

2024

Relatório

Mensal, 4º trimestre e ano de 2024

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	11.250.571,11	10,02%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.978.409,80	1,76%	5.307.578.902,09	0,04%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	547.597,40	0,49%	3.989.816.161,41	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	798.340,85	0,71%	1.250.733.842,54	0,06%	7º I b
BNB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	2.337.757,90	2,08%	179.881.537,34	1,30%	7º I b
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.694.600,87	18,44%	11.056.033.371,76	0,19%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	499.132,69	0,44%	3.670.341.424,26	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	789.659,00	0,70%	3.604.057.716,61	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	285.270,34	0,25%	6.393.295.147,70	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	563.681,47	0,50%	2.738.410.858,21	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	27.751.514,36	24,73%	8.167.774.869,09	0,34%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.535,68	0,04%	11.311.864.366,70	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	198.414,64	0,18%	1.421.558.924,62	0,01%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	38.128,21	0,03%	4.174.516.271,82	0,00%	7º III a
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	802.203,08	0,71%	436.366.481,99	0,18%	7º III a
BRABESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	16.726.797,09	14,90%	15.214.543.760,15	0,11%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	322.339,20	0,29%	800.594.123,62	0,04%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.128.282,12	3,68%	6.911.306.522,53	0,06%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	4.226.506,96	3,77%	3.156.991.525,99	0,13%	7º III a
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	806.101,91	0,72%	0,00		7º IV
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	805.691,17	0,72%	0,00		7º IV
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.611.246,87	1,44%	573.702.274,63	0,28%	8º I
BRABESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.741.436,90	2,44%	201.922.608,18	1,36%	8º I
BRABESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.664.874,84	1,48%	224.524.891,97	0,74%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	776.952,71	0,69%	1.149.535.662,64	0,07%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.934.511,54	2,61%	434.246.813,13	0,68%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.216.748,18	1,98%	240.328.864,41	0,92%	8º I

Investimentos

\$ 112.228.141,99

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.822.510,98

Total Carteira

\$ 114.050.652,97

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.202.231,57	1,07%	1.101.963.255,55	0,11%	8º I
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.789.801,70	1,59%	1.364.461.895,51	0,13%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	697.026,87	0,62%	72.547.559,21	0,96%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	304.587,34	0,27%	109.521.621,08	0,28%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	200.832,43	0,18%	37.940.487,92	0,53%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	496.355,19	0,44%	3.298.833.640,03	0,02%	9º III

Investimentos

\$ 112.228.141,99

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.822.510,98

Total Carteira

\$ 114.050.652,97

Governança (Pró Gestão)

[🔗](#)

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,020000%	29	4.695,542981	136.170,75
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,680000%	20	4.892,127526	97.842,55
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,750000%	49	5.085,097449	249.169,78
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,550000%	146	5.259,200275	767.843,24
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,860000%	351	5.066,686566	1.778.406,98
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,760000%	72	5.127,692083	369.193,83
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,400000%	122	5.555,660683	677.790,60
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,460000%	71	5.509,929575	391.205,00
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,590000%	146	5.412,729585	790.258,52
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,680000%	123	5.346,907496	657.669,62
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,630000%	122	5.383,330075	656.766,27
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,730000%	124	5.310,853397	658.545,82
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,640000%	147	5.376,017485	790.274,57
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,340000%	3	5.601,948899	16.805,85
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,150000%	19	5.752,306642	109.293,83
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,780000%	69	5.275,154619	363.985,67
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,860000%	29	4.584,327557	132.945,50
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,760000%	359	5.295,33772	1.901.026,24
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,800000%	134	5.264,003686	705.376,49

Investimentos

 112.228.141,99

Disponibilidades Financeiras

 1.822.510,98

Total Carteira

 114.050.652,97

Governança (Pró Gestão)

