

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	10.756.106,26	11,20%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	531.291,18	0,55%	6.297.472.287,75	0,01%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	557.334,31	0,58%	5.283.374.941,87	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	810.695,87	0,84%	1.034.042.426,70	0,08%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.393.513,10	2,49%	177.070.662,71	1,35%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	615.610,19	0,64%	5.290.529.627,75	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	748.957,24	0,78%	5.218.373.540,00	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.690.521,76	1,76%	7.603.591.100,02	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.508.181,04	14,07%	5.157.397.073,53	0,26%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.235.021,19	1,29%	8.470.280.308,74	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.646,84	0,04%	11.756.324.476,80	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.056.593,94	3,18%	2.287.059.745,87	0,13%	7º I b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	787.259,85	0,82%	313.213.226,79	0,25%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.741.249,27	11,19%	715.922.351,16	1,50%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.656.979,03	4,85%	10.724.175.764,47	0,04%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.944.445,43	13,48%	162.031.359,07	7,99%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.322.669,02	1,38%	1.298.723.695,54	0,10%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.152,02	0,00%	2.799.591.858,55	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.790.038,64	1,86%	783.566.811,58	0,23%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	3.058.765,51	3,19%	261.739.999,18	1,17%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.022.342,55	2,11%	454.422.244,72	0,45%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	975.885,55	1,02%	1.435.613.851,41	0,07%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.540.661,39	3,69%	662.205.543,66	0,53%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.297.559,45	2,39%	260.031.743,25	0,88%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.337.794,68	1,39%	1.430.648.502,14	0,09%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.754.048,25	1,83%	1.686.539.310,38	0,10%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	824.291,46	0,86%	166.220.845,31	0,50%	8º I

Investimentos

\$ 95.999.136,54

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.389.966,56

Total Carteira

\$ 97.389.103,10

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	381.702,12	0,40%	269.787.546,50	0,14%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	227.676,43	0,24%	80.440.788,20	0,28%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	1.040.285,64	1,08%	16.767.022,34	6,20%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	849.355,91	0,88%	687.792.180,37	0,12%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1.205.020,17	1,26%	313.084.759,07	0,38%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.652.221,17	1,72%	1.995.875.754,00	0,08%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.328.935,25	1,38%	95.692.462,17	1,39%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	540.745,39	0,56%	1.445.973.570,09	0,04%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.777.579,44	4,98%	1.635.814.462,49	0,29%	10º I

Investimentos

\$ 95.999.136,54

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.389.966,56

Total Carteira

\$ 97.389.103,10

Governança (Pró Gestão)

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.503,859061	130.611,91
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.694,216205	93.884,32
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.869,545153	238.607,71
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	5.034,583509	735.049,19
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.844,937215	1.700.572,96
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.904,991456	353.159,38
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.314,996927	648.429,63
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.270,297035	374.191,09
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	5.175,3359	755.599,04
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	5.111,075101	628.662,24
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	5.146,630123	627.888,88
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	5.075,888049	629.410,12
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	5.139,488176	755.504,76
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.360,257136	16.080,77
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.507,382083	104.640,26
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	5.041,060603	347.833,18
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.369,073625	126.703,14
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	5.057,506316	1.815.644,77
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	5.027,111226	673.632,90

Investimentos

\$ 95.999.136,54

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.389.966,56

Total Carteira

\$ 97.389.103,10

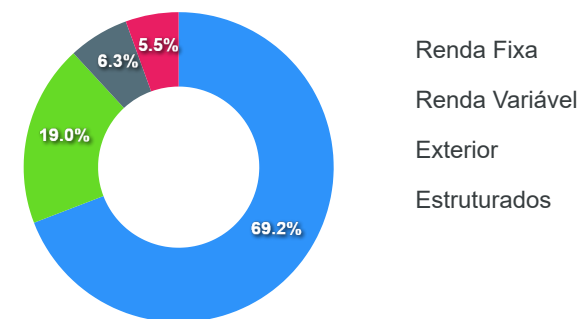
Governança (Pró Gestão)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	11,04%	88,96%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	26,67%	73,33%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	30,46%	29,54%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	18,70%	11,30%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,18%	6,82%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,06%	6,94%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,46%	4,54%

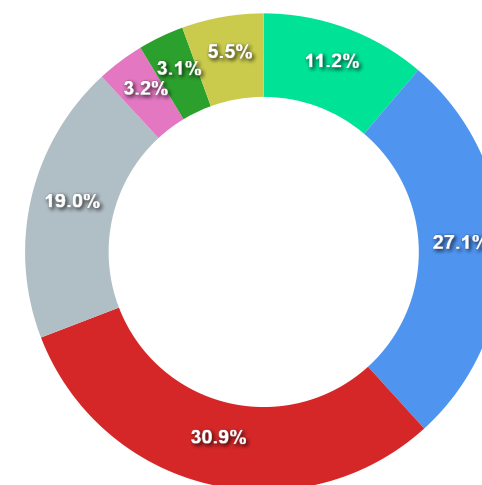
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos



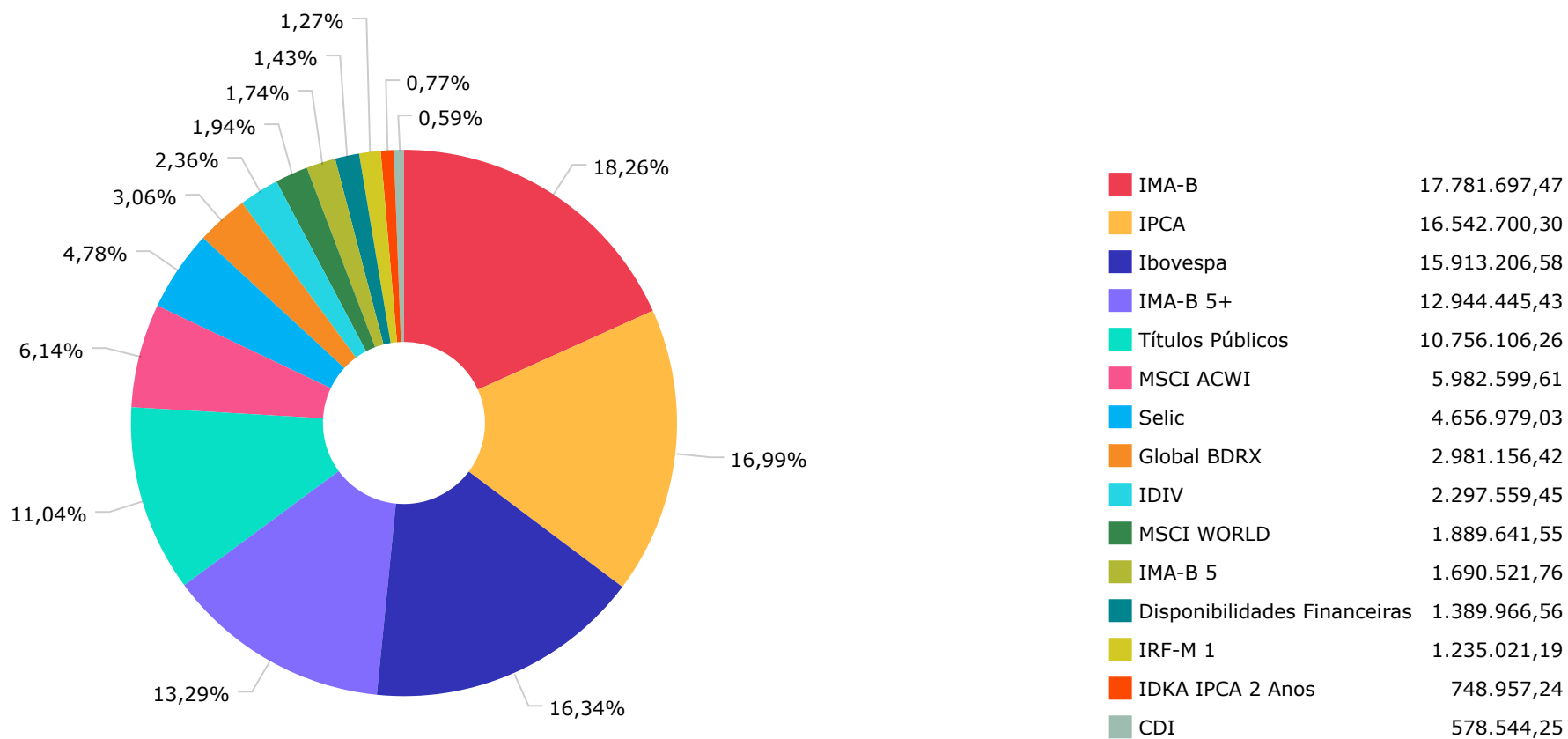
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	11,04%	0,00%	15,00%	100,00%	86.632.996,84
7º I b - FI 100% Títulos TN	26,67%	0,00%	20,00%	100,00%	71.417.476,59
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	97.389.103,10
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.869.455,16
7º III a - FI Referenciados RF	30,46%	0,00%	20,00%	60,00%	28.766.967,09
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	58.433.461,86
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	19.477.820,62
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.869.455,16
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.869.455,16
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.869.455,16

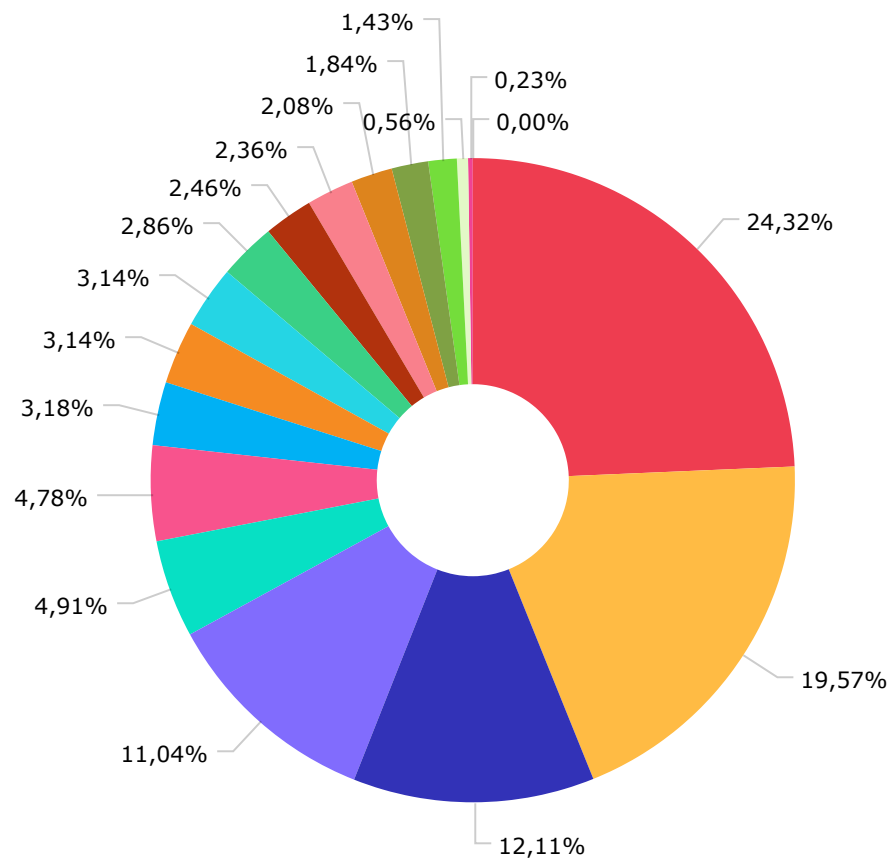
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	18,70%	0,00%	28,00%	30,00%	11.005.964,90
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	29.216.730,93
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	9.738.910,31
9º II - Constituídos no Brasil	3,18%	0,00%	2,00%	10,00%	6.644.248,59
9º III - Ações - BDR Nível I	3,06%	0,00%	5,00%	10,00%	6.757.753,89
10º I - Fundos Multimercados	5,46%	0,00%	5,00%	10,00%	4.420.585,48
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.869.455,16
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.869.455,16
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.869.455,16
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.869.455,16

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03		
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,82	13,64	4,88	6,55	13,64	26,09	1,31	2,76
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94	13,34	2,93	6,55	13,34	27,93	0,02	0,04
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90	12,98	2,79	6,04	12,98	27,02	0,01	0,03
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	2,84	26,33	7,77	9,72	26,33	-9,11		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,59	24,92	7,65	9,07	24,92	-10,73	4,08	8,59
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,98	8,77	5,89	9,52	8,77	-8,60	4,16	8,76
IBOVESPA - BENCHMARK	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01		
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	5,46	22,43	15,18	13,69	22,43	28,13	6,18	13,02
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	5,52	20,23	14,07	12,88	20,23	23,14	6,19	13,03
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,50	19,59	11,92	6,93	19,59	22,06	5,41	11,40
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	5,32	18,69	13,55	11,09	18,69	15,05	6,14	12,93
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,40	17,14	10,44	8,41	17,14	15,05	6,16	12,98
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	5,51	15,90	11,62	7,87	15,90	12,02	6,04	12,72
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,83	15,82	12,81	8,59	15,82	10,40	6,78	14,27
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	6,25	12,50	11,91	6,56	12,50	20,56	6,34	13,34
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,35	11,45	16,32	13,22	11,45	17,20	7,50	15,79
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,47	7,41	9,14	3,37	7,41	-2,64	7,40	15,58
IDIV - BENCHMARK	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,71	24,99	14,10	15,25	24,99	39,28	4,52	9,52
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	0,90

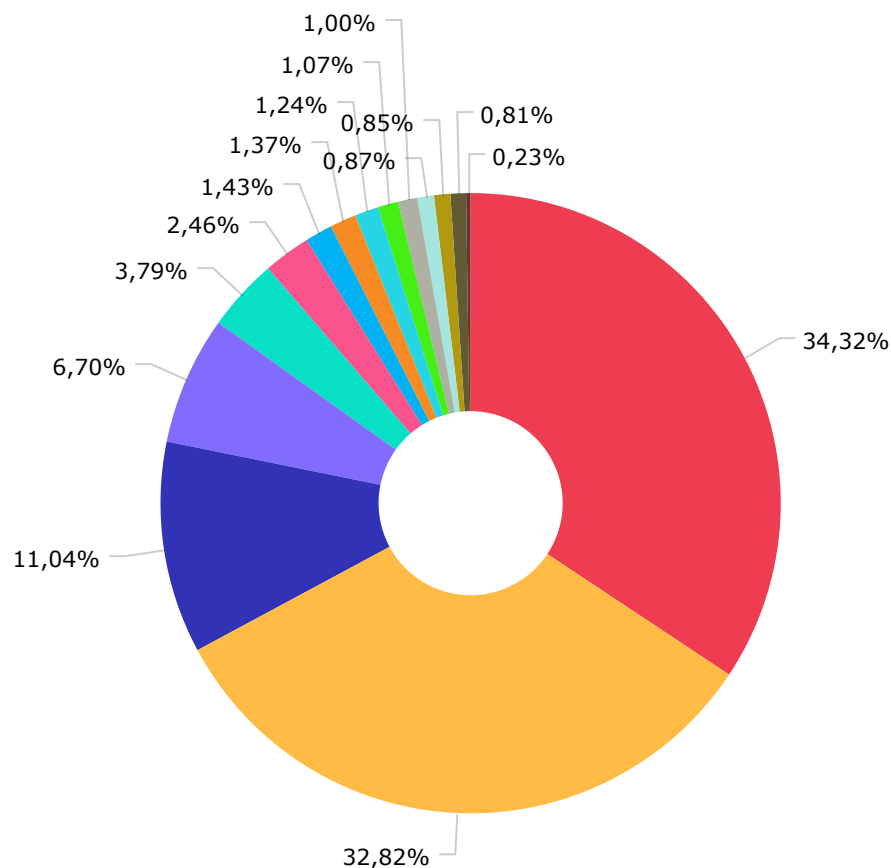
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B - BENCHMARK	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,77	15,98	4,76	4,21	15,98	22,96	1,48	3,12
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,73	15,86	4,71	4,15	15,86	23,03	1,44	3,03
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,74	15,77	4,71	4,04	15,77	22,83	1,46	3,08
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2,83	15,68	4,90	4,40	15,68	23,41	1,54	3,24
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44	11,96	2,92	4,64	11,96	22,79	0,48	1,02
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,91	18,91	6,33	3,63	18,91	22,48	2,40	5,04
IPCA - BENCHMARK	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61	15,84	4,04	5,04	15,84	24,91	0,78	1,65
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,55	15,23	3,64	5,28	15,23	25,31	0,56	1,19
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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,69	13,64	3,22	4,06	13,64		0,81	1,71
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21	13,59	2,92	4,92	13,59	25,74	0,28	0,60
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,53	13,38	3,97	5,23	13,38	23,90	0,50	1,06
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89	13,02	2,83	6,04	13,02	26,29	0,03	0,06
SELIC - BENCHMARK	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03		
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88	12,74	2,74	5,98	12,74	26,34	0,01	0,02
MSCI WORLD - BENCHMARK	2,81	12,98	7,38	7,31	12,98	-14,93		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	4,02	38,02	12,26	13,39	38,02	-24,45	7,84	16,51
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	3,71	3,00	6,26	5,88	3,00	-17,01	5,13	10,81
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	8,89
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	4,08	11,96	8,76	8,85	11,96	-12,95	5,86	12,35

