

2023

Relatório Mensal, 4º trimestre e ano de 2023

Dezembro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	194.682.639,88	35,05%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.073.378,14	5,95%	6.297.472.287,75	0,53%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.252.447,20	2,93%	5.290.529.627,75	0,31%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	59.383.993,44	10,69%	8.470.280.308,74	0,70%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.908.385,03	2,68%	2.287.059.745,87	0,65%	7º I b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	101.928.376,21	18,35%	13.988.008.512,08	0,73%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	25.101.337,97	4,52%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	35.609.181,55	6,41%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	20.625.659,61	3,71%	0,00		7º IV
BB AGRO FIC AÇÕES	13.663.372,11	2,46%	321.664.294,87	4,25%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	14.341.677,98	2,58%	1.502.801.211,89	0,95%	8º I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.904.729,78	1,78%	1.297.128.287,58	0,76%	9º III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.089.800,73	1,64%	658.947.271,35	1,38%	9º III
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	6.906.959,99	1,24%	80.869.143,26	8,54%	10º I

Investimentos

 555.471.939,62

Disponibilidades Financeiras

 0,00

Total Carteira

 555.471.939,62

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2040 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	5.000	4.347,279814	21.736.399,07
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.182,864497	12.548.593,49
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.182,864497	8.365.728,99
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.268,388059	4.268.388,06
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.346,874212	11.614.847,89
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.422,508603	34.619.397,34
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.555,613089	5.348.289,77
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.279,008988	8.558.017,98
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.226,619377	35.190.832,93
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.387,049755	201.804,29
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.438,034393	19.971.154,77
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.379,255499	21.896.277,50
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.207,815316	9.677.975,23
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7550%	154	4.447,614136	684.932,58

Investimentos

\$ 555.471.939,62

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 555.471.939,62

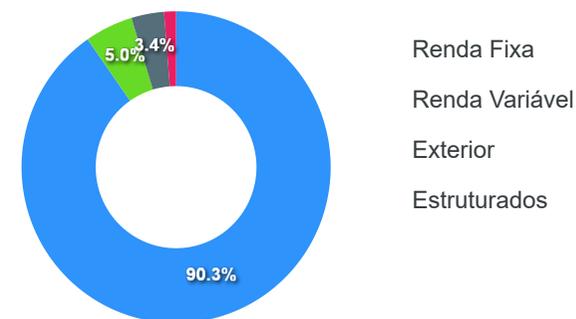
Governança (Pró Gestão)


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	35,05% 194.682.639,88	64,95% 360.789.299,74
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,25% 123.618.203,81	77,75% 431.853.735,81
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	18,35% 101.928.376,21	41,65% 231.354.787,56
7° IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	14,64% 81.336.179,13	5,36% 29.758.208,79
8° I - Fundos de Ações	30,00%	5,04% 28.005.050,09	24,96% 138.636.531,80
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,42% 18.994.530,51	6,58% 36.552.663,45
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	1,24% 6.906.959,99	8,76% 48.640.233,97

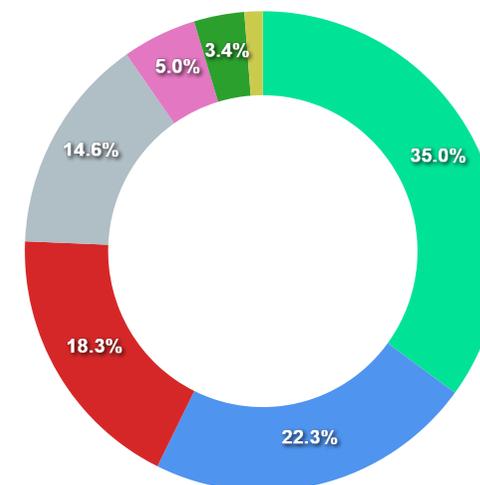
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