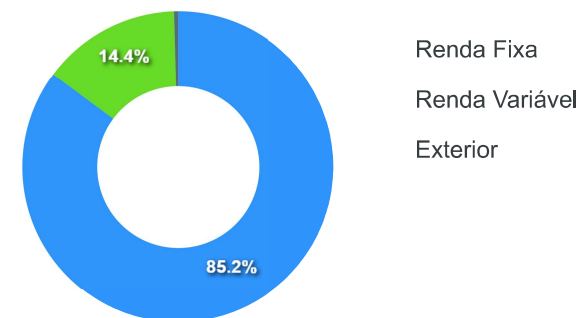


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	10,02%	11.250.571,11 89,98%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	50,33%	56.484.915,00 49,67%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	23,38%	26.244.256,66 36,62%
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	1,44%	1.611.793,08 18,56%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	14,38%	16.140.250,95 15,62%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,44%	496.355,19 9,56%

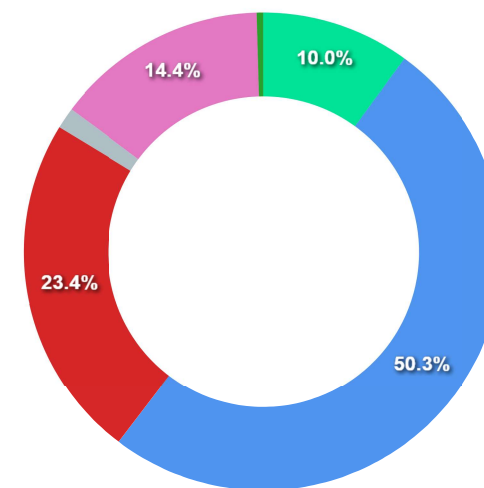
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

