

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	4.648.896,02	2,48%	694	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.623.888,82	2,47%	1.141	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.312.443,70	2,84%	633	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	2.130.153,74	1,14%	198	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	2.186.461,73	1,17%	121	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	2.744.510,21	1,46%	34	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.965.570,95	4,25%	788	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.474.619,08	6,66%	850	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.996.252,83	9,07%	914	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.002.709,97	4,27%	769	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.775.392,24	2,55%	1.190	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	6.469.877,10	3,45%	445	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	5.717.054,09	3,05%	216	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.921.318,12	2,63%	76	0,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	21.094.375,05	11,26%	395	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	6.363.302,83	3,40%	224	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	521.165,43	0,28%	607	4,73%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	6.705.099,44	3,58%	662	3,37%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.889.788,39	2,08%	467	1,41%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.275.808,58	0,68%	3.130	0,49%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	D+16 du	Não há	4.451.013,22	2,38%	128	3,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.829.261,95	1,51%	9.648	0,81%	Artigo 8º, Inciso I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	1.736.259,76	0,93%	536	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	12.437.898,67	6,64%	2.445	0,87%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	Não há	1.625.000,96	0,87%	150	4,92%	Artigo 8º, Inciso I
QLZ MOS FI AÇÕES	D+10	Não há	1.836.593,33	0,98%	59	2,20%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	10.451.329,82	5,58%	1.768	3,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.140.628,99	2,21%	10.022	0,64%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.002.620,13	0,54%	15.972	0,21%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	D+3 du	Não há	709.684,83	0,38%	3.213	0,48%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	5.598.242,36	2,99%	175	1,70%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.180.555,08	1,16%	6.530	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.867.526,28	1,00%	595	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.842.944,96	1,52%	28	2,32%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.043.333,31	0,56%		0,73%	Artigo 11º
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	441.934,60	0,24%		0,15%	Artigo 11º
MACAM SHOPPING FII	Não se ...	Não se aplica	3.359.344,07	1,79%		0,00%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			187.372.860,64				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			541.636,92				Artigo 6º
PL Total			187.914.497,56				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	14,00%	81,95%	153.552.059,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	84.047.830,48	44,86%	19,09%	28,35%	81,95%	69.504.228,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	32.900.161,43	17,56%	20,86%	23,50%	60,00%	79.523.554,95
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	37.474.572,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	6.705.099,44	3,58%	0,00%	5,00%	5,00%	2.663.543,59
Total Renda Fixa	100,00%	123.653.091,35	65,99%	39,95%	70,85%	248,90%	

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





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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	40.532.954,68	21,63%	14,00%	19,60%	25,00%	6.310.260,48
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	9.646.323,72	5,15%	1,60%	2,70%	10,00%	9.090.962,34
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	2.842.944,96	1,52%	1,00%	2,35%	5,00%	6.525.698,07
Artigo 11º	5,00%	4.844.611,98	2,59%	1,00%	1,50%	5,00%	4.524.031,05
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	57.866.835,34	30,88%	17,60%	26,15%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.852.933,95	3,12%	2,00%	3,00%	10,00%	12.884.352,11
Total Exterior	10,00%	5.852.933,95	3,12%	2,00%	3,00%	10,00%	

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	61.609.487,46	32,88	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	40.673.261,20	21,71	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.472.597,44	17,33	-
SOMMA INVESTIMENTOS	17.156.429,26	9,16	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	12.437.898,67	6,64	-
BAYES CAPITAL MANAGEMENT	4.451.013,22	2,38	-
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	3.889.788,39	2,08	-
MACAM ASSET	3.359.344,07	1,79	-
KPTL	2.842.944,96	1,52	-
MOS CAPITAL	1.836.593,33	0,98	-
CLARITAS INVESTIMENTOS	1.736.259,76	0,93	-
MULTINVEST CAPITAL	1.625.000,96	0,87	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.275.808,58	0,68	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.043.333,31	0,56	-
VANQUISH ASSET MANAGEMENT	521.165,43	0,28	-
ZION INVEST	441.934,60	0,24	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,45%	12,13%	2,89%	5,00%	12,13%	22,60%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	11,90%	2,86%	4,97%	11,90%	22,02%	0,43%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	10,82%	2,57%	4,71%	10,90%	24,35%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,96%	5,23%	2,45%	1,88%	5,23%	11,58%	0,21%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,91%	13,25%	2,89%	6,16%	13,25%	26,86%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	12,88%	2,80%	6,00%	12,88%	26,13%	0,04%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	13,02%	2,83%	6,04%	13,02%	26,29%	0,03%	0,00%
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%
IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,84%	15,65%	4,53%	3,50%	15,65%	21,36%	1,58%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,73%	15,86%	4,71%	4,15%	15,86%	23,03%	1,44%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	1,48%	16,51%	4,38%	6,28%	16,51%	26,79%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,46%	16,06%	4,33%	6,05%	16,06%	26,02%	0,66%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	16,32%	4,33%	6,17%	16,32%	26,46%	0,66%	0,03%