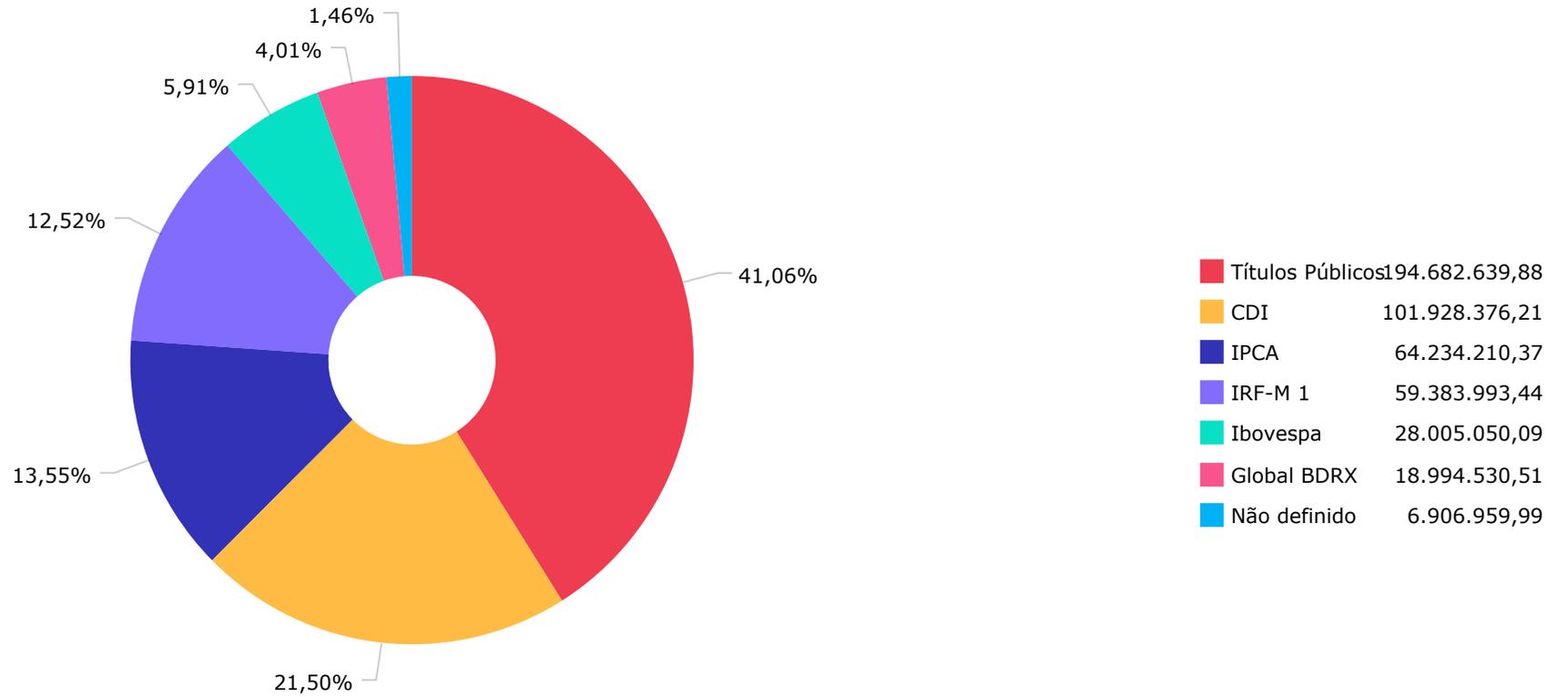
Artigos

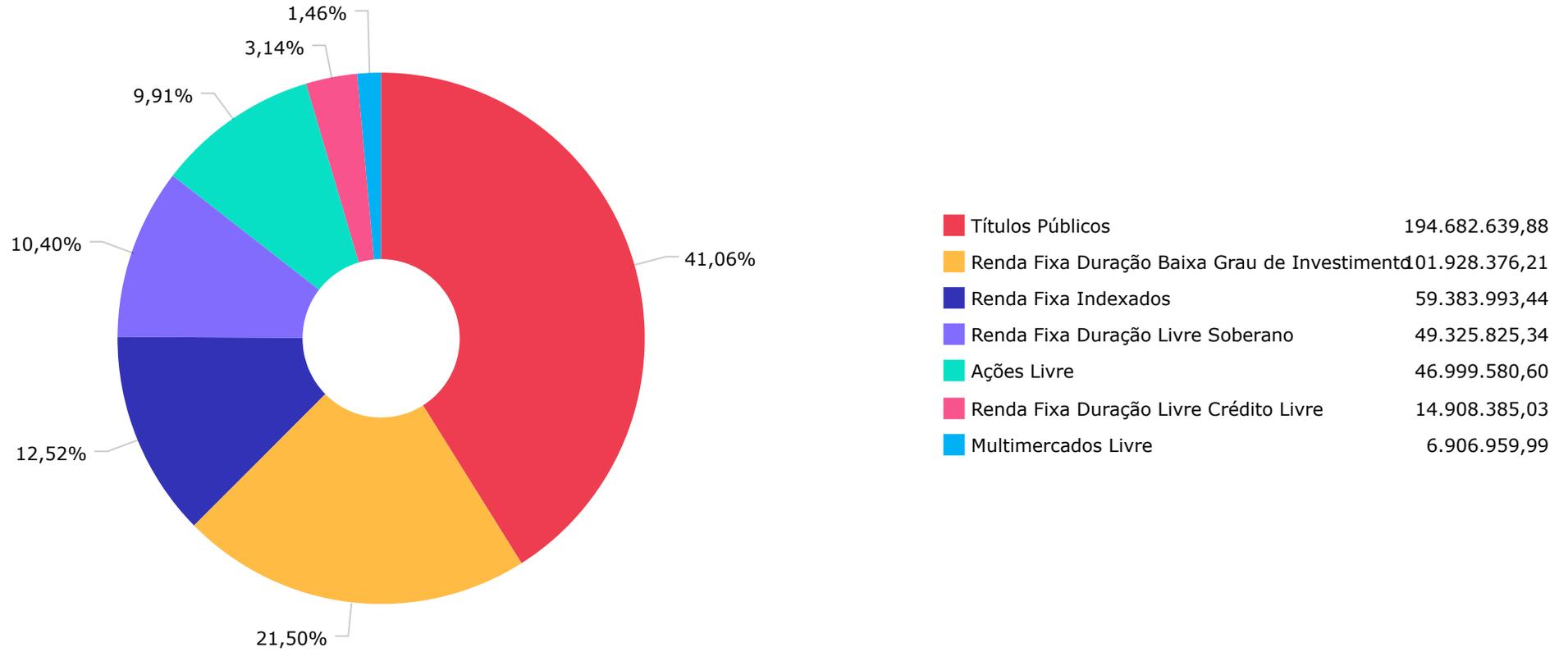


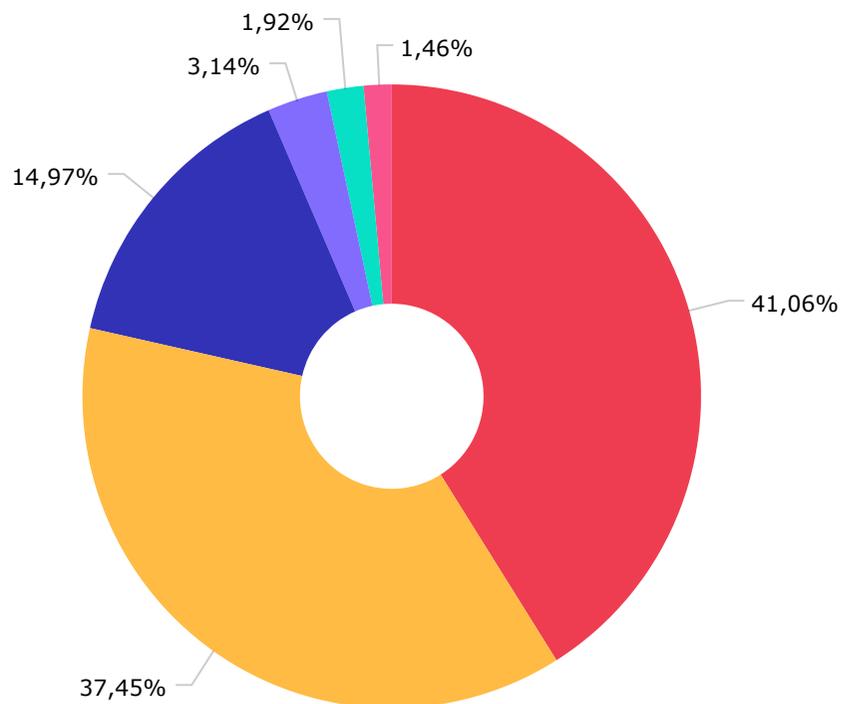
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	35,05%	0,00%	33,00%	100,00%	360.789.299,74
7º I b - FI 100% Títulos TN	22,25%	0,00%	16,00%	100,00%	431.853.735,81
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	555.471.939,62
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.773.596,98
7º III a - FI Referenciados RF	18,35%	0,00%	10,00%	60,00%	231.354.787,56
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	333.283.163,77
7º IV - Ativos Financeiros de ...	14,64%	0,00%	18,00%	20,00%	29.758.208,79
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.773.596,98
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.773.596,98
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.773.596,98

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	5,04%	0,00%	10,00%	30,00%	138.636.531,80
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	166.641.581,89
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	55.547.193,96
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00
9º III - Ações - BDR Nível I	3,42%	0,00%	0,00%	10,00%	36.552.663,45
10º I - Fundos Multimercados	1,24%	0,00%	5,00%	10,00%	48.640.233,97
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.773.596,98
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.773.596,98
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	27.773.596,98
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.773.596,98

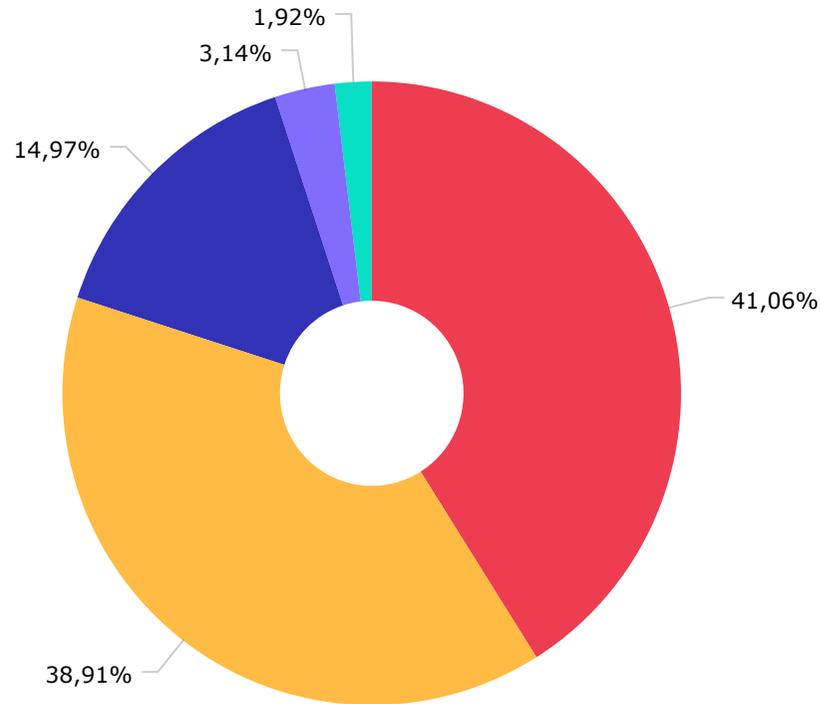
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	-0,12	10,22	0,40	4,63	10,22	21,72	2,81	5,92
CDI - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92	13,32	2,94	6,48	13,32	27,68	0,02	0,04
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,03	17,78	7,61	9,37	17,78	-11,84	4,59	9,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,51	17,40	6,67	9,25	17,40	-18,28	5,59	11,77
IBOVESPA - BENCHMARK								
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	5,22	18,94	13,89	13,09	18,94	18,04	6,39	13,47
BB AGRO FIC AÇÕES	4,11	10,72	7,04	10,13	10,72	8,99	6,41	13,49
IPCA - BENCHMARK								
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61	15,84	4,04	5,04	15,84	24,91	0,78	1,65
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95	14,99	2,92	5,73	14,99	25,68	0,06	0,13
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21	13,59	2,92	4,92	13,59	25,74	0,28	0,60
IRF-M 1 - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89	13,02	2,83	6,04	13,02	26,29	0,03	0,06