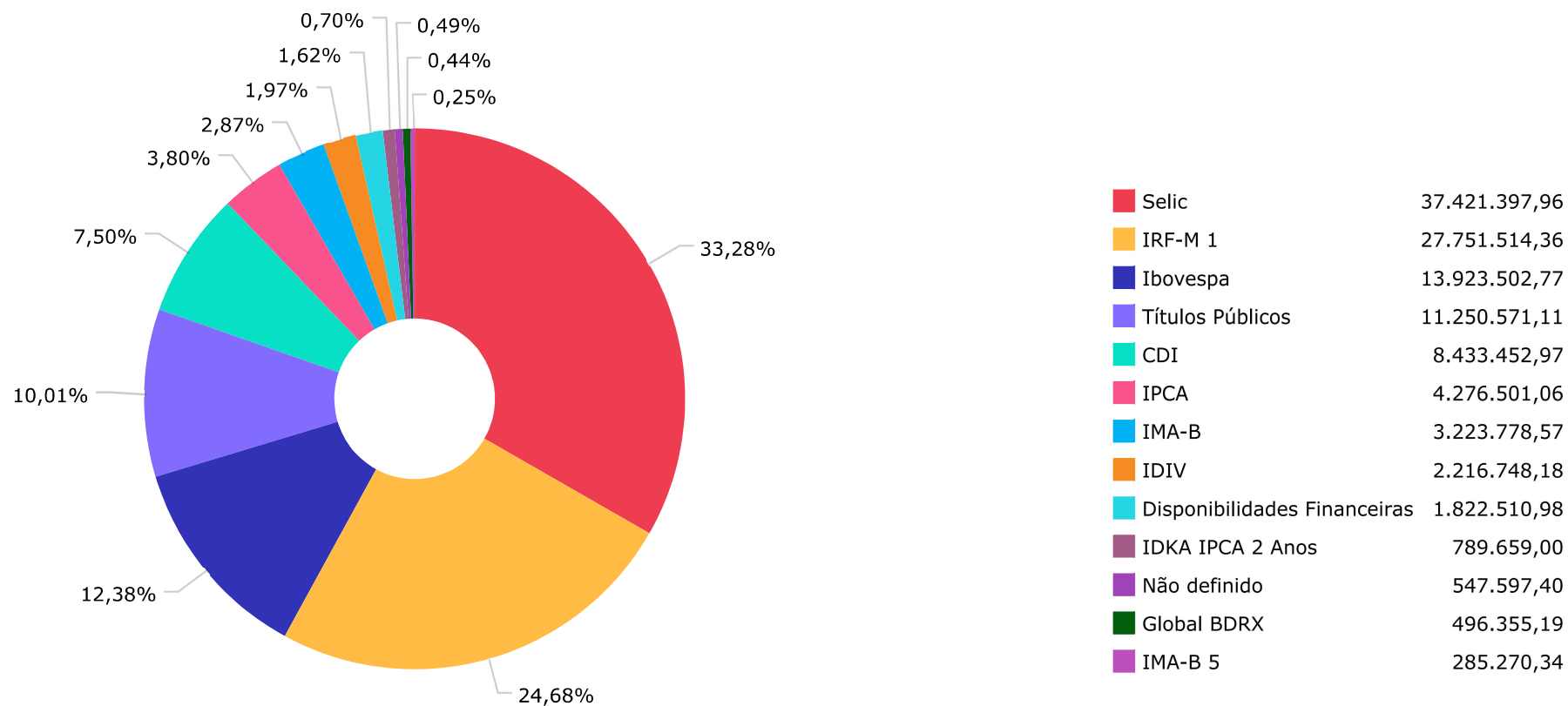


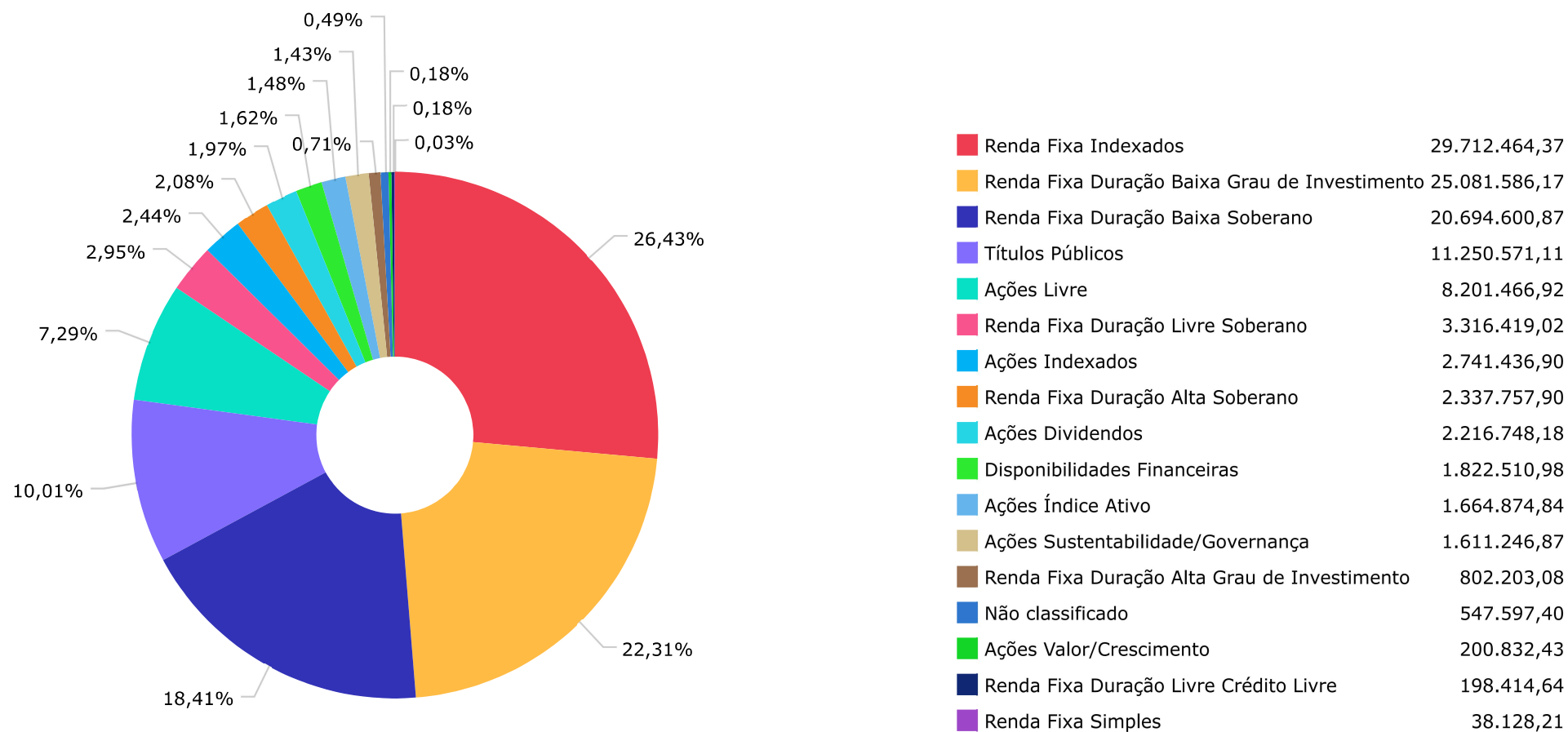
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	10,02%	0,00%	12,00%	100,00%	100.977.570,88
7º I b - FI 100% Títulos TN	50,33%	0,00%	24,00%	100,00%	55.743.226,99
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	112.228.141,99
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.611.407,10
7º III a - FI Referenciados RF	23,38%	0,00%	33,00%	60,00%	41.092.628,53
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	67.336.885,19
7º IV - Ativos Financeiros de ...	1,44%	0,00%	1,00%	20,00%	20.833.835,32
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.611.407,10
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.611.407,10
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.611.407,10

