

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			537.702.629,18	29,47%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	73.287.819,61	4,02%	694	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.107.657,05	0,72%	789	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	17.706.248,53	0,97%	633	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	35.292.957,94	1,93%	788	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	40.411.758,37	2,21%	914	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	15.130.759,09	0,83%	445	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	35.032.572,30	1,92%	25	7,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.812.335,45	0,65%	216	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	3.067.282,77	0,17%	1.815	1,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	79.155.349,08	4,34%	122	6,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	45.727.825,07	2,51%	106	9,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.882.070,64	0,82%	40	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.901.460,12	0,21%	3.756	2,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	16.943.492,26	0,93%	245	1,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	38.609.560,09	2,12%	148	4,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.862.083,94	1,31%	99	4,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	18.498.242,16	1,01%	226	1,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	16.713.612,00	0,92%	14	11,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	8.173.173,84	0,45%	31	3,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

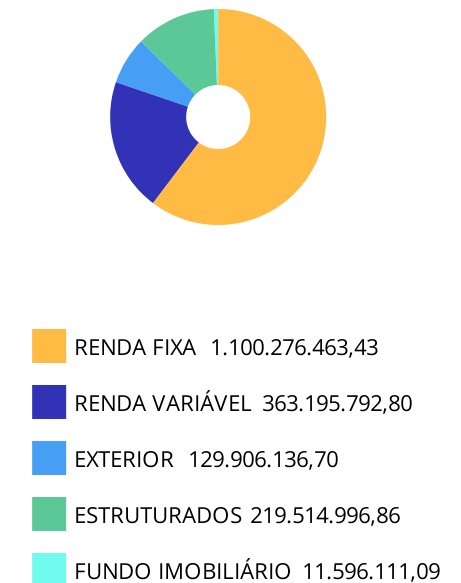
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.582.351,47	0,25%	37	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	18.705.969,56	1,03%	3.211	5,31%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	13.000.773,03	0,71%	1.744	6,15%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	22.349.985,13	1,22%	124	1,70%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	14.300.005,37	0,78%	1	1,09%	Artigo 9º, Inciso II
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+6 du	Não há	4.901.366,15	0,27%	187	0,00%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.501.834,73	0,25%	1.297	5,10%	Artigo 9º, Inciso II
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO ...	D+11 du	Não há	15.054.512,25	0,83%	2	83,99%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	16.105.157,08	0,88%	3.846	2,71%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	5.823.085,71	0,32%	183	1,86%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO ...	D+8 du	Não há	10.984.491,27	0,60%	1.354	5,93%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+8 du	Não há	9.658.671,59	0,53%	390	5,22%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	12.164.149,36	0,67%	3.213	8,17%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	14.062.878,06	0,77%	60.597	1,01%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	51.176.803,38	2,80%	2.510	9,74%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	15.594.834,54	0,85%	83	12,80%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	6.176.941,83	0,34%	583	3,07%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC ...	D+0	Não há	8.899.854,98	0,49%	155	7,22%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	13.433.246,51	0,74%	25	13,87%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	22.987.368,25	1,26%	21	9,71%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	15.386.682,92	0,84%	22	10,31%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	16.411.980,83	0,90%	20	8,92%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	Não se ...	Não se aplica	578.909,17	0,03%	29	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	20.375.670,01	1,12%	103	0,70%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	84.571,42	0,00%	45	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	8.372.873,49	0,46%	41	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.014.741,02	0,11%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	22.488.708,28	1,23%		1,26%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	703.371,63	0,04%	18	0,13%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	13.692.316,16	0,75%	46	3,87%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	D+0	Não há	1.136.122,44	0,06%	10	2,91%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	4.396.111,09	0,24%		3,51%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	7.200.000,00	0,39%		2,97%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.824.489.500,88				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			204.678,67				Artigo 6º
PL Total			1.824.694.179,55				

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

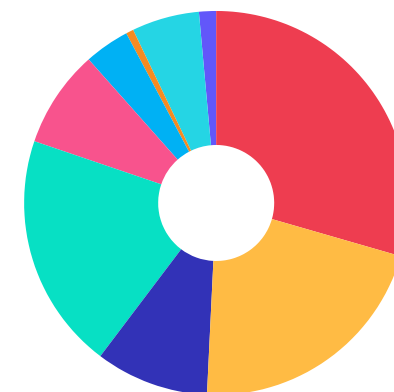
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	537.702.629,18	29,47%	17,00%	32,00%	100,00%	1.286.786.871,70
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	388.516.096,02	21,29%	10,00%	20,00%	100,00%	1.435.973.404,86
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.824.489.500,88
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.224.475,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	174.008.354,90	9,54%	1,00%	7,00%	60,00%	920.685.345,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.094.693.700,53
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	364.897.900,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	49.383,33	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.175.091,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.224.475,04
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.224.475,04
Total Renda Fixa	100,00%	1.100.276.463,43	60,31%	28,00%	59,00%	460,00%	



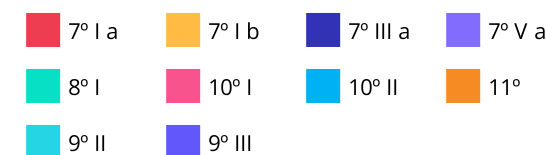
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	363.195.792,80	19,91%	6,00%	22,00%	35,00%	275.375.532,51
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	638.571.325,31
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	150.067.713,24	8,23%	1,00%	7,00%	10,00%	32.381.236,85
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	69.447.283,62	3,81%	1,00%	3,00%	5,00%	21.777.191,42
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	91.224.475,04
Artigo 11º	5,00%	11.596.111,09	0,64%	0,00%	0,00%	5,00%	79.628.363,95
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	594.306.900,75	32,57%	8,00%	32,00%	95,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	103.679.109,28	5,68%	1,00%	7,00%	10,00%	78.769.840,81
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	26.227.027,42	1,44%	1,00%	2,00%	10,00%	156.221.922,67
Total Exterior	10,00%	129.906.136,70	7,12%	2,00%	9,00%	20,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	537.702.629,18	29,47	-
CAIXA DTVM	223.455.887,23	12,25	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	207.078.592,48	11,35	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	167.990.030,73	9,21	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	96.599.948,66	5,29	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	75.210.360,62	4,12	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	67.964.233,71	3,73	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	62.471.644,03	3,42	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	53.152.437,45	2,91	-
ARX INVESTIMENTOS	39.259.076,10	2,15	-
ICATU VANGUARDA	35.032.572,30	1,92	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	31.706.742,59	1,74	-
XP ASSET MANAGEMENT	30.046.363,74	1,65	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	28.833.114,92	1,58	-
TARPON INVESTIMENTOS	28.525.414,18	1,56	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	23.192.079,91	1,27	-
VINCI PARTNERS	19.410.790,07	1,06	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	16.500.529,28	0,90	-
OCCAM BRASIL	15.494.784,28	0,85	-
WESTERN ASSET	14.062.878,06	0,77	-
ALASKA ASSET MANAGEMENT	13.892.913,92	0,76	-
ITAÚ DTVM	7.720.835,99	0,42	-
REAG GESTORA DE RECURSOS	7.200.000,00	0,39	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.823.085,71	0,32	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	5.221.951,01	0,29	-