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 (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	13,57%	3,03%	6,68%	13,57%	28,48%	0,02%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,13%	12,69%	3,08%	5,22%	12,69%	26,00%	0,25%	0,01%
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%
VANQUISH CORAL FI RENDA FIXA LP	-1,11%	-88,54%	-1,83%	-9,30%	-88,54%	-85,87%	0,11%	0,88%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,02%	11,56%	3,30%	7,63%	11,56%	26,95%	0,17%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,69%	13,64%	3,22%	4,06%	13,64%	-	0,81%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,31%	15,54%	4,20%	3,37%	15,54%	-	1,49%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,13%	13,22%	3,63%	6,24%	13,22%	26,55%	0,33%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
QLZ MOS FI AÇÕES	5,63%	-	12,91%	7,87%	-	-	4,72%	0,22%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	5,56%	13,18%	13,72%	11,11%	13,18%	13,30%	6,15%	0,17%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,45%	26,07%	13,94%	13,99%	26,07%	31,61%	4,09%	0,14%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,50%	19,59%	11,92%	6,93%	19,59%	22,06%	5,41%	0,15%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5,44%	16,58%	10,83%	10,21%	16,58%	16,17%	7,67%	0,16%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	7,09%	30,61%	11,88%	12,98%	30,61%	24,77%	4,80%	0,16%
IBX (Benchmark)	5,48%	21,27%	14,95%	13,77%	21,27%	26,15%	-	-
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5,35%	16,34%	11,17%	10,08%	16,34%	26,02%	7,17%	0,19%
IFIX (Benchmark)	4,25%	15,50%	2,86%	4,95%	15,50%	18,06%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-	-	-	-	-	-	16,49%	0,39%
ÁQUILLA FII - AQLL11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,70%	11,43%	7,01%	6,95%	11,43%	-16,44%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,19%	33,22%	12,99%	10,86%	33,22%	17,27%	4,22%	0,13%

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
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	2,57%	14,84%	7,88%	8,03%	14,84%	-15,60%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,95%	16,61%	7,35%	8,82%	16,61%	-13,59%	4,59%	0,14%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,42%	24,23%	11,24%	7,18%	24,23%	0,08%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	5,17%	33,07%	12,98%	10,83%	33,07%	17,21%	4,21%	0,13%
SMLL (Benchmark)	7,05%	17,12%	11,48%	3,40%	17,12%	-0,52%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	7,31%	17,23%	10,26%	2,16%	17,23%	-1,38%	7,55%	0,23%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	6,26%	14,22%	10,43%	3,13%	14,22%	3,89%	8,41%	0,21%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,36%	15,47%	3,64%	6,91%	15,61%	35,13%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,14%	-1,73%	-0,43%	-0,87%	-1,73%	-10,25%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,18%	12,89%	3,05%	5,69%	12,99%	29,09%	-	-
MACAM SHOPPING FII	-	-	-	-	-	-	-	-



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
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	2,57%	14,84%	7,88%	8,03%	14,84%	-15,60%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,95%	16,61%	7,34%	8,82%	16,61%	-13,59%	4,59%	14,099%
Global BDRX (Benchmark)	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL II	2,06%	9,92%	6,16%	10,10%	9,92%	-6,61%	4,16%	13,405%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,68%	46,02%	12,48%	13,68%	46,02%	3,13%	4,94%	16,495%



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



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



CRÉDITO
& 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	163.444.886,17	12.606.458,22	11.034.186,59	168.444.557,99	3.427.400,19	3.427.400,19	2,08%	2,08%	0,96%	0,96%	216,93%	2,80%
Fevereiro	168.444.557,99	11.553.393,00	10.882.600,77	168.106.417,11	-1.008.933,11	2.418.467,08	-0,60%	1,47%				