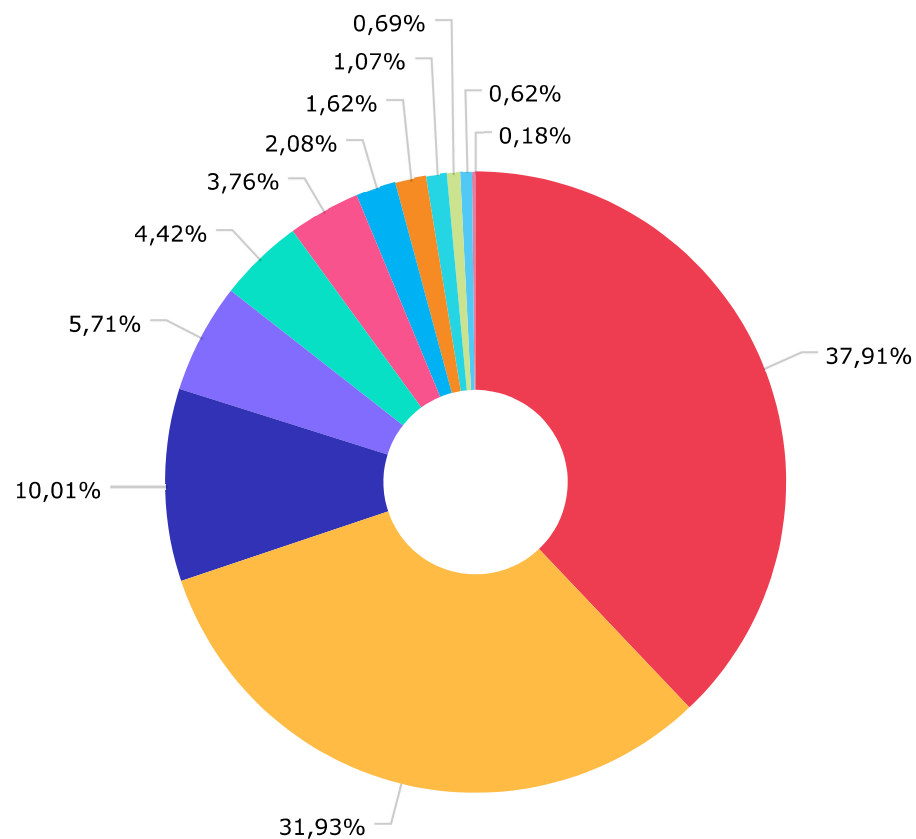
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	14,38%	0,00%	20,00%	30,00%	17.528.191,65
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	33.668.442,60
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	11.222.814,20
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	11.222.814,20
9º III - Ações - BDR Nível I	0,44%	0,00%	2,00%	10,00%	10.726.459,01
10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	11.222.814,20
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.611.407,10
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.611.407,10
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.611.407,10
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.611.407,10