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 '	537.702.629,18	29,47	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	388.516.096,02	21,29	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	174.008.354,90	9,54	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	49.383,33	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	363.195.792,80	19,91	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	103.679.109,28	5,68	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	26.227.027,42	1,44	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	150.067.713,24	8,23	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	69.447.283,62	3,81	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	11.596.111,09	0,64	0,00	5,00
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
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,17%	16,96%	3,73%	7,99%	17,00%	36,08%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-7,33%	-58,73%	-87,97%	-10,66%	-58,73%	433,83%	-	-
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%	0,02%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,44%	11,84%	2,90%	4,59%	11,84%	22,24%	0,49%	0,02%
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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,44%	11,86%	2,91%	4,63%	11,86%	22,56%	0,49%	0,02%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	1,44%	11,91%	2,92%	4,68%	11,91%	22,31%	0,48%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2,46%	13,33%	4,51%	3,89%	13,33%	21,16%	1,41%	0,04%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,73%	15,77%	4,69%	4,09%	15,77%	22,85%	1,45%	0,04%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,68%	15,83%	4,65%	3,91%	15,83%	22,61%	1,46%	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,77%	15,98%	4,76%	4,21%	15,98%	22,96%	1,48%	0,05%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,72%	15,83%	4,68%	3,91%	15,83%	22,72%	1,44%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,75%	15,77%	4,70%	4,00%	15,77%	22,78%	1,47%	0,04%
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%	0,03%

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,46%	16,06%	4,33%	6,05%	16,06%	26,02%	0,66%	0,03%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	16,24%	4,35%	6,18%	16,24%	26,09%	0,67%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94%	13,34%	2,93%	6,55%	13,34%	27,93%	0,02%	0,00%
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%
IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,89%	-	-0,01%	2,54%	-	-	0,73%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	2,54%	-	4,30%	3,07%	-	-	1,54%	-

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 FI MULTIMERCADO	1,00%	14,50%	4,27%	6,64%	14,50%	-	0,81%	0,02%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,46%	-5,48%	1,23%	-0,42%	-5,48%	-	3,53%	0,10%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	0,37%	0,16%	1,35%	-3,14%	0,16%	-59,50%	-	-
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	-3,37%	-	-12,23%	-8,08%	-	-	14,50%	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,51%	-6,01%	-1,87%	-0,64%	-6,01%	-	-	-
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	1,16%	12,59%	3,33%	6,22%	12,59%	25,70%	0,26%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	2,76%	-	7,79%	8,47%	-	-	2,43%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	3,26%	25,46%	10,04%	13,01%	25,46%	-	3,55%	0,08%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	5,28%	16,97%	11,68%	10,56%	16,97%	-	6,04%	0,09%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,53%	14,06%	11,41%	12,64%	14,06%	-	3,75%	0,06%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5,44%	16,58%	10,83%	10,21%	16,58%	16,17%	7,67%	0,16%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,35%	11,45%	16,32%	13,22%	11,45%	17,20%	7,50%	0,16%
XP INVESTOR FI AÇÕES	5,26%	26,25%	13,78%	12,17%	26,25%	40,23%	5,05%	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
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,01%	17,17%	16,98%	14,09%	17,17%	14,83%	6,22%	0,17%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	5,87%	20,61%	14,33%	12,31%	20,61%	26,38%	6,42%	0,17%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,99%	24,84%	13,00%	10,56%	24,84%	44,70%	4,60%	0,15%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5,18%	35,57%	16,75%	15,27%	35,57%	41,41%	6,92%	0,19%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5,25%	23,85%	12,28%	11,24%	23,85%	18,20%	6,39%	0,18%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	9,85%	55,36%	11,54%	24,45%	55,36%	78,35%	5,20%	0,19%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,66%	27,90%	14,41%	12,47%	27,90%	31,07%	4,77%	0,17%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4,49%	15,69%	10,05%	9,63%	15,69%	-	5,17%	0,07%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,83%	15,82%	12,82%	8,59%	15,82%	10,41%	6,78%	0,17%
OCCAM FIC AÇÕES	4,89%	15,74%	13,32%	10,70%	15,74%	20,98%	6,23%	0,16%
BB AGRO FIC AÇÕES	4,11%	10,72%	7,04%	10,13%	10,72%	8,99%	6,41%	0,16%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5,36%	19,09%	13,13%	11,03%	19,09%	24,69%	6,27%	0,16%
IDIV (Benchmark)	6,90%	26,84%	14,61%	16,04%	26,84%	42,88%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,95%	25,50%	14,30%	14,27%	25,50%	34,67%	5,29%	0,16%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5,91%	23,73%	12,67%	12,37%	23,73%	34,24%	4,98%	0,15%
IFIX (Benchmark)	4,25%	15,50%	2,86%	4,95%	15,50%	18,06%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	3,30%	6,57%	7,24%	1,85%	6,57%	-6,11%	9,56%	0,27%

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
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%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	6,52%	14,44%	9,65%	3,21%	14,44%	0,59%	6,40%	0,20%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,61%	14,35%	8,25%	4,57%	14,35%	5,20%	7,06%	0,16%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,24%	15,29%	8,91%	5,20%	15,29%	5,27%	7,97%	0,16%
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,68%	20,11%	4,68%	9,06%	20,31%	46,37%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-2,79%	-41,87%	-7,44%	-13,77%	-41,87%	-95,48%	0,23%	0,17%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	10,82%	2,57%	4,71%	10,90%	24,35%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	0,40%	-5,67%	1,05%	0,18%	-5,67%	-2,58%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,19%	8,55%	-0,60%	-2,17%	8,55%	14,85%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,17%	15,71%	-0,50%	-0,52%	15,71%	82,60%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,10%	11,85%	2,81%	5,20%	11,94%	26,71%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-	-	-	-	-	-	25,40%	0,55%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,18%	12,89%	3,05%	5,69%	12,99%	29,09%	-	-

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
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	9,90%	6,31%	7,28%	10,34%	6,31%	-6,87%	-	-
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,29%	14,44%	3,40%	6,42%	14,56%	32,70%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,03%	47,62%	-0,09%	-0,17%	47,62%	20,50%	0,00%	0,47%