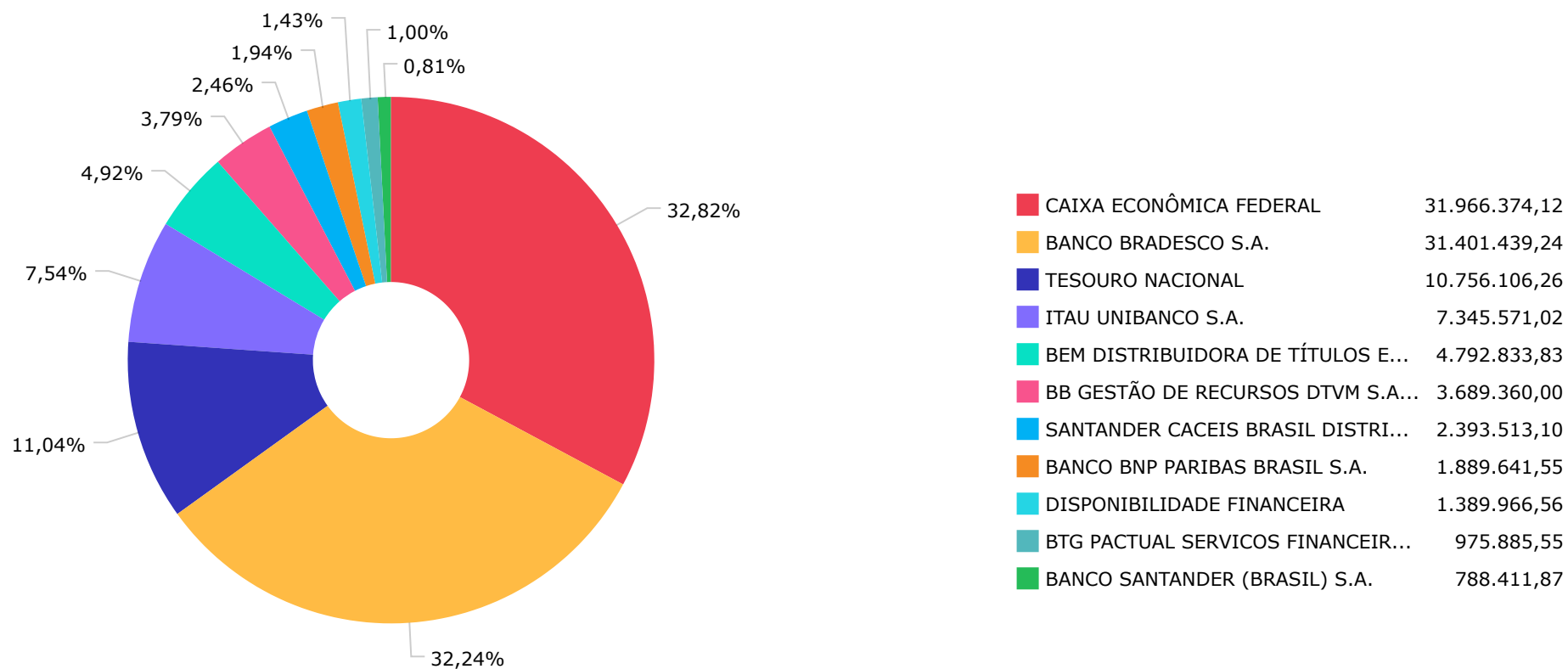




Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	23.685.694,70
Renda Fixa Indexados	19.062.684,56
Ações Livre	11.795.539,87
Títulos Públicos	10.756.106,26
Multimercados Livre	4.777.579,44
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	4.656.979,03
Ações Investimento no Exterior	3.094.661,72
Ações Indexados	3.058.765,51
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	3.056.593,94
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.781.503,93
Renda Fixa Duração Alta Soberano	2.393.513,10
Ações Dividendos	2.297.559,45
Ações Índice Ativo	2.022.342,55
Ações Sustentabilidade/Governança	1.790.038,64
Disponibilidades Financeiras	1.389.966,56
Multimercados Macro	540.745,39
Ações Valor/Crescimento	227.676,43
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	1.152,02



BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	33.423.781,79
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.966.374,12
TESOURO NACIONAL	10.756.106,26
ITAU UNIBANCO S.A.	6.521.279,56
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.689.360,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S....	2.393.513,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.389.966,56
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.337.794,68
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.205.020,17
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	1.040.285,64
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	975.885,55
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	849.355,91
ITAÚ DTVM S.A.	824.291,46
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	788.411,87
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	227.676,43



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	76.550.855,53	871.703,64	255.860,00	78.370.841,73	1.204.142,56	1.204.142,56	1,56% ▲	1,56%	0,99%	0,99%	157,58%	4,28%
Fevereiro	78.370.841,73	1.541.794,21	679.235,13	78.604.427,93	-628.972,88	575.169,68	-0,79% ▼	0,75%	1,22%	2,23%	33,63%	3,54%
Março	78.604.427,93	2.311.001,22	1.358.000,00	80.367.794,75	810.365,60	1.385.535,28	1,02% ▲	1,78%	1,20%	3,45%	51,59%	3,18%
Abril	80.367.794,75	1.366.372,62	567.000,00	82.342.260,71	1.175.093,34	2.560.628,62	1,45% ▲	3,25%	0,99%	4,47%	72,71%	3,07%
Mai	82.342.260,71	2.480.415,53	1.232.046,07	85.591.259,29	2.000.629,12	4.561.257,74	2,39% ▲	5,73%	0,69%	5,20%	110,19%	2,80%
Junho	85.591.259,29	12.187.095,97	11.464.552,72	88.930.753,55	2.616.951,01	7.178.208,75	3,03% ▲	8,93%	0,36%	5,58%	160,04%	3,10%
Julho	88.930.753,55	705.040,60	430.000,00	90.422.775,77	1.216.981,62	8.395.190,37	1,36% ▲	10,42%	0,56%	6,17%	168,88%	2,71%
Agosto	90.422.775,77	673.115,48	264.698,11	90.025.812,75	-805.380,39	7.589.809,98	-0,89% ▼	9,44%	0,71%	6,93%	136,22%	2,78%
Setembro	90.025.812,75	182.750,27	60.000,00	89.550.817,74	-597.745,28	6.992.064,70	-0,66% ▼	8,71%	0,68%	7,66%	113,71%	3,14%
Outubro	89.550.817,74	83.678,39	89.000,00	88.543.333,00	-1.002.163,13	5.989.901,57	-1,12% ▼	7,50%	0,68%	8,39%	89,39%	3,65%
Novembro	88.543.333,00	495.771,01	272.846,05	92.644.401,16	3.878.143,20	9.868.044,77	4,37% ▲	12,19%	0,70%	9,15%	133,22%	2,99%
Dezembro	92.644.401,16	578.624,53	62.400,00	95.999.136,54	2.838.510,85	12.706.555,62	3,05% ▲	15,61%	0,98%	10,22%	152,74%	2,41%

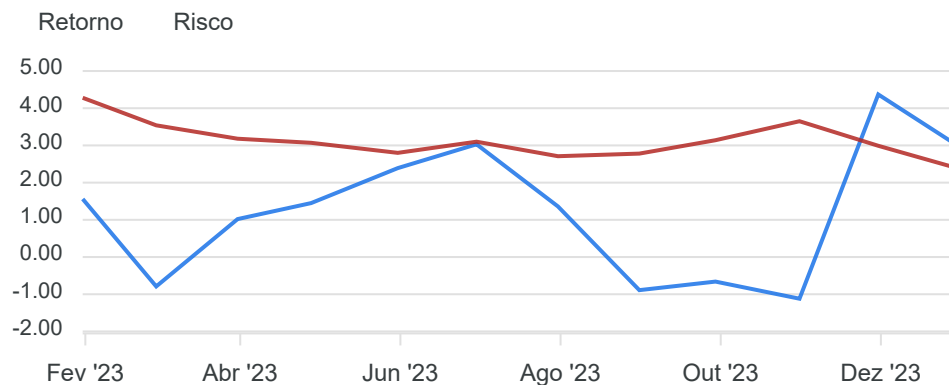
Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.385.535,28	1,78%	3,45%
2º Trim	5.792.673,47	7,03%	2,06%
1º Sem	7.178.208,75	8,93%	5,58%
3º Trim	-186.144,05	-0,20%	1,97%
4º Trim	5.714.490,92	6,35%	2,38%
2º Sem	5.528.346,87	6,13%	4,40%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

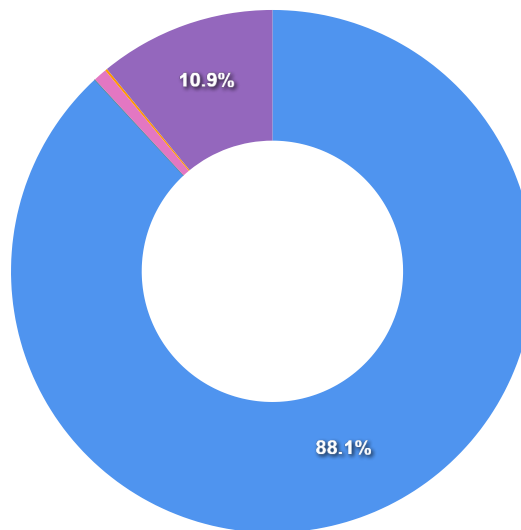


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 29/12/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	85.822.300,97	89,40
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	810.695,87	0,84
Até D+3600	130.611,91	0,14
Acima D+3600	10.625.494,34	11,07
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.657.082,06	0,00	0,00	10.756.106,26	99.024,20	0,93% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	526.300,51	0,00	0,00	531.291,18	4.990,67	0,95% ▲	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	542.452,01	0,00	0,00	557.334,31	14.882,30	2,74% ▲	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	797.206,80	0,00	0,00	810.695,87	13.489,07	1,69% ▲	0,81%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.327.540,97	0,00	0,00	2.393.513,10	65.972,13	2,83% ▲	1,54%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.068.392,96	516.480,96	0,00	10.741.249,27	156.375,35	1,48% ▲	0,56%
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.616.475,94	0,00	0,00	4.656.979,03	40.503,09	0,88% ▲	0,01%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.456.865,26	0,00	0,00	12.944.445,43	487.580,17	3,91% ▲	2,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	608.265,90	0,00	0,00	615.610,19	7.344,29	1,21% ▲	0,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	738.603,27	0,00	0,00	748.957,24	10.353,97	1,40% ▲	0,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.666.547,94	0,00	0,00	1.690.521,76	23.973,82	1,44% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.149.644,15	0,00	0,00	13.508.181,04	358.536,89	2,73% ▲	1,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.224.171,41	0,00	0,00	1.235.021,19	10.849,78	0,89% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.321,03	0,00	0,00	36.646,84	325,81	0,90% ▲	0,01%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.287.009,96	0,00	0,00	1.322.669,02	35.659,06	2,77% ▲	1,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.008.148,01	0,00	0,00	3.056.593,94	48.445,93	1,61% ▲	0,78%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	775.369,66	0,00	0,00	787.259,85	11.890,19	1,53% ▲	0,50%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.175,63	62.143,57	62.400,00	1.152,02	232,82	0,37% ▲	0,02%
	64.487.573,47	578.624,53	62.400,00	66.394.227,54	1.390.429,54	2,14%	1,02%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.696.401,07	0,00	0,00	1.790.038,64	93.637,57	5,52% ▲	6,19%
BRABESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.900.414,24	0,00	0,00	3.058.765,51	158.351,27	5,46% ▲	6,18%
BRABESCO SELECTION FIAÇÕES	1.903.292,08	0,00	0,00	2.022.342,55	119.050,47	6,25% ▲	6,34%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	930.912,13	0,00	0,00	975.885,55	44.973,42	4,83% ▲	6,78%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.359.155,38	0,00	0,00	3.540.661,39	181.506,01	5,40% ▲	6,16%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.153.181,32	0,00	0,00	2.297.559,45	144.378,13	6,71% ▲	4,52%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.256.191,12	0,00	0,00	1.337.794,68	81.603,56	6,50% ▲	5,41%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.633.884,49	0,00	0,00	1.754.048,25	120.163,76	7,35% ▲	7,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	781.270,78	0,00	0,00	824.291,46	43.020,68	5,51% ▲	6,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	361.902,64	0,00	0,00	381.702,12	19.799,48	5,47% ▲	7,40%
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	216.174,61	0,00	0,00	227.676,43	11.501,82	5,32% ▲	6,14%
-	17.192.779,86	0,00	0,00	18.210.766,03	1.017.986,17	5,92%	6,11%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	531.091,94	0,00	0,00	540.745,39	9.653,45	1,82% ▲	1,31%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.541.834,06	0,00	0,00	4.777.579,44	235.745,38	5,19% ▲	4,22%
-	5.072.926,00	0,00	0,00	5.318.324,83	245.398,83	4,84%	3,92%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.003.077,75	0,00	0,00	1.040.285,64	37.207,89	3,71% ▲	5,13%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.610.532,86	0,00	0,00	1.652.221,17	41.688,31	2,59% ▲	4,08%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.303.193,02	0,00	0,00	1.328.935,25	25.742,23	1,98% ▲	4,16%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	816.530,03	0,00	0,00	849.355,91	32.825,88	4,02% ▲	7,84%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.157.788,17	0,00	0,00	1.205.020,17	47.232,00	4,08% ▲	5,86%
	5.891.121,83	0,00	0,00	6.075.818,14	184.696,31	3,14%	3,99%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	516.216,50	0,00	0,00	531.291,18	15.074,68	2,92% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	532.252,72	0,00	0,00	557.334,31	25.081,59	4,71% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	807.664,24	0,00	22.412,56	810.695,87	25.444,19	3,15% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIXA	2.281.776,76	0,00	0,00	2.393.513,10	111.736,34	4,90% ▲
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	9.865.071,06	516.480,96	0,00	10.741.249,27	359.697,25	3,46% ▲
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	4.159.433,15	378.864,68	0,00	4.656.979,03	118.681,20	2,62% ▲
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIXA	12.173.333,20	0,00	0,00	12.944.445,43	771.112,23	6,33% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	598.126,55	0,00	0,00	615.610,19	17.483,64	2,92% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	728.161,71	0,00	0,00	748.957,24	20.795,53	2,86% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	1.642.571,25	0,00	0,00	1.690.521,76	47.950,51	2,92% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	12.901.109,86	0,00	0,00	13.508.181,04	607.071,18	4,71% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	1.201.085,99	0,00	0,00	1.235.021,19	33.935,20	2,83% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	35.652,39	0,00	0,00	36.646,84	994,45	2,79% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.262.547,68	0,00	0,00	1.322.669,02	60.121,34	4,76% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	2.938.042,77	0,00	0,00	3.056.593,94	118.551,17	4,04% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIXA	757.203,18	0,00	0,00	787.259,85	30.056,67	3,97% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENTA FIXA REFERENCIADO DI	5.796,45	262.728,29	268.768,79	1.152,02	1.396,07	0,52% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.658.599,59	0,00	133.064,70	10.756.106,26	230.571,37	2,16% ▲
	63.064.645,05	1.158.073,93	424.246,05	66.394.227,54	2.595.754,61	4,07%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.569.218,72	0,00	0,00	1.790.038,64	220.819,92	14,07% ▲
BRADERCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.655.547,10	0,00	0,00	3.058.765,51	403.218,41	15,18% ▲
BRADERCO SELECTION FIAÇÕES	1.807.194,27	0,00	0,00	2.022.342,55	215.148,28	11,91% ▲
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	865.033,14	0,00	0,00	975.885,55	110.852,41	12,81% ▲
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.206.096,43	0,00	0,00	3.540.661,39	334.564,96	10,44% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.013.669,64	0,00	0,00	2.297.559,45	283.889,81	14,10% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.195.294,41	0,00	0,00	1.337.794,68	142.500,27	11,92% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.507.968,84	0,00	0,00	1.754.048,25	246.079,41	16,32% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	738.504,52	0,00	0,00	824.291,46	85.786,94	11,62% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	349.741,38	0,00	0,00	381.702,12	31.960,74	9,14% ▲
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	200.500,19	0,00	0,00	227.676,43	27.176,24	13,55% ▲
	16.108.768,64	0,00	0,00	18.210.766,03	2.101.997,39	13,05%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	515.587,13	0,00	0,00	540.745,39	25.158,26	4,88% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.228.313,48	0,00	0,00	4.777.579,44	549.265,96	12,99% ▲
	4.743.900,61	0,00	0,00	5.318.324,83	574.424,22	12,11%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	979.044,52	0,00	0,00	1.040.285,64	61.241,12	6,26% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.534.841,50	0,00	0,00	1.652.221,17	117.379,67	7,65% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.255.033,08	0,00	0,00	1.328.935,25	73.902,17	5,89% ▲
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	756.616,47	0,00	0,00	849.355,91	92.739,44	12,26% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.107.967,87	0,00	0,00	1.205.020,17	97.052,30	8,76% ▲
	5.633.503,44	0,00	0,00	6.075.818,14	442.314,70	7,85%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	462.049,25	0,00	0,00	531.291,18	69.241,93	14,99% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	460.808,28	22.206,98	0,00	557.334,31	74.319,05	15,39% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	754.161,32	0,00	44.619,54	810.695,87	101.154,09	13,41% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.376.361,02	760.000,00	0,00	2.393.513,10	257.152,08	12,04% ▲
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.269.291,64	5.516.480,96	0,00	10.741.249,27	955.476,67	9,76% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.009.807,94	5.158.043,03	5.149.796,98	4.656.979,03	638.925,04	6,97% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.515.259,20	2.673.725,97	0,00	12.944.445,43	1.755.460,26	15,69% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1.690.594,60	0,00	1.823.425,97	0,00	132.831,37	7,86% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	546.495,40	0,00	575.332,48	0,00	28.837,08	5,28% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	541.976,95	0,00	0,00	615.610,19	73.633,24	13,59% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	669.307,90	0,00	0,00	748.957,24	79.649,34	11,90% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.264.333,40	0,00	4.000.000,00	1.690.521,76	426.188,36	8,10% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.258.414,84	4.835.632,95	0,00	13.508.181,04	1.414.133,25	11,69% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.076.200,26	16.685,45	0,00	1.235.021,19	142.135,48	13,01% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.436,61	0,00	0,00	36.646,84	4.210,23	12,98% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.140.440,37	0,00	0,00	1.322.669,02	182.228,65	15,98% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.638.641,44	0,00	0,00	3.056.593,94	417.952,50	15,84% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	643.651,90	54.301,65	0,00	787.259,85	89.306,30	12,80% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	162.911,22	4.440.286,48	4.623.616,09	1.152,02	21.570,41	0,47% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.290.708,26	0,00	518.847,02	10.756.106,26	984.245,02	9,56% ▲
	51.803.851,80	23.477.363,47	16.735.638,08	66.394.227,54	7.848.650,35	13,41%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.488.882,59	0,00	0,00	1.790.038,64	301.156,05	20,23% ▲
BRADERCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.498.293,30	0,00	0,00	3.058.765,51	560.472,21	22,43% ▲
BRADERCO SELECTION FIAÇÕES	1.797.606,85	0,00	0,00	2.022.342,55	224.735,70	12,50% ▲
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	842.598,07	0,00	0,00	975.885,55	133.287,48	15,82% ▲
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.022.473,42	0,00	0,00	3.540.661,39	518.187,97	17,14% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.838.125,33	0,00	0,00	2.297.559,45	459.434,12	24,99% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.118.668,63	0,00	0,00	1.337.794,68	219.126,05	19,59% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.573.872,70	0,00	0,00	1.754.048,25	180.175,55	11,45% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	711.221,69	0,00	0,00	824.291,46	113.069,77	15,90% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	355.361,62	0,00	0,00	381.702,12	26.340,50	7,41% ▲
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	191.817,25	0,00	0,00	227.676,43	35.859,18	18,69% ▲
	15.438.921,45	0,00	0,00	18.210.766,03	2.771.844,58	17,95%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	475.822,55	0,00	0,00	540.745,39	64.922,84	13,64% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.586.286,40	0,00	0,00	4.777.579,44	1.191.293,04	33,22% ▲
	4.062.108,95	0,00	0,00	5.318.324,83	1.256.215,88	30,93%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.009.955,12	0,00	0,00	1.040.285,64	30.330,52	3,00% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.322.605,46	0,00	0,00	1.652.221,17	329.615,71	24,92% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.221.759,96	0,00	0,00	1.328.935,25	107.175,29	8,77% ▲
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	615.397,58	0,00	0,00	849.355,91	233.958,33	38,02% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.076.255,21	0,00	0,00	1.205.020,17	128.764,96	11,96% ▲
	5.245.973,33	0,00	0,00	6.075.818,14	829.844,81	15,82%