TESOURO NACIONAL	194.682.639,88
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	177.564.816,85
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	70.983.158,01
ITAU UNIBANCO S.A.	14.908.385,03
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	9.089.800,73
CAIXA DTVM	6.906.959,99



TESOURO NACIONAL	194.682.639,88
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	184.471.776,84
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	70.983.158,01
ITAU UNIBANCO S.A.	14.908.385,03
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	9.089.800,73

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	463.430.876,81	2.843.780,71	2.813.000,00	470.292.989,11	6.831.331,59	6.831.331,59	1,47% ▲	1,47%	0,96%	0,96%	153,13%	2,19%
Fevereiro	470.292.989,11	63.855.148,07	69.307.042,43	465.055.927,45	214.832,70	7.046.164,29	0,05% ▲	1,52%	1,19%	2,16%	70,37%	1,85%
Março	465.055.927,45	33.017.672,44	9.766.775,99	493.343.301,82	5.036.477,92	12.082.642,21	1,03% ▲	2,57%	1,16%	3,34%	76,95%	1,73%
Abril	493.343.301,82	323.544,59	3.073.356,13	495.506.173,82	4.912.683,54	16.995.325,75	1,00% ▲	3,59%	0,96%	4,34%	82,72%	1,56%
Mai	495.506.173,82	9.749.120,47	2.974.200,00	508.212.262,97	5.931.168,68	22.926.494,43	1,18% ▲	4,81%	0,66%	5,02%	95,82%	1,52%
Junho	508.212.262,97	4.203.294,91	4.301.036,75	518.145.063,64	10.030.542,51	32.957.036,94	1,97% ▲	6,88%	0,33%	5,37%	128,12%	1,58%
Julho	518.145.063,64	4.517.648,63	4.669.000,00	524.694.082,71	6.700.370,44	39.657.407,38	1,29% ▲	8,26%	0,53%	5,92%	139,53%	1,49%
Agosto	524.694.082,71	29.225.373,02	27.149.396,97	528.540.773,74	1.770.714,98	41.428.122,36	0,34% ▲	8,63%	0,68%	6,64%	129,97%	1,54%
Setembro	528.540.773,74	4.672.760,22	3.472.284,42	531.067.290,03	1.326.040,49	42.754.162,85	0,25% ▲	8,90%	0,65%	7,33%	121,42%	1,44%
Outubro	531.067.290,03	106.586.989,74	99.739.121,01	538.492.339,88	577.181,12	43.331.343,97	0,11% ▲	9,02%	0,65%	8,02%	112,47%	1,21%
Novembro	538.492.339,88	26.041.445,75	28.040.137,29	546.773.381,42	10.279.733,08	53.611.077,05	1,91% ▲	11,10%	0,67%	8,75%	126,86%	0,67%
Dezembro	546.773.381,42	60.314.512,07	58.301.491,19	555.471.939,62	6.685.537,32	60.296.614,37	1,22% ▲	12,45%	0,95%	9,78%	127,30%	0,57%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	12.082.642,21	2,57%	3,34%
2º Trim	20.874.394,73	4,21%	1,96%
1º Sem	32.957.036,94	6,88%	5,37%
3º Trim	9.797.125,91	1,89%	1,86%
4º Trim	17.542.451,52	3,26%	2,28%
2º Sem	27.339.577,43	5,21%	4,19%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

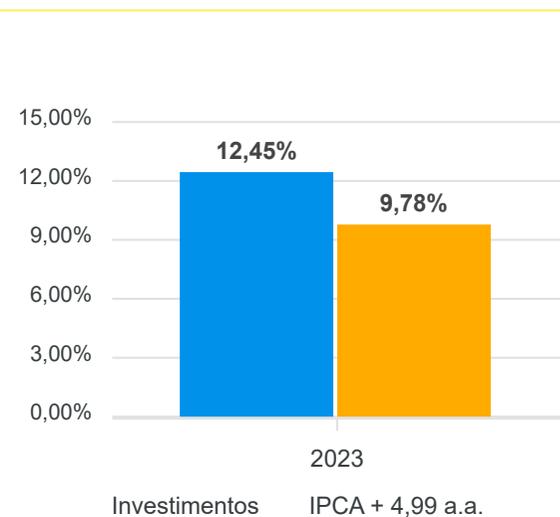


Gráfico Risco x Retorno

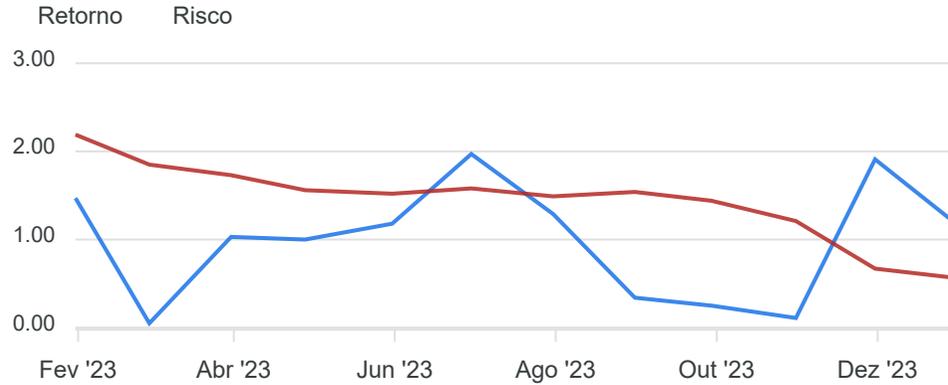
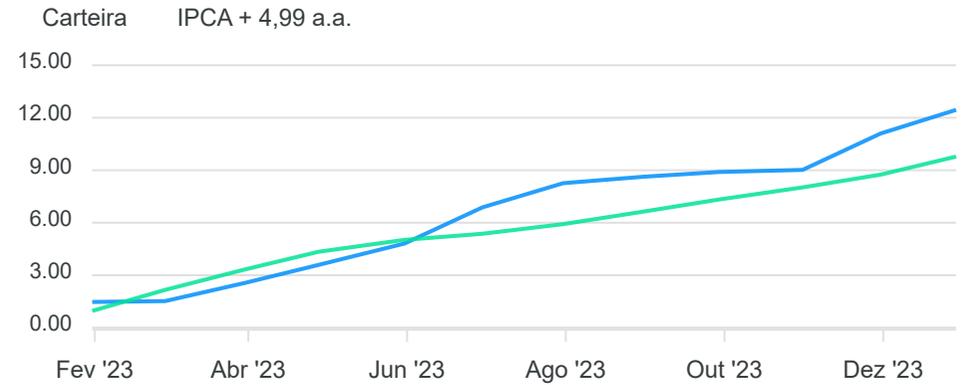
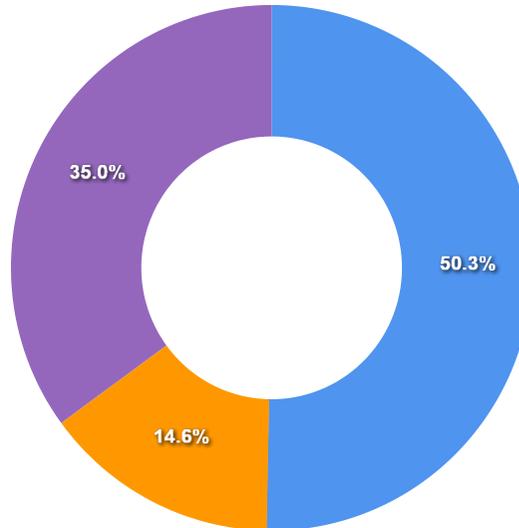