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%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,77%	32,50%	12,06%	10,48%	32,50%	-16,96%	4,42%	16,594%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	2,06%	9,92%	6,16%	10,10%	9,92%	-6,61%	4,16%	13,405%

MSCI WORLD (Benchmark)	2,81%	12,98%	7,38%	7,31%	12,98%	-14,93%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4,03%	9,37%	7,18%	8,26%	9,37%	-18,58%	4,75%	12,141%
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%

MSCI ACWI (Benchmark)	2,70%	11,43%	7,01%	6,95%	11,43%	-16,44%	-	-
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	3,28%	7,53%	7,01%	6,11%	7,53%	-16,20%	5,64%	13,400%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	4,08%	11,96%	8,76%	8,85%	11,96%	-12,95%	5,86%	16,025%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	3,28%	-2,52%	3,88%	-5,58%	-2,52%	14,77%	6,68%	11,766%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	0,07%	-16,97%	-6,59%	-0,42%	-16,97%	1,14%	6,84%	18,781%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULT...	1,83%	-4,54%	-2,05%	1,01%	-4,54%	33,51%	4,21%	14,374%

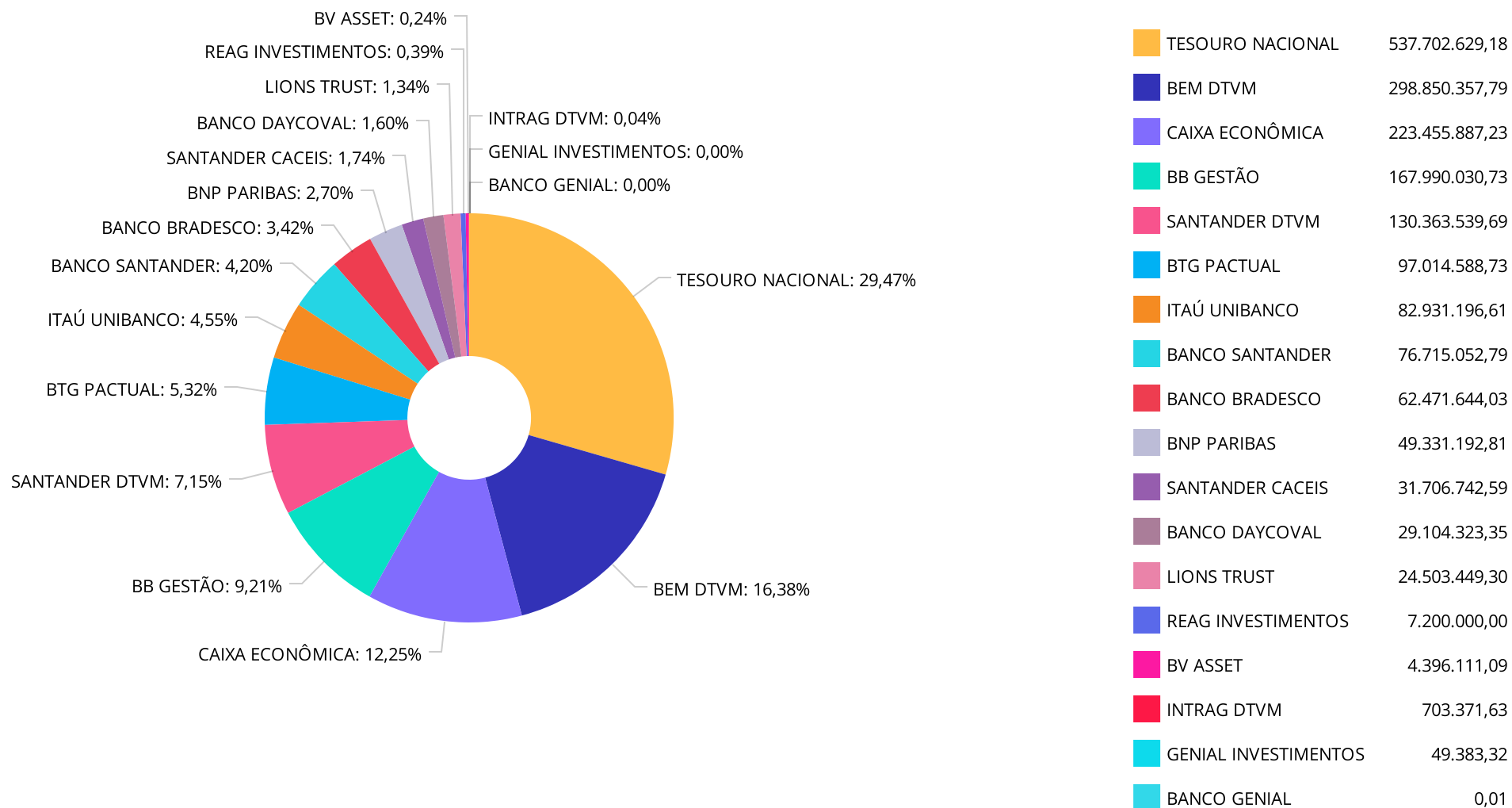
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	7,00%	5,78%	4,53%	4,22%	5,78%	-	6,30%	15,442%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIM...	3,55%	14,96%	7,92%	10,70%	14,96%	-	5,37%	14,854%