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

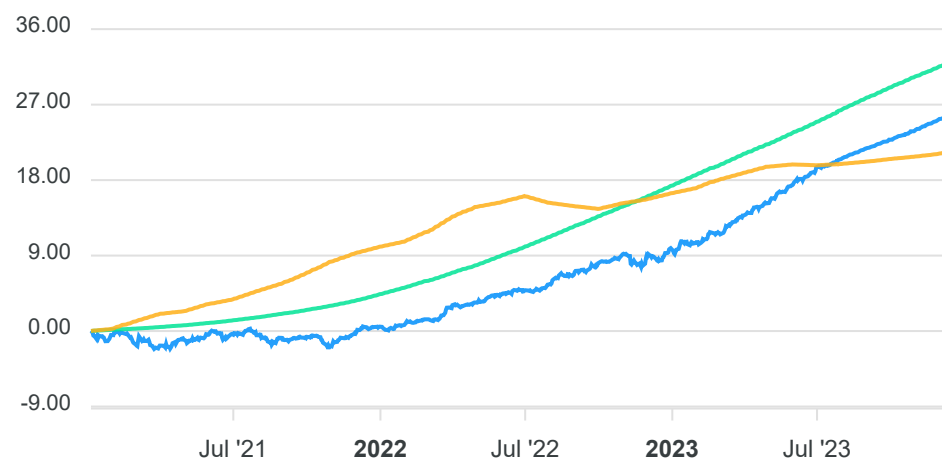
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe de Renda Fixa.

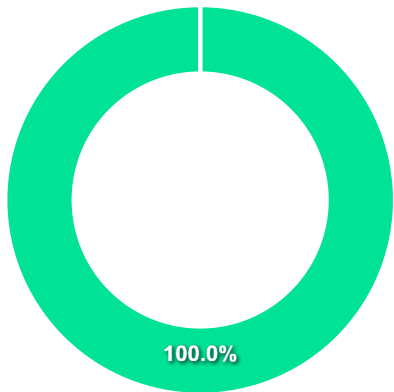
COMPARATIVO

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
649

Patrimônio Líquido Fundo
5.283.374.941,87

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

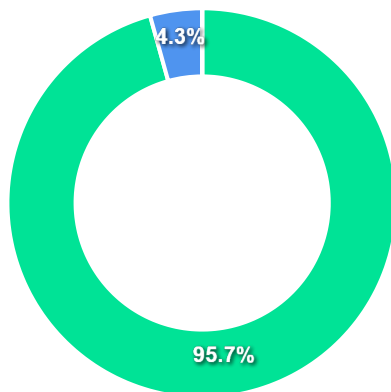
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,74%	15,77%	4,71%	4,04%	15,77%	22,83%	1,46%	3,08%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.055.258,55	95.68%
Operação compromissada	227.372,77	4.30%
Valores a pagar/receber	624,77	0.01%
Derivativos	161,54	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	597.421,70	11,31	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	584.784,98	11,07	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	578.674,60	10,95	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	509.944,88	9,65	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	416.245,49	7,88	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	369.996,93	7,00	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	368.591,91	6,98	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	367.487,64	6,96	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	367.144,94	6,95	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	311.183,31	5,89	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	227.372,77	4,30	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	185.892,66	3,52	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	138.203,26	2,62	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	134.156,51	2,54	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	125.529,74	2,38	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	714,85	0,01	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	85,15	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK27	42,01	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ26	36,81	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa Selic	14,55	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	6,77	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,02	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	-1,20	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	-1,24	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa Cetip	-29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-40,99	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
198

Patrimônio Líquido Fundo
1.034.042.426,70

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IPCA

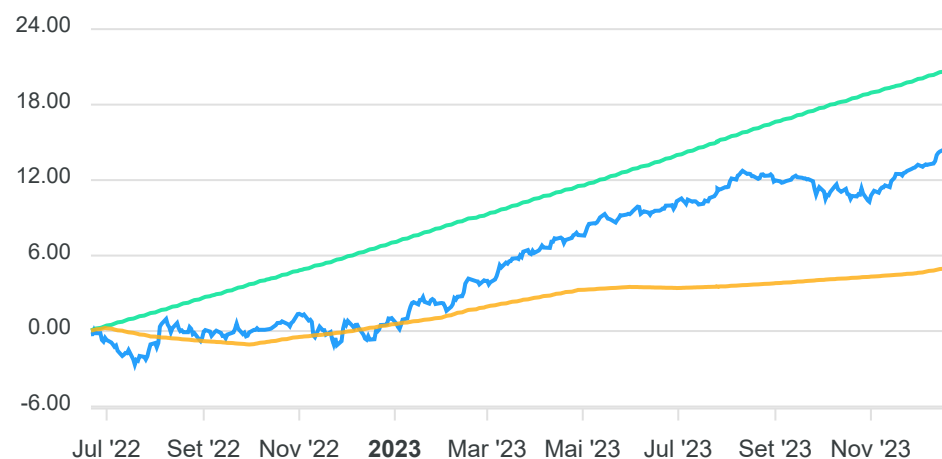
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos e derivativos de renda fixa, sendo que poderá incorrer nos seguintes fatores de risco: taxa de juros pré-fixadas, taxa de juros pós-fixadas, índices de preço e derivativos.

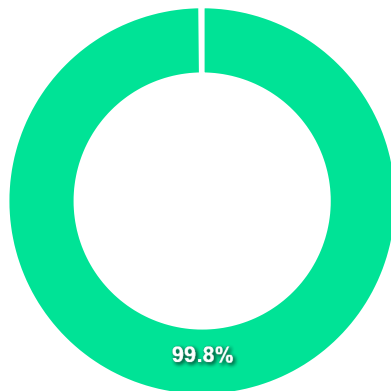
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,69%	13,64%	3,22%	4,06%	13,64%	-%	0,81%	1,71%
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
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	1.032.425,92	99,84	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	1.607,12	0,16	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	32,80	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,10	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	2,84	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-8,12	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-8,20	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.032.425,92	99.84%
Operação compromissada	1.607,12	0.16%
Valores a pagar/receber	25,26	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E
VALORES MOBILIARIOS S.A.

Gestão
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
114

Patrimônio Líquido Fundo
177.070.662,71

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Alta Soberano

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em títulos de emissão
do Tesouro Nacional atrelados ao IPCA.

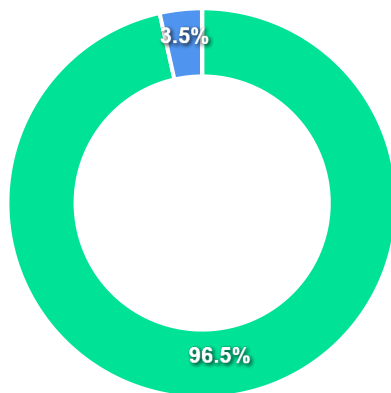
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,83%	15,68%	4,90%	4,40%	15,68%	23,41%	1,54%	3,24%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	170.855,32	96.49%
Operação compromissada	6.182,13	3.49%
Valores a pagar/receber	33,21	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	22.749,30	12,85	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	19.818,83	11,19	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	18.310,20	10,34	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	15.410,27	8,70	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	14.087,93	7,96	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	13.808,06	7,80	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	11.401,80	6,44	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	10.955,59	6,19	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033	10.931,43	6,17	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	10.926,27	6,17	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	9.518,82	5,38	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	7.919,87	4,47	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	6.182,13	3,49	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	3.094,31	1,75	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	1.609,36	0,91	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026	313,29	0,18	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	56,88	0,03	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	6,69	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-30,36	-0,02	Valores a pagar/receber

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

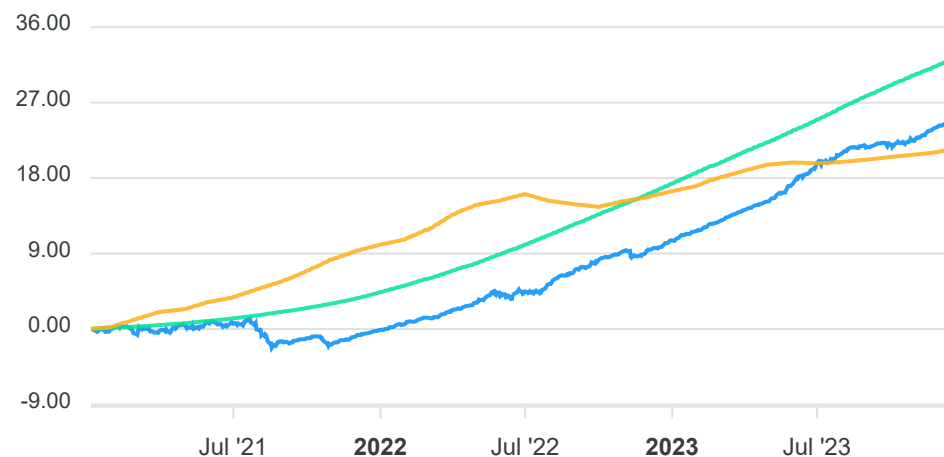
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

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

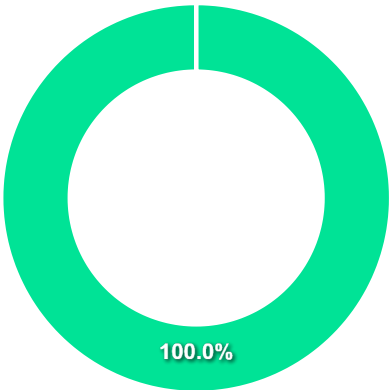
COMPARATIVO

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
850

Patrimônio Líquido Fundo
5.218.373.540,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IDKA IPCA 2 Anos

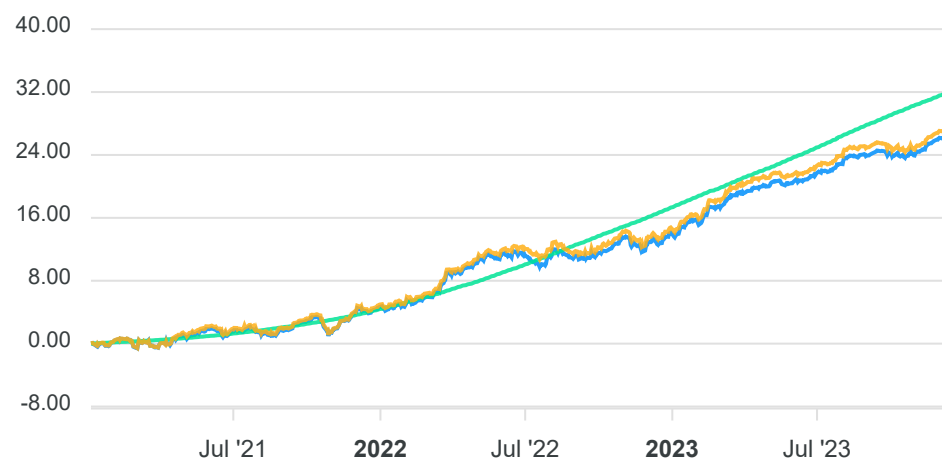
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.