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/12/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	279.453.120,61	50,31
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	81.336.179,13	14,64
Acima D+3600	194.682.639,88	35,05
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	213.124.769,91	0,00	20.678.265,93	194.682.639,88	2.236.135,90	1,05% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.762.704,50	0,00	0,00	33.073.378,14	310.673,64	0,95% ▲	0,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	97.323.516,09	34.940.349,95	31.276.847,60	101.928.376,21	941.357,77	0,71% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.058.553,81	0,00	0,00	16.252.447,20	193.893,39	1,21% ▲	0,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	58.488.605,20	374.162,12	0,00	59.383.993,44	521.226,12	0,89% ▲	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.672.092,53	0,00	0,00	14.908.385,03	236.292,50	1,61% ▲	0,78%
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	35.316.642,59	0,00	0,00	35.609.181,55	292.538,96	0,83% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	20.470.514,97	0,00	0,00	20.625.659,61	155.144,64	0,76% ▲	-
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	0,00	25.000.000,00	0,00	25.101.337,97	101.337,97	0,41% ▲	-
	488.217.399,60	60.314.512,07	51.955.113,53	501.565.399,03	4.988.600,89	1,00%	0,05%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	13.123.611,11	0,00	0,00	13.663.372,11	539.761,00	4,11% ▲	6,41%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	13.630.202,30	0,00	0,00	14.341.677,98	711.475,68	5,22% ▲	6,39%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE ...	6.406.552,90	0,00	6.346.377,66	0,00	-60.175,24	-0,94% ▼	6,38%
-	33.160.366,31	0,00	6.346.377,66	28.005.050,09	1.191.061,44	3,59%	6,40%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	6.914.929,77	0,00	0,00	6.906.959,99	-7.969,78	-0,12% ▼	2,81%
-	6.914.929,77	0,00	0,00	6.906.959,99	-7.969,78	-0,12%	2,81%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.613.165,97	0,00	0,00	9.904.729,78	291.563,81	3,03% ▲	4,59%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.867.519,77	0,00	0,00	9.089.800,73	222.280,96	2,51% ▲	5,59%
	18.480.685,74	0,00	0,00	18.994.530,51	513.844,77	2,78%	2,39%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.134.964,98	0,00	0,00	33.073.378,14	938.413,16	2,92% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	85.567.430,64	109.492.249,65	95.826.409,17	101.928.376,21	2.695.105,09	1,38% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.790.869,50	0,00	0,00	16.252.447,20	461.577,70	2,92% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	57.385.627,04	374.162,12	0,00	59.383.993,44	1.624.204,28	2,81% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.330.157,62	0,00	0,00	14.908.385,03	578.227,41	4,04% ▲
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	0,00	25.000.000,00	0,00	25.101.337,97	101.337,97	0,41% ▲
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	0,00	35.000.000,00	0,00	35.609.181,55	609.181,55	1,74% ▲
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	20.171.492,31	0,00	0,00	20.625.659,61	454.167,30	2,25% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	191.782.953,89	20.056.835,67	22.830.427,68	194.682.639,88	5.673.278,00	2,68% ▲
	417.163.495,98	189.923.247,44	118.656.836,85	501.565.399,03	13.135.492,46	2,69%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.371.020,68	0,00	9.319.449,73	0,00	-51.570,95	-0,55% ▼
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10.216.303,03	0,00	9.928.756,96	0,00	-287.546,07	-2,81% ▼
BB AGRO FIC AÇÕES	12.764.327,08	0,00	0,00	13.663.372,11	899.045,03	7,04% ▲
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.592.398,77	0,00	0,00	14.341.677,98	1.749.279,21	13,89% ▲
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	0,00	3.019.700,12	3.074.365,78	0,00	54.665,66	1,81% ▲
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE ...	6.126.635,03	0,00	6.346.377,66	0,00	219.742,63	3,59% ▲
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9.474.547,42	0,00	9.518.907,12	0,00	44.359,70	0,47% ▲
	60.545.232,01	3.019.700,12	38.187.857,25	28.005.050,09	2.627.975,21	4,34%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	6.879.422,60	0,00	0,00	6.906.959,99	27.537,39	0,40% ▲
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	22.866.290,52	0,00	23.150.025,53	0,00	283.735,01	1,24% ▲
	29.745.713,12	0,00	23.150.025,53	6.906.959,99	311.272,40	1,05%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.204.535,43	0,00	0,00	9.904.729,78	700.194,35	7,61% ▲
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.521.810,82	0,00	0,00	9.089.800,73	567.989,91	6,67% ▲
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.886.502,67	0,00	6.086.029,86	0,00	199.527,19	3,39% ▲
	23.612.848,92	0,00	6.086.029,86	18.994.530,51	1.467.711,45	6,22%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.763.002,71	0,00	0,00	33.073.378,14	4.310.375,43	14,99% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.429.116,66	235.860.698,41	149.557.062,46	101.928.376,21	10.195.623,60	4,23% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	14.308.489,15	0,00	0,00	16.252.447,20	1.943.958,05	13,59% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	65.922.577,32	6.414.056,42	20.006.000,00	59.383.993,44	7.053.359,70	9,75% ▲
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	19.610.880,82	0,00	19.678.498,14	0,00	67.617,32	0,34% ▲
ICATU VANGUARDA PLUS FI RENDA FIXA LP	23.363.218,19	0,00	23.476.477,81	0,00	113.259,62	0,48% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.869.842,58	0,00	0,00	14.908.385,03	2.038.542,45	15,84% ▲
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	0,00	25.000.000,00	0,00	25.101.337,97	101.337,97	0,41% ▲
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	0,00	35.000.000,00	0,00	35.609.181,55	609.181,55	1,74% ▲
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	0,00	20.000.000,00	0,00	20.625.659,61	625.659,61	3,13% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	185.162.072,57	20.056.835,67	29.464.891,13	194.682.639,88	18.928.622,77	9,22% ▲
	355.429.200,00	342.331.590,50	242.182.929,54	501.565.399,03	45.987.538,07	10,09%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.909.151,87	0,00	9.319.449,73	0,00	410.297,86	4,61% ▲
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.650.807,70	0,00	9.928.756,96	0,00	277.949,26	2,88% ▲
BB AGRO FIC AÇÕES	12.340.516,28	0,00	0,00	13.663.372,11	1.322.855,83	10,72% ▲
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.058.224,56	0,00	0,00	14.341.677,98	2.283.453,42	18,94% ▲
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	0,00	3.019.700,12	3.074.365,78	0,00	54.665,66	1,81% ▲
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE ...	5.772.825,00	0,00	6.346.377,66	0,00	573.552,66	9,94% ▲
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	8.589.627,76	0,00	9.518.907,12	0,00	929.279,36	10,82% ▲
	57.321.153,17	3.019.700,12	38.187.857,25	28.005.050,09	5.852.054,05	10,21%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	10.130.752,53	0,00	4.000.000,00	6.906.959,99	776.207,46	7,66% ▲
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	19.418.685,92	0,00	23.150.025,53	0,00	3.731.339,61	19,22% ▲
	29.549.438,45	0,00	27.150.025,53	6.906.959,99	4.507.547,07	15,25%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.409.859,91	0,00	0,00	9.904.729,78	1.494.869,87	17,78% ▲
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.742.748,11	0,00	0,00	9.089.800,73	1.347.052,62	17,40% ▲
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.978.477,17	0,00	6.086.029,86	0,00	1.107.552,69	22,25% ▲
	21.131.085,19	0,00	6.086.029,86	18.994.530,51	3.949.475,18	18,69%

