	12,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	951.773,01	0,00	0,00	1.065.646,20	113.873,19	11,97%	11,96%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	727.982,93	0,00	0,00	837.077,24	109.094,31	14,99%	14,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	431.360,15	559.557,19	576.000,00	481.763,17	66.845,83	11,26%	11,72%
LETRA FINANCEIRA DAYCOVAL	0,00	450.000,00	0,00	499.526,82	49.526,82	10,99%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	373.098,53	0,00	0,00	421.677,21	48.578,68	13,03%	13,02%
CDB - BANCO DAYCOVAL	352.972,89	262.743,85	356.567,80	292.310,70	33.161,76	11,02%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	788.059,55	592.000,00	1.158.000,00	239.154,69	17.095,14	13,57%	16,06%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	149.329,45	505.000,00	349.000,00	320.540,82	15.211,37	14,93%	16,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	105.738,08	0,00	16.500,00	100.854,85	11.616,77	12,82%	12,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	58.490,65	0,00	0,00	65.470,28	6.979,63	11,93%	11,93%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	871.239,07	0,00	875.064,84	0,00	3.825,77	0,44%	11,93%
V8 VANQUISH TERMO FI RENDA FIXA	0,00	40.879,08	0,00	41.452,87	573,79	2,24%	12,90%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.100.000,00	1.073.000,00	1.411,03	-25.588,97	2,95%	15,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	3.301.500,00	1.268.926,75	2.002.200,60	-30.372,65	0,07%	15,77%

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
Total Renda Fixa	15.716.062,54	16.762.721,92	15.015.714,29	19.549.370,27	2.086.300,10	11,95%	

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
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.276.834,93	0,00	0,00	1.479.476,99	202.642,06	15,87%	15,79%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	952.652,64	0,00	0,00	1.090.736,23	138.083,59	14,50%	14,49%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	220.500,00	0,00	23.940,00	280.350,00	83.790,00	39,66%	27,14%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	591.483,87	0,00	0,00	656.357,98	64.874,11	10,96%	10,97%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	327.531,73	0,00	0,00	383.685,41	56.153,68	17,14%	17,14%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	236.429,48	0,00	0,00	284.542,55	48.113,07	20,37%	20,35%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	390.000,00	0,00	437.696,14	47.696,14	12,24%	23,96%
SICREDI BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	97.744,90	0,00	0,00	130.742,17	32.997,27	33,77%	33,76%
TARUÁ FIC AÇÕES	0,00	200.000,00	0,00	226.381,21	26.381,21	13,21%	13,90%
TIVIO RENDA IMOBILIARIA FII - TVRI11	32.490,00	0,00	4.119,20	37.179,20	8.808,40	28,62%	14,43%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	417.947,01	0,00	0,00	421.767,31	3.820,30	0,94%	0,91%
DAYCOVAL TOP SELEÇÃO FIC AÇÕES	379.328,31	0,00	377.851,35	0,00	-1.476,96	-0,38%	6,07%
META VALOR FI AÇÕES	831.872,74	0,00	815.352,38	0,00	-16.520,36	-1,98%	1,25%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	79.713,09	0,00	0,00	39.142,27	-40.570,82	-50,89%	-51,42%
Total Renda Variável	5.444.528,70	590.000,00	1.221.262,93	5.468.057,46	654.791,69	10,85%	

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.