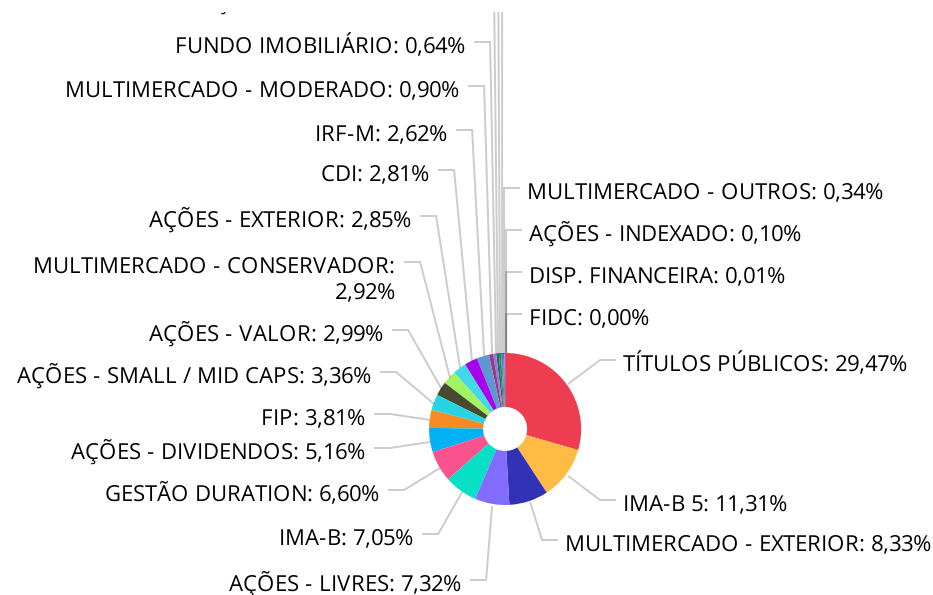
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	537.702.629,18	■ IMA-B 5	206.316.896,89	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	152.064.316,80
■ AÇÕES - LIVRES	133.544.115,95	■ IMA-B	128.713.998,32	■ GESTÃO DURATION	120.393.113,00
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	94.064.715,93	■ FIP	69.447.283,62	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	61.221.562,25
■ AÇÕES - VALOR	54.477.121,33	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	53.314.618,95	■ AÇÕES - EXTERIOR	52.005.991,53
■ CDI	51.208.190,61	■ IRF-M	47.719.078,26	■ MULTIMERCADO - MODERADO	16.411.980,83
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	11.596.111,09	■ AÇÕES - SETORIAIS	10.294.822,78	■ IDKA IPCA 2A	8.173.173,84
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.720.835,99	■ MULTIMERCADO - OUTROS	6.176.941,83	■ AÇÕES - INDEXADO	1.872.618,57
■ DISP. FINANCEIRA	204.678,67	■ FIDC	49.383,33		

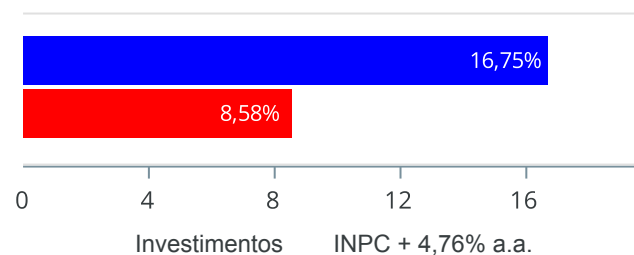
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2023)

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	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.353,184047	10.048.181,87	14.800.825,76	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	13/12/2022	12.000	3959,170000	4.307,158630	47.510.040,00	51.685.903,56	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.449,872129	36.097.639,50	37.823.913,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.449,872129	55.208.154,53	57.848.337,68	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.449,872129	14.651.394,86	15.352.058,85	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.449,872129	7.520.551,00	14.239.590,81	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.449,872129	13.087.396,08	17.799.488,52	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.449,872129	25.480.686,71	26.699.232,77	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.562,136179	24.699.419,65	27.372.817,07	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.562,136179	20.000.340,99	22.468.520,68	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.562,136179	20.609.488,43	23.152.841,11	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.562,136179	25.008.464,96	28.285.244,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.496,625121	25.347.747,49	26.979.750,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.496,625121	41.512.279,91	44.966.251,21	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.496,625121	25.038.468,13	28.328.738,26	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/04/2022	12.000	4159,261023	4.496,625121	49.911.132,28	53.959.501,45	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	16/05/2023	10.000	428.739,166800	4.593,961331	4.287.391.668,00	45.939.613,31	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	1.521.923.415,51	19.745.851,98	15.034.568,84	1.539.330.940,80	12.696.242,15	12.696.242,15	0,83%	0,83%	0,87%	0,87%	95,74%	5,49%
Fevereiro	1.539.330.940,80	164.546.755,80	162.749.949,62	1.532.011.715,31	-9.116.031,67	3.580.210,48	-0,59%	0,24%	1,11%	1,98%	11,86%	4,56%
Março	1.532.011.715,31	42.891.324,38	37.407.841,36	1.558.225.520,96	20.730.322,63	24.310.533,11	1,35%	1,59%	1,07%	3,07%	51,64%	4,33%
Abril	1.558.225.520,96	42.954.742,00	43.288.697,99	1.584.077.622,79	26.186.057,82	50.496.590,93	1,68%	3,29%	0,86%	3,96%	83,10%	3,89%
Mai	1.584.077.622,79	143.992.950,33	149.974.636,62	1.622.403.232,64	44.307.296,14	94.803.887,07	2,80%	6,18%	0,77%	4,76%	129,83%	3,88%
Junho	1.622.403.232,64	20.114.029,88	12.907.496,29	1.682.737.151,27	53.127.385,04	147.931.272,11	3,26%	9,64%	0,29%	5,06%	190,45%	4,10%
Julho	1.682.737.151,27	14.500.000,00	12.269.261,90	1.708.274.197,17	23.306.307,80	171.237.579,91	1,38%	11,16%	0,30%	5,38%	207,57%	3,74%
Agosto	1.708.274.197,17	29.708.078,12	26.370.545,70	1.694.898.716,53	-16.713.013,06	154.524.566,85	-0,98%	10,08%	0,63%	6,04%	166,90%	3,72%
Setembro	1.694.898.716,53	26.170.006,11	22.905.532,73	1.688.785.129,19	-9.378.060,72	145.146.506,13	-0,55%	9,47%	0,48%	6,55%	144,64%	3,91%
Outubro	1.688.785.129,19	13.240.000,00	9.150.905,24	1.670.557.853,51	-22.316.370,44	122.830.135,69	-1,32%	8,02%	0,51%	7,09%	113,22%	4,56%
Novembro	1.670.557.853,51	35.180.898,59	31.274.469,21	1.749.750.196,04	75.285.913,15	198.116.048,84	4,50%	12,88%	0,47%	7,59%	169,69%	4,09%
Dezembro	1.749.750.196,04	23.674.800,00	9.395.885,87	1.824.489.500,88	60.460.390,71	258.576.439,55	3,43%	16,75%	0,92%	8,58%	195,16%	3,34%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