Cenário Econômico

Assim como o mês de novembro, dezembro foi mais um mês positivo para as carteiras de investimentos, mais uma vez beneficiado pelo bom desempenho da renda variável local e repetindo o movimento anterior, mais um mês de fechamento na curva de juros, que beneficiaram os fundos atrelados a inflação, e não muito diferente os fundos de investimentos ligados a ativos no exterior tiveram mais um mês de desempenho positivo.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 não foram atingidos diante das oportunidades que o mercado ofereceu como boas alternativas.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos da política de investimentos, de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva da SPREV, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

No segmento de renda fixa, o fechamento da curva de juros continuou alavancando os resultados tanto dos fundos ligados a inflação, assim como dos fundos de defesa. No segmento de renda variável as carteiras foram beneficiadas pelo forte desempenho dos fundos ligados à bolsa brasileira. E por fim os fundos no exterior também tiveram um desempenho positivo pelo avanço do mercado americano.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 16 de janeiro de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,30%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+3
Quantidade de Cotistas	694
Patrimônio Líquido Fundo	6.297.472.287,75

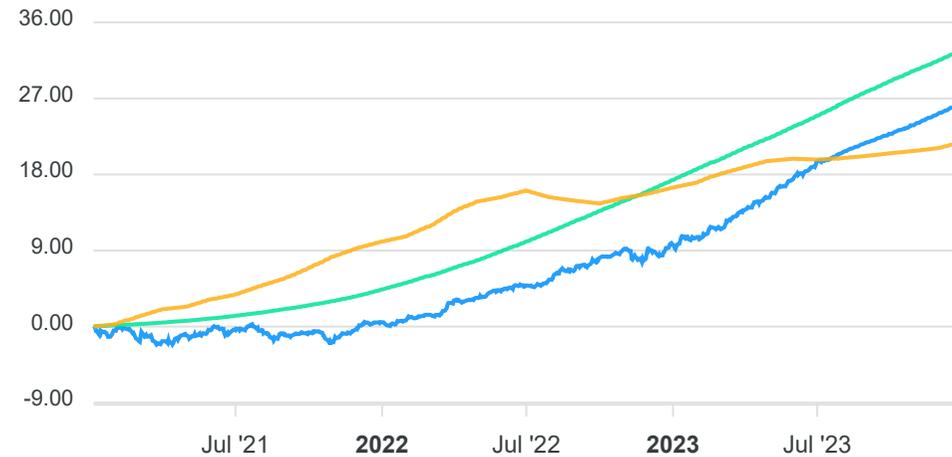
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IPCA
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe de Renda Fixa.

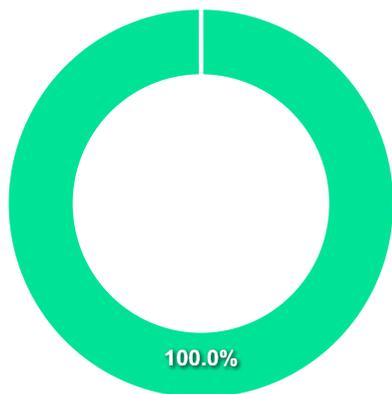
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,95%	14,99%	2,92%	5,73%	14,99%	25,68%	0,06%	0,13%
Benchmark	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP JUROS BRASIL FI RENDA FIXA LP	6.297.436,33	100,00	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	188,19	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,53	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	1,93	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-49,26	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-72,36	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.297.436,33	100.00%
Valores a pagar/receber	98,87	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
788

Patrimônio Líquido Fundo
5.290.529.627,75

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IPCA

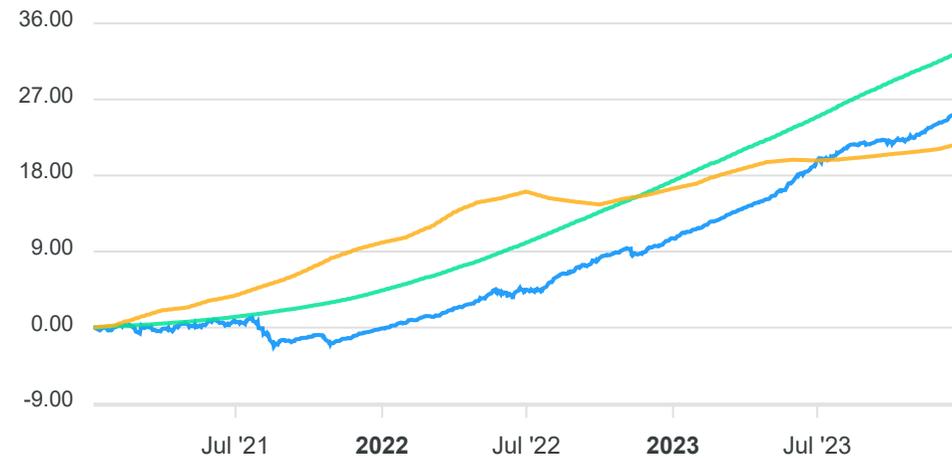
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA
MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:
10.948.555/0001-13.

COMPARATIVO

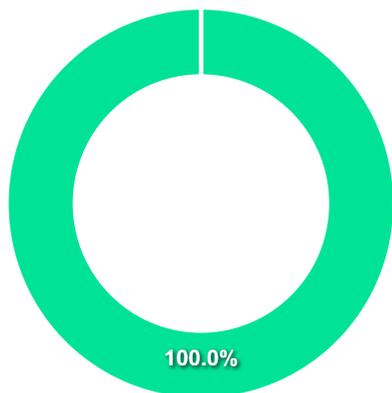
📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	0,60%
Benchmark	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA LP	5.290.909,71	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-380,63	-0,01	Valores a pagar/receber



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.290.909,71	100.01%
Valores a pagar/receber	-380,08	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.190

Patrimônio Líquido Fundo
8.470.280.308,74

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IRF-M 1

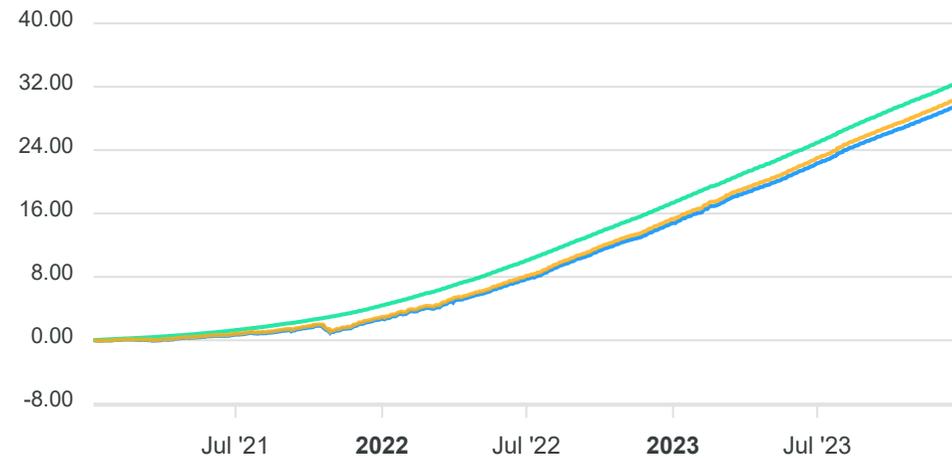
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.