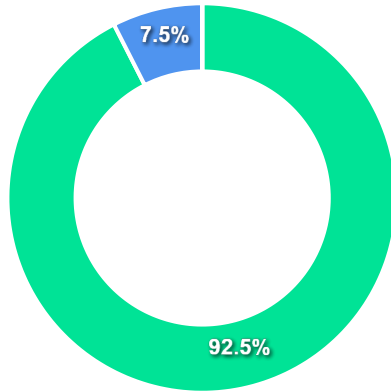
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,40%	11,90%	2,86%	4,97%	11,90%	22,02%	0,43%	0,90%
Benchmark	1,45%	12,13%	2,89%	5,00%	12,13%	22,60%		
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
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	2.998.656,00	57,46	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	1.785.320,92	34,21	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	390.749,63	7,49	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	42.454,28	0,81	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1.426,46	0,03	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	11,12	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	0,00	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-245,41	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.827.857,66	92.52%
Operação compromissada	390.749,63	7.49%
Derivativos	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-233,75	-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
914

Patrimônio Líquido Fundo
7.603.591.100,02

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5

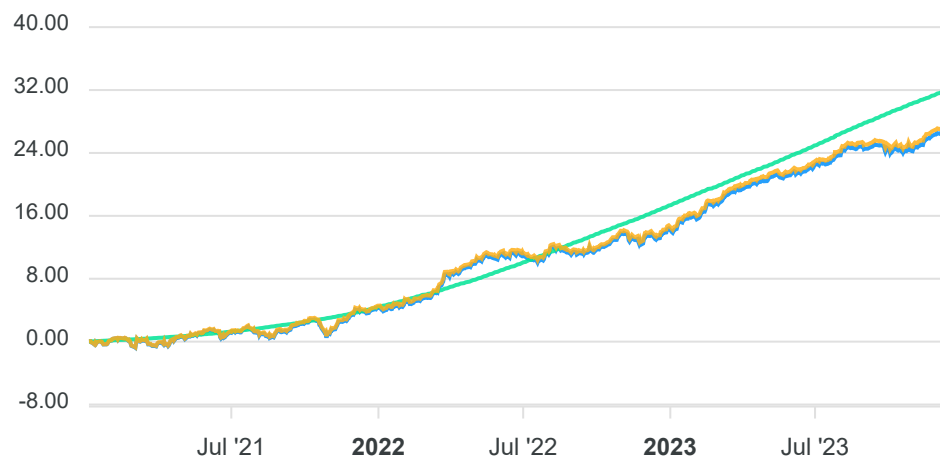
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

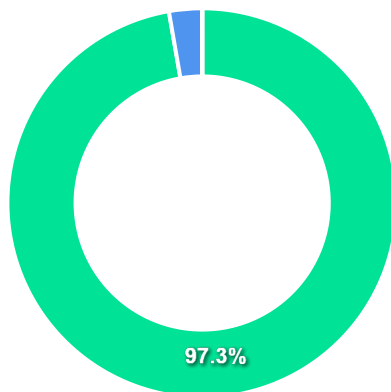
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,44%	11,96%	2,92%	4,64%	11,96%	22,79%	0,48%	1,02%
Benchmark	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%		
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
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	1.942.154,05	25,54	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	1.937.354,09	25,48	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	1.633.467,12	21,48	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	1.092.720,19	14,37	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	777.812,55	10,23	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	208.423,23	2,74	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	10.566,43	0,14	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1.412,19	0,02	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	11,47	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	0,00	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-330,74	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.395.486,60	97.26%
Operação compromissada	208.423,23	2.74%
Derivativos	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-318,73	-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
769

Patrimônio Líquido Fundo
5.157.397.073,53

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B.

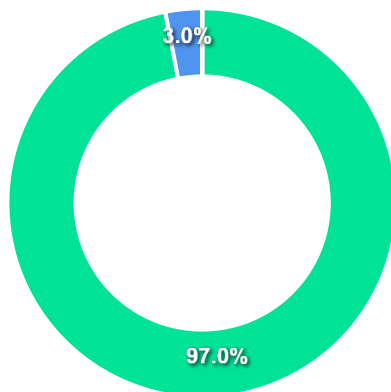
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,73%	15,86%	4,71%	4,15%	15,86%	23,03%	1,44%	3,03%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.001.365,82	96.97%
Operação compromissada	156.254,62	3.03%
Derivativos	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-223,37	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	702.706,11	13,63	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	626.767,09	12,15	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	523.916,76	10,16	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	520.665,35	10,10	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	367.423,86	7,12	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	361.856,30	7,02	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	354.806,41	6,88	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	348.794,33	6,76	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	333.730,52	6,47	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	298.345,46	5,78	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	252.688,08	4,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	180.423,93	3,50	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	156.254,62	3,03	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	118.681,04	2,30	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	9.162,67	0,18	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1.397,93	0,03	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	10,39	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	0,00	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-234,30	0,00	Valores a pagar/receber

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

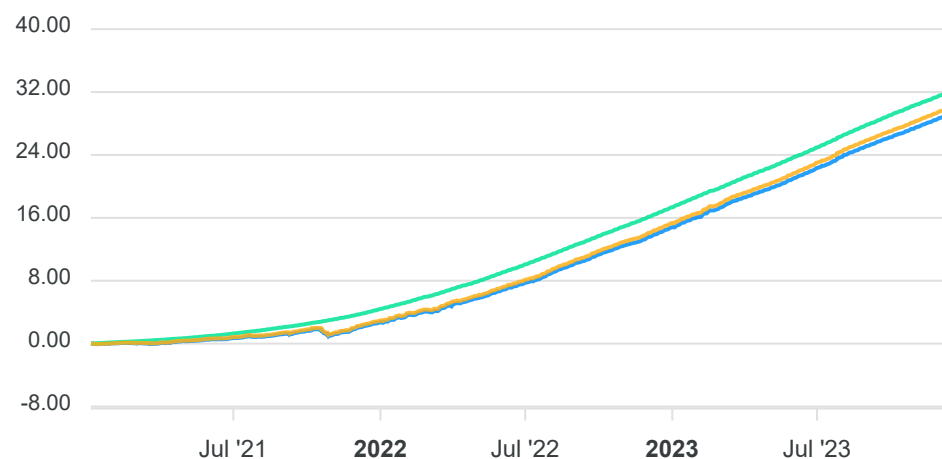
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

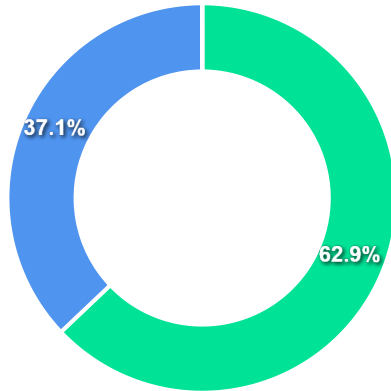
COMPARATIVO

📅 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 compromissada
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 compromissada	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
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
724

Patrimônio Líquido Fundo
11.756.324.476,80

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
CDI

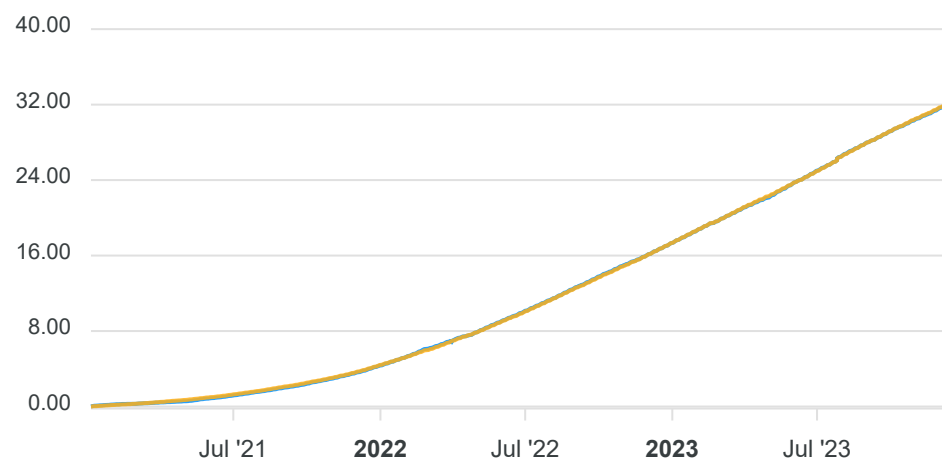
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais, com prazo médio de carteira superior 365 dias.

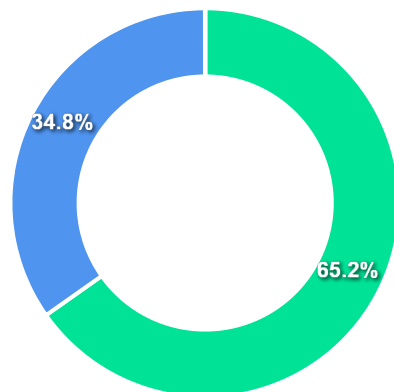
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,90%	12,98%	2,79%	6,04%	12,98%	27,02%	0,01%	0,03%
Benchmark	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.668.035,73	65.22%
Operação comprometida	4.085.939,39	34.76%
Valores a pagar/receber	2.349,36	0.02%
Derivativos	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/10/2025	4.085.939,39	34,76	Operação comprometida
LTN - Venc.: 01/01/2024 (BRSTNCLTN7S1)	2.099.060,64	17,85	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	1.122.781,96	9,55	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	1.022.264,71	8,70	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	696.885,81	5,93	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2029 (BRSTNCNTF1Q6)	551.697,25	4,69	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2029 (BRSTNCLF1RM3)	481.871,01	4,10	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026 (BRSTNCLTN848)	391.293,21	3,33	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	224.932,04	1,91	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2027 (BRSTNCLTN871)	206.171,48	1,75	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2025 (BRSTNCLTN863)	204.010,21	1,74	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	182.491,61	1,55	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	173.759,39	1,48	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	135.876,24	1,16	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	84.238,58	0,72	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	37.672,69	0,32	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	29.281,20	0,25	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2026 (BRSTNCLTN7U7)	13.046,14	0,11	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	10.701,54	0,09	Títulos Federais
Outros Valores a receber	2.822,08	0,02	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	11,50	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ26	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF26	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ25	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas - DAPFUTQ28	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF25	0,00	0,00	Derivativos

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

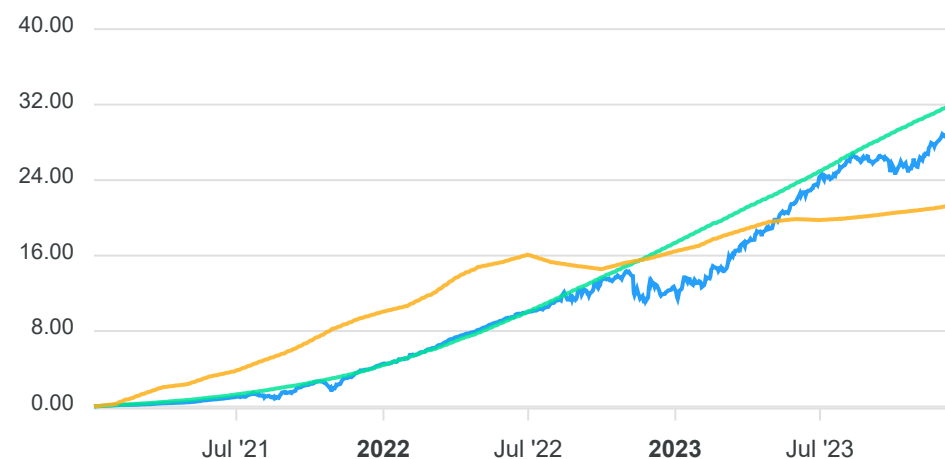
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre

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.

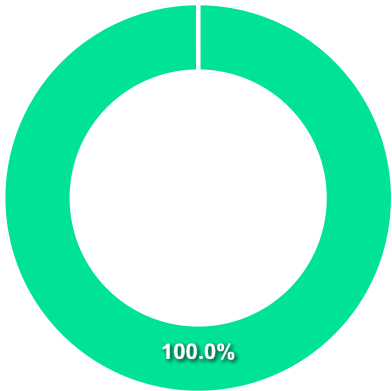
COMPARATIVO

📅 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
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,40%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+1
Quantidade de Cotistas
66
Patrimônio Líquido Fundo
313.213.226,79

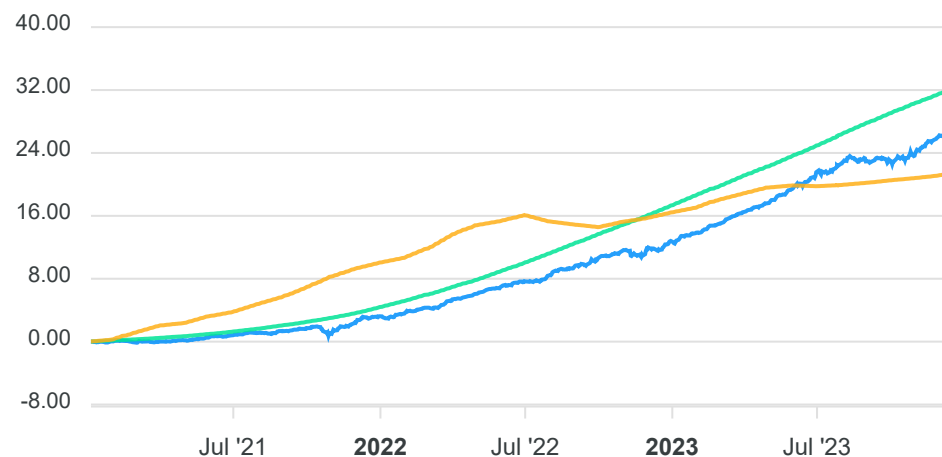
PERFIL DO FUNDO

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 de fundos que invistam em ativos de renda fixa relacionados à variação das taxas de juros pós ou pré-fixados, de índices de preços, ou ambos, sendo vedada a exposição à moeda estrangeira e renda variável.

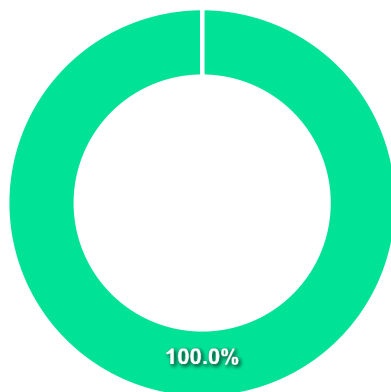
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,53%	13,38%	3,97%	5,23%	13,38%	23,90%	0,50%	1,06%
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 SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	124.140,78	39,63	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	123.577,01	39,45	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	65.550,18	20,93	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	10,89	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-70,64	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	313.267,97	100.02%
Valores a pagar/receber	-54,75	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,40%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+4

Quantidade de Cotistas

149

Patrimônio Líquido Fundo

715.922.351,16

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

IPCA

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

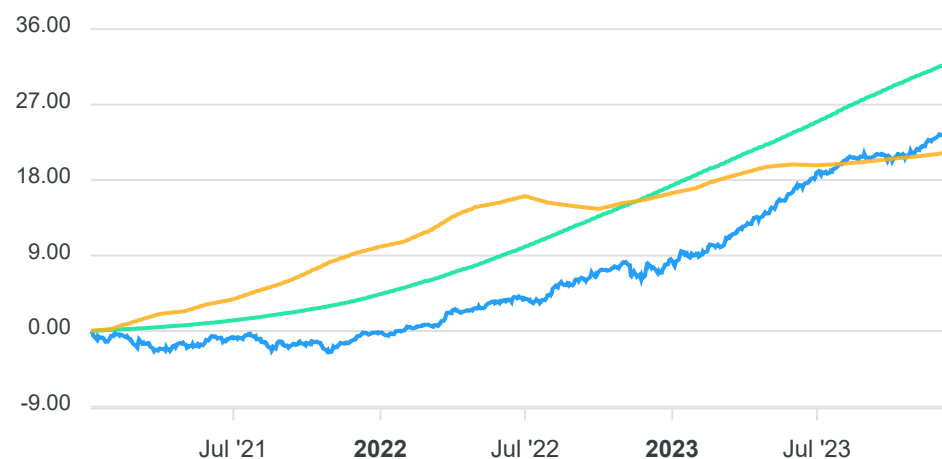
Política de Investimento

Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de renda fixa, os quais atuam nos mercados de juros pré e pós-fixados e índices de preços, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

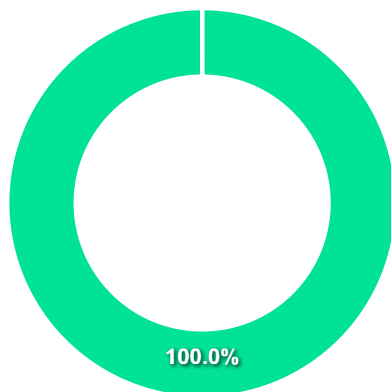
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,55%	15,23%	3,64%	5,28%	15,23%	25,31%	0,56%	1,19%
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 BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	284.703,23	39,77	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	187.702,88	26,22	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	149.995,63	20,95	Fundos de Investimento
Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	37.298,49	5,21	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	37.275,35	5,21	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	14.913,65	2,08	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	3.262,81	0,46	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	519,91	0,07	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	492,30	0,07	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,60	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-252,49	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	716.164,24	100.03%
Valores a pagar/receber	-241,89	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,15%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+0

Quantidade de Cotistas

677

Patrimônio Líquido Fundo

10.724.175.764,47

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

Selic

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Baixa Soberano

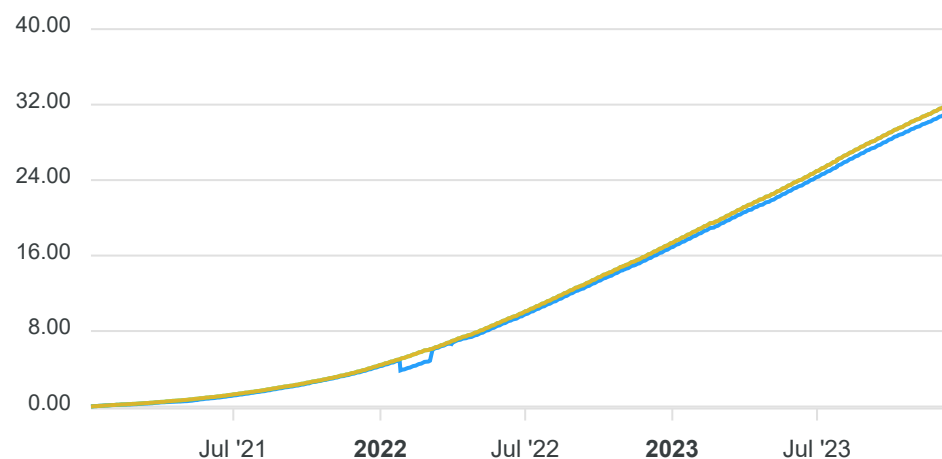
Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em carteira composta de ativos ou modalidades operacionais vinculados a variação do CDI, sendo vedada a exposição em moeda estrangeira e renda variável.