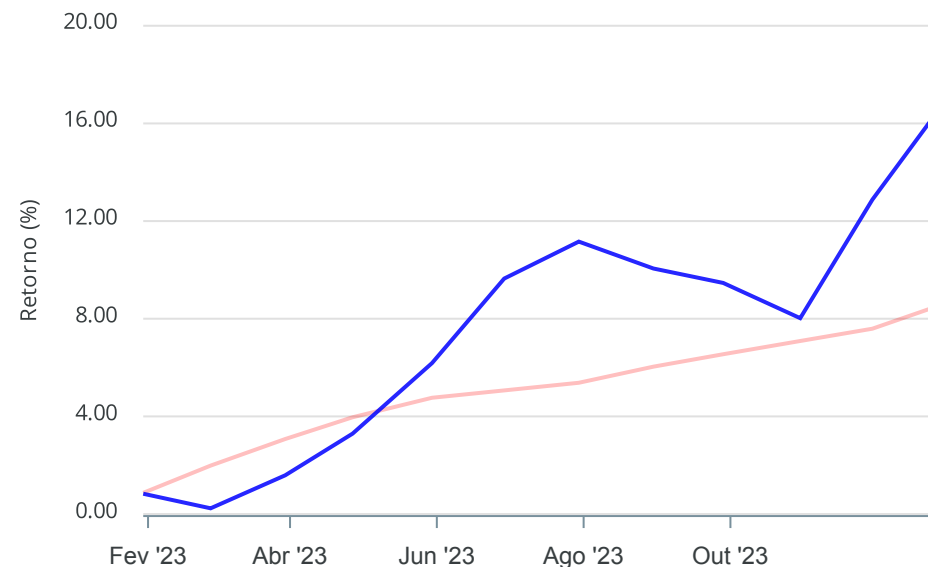
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	53.290,91	0,00	28.888,65	49.383,32	24.981,06	46,88%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	519.221.957,60	0,00	0,00	537.702.629,18	18.480.671,58	3,56%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	17.999.530,88	0,00	0,00	18.498.242,16	498.711,28	2,77%	2,77%	1,48%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.490.820,49	0,00	0,00	16.943.492,26	452.671,77	2,74%	2,74%	1,47%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	44.514.206,23	0,00	0,00	45.727.825,07	1.213.618,84	2,73%	2,73%	1,45%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	23.230.699,41	0,00	0,00	23.862.083,94	631.384,53	2,72%	2,72%	1,44%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.987.186,71	0,00	0,00	3.067.282,77	80.096,06	2,68%	2,68%	1,46%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.299.235,50	0,00	0,00	16.713.612,00	414.376,50	2,54%	2,54%	1,54%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.807.865,45	0,00	0,00	3.901.460,12	93.594,67	2,46%	2,46%	1,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.625.114,21	0,00	0,00	11.812.335,45	187.221,24	1,61%	1,61%	0,78%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.667.289,86	0,00	0,00	14.882.070,64	214.780,78	1,46%	1,46%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.912.940,71	0,00	0,00	15.130.759,09	217.818,38	1,46%	1,46%	0,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	17.451.625,83	0,00	0,00	17.706.248,53	254.622,70	1,46%	1,46%	0,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.921.009,77	0,00	0,00	13.107.657,05	186.647,28	1,44%	1,44%	0,49%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	78.030.485,74	0,00	0,00	79.155.349,08	1.124.863,34	1,44%	1,44%	0,49%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	34.534.936,07	0,00	0,00	35.032.572,30	497.636,23	1,44%	1,44%	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	39.838.666,48	0,00	0,00	40.411.758,37	573.091,89	1,44%	1,44%	0,48%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	38.062.694,23	0,00	0,00	38.609.560,09	546.865,86	1,44%	1,44%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	34.871.909,30	0,00	0,00	35.292.957,94	421.048,64	1,21%	1,21%	0,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	72.599.393,00	0,00	0,00	73.287.819,61	688.426,61	0,95%	0,95%	0,06%

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
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	8.101.059,31	0,00	0,00	8.173.173,84	72.114,53	0,89%	0,89%	0,73%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	36.439.808,49	23.674.800,00	9.300.300,00	51.208.190,61	393.882,12	0,66%	0,94%	0,02%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	1.058.661.726,19	23.674.800,00	9.329.188,65	1.100.276.463,43	27.269.125,89	2,54%		0,62%

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
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	5.700.000,00	0,00	30.000,00	7.200.000,00	1.530.000,00	26,84%	26,98%	25,40%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTISTRATÉGIA	12.298.444,80	0,00	0,00	13.692.316,16	1.393.871,36	11,33%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	25.968.278,88	0,00	0,00	28.525.414,18	2.557.135,30	9,85%	9,85%	5,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	31.016.177,15	0,00	0,00	33.297.256,81	2.281.079,66	7,35%	7,35%	7,50%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	16.771.504,42	0,00	0,00	17.936.619,00	1.165.114,58	6,95%	6,95%	5,29%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	24.663.460,84	0,00	0,00	26.305.150,00	1.641.689,16	6,66%	6,66%	4,77%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	4.902.290,20	0,00	0,00	5.221.951,01	319.660,81	6,52%	6,52%	6,40%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	17.149.356,19	0,00	0,00	18.163.051,27	1.013.695,08	5,91%	5,91%	4,98%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	36.822.316,97	0,00	0,00	38.982.337,05	2.160.020,08	5,87%	5,87%	6,42%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.346.856,77	0,00	0,00	11.964.622,47	617.765,70	5,44%	5,44%	7,67%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.327.758,92	0,00	0,00	7.720.835,99	393.077,07	5,36%	5,36%	6,27%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	14.813.213,30	0,00	0,00	15.594.834,54	781.621,24	5,28%	5,28%	6,04%
XP INVESTOR FI AÇÕES	12.351.387,88	0,00	0,00	13.000.773,03	649.385,15	5,26%	5,26%	5,05%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.353.899,89	0,00	0,00	4.582.351,47	228.451,58	5,25%	5,25%	6,39%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	43.748.911,01	0,00	0,00	46.040.752,64	2.291.841,63	5,24%	5,24%	7,97%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	48.631.992,15	0,00	0,00	51.176.803,38	2.544.811,23	5,23%	5,23%	4,23%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	13.208.723,10	0,00	0,00	13.892.913,92	684.190,82	5,18%	5,18%	6,92%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	37.384.882,79	0,00	0,00	39.259.076,10	1.874.193,31	5,01%	5,01%	6,22%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.816.366,59	0,00	0,00	18.705.969,56	889.602,97	4,99%	4,99%	4,60%
OCCAM FIC AÇÕES	14.772.359,88	0,00	0,00	15.494.784,28	722.424,40	4,89%	4,89%	6,23%