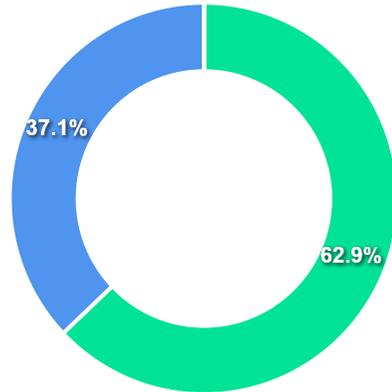
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,89%	13,02%	2,83%	6,04%	13,02%	26,29%	0,03%	0,06%
Benchmark	0,91%	13,25%	2,89%	6,16%	13,25%	26,86%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	5.329.911,47	62,92	Operação comprometida
LTN - Venc.: 01/01/2024 (BRSTNCLTN7S1)	2.569.800,98	30,34	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2024 (BRSTNCLTN7Y9)	427.615,45	5,05	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	85.617,56	1,01	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2024 (BRSTNCLTN7W3)	39.911,88	0,47	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2024 (BRSTNCLTN822)	18.156,21	0,21	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	10,58	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV24	0,00	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-744,36	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação comprometida	5.329.911,47	62.92%
Títulos Federais	3.141.102,08	37.08%
Derivativos	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-733,24	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
0,40%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
216

Patrimônio Líquido Fundo
2.287.059.745,87

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IPCA

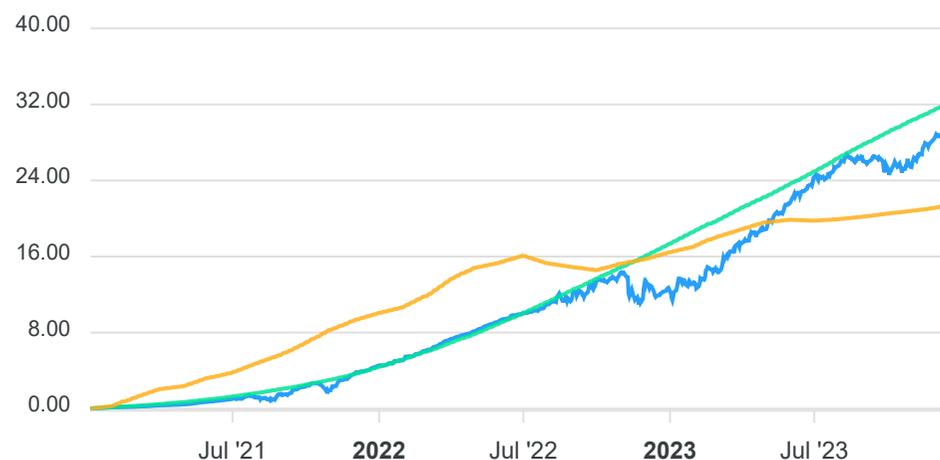
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre

Política de Investimento
Alocar preponderante em cotas de fundos de investimento de renda fixa atrelados ao IMA e seus sub-índices, podendo alocar também em fundos de investimento de renda fixa que seguem o CDI.

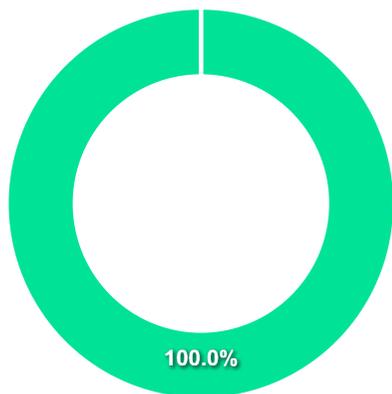
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	1,65%
Benchmark	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	2.283.237,26	99,83	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.482,98	0,20	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-731,03	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.287.720,24	100.03%
Valores a pagar/receber	-660,49	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
988

Patrimônio Líquido Fundo
13.988.008.512,08

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

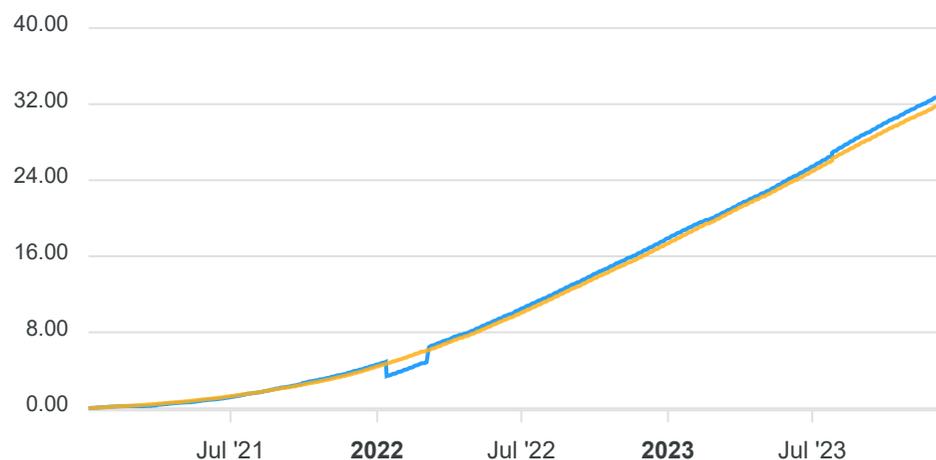
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em ativos financeiros que sejam considerados de baixo risco de crédito e classificados por agência de risco registrada na CVM.

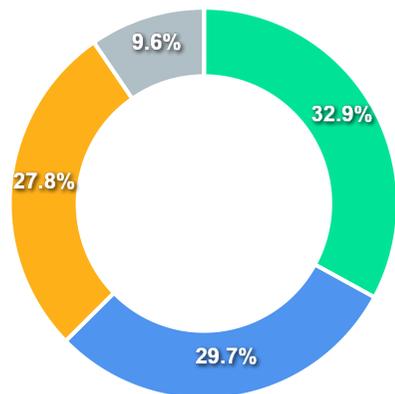
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	13,32%	2,94%	6,48%	13,32%	27,68%	0,02%	0,04%
Benchmark	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Privados	4.608.999,61	32.95%
Títulos Federais	4.150.565,61	29.67%
Operação compromissada	3.886.791,91	27.79%
Debêntures	1.342.231,08	9.60%
Valores a pagar/receber	-579,70	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2026	3.886.791,91	27,79	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	1.091.680,91	7,80	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	795.899,13	5,69	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	760.105,86	5,43	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	541.137,80	3,87	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	464.821,70	3,32	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	408.531,31	2,92	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	340.717,91	2,44	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	250.967,36	1,79	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	230.153,17	1,65	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	188.855,36	1,35	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	186.948,60	1,34	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	185.609,60	1,33	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	174.965,35	1,25	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	150.687,81	1,08	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	133.344,67	0,95	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	130.777,52	0,93	Títulos Privados
Debêntures - PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS (33.000.16...	115.518,06	0,83	Debêntures
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	114.443,72	0,82	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	114.198,87	0,82	Títulos Privados
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	107.638,26	0,77	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	97.644,84	0,70	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) -...	95.039,99	0,68	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	93.480,71	0,67	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	92.410,07	0,66	Títulos Federais
Debêntures - B3 S.A. (09.346.601/0001-25) - Venc.: 05/08/2...	89.699,92	0,64	Debêntures
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	83.732,94	0,60	Títulos Federais

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
1,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+2 du

Quantidade de Cotistas
4.383

Patrimônio Líquido Fundo
303.033.120,52

Patrimônio Líquido Master
321.664.294,87

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

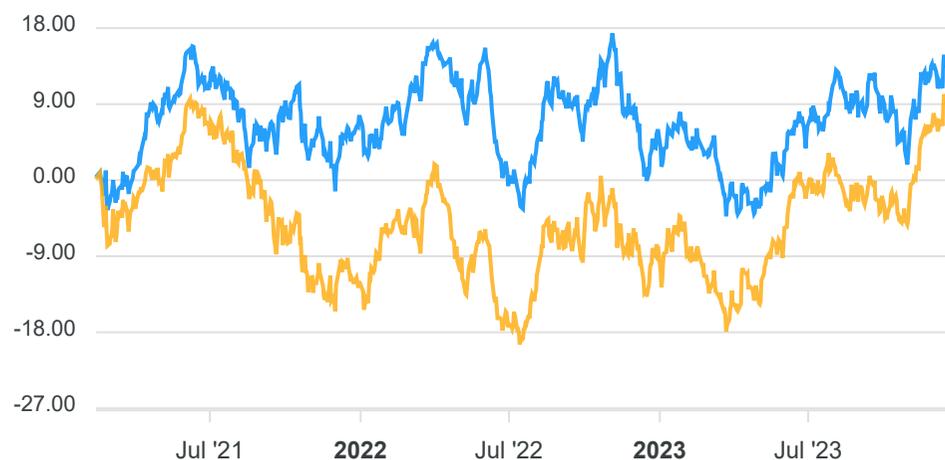
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do BB TOP
AÇÕES AGRO FI AÇÕES, CNPJ: 40.054.367/0001-02.