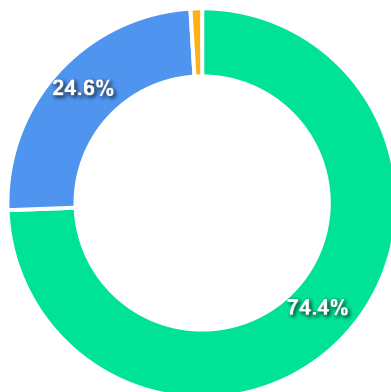
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,88%	12,74%	2,74%	5,98%	12,74%	26,34%	0,01%	0,02%
Benchmark	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.980.165,07	74.41%
Operação compromissada	2.640.706,10	24.62%
Valores a pagar/receber	103.304,60	0.96%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2025	2.463.523,65	22,97	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	1.498.096,18	13,97	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	1.491.457,82	13,91	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	1.482.764,43	13,83	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1.065.490,97	9,94	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	771.719,81	7,20	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	675.810,60	6,30	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	645.859,44	6,02	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	178.717,88	1,67	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	177.182,45	1,65	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	170.247,94	1,59	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	104.999,97	0,98	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,60	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.695,98	-0,02	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,20%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+1

Quantidade de Cotistas

39

Patrimônio Líquido Fundo

162.031.359,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

IMA-B 5+

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

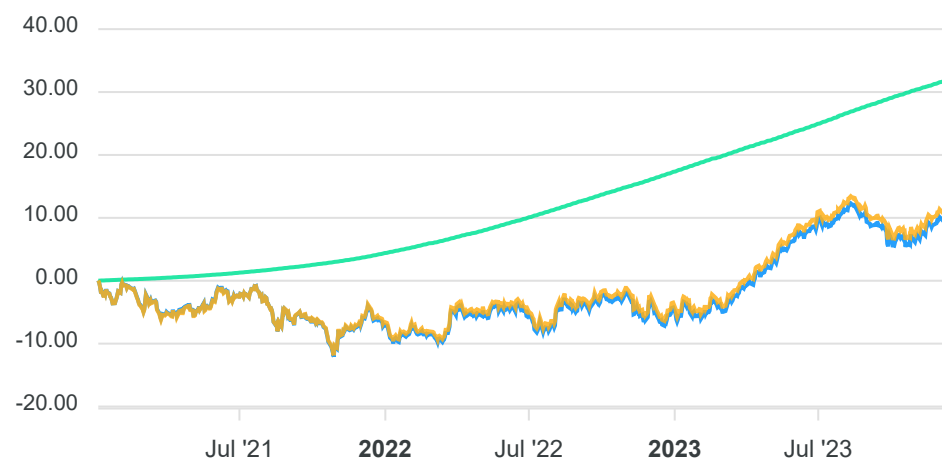
Política de Investimento

Investe seus recursos em cotas de fundo de investimento, nos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

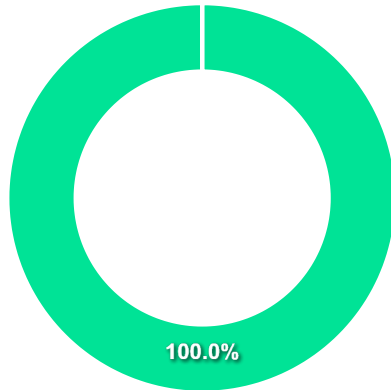
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,91%	18,91%	6,33%	3,63%	18,91%	22,48%	2,40%	5,04%
Benchmark	3,94%	19,28%	6,42%	3,80%	19,28%	23,21%		
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 BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	162.058,78	100,02	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	9,16	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,36	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-36,94	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	162.058,78	100.02%
Valores a pagar/receber	-27,42	-0.02%

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
226

Patrimônio Líquido Fundo
1.298.723.695,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 dias.

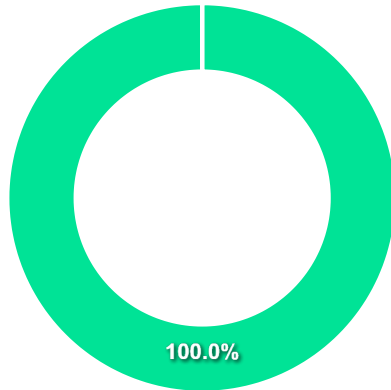
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,77%	15,98%	4,76%	4,21%	15,98%	22,96%	1,48%	3,12%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
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 BRASIL IMA-B FI RENDA FIXA LP	1.298.787,30	100,00	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	-64,15	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.298.787,30	100.00%
Valores a pagar/receber	-63,61	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
458
Patrimônio Líquido Fundo
2.799.591.858,55

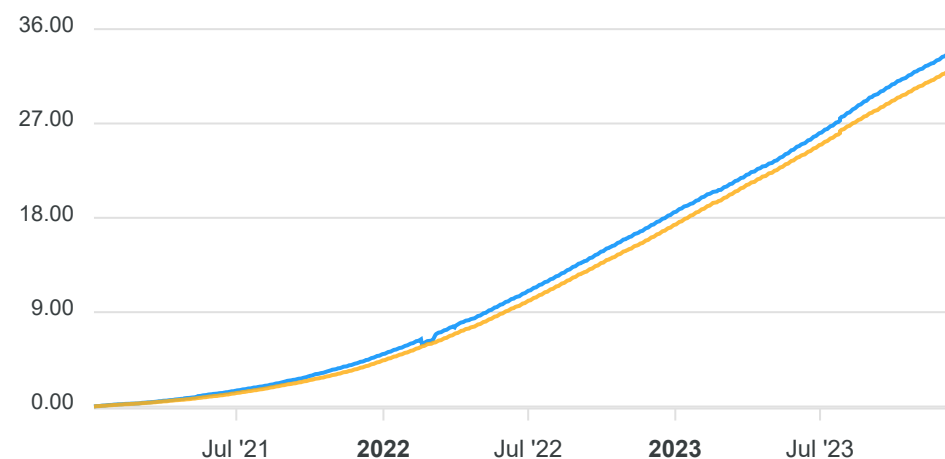
PERFIL DO FUNDO

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 em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa e cotas de fundos de índice de renda fixa.

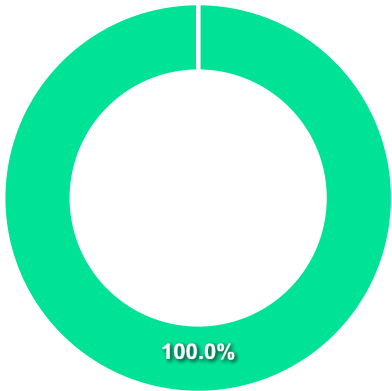
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,94%	13,34%	2,93%	6,55%	13,34%	27,93%	0,02%	0,04%
Benchmark	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 SANTANDER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	2.799.990,28	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	20,14	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-423,56	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.799.990,28	100.01%
Valores a pagar/receber	-398,42	-0.01%

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
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4

Quantidade de Cotistas
 1.159

Patrimônio Líquido Fundo
 783.566.811,58

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

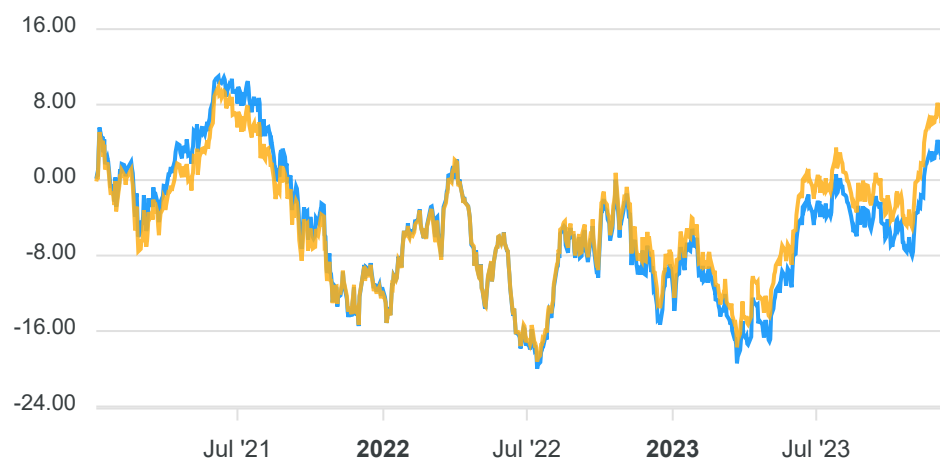
Classificação ANBIMA
 Ações Sustentabilidade/Governança

Política de Investimento
 Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

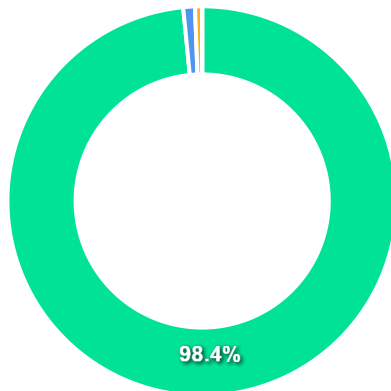
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,52%	20,23%	14,07%	12,88%	20,23%	23,14%	6,19%	13,03%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	771.381,71	98.44%
Valores a pagar/receber	7.599,62	0.97%
Operação compromissada	4.609,67	0.59%
Derivativos	-13,43	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	108.053,75	13,79	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	52.139,16	6,65	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	47.688,91	6,09	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	27.322,52	3,49	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	26.467,83	3,38	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	24.719,62	3,15	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	18.764,49	2,39	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	18.638,79	2,38	Ações
WEG ON NM - WEGE3	18.550,23	2,37	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3	17.208,11	2,20	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	14.799,54	1,89	Ações
BRABESCO PN N1 - BBDC4	14.555,59	1,86	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	13.665,25	1,74	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	12.442,71	1,59	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	12.300,11	1,57	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RENT3	11.614,82	1,48	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	11.460,37	1,46	Ações
B3 ON NM - B3SA3	9.963,83	1,27	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	9.255,44	1,18	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SUZB3	8.375,04	1,07	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	8.192,75	1,05	Ações
VIBRA ON NM - VBRR3	8.020,62	1,02	Ações
BRF SA ON NM - BRFS3	7.647,98	0,98	Ações
BRABESCO ON N1 - BBDC3	7.634,73	0,97	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	7.141,75	0,91	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7.083,33	0,90	Ações
JBS ON NM - JBSS3	6.849,18	0,87	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,50%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+3

Quantidade de Cotistas

45

Patrimônio Líquido Fundo

261.739.999,18

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 8º, Inciso I

Benchmark

Ibovespa

Classificação ANBIMA

Ações Indexados

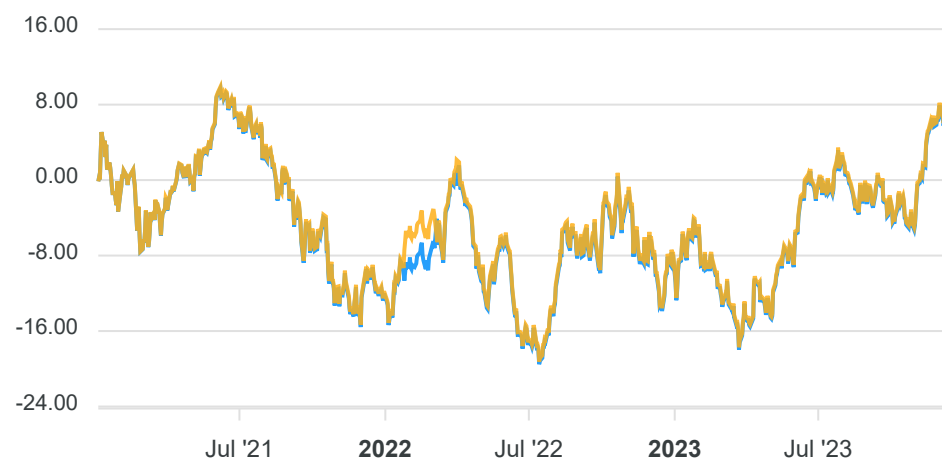
Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações, bônus ou recibos de subscrição, Certificados de Depósito de Ações e BDR Nível II e III.

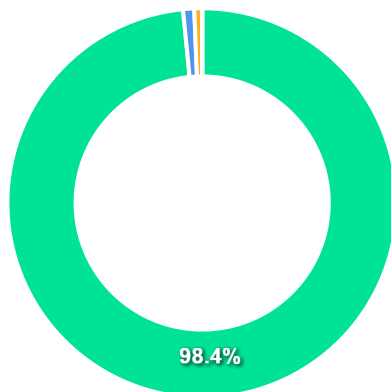
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,46%	22,43%	15,18%	13,69%	22,43%	28,13%	6,18%	13,02%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	257.621,90	98.43%
Valores a pagar/receber	2.413,49	0.92%
Operação compromissada	1.703,22	0.65%
Outros	6,78	0.00%
Derivativos	-5,39	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	36.459,86	13,93	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	10.926,08	4,17	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	10.762,32	4,11	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	8.377,66	3,20	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	7.432,30	2,84	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	6.704,56	2,56	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	6.501,00	2,48	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	6.254,32	2,39	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	5.856,16	2,24	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3	5.533,80	2,11	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBAS3	5.269,08	2,01	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	4.848,23	1,85	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	4.488,15	1,71	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	4.392,03	1,68	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.356,30	1,66	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	4.146,25	1,58	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	4.043,36	1,54	Ações
WEG ON NM - WEGE3	3.989,16	1,52	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	3.736,62	1,43	Ações
B3 ON NM - B3SA3	3.641,50	1,39	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	3.589,49	1,37	Ações
Outros Valores a receber	3.225,91	1,23	Valores a pagar/receber
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	3.111,17	1,19	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ELET3	2.957,37	1,13	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SUZB3	2.625,79	1,00	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	2.547,24	0,97	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - WEGE3	2.165,80	0,83	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
LTDA

Gestão
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
127

Patrimônio Líquido Fundo
454.422.244,72

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

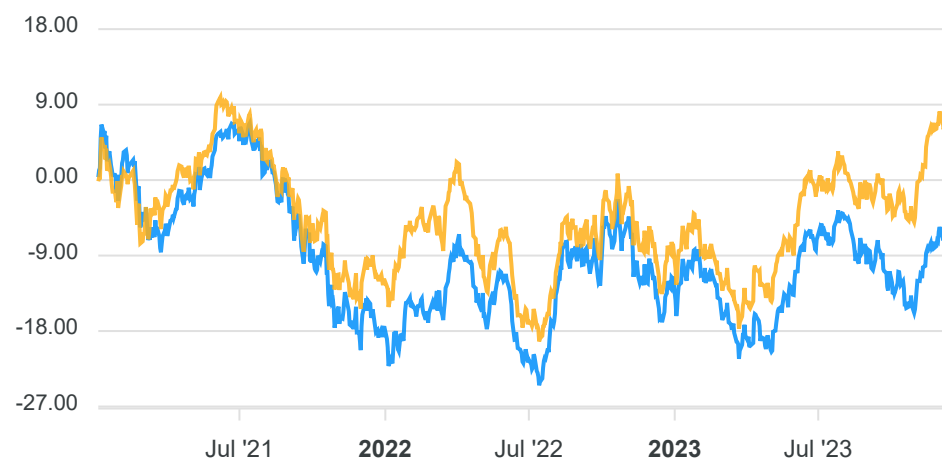
Classificação ANBIMA
Ações Índice Ativo

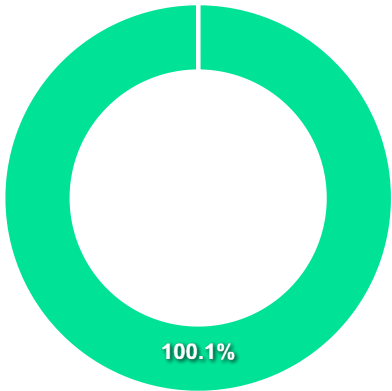
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 67% dos seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações, cotas de Fundos de ações e cotas dos Fundos de índice de ações. O fundo não pode conter mais de 20 empresas emissoras de ações.

COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	6,25%	12,50%	11,91%	6,56%	12,50%	20,56%	6,34%	13,34%
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 BRAM INSTITUCIONAL FI AÇÕES	454.963,17	100,12	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	9,57	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,53	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-551,03	-0,12	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	454.963,17	100.12%
Valores a pagar/receber	-540,93	-0.12%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM

Gestão
 BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
 3,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4 ou D+33

Quantidade de Cotistas
 2.162

Patrimônio Líquido Fundo
 1.435.426.948,17

Patrimônio Líquido Master
 1.435.613.851,41

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

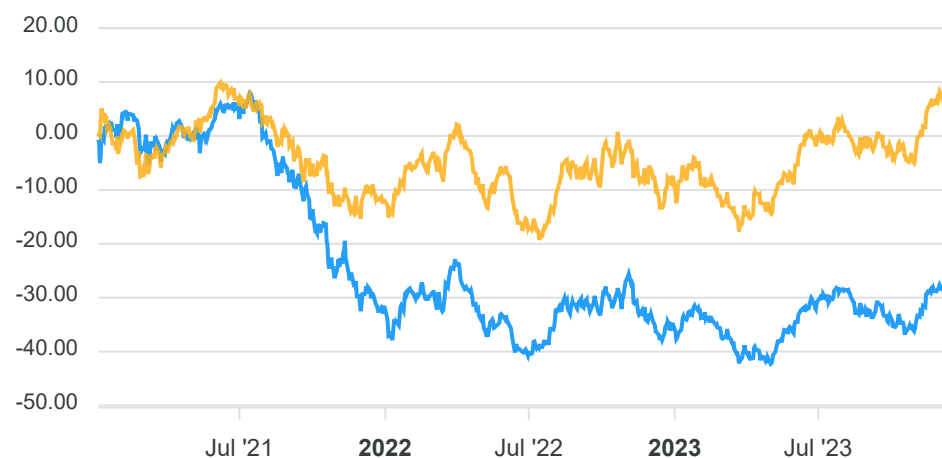
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, preponderantemente, em cotas do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 17.009.959/0001-90.

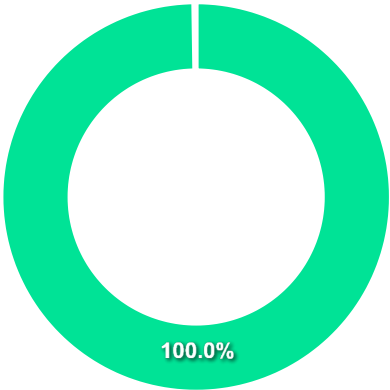
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,83%	15,82%	12,81%	8,59%	15,82%	10,40%	6,78%	14,27%
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 BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FIAÇÃOE...	1.452.015,20	100,00	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2024	3.412,30	0,24	Operação compromissada
Outros Valores a receber	327,32	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-3.759,98	-0,26	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.452.015,20	100.00%
Operação compromissada	3.412,30	0.24%
Valores a pagar/receber	-3.432,66	-0.24%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 1,50%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+25

Quantidade de Cotistas
 938

Patrimônio Líquido Fundo
 662.205.543,66

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

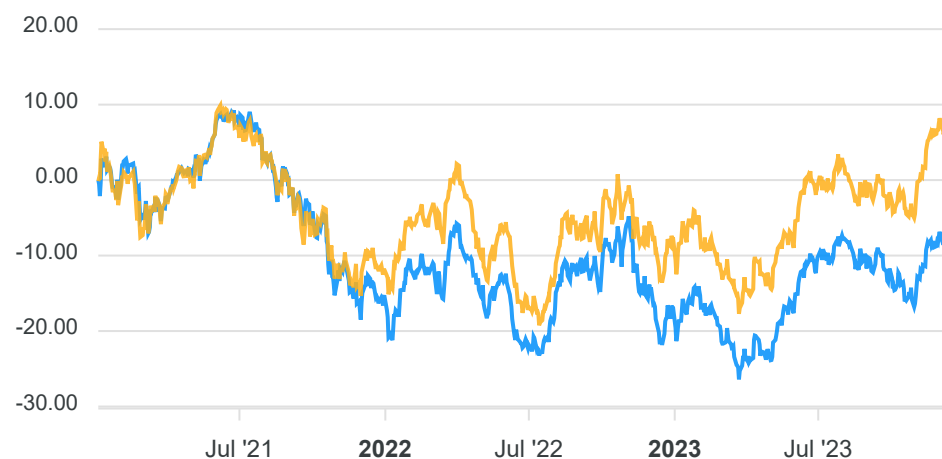
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de
 ações geridos por gestores distintos.

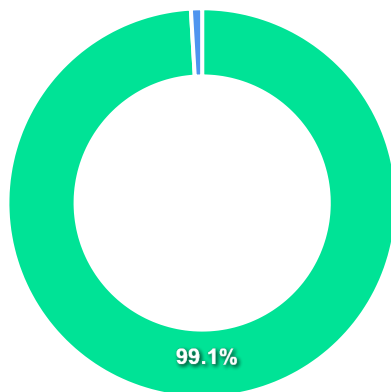
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,40%	17,14%	10,44%	8,41%	17,14%	15,05%	6,16%	12,98%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	662.986,08	99.07%
Valores a pagar/receber	6.219,47	0.93%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de NAVI INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	64.970,05	9,81	Fundos de Investimento
Cotas de OCEANA SELECTION 30 E FIC AÇÕES	60.194,24	9,09	Fundos de Investimento
Cotas de CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	60.189,98	9,09	Fundos de Investimento
Cotas de VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	59.460,23	8,98	Fundos de Investimento
Cotas de CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	59.444,92	8,98	Fundos de Investimento
Cotas de SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI AÇÕES	57.074,70	8,62	Fundos de Investimento
Cotas de TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	56.103,47	8,47	Fundos de Investimento
Cotas de APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	40.810,89	6,16	Fundos de Investimento
Cotas de OCCAM FIC AÇÕES	32.311,64	4,88	Fundos de Investimento
Cotas de TRUXT C VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	30.681,18	4,63	Fundos de Investimento
Cotas de MILES CAIXA VIRTUS FIC AÇÕES	27.183,98	4,11	Fundos de Investimento
Cotas de BRASIL CAPITAL 30 FIC AÇÕES	27.143,29	4,10	Fundos de Investimento
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	24.072,11	3,64	Fundos de Investimento
Cotas de LEBLON AÇÕES II INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	21.521,80	3,25	Fundos de Investimento
Cotas de EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	19.359,86	2,92	Fundos de Investimento
Cotas de MOAT CAIXA AÇÕES FIC AÇÕES	14.691,48	2,22	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	7.772,27	1,17	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	7.265,34	1,10	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.045,87	-0,16	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
2.217

Patrimônio Líquido Fundo
260.031.743,25

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
IDIV

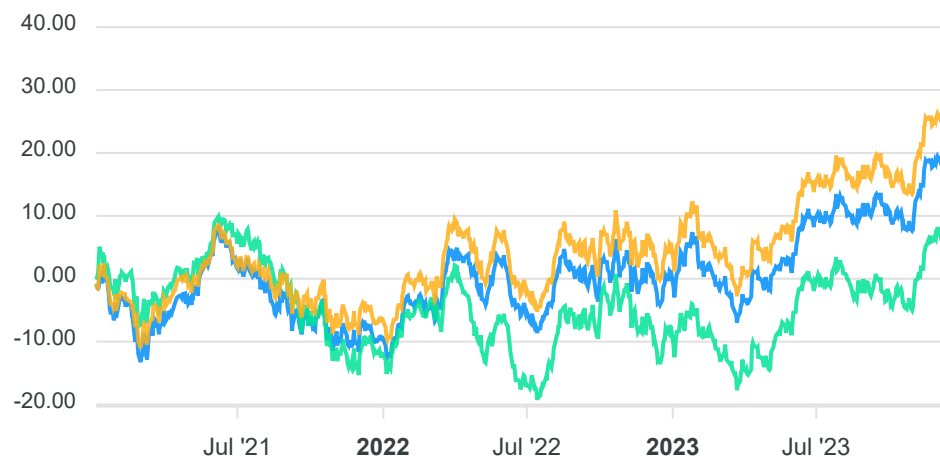
Classificação ANBIMA
Ações Dividendos

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ações de empresas que possuam a política e/ou potencial de distribuição de dividendos e/ou juros sobre o capital.

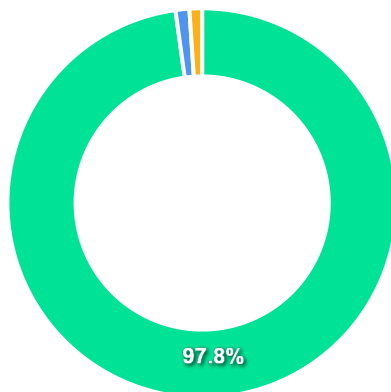
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	6,71%	24,99%	14,10%	15,25%	24,99%	39,28%	4,52%	9,52%
Benchmark	6,90%	26,84%	14,61%	16,04%	26,84%	42,88%		
IBOVESPA	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	254.381,86	97.81%
Valores a pagar/receber	2.980,07	1.15%
Fundos de Investimento	2.727,86	1.05%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
GERDAU PN N1 - GGBR4	14.671,21	5,64	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	13.618,22	5,24	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	13.264,89	5,10	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	12.824,78	4,93	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	12.056,51	4,64	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	11.460,19	4,41	Ações
VALE ON N1 - VALE3	11.348,40	4,36	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	9.595,94	3,69	Ações
SID NACIONAL ON - CSNA3	9.263,79	3,56	Ações
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	8.808,71	3,39	Ações
JBS ON NM - JBSS3	8.691,10	3,34	Ações
SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	8.288,18	3,19	Ações
TELEF BRASIL ON - VIVT3	8.283,20	3,19	Ações
KLABIN S.A. UNT N2 - KLBN11	8.141,41	3,13	Ações
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	8.079,85	3,11	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	7.132,26	2,74	Ações
CSNMINERACAOON N2 - CMIN3	6.747,11	2,59	Ações
TAESA UNT N2 - TAEE11	6.520,76	2,51	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	5.730,29	2,20	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	5.667,83	2,18	Ações
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	5.256,75	2,02	Ações
BRADESPAR PN N1 - BRAP4	5.072,11	1,95	Ações
CEMIG ON N1 - CMIG3	4.297,21	1,65	Ações
PORTO SEGURO ON NM - PSSA3	4.135,69	1,59	Ações
Outros Valores a receber	3.972,69	1,53	Valores a pagar/receber
USIMINAS PNA N1 - USIM5	3.786,60	1,46	Ações
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	3.592,14	1,38	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
 LTDA

Gestão
 CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+15

Quantidade de Cotistas
 2.445

Patrimônio Líquido Fundo
 1.430.648.502,14

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

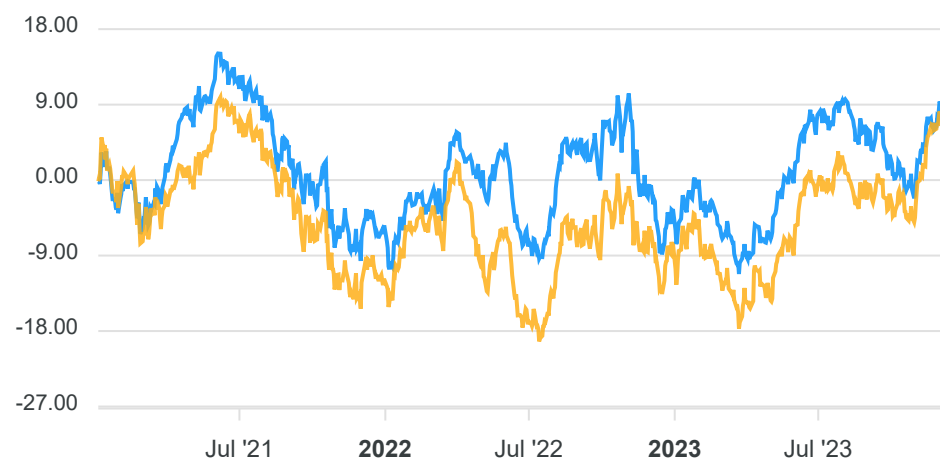
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de renda
 variável, podendo aproveitar oportunidades disponíveis nos
 mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de
 investimento.

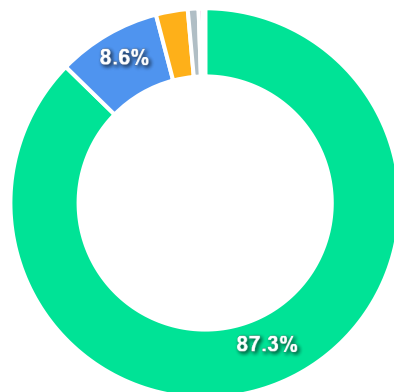
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	6,50%	19,59%	11,92%	6,93%	19,59%	22,06%	5,41%	11,40%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	1.118.666,55	87.31%
Operação compromissada	110.422,23	8.62%
Brazilian Depositary Receipts	33.785,73	2.64%
Valores a pagar/receber	11.432,70	0.89%
Derivativos	4.145,11	0.32%
Outros	1.392,66	0.11%
Títulos Federais	1.387,56	0.11%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	110.422,23	8,62	Operação compromissada
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	44.993,74	3,51	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	30.392,46	2,37	Ações
GPS ON NM - GGPS3	29.060,02	2,27	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBAS3	28.102,96	2,19	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	26.575,43	2,07	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	23.263,93	1,82	Ações
RANDON PART PN N1 - RAPT4	23.242,44	1,81	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - KLBN11	22.171,92	1,73	Ações
PORTO SEGURO ON NM - PSSA3	19.493,06	1,52	Ações
CELUL IRANI ON - RANI3	19.407,21	1,51	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	19.077,53	1,49	Ações
ALIANSCSONAEON NM - ALSO3	18.909,64	1,48	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	18.858,46	1,47	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	18.830,00	1,47	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	18.660,77	1,46	Ações
NEOENERGIA ON ATZ NM - NEOE3	18.518,62	1,45	Ações
SANEPAR UNT N2 - SAPR11	18.238,26	1,42	Ações
BANRISUL PNB N1 - BRSR6	18.194,54	1,42	Ações
VULCABRAS ON - VULC3	17.597,29	1,37	Ações
VALE ON N1 - VALE3	16.836,48	1,31	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CYRE3	16.304,38	1,27	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	16.273,63	1,27	Ações
AUREN ON NM - AURE3	16.081,24	1,26	Ações
CURY S.A. ON NM - CURY3	15.845,37	1,24	Ações
KEPLER WEBER ON - KEPL3	15.706,48	1,23	Ações
MERCADOLIBRE INC - MELI34	15.269,06	1,19	Brazilian Depositary Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 1,90%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+24

Quantidade de Cotistas
 13.834

Patrimônio Líquido Fundo
 1.403.792.198,31

Patrimônio Líquido Master
 1.686.539.310,38

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

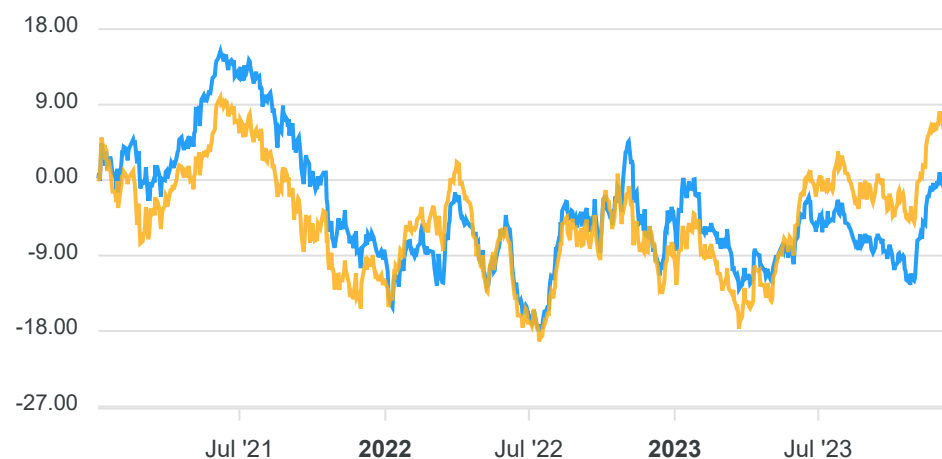
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ
 DUNAMIS MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 18.138.837/0001-67.