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	0,10		1,40	3,24			1,98	4,17
CDI - BENCHMARK								
	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34		
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86	11,18	2,61	5,40	11,18	26,27	0,03	0,07
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIA...	0,84	11,18	2,58	5,40	11,18	26,01	0,05	0,10
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86	10,61	2,64	5,35	10,61	24,97	0,05	0,11
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82	9,77	2,40	4,84	9,77	22,87	0,04	0,08
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
	4,64	70,59	20,17	20,93	70,59	115,52		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,40	68,28	19,72	20,62	68,28	110,22	9,19	19,35
IBOVESPA - BENCHMARK								
	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61		
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-5,05	2,04	-8,21	2,87	2,04	13,72	9,12	19,21
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-4,26	-9,99	-8,56	-3,27	-9,99	8,22	9,06	19,07
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,12	-10,13	-6,29	-0,43	-10,13	7,47	4,33	9,11
BRDESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-4,20	-10,37	-8,71	-2,86	-10,37	9,73	9,14	19,25
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-4,52	-11,79	-9,26	-3,98	-11,79	4,70	8,61	18,13
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-5,66	-15,44	-11,52	-5,94	-15,44	-2,00	10,00	21,05
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,05	-17,12	-11,31	-8,54	-17,12	-2,91	9,04	19,05
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	-5,86	-17,68	-10,86	-5,01	-17,68	-7,38	8,64	18,19
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-5,31	-20,20	-11,44	-6,16	-20,20	-14,29	9,20	19,38
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,33	-20,38	-12,73	-11,80	-20,38	-7,79	9,72	20,47
IDIV - BENCHMARK								
	-4,89	-2,62	-6,59	0,81	-2,62	23,51		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,77	-3,52	-6,61	0,35	-3,52	20,60	8,36	17,60

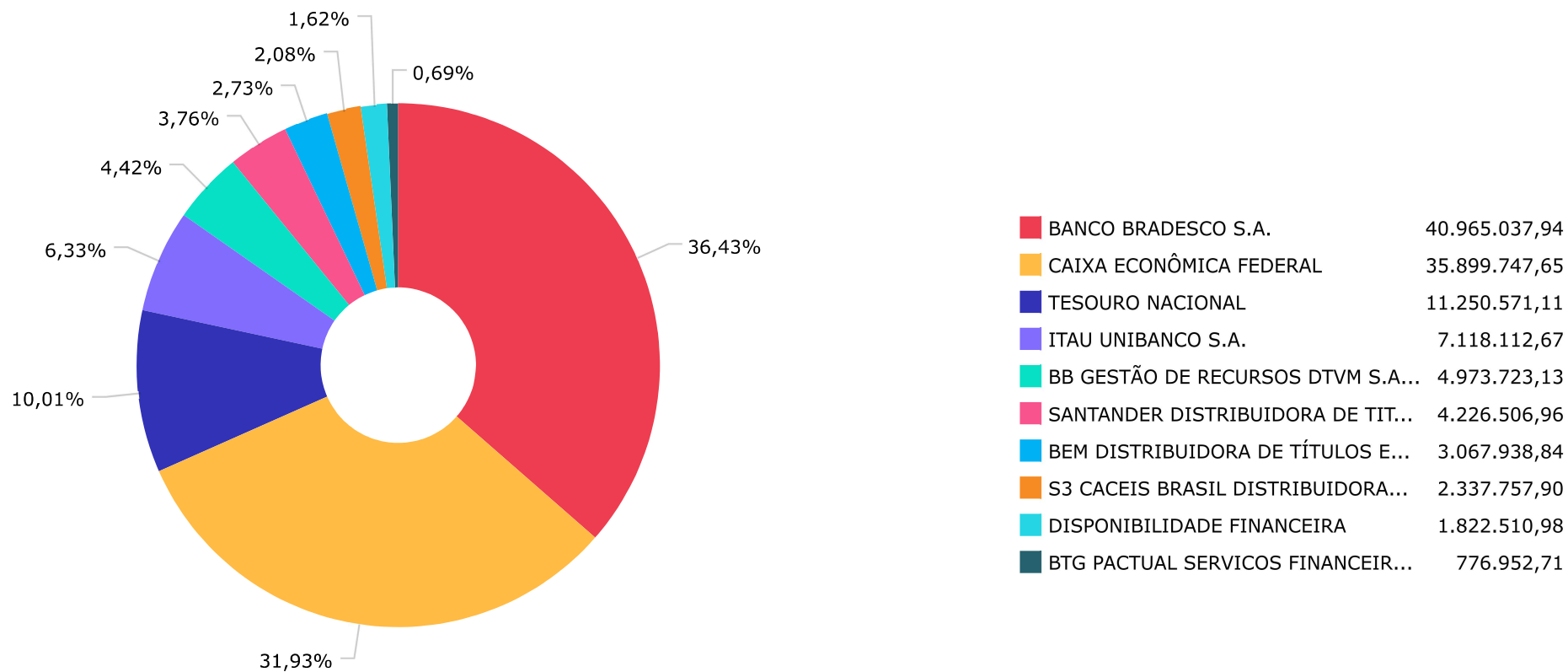
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	-0,24	5,84	0,79	2,55	5,84	18,67		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29	5,43	0,67	2,41	5,43	17,98	2,40	5,06
IMA-B - BENCHMARK	-2,62	-2,44	-3,23	-1,36	-2,44	13,22		
BNB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-2,76	-2,33	-3,28	-1,36	-2,33	12,98	4,57	9,63
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-2,54	-2,33	-3,12	-1,04	-2,33	13,27	4,37	9,21
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,66	-2,72	-3,33	-1,51	-2,72	12,71	4,62	9,74
IMA-B 5 - BENCHMARK	-0,28	6,16	0,82	2,75	6,16	19,03		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,31	5,92	0,75	2,63	5,92	18,59	2,25	4,73
IPCA - BENCHMARK	0,52	4,83	1,48	2,29	4,83	9,68		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17	8,12	1,38	4,13	8,12	24,33	0,77	1,62
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,20	6,26	1,60	3,81	6,26	20,70	1,18	2,48
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,32	5,99	1,74	4,01	5,99	22,78	1,13	2,38
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,46	4,23	0,32	2,22	4,23	18,44	2,62	5,52
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,31	2,72	-1,26	0,90	2,72	18,37	2,70	5,69
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,70	9,46	2,13	4,74	9,46	23,96		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,69	9,33	2,08	4,64	9,33	23,57	0,23	0,48
SELIC - BENCHMARK	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34		
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86	11,52	2,62	5,52	11,52	26,71	0,04	0,08
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,85	10,58	2,57	5,22	10,58	24,67	0,04	0,08