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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.884.587,51	0,00	0,00	1.975.634,07	91.046,56	4,83%	4,83%	6,78%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.520.008,27	0,00	0,00	9.958.858,60	438.850,33	4,61%	4,61%	7,06%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	14.725.699,78	0,00	0,00	15.386.682,92	660.983,14	4,49%	4,49%	5,17%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.255.798,19	0,00	36.697,22	4.396.111,09	177.010,12	4,16%	4,20%	9,56%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.888.133,73	0,00	0,00	10.294.822,78	406.689,05	4,11%	4,11%	6,41%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	15.851.732,54	0,00	0,00	16.411.980,83	560.248,29	3,53%	3,53%	3,75%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.981.708,21	0,00	0,00	6.176.941,83	195.233,62	3,26%	3,26%	3,55%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	8.661.015,62	0,00	0,00	8.899.854,98	238.839,36	2,76%	2,76%	2,43%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	13.279.256,15	0,00	0,00	13.433.246,51	153.990,36	1,16%	1,16%	0,26%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	22.760.424,01	0,00	0,00	22.987.368,25	226.944,24	1,00%	1,00%	0,81%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.864.036,02	0,00	0,00	1.872.618,57	8.582,55	0,46%	0,46%	3,53%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.398.872,95	0,00	0,00	22.488.708,28	89.835,33	0,40%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.007.351,82	0,00	0,00	2.014.741,02	7.389,20	0,37%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	579.053,34	0,00	0,00	578.909,17	-144,17	-0,02%	-0,02%	0,00%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.409.397,00	0,00	0,00	20.375.670,01	-33.726,99	-0,17%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	8.388.819,77	0,00	0,00	8.372.873,49	-15.946,28	-0,19%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	706.953,52	0,00	0,00	703.371,63	-3.581,89	-0,51%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	87.002,02	0,00	0,00	84.571,42	-2.430,60	-2,79%	-2,79%	0,23%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	1.175.747,74	0,00	0,00	1.136.122,44	-39.625,30	-3,37%	-3,37%	14,50%
Total Renda Variável	565.473.779,92	0,00	66.697,22	594.306.900,75	28.899.818,05	5,11%		5,76%

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 (%)	(%) Instít	Var - Mês
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	14.023.093,74	0,00	0,00	15.054.512,25	1.031.418,51	7,36%	7,36%	6,30%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.594.843,89	0,00	0,00	5.823.085,71	228.241,82	4,08%	4,08%	5,86%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.481.491,18	0,00	0,00	16.105.157,08	623.665,90	4,03%	4,03%	4,75%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	21.560.385,90	0,00	0,00	22.349.985,13	789.599,23	3,66%	3,66%	5,44%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	13.809.232,22	0,00	0,00	14.300.005,37	490.773,15	3,55%	3,55%	5,37%
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	4.745.513,48	0,00	0,00	4.901.366,15	155.852,67	3,28%	3,28%	6,68%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.358.849,08	0,00	0,00	4.501.834,73	142.985,65	3,28%	3,28%	5,64%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.683.561,64	0,00	0,00	14.062.878,06	379.316,42	2,77%	2,77%	4,42%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	11.918.445,59	0,00	0,00	12.164.149,36	245.703,77	2,06%	2,06%	4,16%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	10.787.278,53	0,00	0,00	10.984.491,27	197.212,74	1,83%	1,83%	4,21%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	9.651.994,68	0,00	0,00	9.658.671,59	6.676,91	0,07%	0,07%	6,84%
Total Exterior	125.614.689,93	0,00	0,00	129.906.136,70	4.291.446,77	3,42%		5,29%

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	518.235.256,54	0,00	10.385.717,65	537.702.629,18	29.853.090,29	5,76%	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	76.918.237,57	0,00	0,00	79.155.349,08	2.237.111,51	2,91%	2,91%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	71.208.375,11	0,00	0,00	73.287.819,61	2.079.444,50	2,92%	2,92%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	43.678.386,48	0,00	0,00	45.727.825,07	2.049.438,59	4,69%	4,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	39.265.506,18	0,00	0,00	40.411.758,37	1.146.252,19	2,92%	2,92%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	37.520.208,25	0,00	0,00	38.609.560,09	1.089.351,84	2,90%	2,90%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	22.795.273,49	0,00	0,00	23.862.083,94	1.066.810,45	4,68%	4,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	34.290.620,20	0,00	0,00	35.292.957,94	1.002.337,74	2,92%	2,92%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	34.038.632,98	0,00	0,00	35.032.572,30	993.939,32	2,92%	2,92%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	17.657.412,77	0,00	0,00	18.498.242,16	840.829,39	4,76%	4,76%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	5.937.566,59	71.735.403,79	27.240.594,75	51.208.190,61	775.814,98	1,00%	2,93%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.183.290,00	0,00	0,00	16.943.492,26	760.202,26	4,70%	4,70%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	16.972.161,69	0,00	0,00	17.706.248,53	734.086,84	4,33%	4,33%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.024.204,50	0,00	0,00	16.713.612,00	689.407,50	4,30%	4,30%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.503.323,72	0,00	0,00	15.130.759,09	627.435,37	4,33%	4,33%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.262.187,89	0,00	0,00	14.882.070,64	619.882,75	4,35%	4,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.354.189,51	0,00	0,00	11.812.335,45	458.145,94	4,04%	4,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.735.429,22	0,00	0,00	13.107.657,05	372.227,83	2,92%	2,92%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	11.394.384,46	0,00	11.595.326,93	0,00	200.942,47	1,76%	3,33%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.733.167,28	0,00	0,00	3.901.460,12	168.292,84	4,51%	4,51%

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
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.931.021,21	0,00	0,00	3.067.282,77	136.261,56	4,65%	4,65%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	410.558,51	0,00	403.529,33	49.383,32	42.354,14	10,32%	-87,97%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	8.173.820,32	0,00	0,00	8.173.173,84	-646,48	-0,01%	-0,01%
Total Renda Fixa	1.030.223.214,48	71.735.403,79	49.625.168,66	1.100.276.463,43	47.943.013,82	4,56%	

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
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	45.241.211,51	0,00	0,00	51.176.803,38	5.935.591,87	13,12%	13,12%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	33.561.357,68	0,00	0,00	39.259.076,10	5.697.718,42	16,98%	16,98%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	34.095.329,10	0,00	0,00	38.982.337,05	4.887.007,95	14,33%	14,33%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28.625.908,93	0,00	0,00	33.297.256,81	4.671.347,88	16,32%	16,32%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	42.274.433,33	0,00	0,00	46.040.752,64	3.766.319,31	8,91%	8,91%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	22.992.913,34	0,00	0,00	26.305.150,00	3.312.236,66	14,41%	14,41%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	25.575.040,03	0,00	0,00	28.525.414,18	2.950.374,15	11,54%	11,54%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.692.575,83	0,00	0,00	17.936.619,00	2.244.043,17	14,30%	14,30%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	5.099.000,00	0,00	86.000,00	7.200.000,00	2.187.000,00	42,89%	-
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	16.553.675,54	0,00	0,00	18.705.969,56	2.152.294,02	13,00%	13,00%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	16.121.294,17	0,00	0,00	18.163.051,27	2.041.757,10	12,66%	12,66%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	11.900.263,94	0,00	0,00	13.892.913,92	1.992.649,98	16,74%	16,74%
OCCAM FIC AÇÕES	13.673.456,25	0,00	0,00	15.494.784,28	1.821.328,03	13,32%	13,32%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.731.607,68	0,00	0,00	16.411.980,83	1.680.373,15	11,41%	11,41%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	13.964.108,38	0,00	0,00	15.594.834,54	1.630.726,16	11,68%	11,68%
XP INVESTOR FI AÇÕES	11.426.625,23	0,00	0,00	13.000.773,03	1.574.147,80	13,78%	13,78%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13.981.218,02	0,00	0,00	15.386.682,92	1.405.464,90	10,05%	10,05%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.795.267,41	0,00	0,00	11.964.622,47	1.169.355,06	10,83%	10,83%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTISTRATÉGIA	12.613.757,92	0,00	0,00	13.692.316,16	1.078.558,24	8,55%	7,28%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	22.047.093,91	0,00	0,00	22.987.368,25	940.274,34	4,26%	4,26%