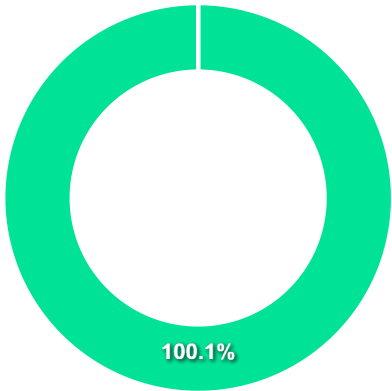
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	7,35%	11,45%	16,32%	13,22%	11,45%	17,20%	7,50%	15,79%
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 ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES	1.401.936,37	99,87	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	9.516,13	0,68	Valores a pagar/receber
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	3.372,62	0,24	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-11.102,93	-0,79	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.405.308,99	100.11%
Valores a pagar/receber	-1.516,80	-0.11%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAÚ DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,80%

Taxa de Performance
 10,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+24

Quantidade de Cotistas
 16

Patrimônio Líquido Fundo
 166.220.845,31

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

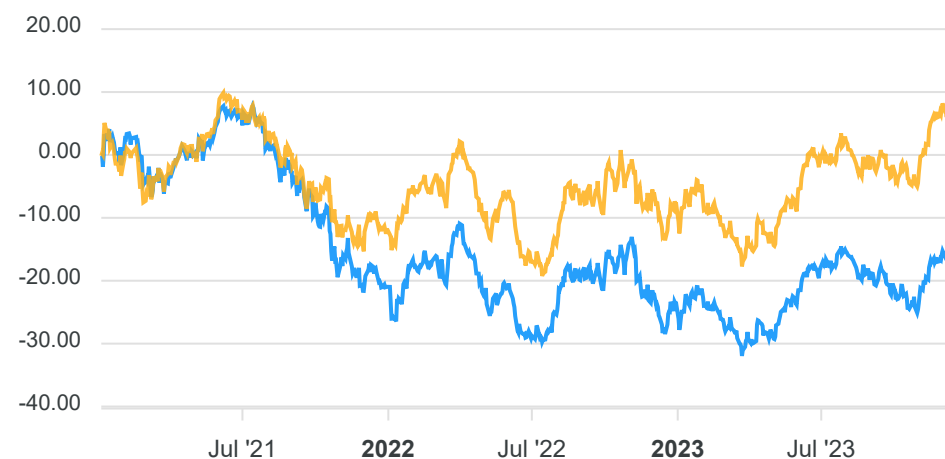
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos classificados como Ações, os quais investem em ativos financeiros que tenham como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado.

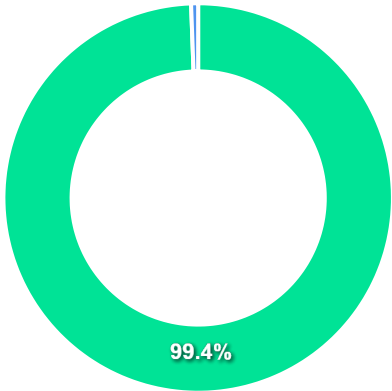
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,51%	15,90%	11,62%	7,87%	15,90%	12,02%	6,04%	12,72%
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 ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS MULTIGESTOR X FI...	164.541,06	98,99	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	1.078,18	0,65	Valores a pagar/receber
Cotas de ITAÚ CAIXA FIAÇÕES	711,34	0,43	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	0,33	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-110,06	-0,07	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	165.252,40	99.42%
Valores a pagar/receber	968,45	0.58%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 2,50%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+24

Quantidade de Cotistas
 65

Patrimônio Líquido Fundo
 196.568.217,40

Patrimônio Líquido Master
 269.787.546,50

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

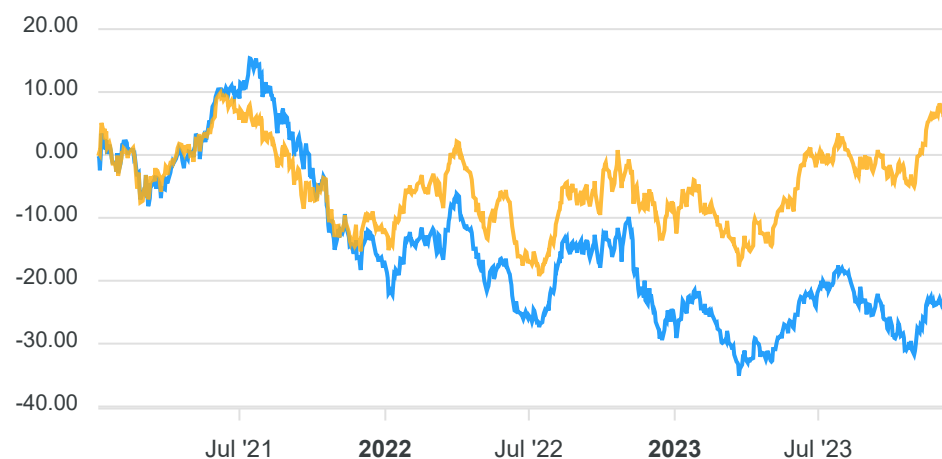
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ
 PHOENIX FI AÇÕES, CNPJ: 09.094.073/0001-64.

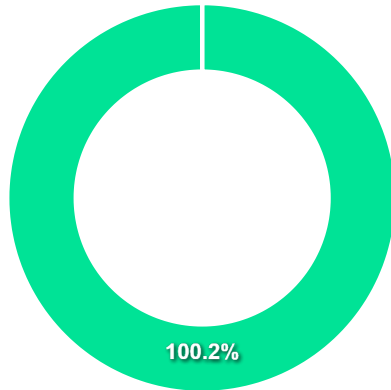
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,47%	7,41%	9,14%	3,37%	7,41%	-2,64%	7,40%	15,58%
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 ITAÚ PHOENIX FI AÇÕES	196.518,73	99,97	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	394,64	0,20	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	50,00	0,03	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,39	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-395,54	-0,20	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	196.913,37	100.18%
Valores a pagar/receber	-345,15	-0.18%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
LTDA

Gestão
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS
S.A.

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
3.068

Patrimônio Líquido Fundo
80.440.788,20

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

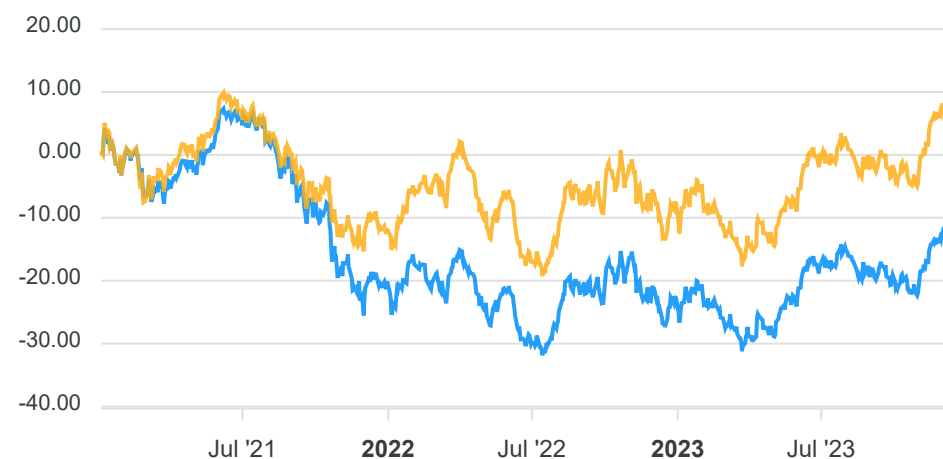
Classificação ANBIMA
Ações Valor/Crescimento

Política de Investimento
Aplica seus recursos no mercado de renda variável, utilizando-se de análise fundamentalista, observando entre outros aspectos, a potencialidade do valor intrínseco das ações selecionadas.

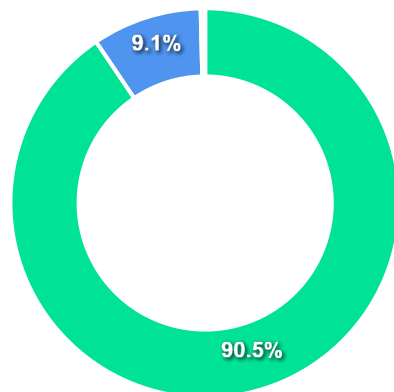
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,32%	18,69%	13,55%	11,09%	18,69%	15,05%	6,14%	12,93%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	67.435,31	90.54%
Operação compromissada	6.770,55	9.09%
Valores a pagar/receber	251,35	0.34%
Derivativos	25,01	0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	8.488,05	11,40	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	6.770,55	9,09	Operação compromissada
PETROBRAS PN - PETR4	5.137,11	6,90	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	4.457,00	5,98	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	2.750,59	3,69	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	2.700,35	3,63	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	2.648,51	3,56	Ações
B3 ON NM - B3SA3	2.560,01	3,44	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	2.212,91	2,97	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	2.182,18	2,93	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	1.817,60	2,44	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	1.735,79	2,33	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	1.698,24	2,28	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	1.618,18	2,17	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	1.322,80	1,78	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	1.270,15	1,71	Ações
ASSAI ON NM - ASAI3	1.242,75	1,67	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	1.209,46	1,62	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	994,79	1,34	Ações
Outros Valores a receber	954,08	1,28	Valores a pagar/receber
GERDAU PN N1 - GGBR4	953,16	1,28	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	913,84	1,23	Ações
WEG ON NM - WEGE3	899,50	1,21	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	891,59	1,20	Ações
TOTVS ON NM - TOTS3	853,20	1,15	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	791,87	1,06	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	773,36	1,04	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA

Taxa de Administração

0,70%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+5

Quantidade de Cotistas

35

Patrimônio Líquido Fundo

16.767.022,34

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 9º, Inciso II

Benchmark

MSCI WORLD

Classificação ANBIMA

Ações Investimento no Exterior

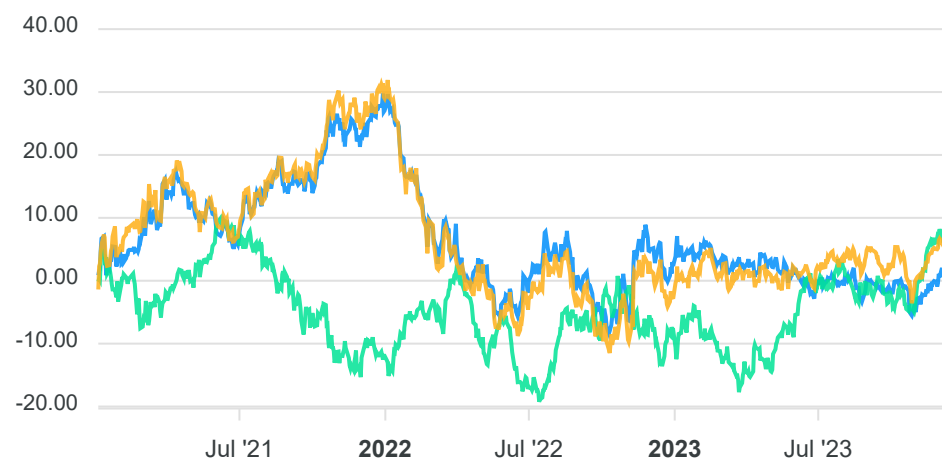
Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 90% de seus recursos em cotas do BNP PARIBAS GLOBAL LOW VOL EQUITY I CAP (LU0823418115), domiciliado em Luxemburgo.

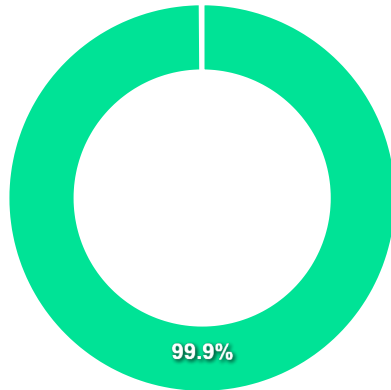
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,71%	3,00%	6,26%	5,88%	3,00%	-17,01%	5,13%	10,81%
Benchmark	2,81%	12,98%	7,38%	7,31%	12,98%	-14,93%		
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 PARVEST EQUITY WORLD LOW VOLATILITY I USD CAP	16.607,50	99,05	Fundos de Investimento
Cotas de BNP PARIBAS MASTER CASH FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	139,35	0,83	Fundos de Investimento
LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	14,19	0,08	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	12,61	0,08	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	3,36	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-9,99	-0,06	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	16.746,85	99.88%
Títulos Federais	14,19	0.08%
Valores a pagar/receber	5,98	0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA

Taxa de Administração
0,80%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+5

Quantidade de Cotistas
7.645

Patrimônio Líquido Fundo
687.792.180,37

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso II

Benchmark
MSCI WORLD

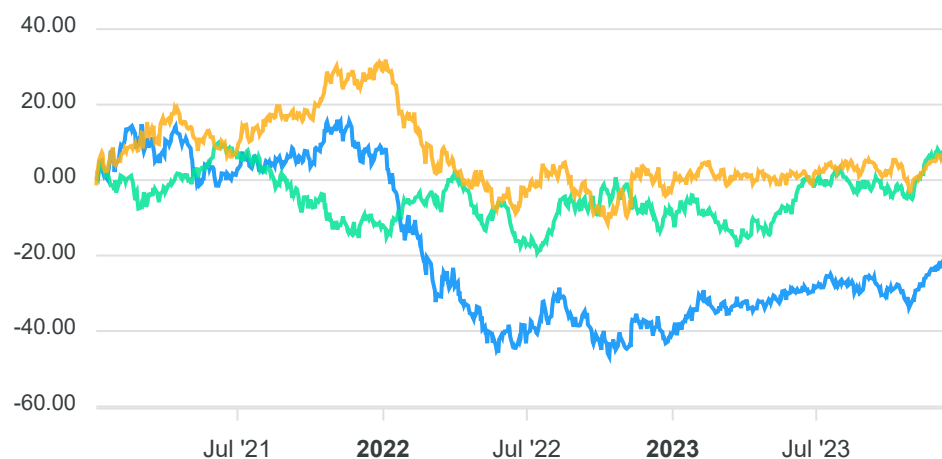
Classificação ANBIMA
Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do MS
GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY MASTER
INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ:
33.362.028/0001-28.