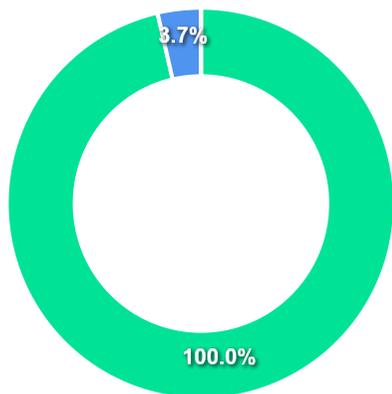
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,11%	10,72%	7,04%	10,13%	10,72%	8,99%	6,41%	13,49%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP AÇÕES AGRO FIAÇÕES	303.055,65	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	11.317,28	3,73	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,75	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	0,28	0,00	Outros
Valores a pagar / IR_a_recolher	0,15	0,00	Outros
Outras Disponibilidades	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-6,95	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-36,93	-0,01	Outros
Valores a pagar / Cotas_Resgatadas	-11.292,22	-3,73	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	303.055,65	100.01%
Valores a pagar/receber	11.307,04	3.73%
Outros	-11.328,73	-3.74%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 1,00%
Taxa de Performance 20,00%
Disponibilidade de Resgate D+3
Quantidade de Cotistas 18.137
Patrimônio Líquido Fundo 1.502.801.211,89

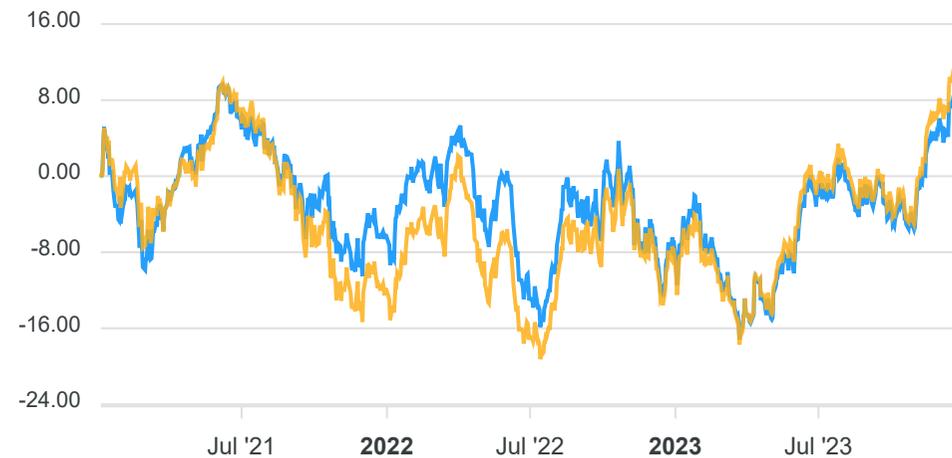
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 8º, Inciso I
Benchmark Ibovespa
Classificação ANBIMA Ações Livre
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento que apresentem carteira composta por ações emitidas por empresas brasileiras e seus proventos, títulos públicos federais e contratos de índices futuros.

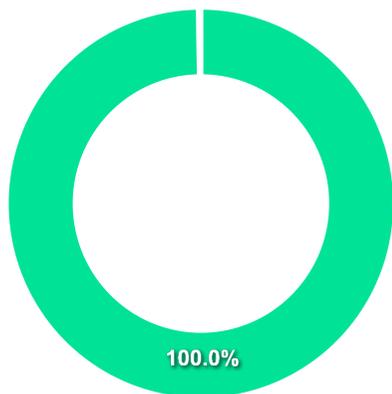
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,22%	18,94%	13,89%	13,09%	18,94%	18,04%	6,39%	13,47%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB QUANTITATIVO FI AÇÕES	1.502.881,53	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	3.947,50	0,26	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	7,50	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas_a_Emitir_Passi	7,50	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	6,95	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,09	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR_a_recolher	-9,62	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Cetip	-14,68	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-178,98	-0,01	Outros
Valores a pagar / Cotas_Resgatadas	-3.818,54	-0,25	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.502.881,53	100.00%
Valores a pagar/receber	3.948,22	0.26%
Outros	-3.999,64	-0.27%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,50%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+4 du
Quantidade de Cotistas 143
Patrimônio Líquido Fundo 1.297.128.287,58

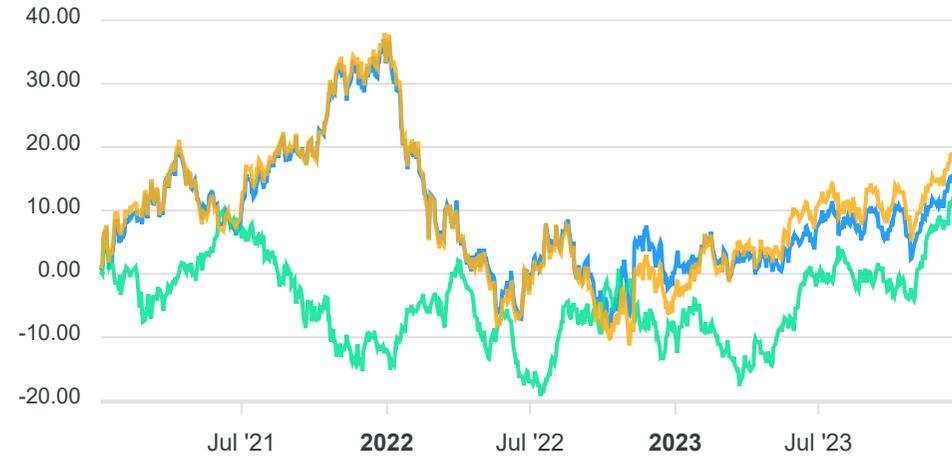
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 9º, Inciso III
Benchmark Global BDRX
Classificação ANBIMA Ações Livre
Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil que atendam aos critérios da temática ESG.