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
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.824.710,96	0,00	0,00	7.720.835,99	896.125,03	13,13%	13,13%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.199.529,20	0,00	0,00	9.958.858,60	759.329,40	8,25%	8,25%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.617.427,10	0,00	0,00	10.294.822,78	677.395,68	7,04%	7,04%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	8.257.046,35	0,00	0,00	8.899.854,98	642.808,63	7,78%	7,78%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	5.613.412,29	0,00	0,00	6.176.941,83	563.529,54	10,04%	10,04%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.081.243,05	0,00	0,00	4.582.351,47	501.108,42	12,28%	12,28%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	4.762.366,57	0,00	0,00	5.221.951,01	459.584,44	9,65%	9,65%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	13.000.600,59	0,00	0,00	13.433.246,51	432.645,92	3,33%	3,33%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.099.295,34	0,00	110.091,66	4.396.111,09	406.907,41	9,93%	7,24%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.255.826,34	0,00	0,00	22.488.708,28	232.881,94	1,05%	1,05%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.751.218,64	0,00	0,00	1.975.634,07	224.415,43	12,81%	12,81%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	1.987.920,33	0,00	0,00	2.014.741,02	26.820,69	1,35%	1,35%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.849.844,63	0,00	0,00	1.872.618,57	22.773,94	1,23%	1,23%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	579.401,67	0,00	0,00	578.909,17	-492,50	-0,09%	-0,08%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	91.368,73	0,00	0,00	84.571,42	-6.797,31	-7,44%	-7,44%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	716.791,36	0,00	0,00	703.371,63	-13.419,73	-1,87%	-1,87%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	8.423.584,43	0,00	0,00	8.372.873,49	-50.710,94	-0,60%	-0,60%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	868.449,55	360.294,80	0,00	1.136.122,44	-92.621,91	-7,54%	-12,23%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.478.688,01	0,00	0,00	20.375.670,01	-103.018,00	-0,50%	-0,50%
Total Renda Variável	535.424.863,34	360.294,80	196.091,66	594.306.900,75	58.717.834,27	10,96%	

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...	20.651.426,65	0,00	0,00	22.349.985,13	1.698.558,48	8,22%	8,22%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.549.042,58	0,00	0,00	14.062.878,06	1.513.835,48	12,06%	12,06%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.026.750,42	0,00	0,00	16.105.157,08	1.078.406,66	7,18%	7,18%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	13.250.001,96	0,00	0,00	14.300.005,37	1.050.003,41	7,92%	7,92%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	11.458.173,80	0,00	0,00	12.164.149,36	705.975,56	6,16%	6,16%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	14.367.210,87	0,00	0,00	15.054.512,25	687.301,38	4,78%	4,53%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.354.094,51	0,00	0,00	5.823.085,71	468.991,20	8,76%	8,76%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.206.810,41	0,00	0,00	4.501.834,73	295.024,32	7,01%	7,01%
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	4.718.425,23	0,00	0,00	4.901.366,15	182.940,92	3,88%	3,88%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	11.214.632,93	0,00	0,00	10.984.491,27	-230.141,66	-2,05%	-2,05%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	10.340.482,01	0,00	0,00	9.658.671,59	-681.810,42	-6,59%	-6,59%
Total Exterior	123.137.051,37	0,00	0,00	129.906.136,70	6.769.085,33	5,50%	

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	477.675.700,98	42.873.916,68	68.772.714,75	537.702.629,18	85.925.726,27	16,51%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	63.736.390,80	0,00	0,00	73.287.819,61	9.551.428,81	14,99%	14,99%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	60.630.930,42	10.302.693,85	0,00	79.155.349,08	8.221.724,81	11,59%	11,86%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	39.498.842,35	0,00	0,00	45.727.825,07	6.228.982,72	15,77%	15,77%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	35.876.322,12	219.416,68	0,00	40.411.758,37	4.316.019,57	11,96%	11,96%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	31.071.561,11	0,00	0,00	35.292.957,94	4.221.396,83	13,59%	13,59%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	34.521.711,48	0,00	0,00	38.609.560,09	4.087.848,61	11,84%	11,84%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	31.303.399,60	0,00	0,00	35.032.572,30	3.729.172,70	11,91%	11,91%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.601.906,00	0,00	0,00	23.862.083,94	3.260.177,94	15,82%	15,82%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	15.949.675,89	0,00	0,00	18.498.242,16	2.548.566,27	15,98%	15,98%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	8.544.126,30	300.421.767,68	260.221.718,44	51.208.190,61	2.464.015,07	0,80%	13,34%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.255.698,72	0,00	0,00	17.706.248,53	2.450.549,81	16,06%	16,06%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.635.543,04	0,00	0,00	16.943.492,26	2.307.949,22	15,77%	15,77%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.008.193,16	0,00	0,00	15.130.759,09	2.122.565,93	16,32%	16,32%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.802.615,73	0,00	0,00	14.882.070,64	2.079.454,91	16,24%	16,24%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	15.000.000,00	0,00	16.713.612,00	1.713.612,00	11,42%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.197.140,58	0,00	0,00	11.812.335,45	1.615.194,87	15,84%	15,84%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.710.282,83	0,00	0,00	13.107.657,05	1.397.374,22	11,93%	11,93%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	10.213.346,01	0,00	11.595.326,93	0,00	1.381.980,92	13,53%	15,28%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	119.643,27	0,00	645.954,88	49.383,32	575.694,93	481,18%	-58,72%

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
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	10.408.177,72	0,00	7.000.000,00	3.901.460,12	493.282,40	4,74%	13,33%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.648.082,53	0,00	0,00	3.067.282,77	419.200,24	15,83%	15,83%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,00	8.000.000,00	0,00	8.173.173,84	173.173,84	2,16%	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.181.469,44	0,00	10.302.693,85	0,00	121.224,41	1,19%	12,11%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	11.595.646,39	0,00	11.712.858,26	0,00	117.211,87	1,01%	15,95%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
Total Renda Fixa	942.186.406,48	376.817.794,89	370.251.267,11	1.100.276.463,43	151.523.529,17	15,97%	