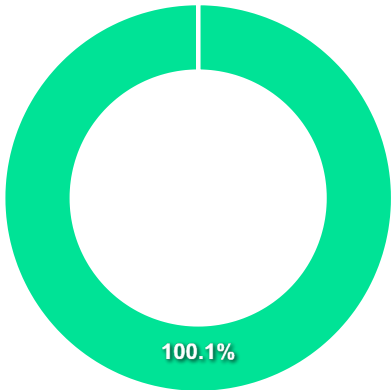
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,02%	38,02%	12,26%	13,39%	38,02%	-24,45%	7,84%	16,51%
Benchmark	2,81%	12,98%	7,38%	7,31%	12,98%	-14,93%		
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 MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY MASTER INV...	633.277,63	99,84	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	1.952,98	0,31	Valores a pagar/receber
Cotas de XP CASH B1 FIC RENDA FIXA SIMPLES	1.389,49	0,22	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	3,13	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-2.326,09	-0,37	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	634.667,12	100.06%
Valores a pagar/receber	-369,98	-0.06%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
LTDA

Gestão
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA.

Taxa de Administração
0,85%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4 du

Quantidade de Cotistas
183

Patrimônio Líquido Fundo
313.084.759,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso II

Benchmark
MSCI ACWI

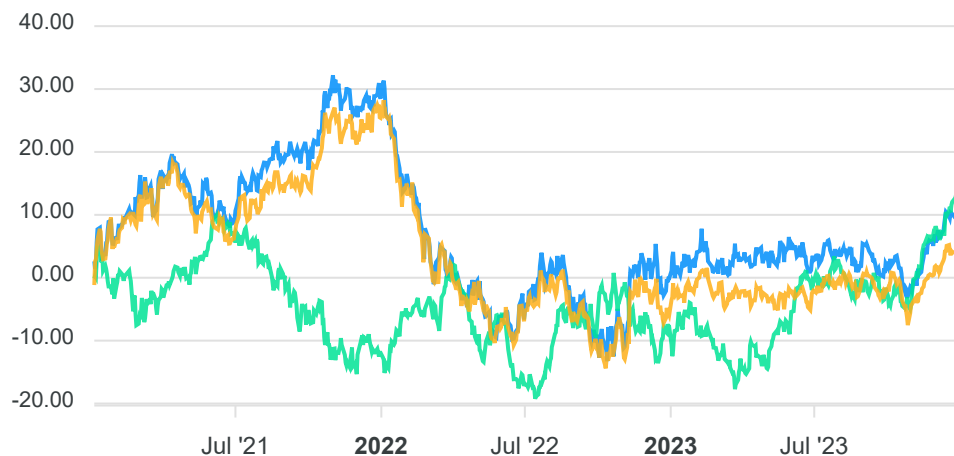
Classificação ANBIMA
Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS
INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ:
37.308.317/0001-08.

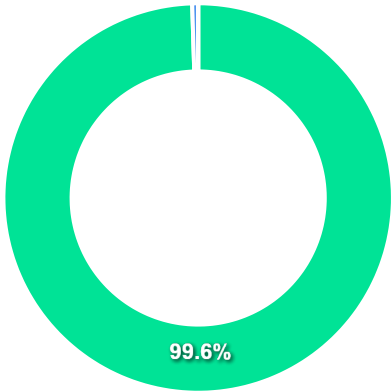
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,08%	11,96%	8,76%	8,85%	11,96%	-12,95%	5,86%	12,35%
Benchmark	2,70%	11,43%	7,01%	6,95%	11,43%	-16,44%		
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 SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD IS IN...	311.760,14	99,58	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	1.548,81	0,49	Operação compromissada
Outros Valores a receber	0,39	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-224,68	-0,07	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	311.760,14	99.58%
Operação compromissada	1.548,81	0.49%
Valores a pagar/receber	-224,19	-0.07%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,70%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
468

Patrimônio Líquido Fundo
1.995.875.754,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
Global BDRX

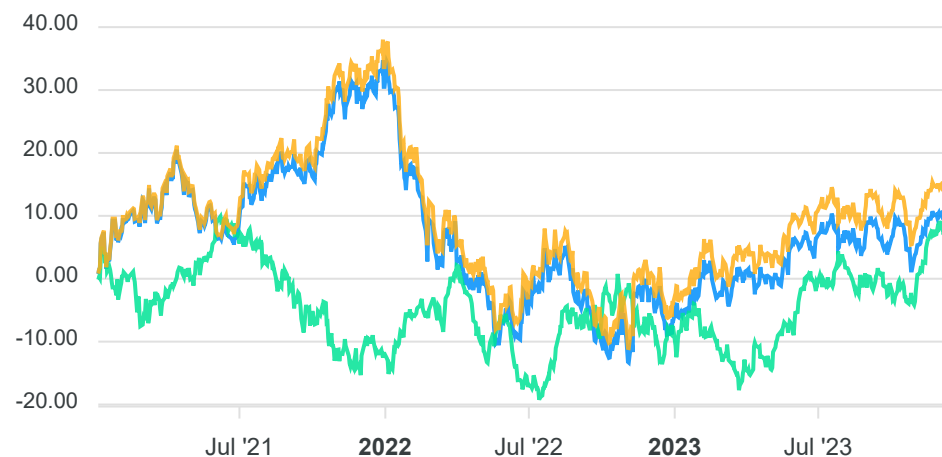
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.

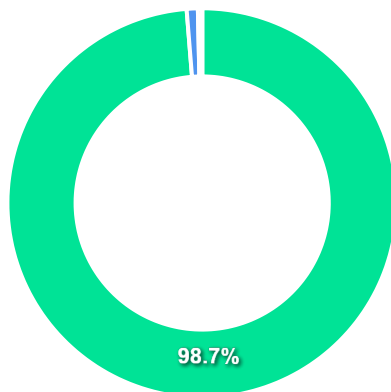
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,59%	24,92%	7,65%	9,07%	24,92%	-10,73%	4,08%	8,59%
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 Depositary Receipts	1.967.717,23	98.72%
Fundos de Investimento	18.412,74	0.92%
Valores a pagar/receber	7.031,18	0.35%
Outros	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
APPLE INC - AAPL34	213.986,67	10,72	Brazilian Depositary Rece...
MICROSOFT CORPORATIO - MSFT34	199.529,61	10,00	Brazilian Depositary Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	113.288,55	5,68	Brazilian Depositary Rece...
NVIDIA COR - NVDC34	86.557,78	4,34	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	59.804,86	3,00	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL35	58.299,78	2,92	Brazilian Depositary Rece...
TESLA, INC - TSLA34	56.422,92	2,83	Brazilian Depositary Rece...
META PLATFORMS, INC - M1TA34	56.042,76	2,81	Brazilian Depositary Rece...
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD - TSMC34	38.786,90	1,94	Brazilian Depositary Rece...
ELI LILLY AND COMPAN - LILY34	38.565,64	1,93	Brazilian Depositary Rece...
BROADCOM INC - AVGO34	38.505,56	1,93	Brazilian Depositary Rece...
JPMORGAN CHASE & CO - JPMC34	34.791,85	1,74	Brazilian Depositary Rece...
UNITEDHEALTH GROUP INC - UNHH34	34.248,26	1,72	Brazilian Depositary Rece...
WALMART INC - WALM34	29.858,42	1,50	Brazilian Depositary Rece...
EXXON MOBIL CORPORATIO - EXXO34	29.045,29	1,46	Brazilian Depositary Rece...
MASTERCARD INCORPORATE - MSCD34	28.168,84	1,41	Brazilian Depositary Rece...
NOVO NORDISK S.A. - N1VO34	24.946,77	1,25	Brazilian Depositary Rece...
THE HOME DEPOT, INC - HOME34	24.858,77	1,25	Brazilian Depositary Rece...
PROCTER & GAMBLE COMPANY - PGCO34	24.493,44	1,23	Brazilian Depositary Rece...
ASML HOLDING N - ASML34	22.006,83	1,10	Brazilian Depositary Rece...
TOYOTA MOTOR CORP - TMCO34	20.905,85	1,05	Brazilian Depositary Rece...
COSTCO WHOLESALE CORPORATION - COWC34	20.850,56	1,04	Brazilian Depositary Rece...
ORACLE CORPORATION - ORCL34	20.845,50	1,04	Brazilian Depositary Rece...
CHEVRON CORPORATIO - CHVX34	20.299,22	1,02	Brazilian Depositary Rece...
MERCK & CO, INC - MRCK34	19.507,78	0,98	Brazilian Depositary Rece...
ABBVIE INC - ABBV34	19.406,41	0,97	Brazilian Depositary Rece...
ADOBE IN - ADBE34	19.376,06	0,97	Brazilian Depositary Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 1,90%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+3

Quantidade de Cotistas
 1.743

Patrimônio Líquido Fundo
 95.692.462,17

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
 Global BDRX

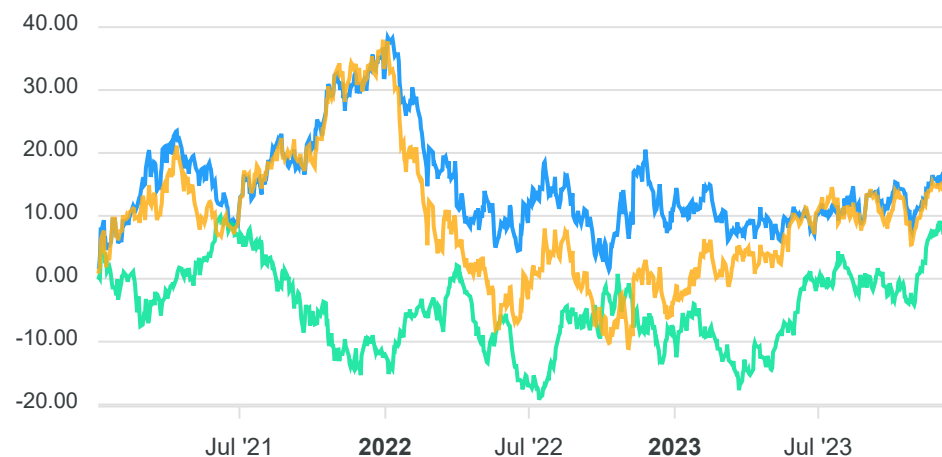
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento em ações, os quais investem em certificados de ações (BDRs, classificados como Nível I, II ou III) de empresas norte-americanas ou listadas nas bolsas americanas, negociadas no mercado local.

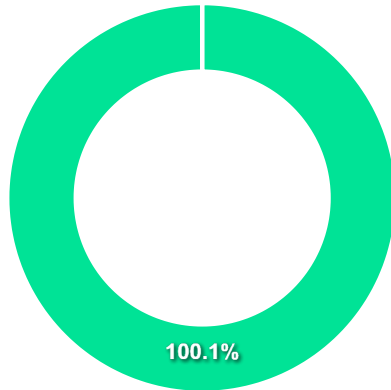
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,98%	8,77%	5,89%	9,52%	8,77%	-8,60%	4,16%	8,76%
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



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ FI AÇÕES BDR NÍVEL I	95.301,19	99,59	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	501,05	0,52	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	58,57	0,06	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	30,00	0,03	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-198,35	-0,21	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	95.802,24	100.11%
Valores a pagar/receber	-109,78	-0.11%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
4.969

Patrimônio Líquido Fundo
1.445.973.570,09

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
CDI

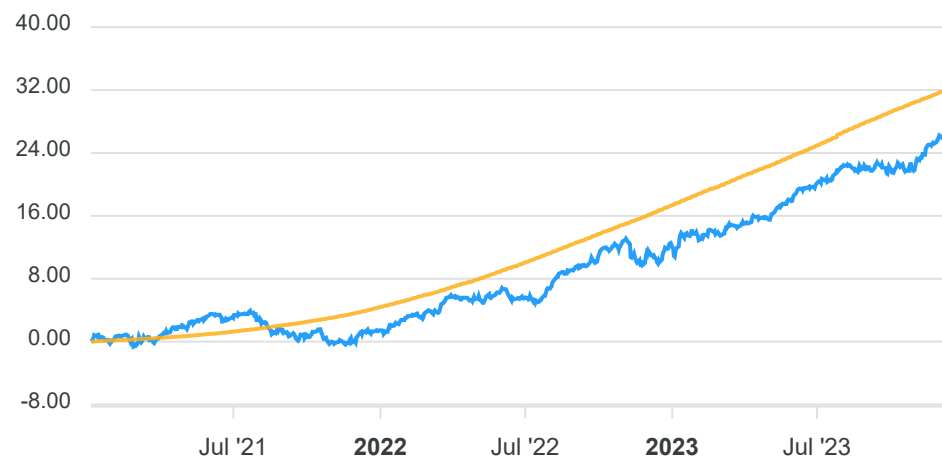
Classificação ANBIMA
Multimercados Macro

Política de Investimento
Aplica em fundos que invistam em carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, nacional e internacional, com prazo médio superior a 365 dias.

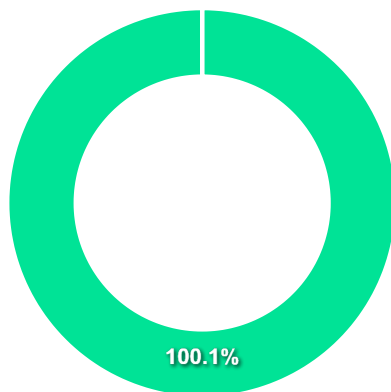
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,82%	13,64%	4,88%	6,55%	13,64%	26,09%	1,31%	2,76%
Benchmark	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		
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 TPF FI RENDA FIXA LP	407.275,51	28,17	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER HEDGE II FI MULTIMERCADO LP	336.619,17	23,28	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	192.144,32	13,29	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER HEDGE FI MULTIMERCADO LP	182.043,87	12,59	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	146.507,15	10,13	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	146.350,02	10,12	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FI AÇÕES	21.990,64	1,52	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.419,68	1,07	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	-1.378,00	-0,10	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.448.350,37	100.10%
Valores a pagar/receber	-1.377,46	-0.10%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 1,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 6.530

Patrimônio Líquido Fundo
 1.635.814.462,49

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
 MSCI ACWI

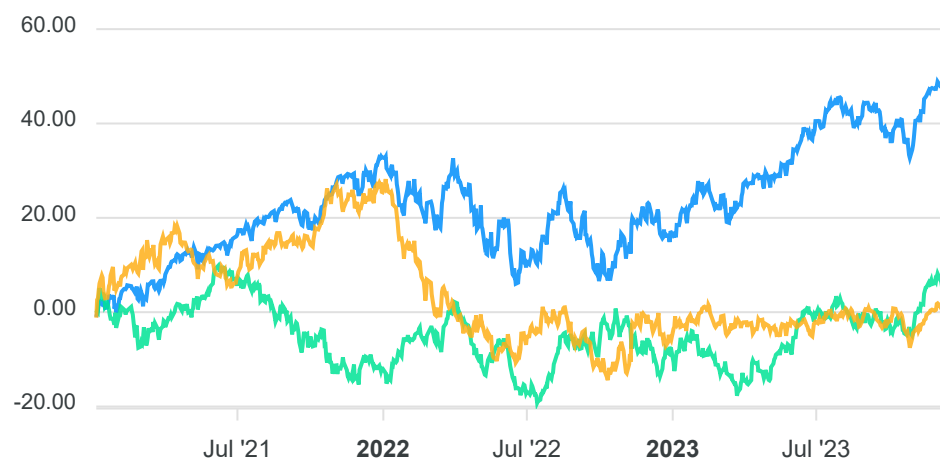
Classificação ANBIMA
 Multimercados Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos nos mercados de renda fixa e renda variável, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial. No mercado de renda variável, realizará operações de derivativos envolvendo contratos futuros de S&P500.

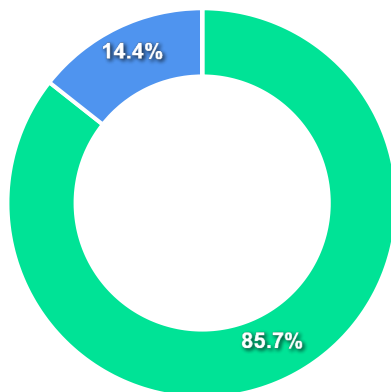
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,19%	33,22%	12,99%	10,86%	33,22%	17,27%	4,22%	8,89%
Benchmark	2,70%	11,43%	7,01%	6,95%	11,43%	-16,44%		
IBOVESPA	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.401.310,18	85.66%
Operação compromissada	235.003,43	14.37%
Derivativos	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-499,15	-0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	426.502,03	26,07	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	343.443,03	21,00	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	298.214,38	18,23	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	235.003,43	14,37	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	139.566,04	8,53	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	124.529,57	7,61	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	31.212,12	1,91	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	19.834,77	1,21	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	18.008,23	1,10	Títulos Federais
Outros Valores a receber	96,36	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,76	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - ISPFUTH24	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - ISPFUTZ23	0,00	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-606,26	-0,04	Valores a pagar/receber