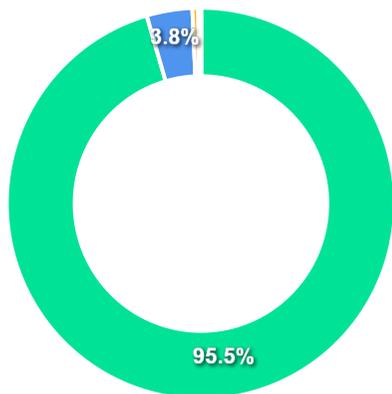
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,03%	17,78%	7,61%	9,37%	17,78%	-11,84%	4,59%	9,67%
Benchmark	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%		
IBOVESPA	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depository Receipts	1.239.217,78	95.53%
Fundos de Investimento	49.330,03	3.80%
Outros	5.924,72	0.46%
Operação compromissada	3.235,84	0.25%
Derivativos	-100,83	-0.01%
Valores a pagar/receber	-465,47	-0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
ISHARES ESG AWARE MSCI USA ETF - BEGU39	311.675,56	24,03	Brazilian Depository Rece...
APPLE INC - AAPL34	121.144,28	9,34	Brazilian Depository Rece...
MICROSOFT CORPORATIO - MSFT34	118.765,73	9,16	Brazilian Depository Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	71.004,21	5,47	Brazilian Depository Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	69.838,29	5,38	Brazilian Depository Rece...
META PLATFORMS, INC - FBOK34	49.647,00	3,83	Brazilian Depository Rece...
NVIDIA COR - NVDC34	47.702,52	3,68	Brazilian Depository Rece...
Cotas de ISHARES IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	37.161,15	2,86	Fundos de Investimento
TESLA, INC - TSLA34	35.164,61	2,71	Brazilian Depository Rece...
BROADCOM INC - AVGO34	32.202,75	2,48	Brazilian Depository Rece...
COMCAST CORPORATIO - CMCS34	27.485,25	2,12	Brazilian Depository Rece...
Valores a receber / Juros sobre Capital	25.455,82	1,96	Valores a pagar/receber
WALMART INC - WALM34	23.463,62	1,81	Brazilian Depository Rece...
CISCO SYSTEMS, INC - CSCO34	21.999,53	1,70	Brazilian Depository Rece...
ELI LILLY AND COMPAN - LILY34	19.851,75	1,53	Brazilian Depository Rece...
BOOKING HOLDINGS INC - BKNG34	17.098,22	1,32	Brazilian Depository Rece...
UNITEDHEALTH GROUP INC - UNHH34	15.275,80	1,18	Brazilian Depository Rece...
THE WALT DISNEY COMPAN - DISB34	14.995,60	1,16	Brazilian Depository Rece...
VISA INC - VISA34	13.827,50	1,07	Brazilian Depository Rece...
THE COCA-COLA COMPAN - COCA34	13.189,18	1,02	Brazilian Depository Rece...
Cotas de BB TOP ESPELHO AÇÕES TRÍGONO HORIZON MICROCAP FIC...	12.168,88	0,94	Fundos de Investimento
MASTERCARD INCORPORATE - MSCD34	11.977,33	0,92	Brazilian Depository Rece...
JOHNSON & JOHNSO - JNJB34	11.281,99	0,87	Brazilian Depository Rece...
JPMORGAN CHASE & CO - JPMC34	11.009,61	0,85	Brazilian Depository Rece...
COSTCO WHOLESALE CORPORATION - COWC34	9.811,67	0,76	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipts - BDR	9.807,07	0,76	Brazilian Depository Rece...
MERCK & CO, INC - MRCK34	9.740,12	0,75	Brazilian Depository Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Gestão
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+5

Quantidade de Cotistas
346

Patrimônio Líquido Fundo
658.947.271,35

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
Global BDRX

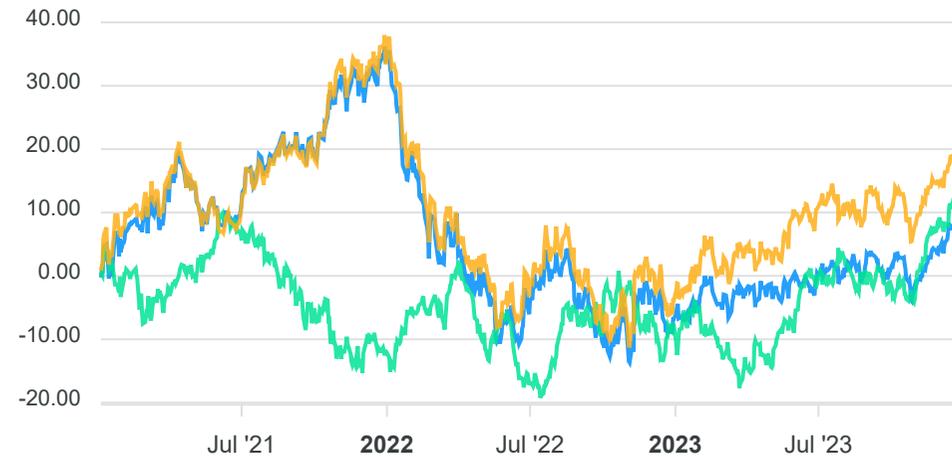
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em depósitos de valores mobiliários BDRs Nível 1, do setor de consumo.

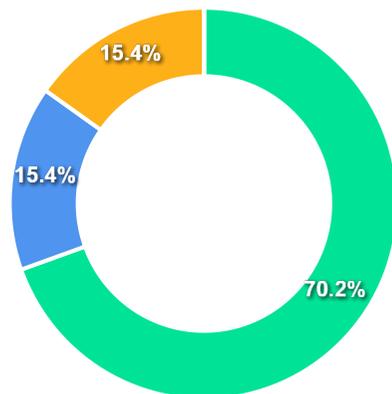
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,51%	17,40%	6,67%	9,25%	17,40%	-18,28%	5,59%	11,77%
Benchmark	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%		
IBOVESPA	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depository Receipts	486.905,98	70.25%
Títulos Federais	107.056,26	15.44%
Títulos Privados	106.407,06	15.35%
Derivativos	-1.244,40	-0.18%
Valores a pagar/receber	-5.972,23	-0.86%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04...	106.407,06	15,35	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	59.944,46	8,65	Títulos Federais
Brazilian Depository Receipt - BDR - MSFT34	48.006,97	6,93	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - AAPL34	40.149,14	5,79	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - AMZO34	22.877,73	3,30	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - GOGL34	21.896,12	3,16	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - UNHH34	20.658,35	2,98	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - EXXO34	15.857,99	2,29	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - AXPB34	15.565,37	2,25	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - BERK34	14.643,88	2,11	Brazilian Depository Rece...
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	14.628,94	2,11	Títulos Federais
Brazilian Depository Receipt - BDR - VISA34	14.531,92	2,10	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - MSCD34	13.837,30	2,00	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - MCDC34	13.682,69	1,97	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - CMCS34	13.414,23	1,94	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - CHVX34	13.164,06	1,90	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - DHER34	13.072,38	1,89	Brazilian Depository Rece...
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	12.945,98	1,87	Títulos Federais
Brazilian Depository Receipt - BDR - LILY34	12.150,44	1,75	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - FDXB34	10.928,39	1,58	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - MRCK34	10.919,95	1,58	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - UPSS34	10.495,80	1,51	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - M1NS34	10.213,37	1,47	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - M1TA34	10.176,59	1,47	Brazilian Depository Rece...
Brazilian Depository Receipt - BDR - CHCM34	9.482,96	1,37	Brazilian Depository Rece...
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	9.365,56	1,35	Títulos Federais
Brazilian Depository Receipt - BDR - TMOS34	8.783,42	1,27	Brazilian Depository Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA DTVM

Taxa de Administração
1,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1 du

Quantidade de Cotistas
823

Patrimônio Líquido Fundo
80.869.143,26

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
Não definido

Classificação ANBIMA
Multimercados Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA
MASTER HEDGE FI MULTIMERCADO LP, CNPJ:
30.068.240/0001-99.

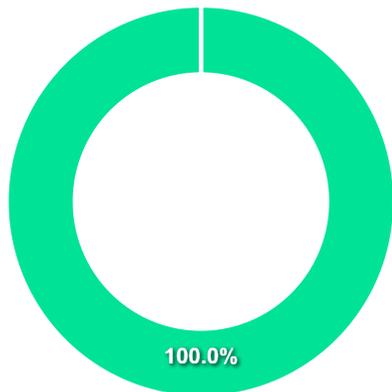
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,12%	10,22%	0,40%	4,63%	10,22%	21,72%	2,81%	5,92%
IBOVESPA	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER HEDGE FI MULTIMERCADO LP	80.884,09	100,02	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	0,33	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-15,27	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	80.884,09	100.02%
Valores a pagar/receber	-14,94	-0.02%