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
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	40.863.027,95	0,00	51.176.803,38	10.313.775,43	25,24%	33,78%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	18.361.146,73	0,00	0,00	28.525.414,18	10.164.267,45	55,36%	55,36%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	32.321.389,25	0,00	0,00	38.982.337,05	6.660.947,80	20,61%	20,61%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	39.934.448,43	0,00	0,00	46.040.752,64	6.106.304,21	15,29%	15,29%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	33.505.528,92	0,00	0,00	39.259.076,10	5.753.547,18	17,17%	17,17%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	20.579.911,49	0,00	26.305.150,00	5.725.238,51	27,82%	27,90%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.391.999,13	8.380.000,00	0,00	18.705.969,56	3.933.970,43	26,63%	24,84%
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	13.892.913,92	3.892.913,92	38,93%	35,56%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.291.691,03	0,00	0,00	17.936.619,00	3.644.927,97	25,50%	25,50%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.679.280,65	0,00	0,00	18.163.051,27	3.483.770,62	23,73%	23,73%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	29.876.967,90	0,00	0,00	33.297.256,81	3.420.288,91	11,45%	11,45%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	37.483.286,25	0,00	40.863.027,95	0,00	3.379.741,70	9,02%	33,02%
XP INVESTOR FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	13.000.773,03	3.000.773,03	30,01%	26,25%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	20.075.694,02	0,00	0,00	22.987.368,25	2.911.674,23	14,50%	14,50%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATÉGIA	17.609.165,00	0,00	101.780,98	20.375.670,01	2.868.285,99	16,29%	15,71%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	13.332.537,27	0,00	0,00	15.594.834,54	2.262.297,27	16,97%	16,97%
OCCAM FIC AÇÕES	13.387.073,56	0,00	0,00	15.494.784,28	2.107.710,72	15,74%	15,74%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13.300.366,08	0,00	0,00	15.386.682,92	2.086.316,84	15,69%	15,69%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.389.221,46	0,00	0,00	16.411.980,83	2.022.759,37	14,06%	14,06%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.263.201,85	0,00	0,00	11.964.622,47	1.701.420,62	16,58%	16,58%

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
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	5.999.000,00	0,00	320.000,00	7.200.000,00	1.521.000,00	25,35%	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	11.930.801,05	0,00	0,00	13.433.246,51	1.502.445,46	12,59%	12,59%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	10.794.266,49	1.471.324,38	0,00	13.692.316,16	1.426.725,29	11,63%	6,31%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	4.923.590,74	0,00	0,00	6.176.941,83	1.253.351,09	25,46%	25,46%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.709.472,47	0,00	0,00	9.958.858,60	1.249.386,13	14,35%	14,35%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.483.463,42	0,00	0,00	7.720.835,99	1.237.372,57	19,09%	19,09%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.298.102,04	0,00	0,00	10.294.822,78	996.720,74	10,72%	10,72%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.700.056,27	0,00	0,00	4.582.351,47	882.295,20	23,85%	23,85%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MU...	0,00	8.031.511,65	0,00	8.899.854,98	868.343,33	10,81%	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.125.199,26	0,00	423.097,36	4.396.111,09	694.009,19	16,82%	6,57%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	7.092.679,25	603.078,12	0,00	8.372.873,49	677.116,12	8,80%	8,55%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.705.799,89	0,00	0,00	1.975.634,07	269.834,18	15,82%	15,82%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.221.951,01	221.951,01	4,44%	14,44%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	392.158,01	0,00	15.830,08	578.909,17	202.581,24	51,66%	47,62%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.011.592,35	0,00	40.631,53	2.014.741,02	43.780,20	2,18%	0,16%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	598.749,97	517.719,78	0,00	1.136.122,44	19.652,69	1,76%	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	145.481,58	0,00	30.121,41	84.571,42	-30.788,75	-21,16%	-41,87%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	417.218,15	382.708,91	0,00	703.371,63	-96.555,43	-12,07%	-6,01%
RIO BRAVO ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.872.618,57	-127.381,43	-6,37%	-5,48%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.751.746,57	0,00	8.381.617,78	0,00	-370.128,79	-4,23%	16,58%

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
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.144.668,03	1.294.742,00	348.351,47	22.488.708,28	-602.350,28	-2,57%	-5,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	22.372.255,95	0,00	20.579.911,49	0,00	-1.792.344,46	-8,01%	7,41%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	23.873.300,99	0,00	20.086.105,78	0,00	-3.787.195,21	-15,86%	21,06%
Total Renda Variável	484.672.600,01	109.124.024,28	91.190.475,83	594.306.900,75	91.700.752,29	18,25%	

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
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.203.517,42	13.000.000,00	24.604.669,08	14.062.878,06	3.464.029,72	9,84%	32,50%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	19.264.837,90	0,00	0,00	22.349.985,13	3.085.147,23	16,01%	16,01%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	17.604.894,38	0,00	20.295.761,33	0,00	2.690.866,95	15,28%	38,02%
FRANKLIN CLEARBRIDGE AÇÕES EUA GROWTH INVESTIMENTO...	11.877.728,42	0,00	13.387.618,02	0,00	1.509.889,60	12,71%	49,08%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.726.042,30	0,00	0,00	16.105.157,08	1.379.114,78	9,37%	9,37%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	0,00	13.387.618,02	0,00	14.300.005,37	912.387,35	6,82%	14,96%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	0,00	10.145.000,00	0,00	10.984.491,27	839.491,27	8,27%	-4,54%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.200.847,61	0,00	0,00	5.823.085,71	622.238,10	11,96%	11,96%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	0,00	24.600.000,00	13.000.000,00	12.164.149,36	564.149,36	2,29%	9,92%
RIO BRAVO TEMPLETON CLIMATE CHANGE INVESTIMENTO NO...	0,00	14.500.000,00	0,00	15.054.512,25	554.512,25	3,82%	5,78%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.186.540,99	0,00	0,00	4.501.834,73	315.293,74	7,53%	7,53%
ELECTRON GLOBAL ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	0,00	5.000.000,00	0,00	4.901.366,15	-98.633,85	-1,97%	-2,52%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	0,00	10.145.000,00	0,00	9.658.671,59	-486.328,41	-4,79%	-16,97%
Total Exterior	95.064.409,02	90.777.618,02	71.288.048,43	129.906.136,70	15.352.158,09	13,40%	

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.