BANCO BRADESCO S.A.	42.629.912,78
CAIXA DTVM	35.899.747,65
TESOURO NACIONAL	11.250.571,11
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	6.421.085,80
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	4.973.723,13
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	4.226.506,96
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S....	2.337.757,90
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.822.510,98
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.202.231,57
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	776.952,71
ITAÚ DTVM S.A.	697.026,87
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	200.832,43



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	95.999.136,54	1.530.719,12	81.000,00	97.025.811,90	-423.043,76	-423.043,76	-0,43% ▼	-0,43%	0,85%	0,85%	-50,59%	2,35%
Fevereiro	97.025.811,90	855.842,25	68.000,00	98.905.748,95	1.092.094,80	669.051,04	1,12% ▲	0,68%	1,20%	2,06%	33,01%	2,30%
Março	98.905.748,95	18.537.508,23	17.324.999,23	100.722.697,45	604.439,50	1.273.490,54	0,60% ▲	1,29%	0,55%	2,62%	49,24%	1,60%
Abril	100.722.697,45	4.446.055,88	5.087.843,25	99.279.189,39	-801.720,69	471.769,85	-0,80% ▼	0,48%	0,81%	3,45%	13,91%	1,87%
Mai	99.279.189,39	2.475.565,57	360.294,08	101.780.955,77	386.494,89	858.264,74	0,38% ▲	0,86%	0,87%	4,35%	19,77%	1,45%
Junho	101.780.955,77	1.485.329,78	627.900,00	103.155.683,46	517.297,91	1.375.562,65	0,50% ▲	1,37%	0,60%	4,98%	27,51%	1,89%
Julho	103.155.683,46	5.061.647,55	3.466.672,45	106.312.510,51	1.561.851,95	2.937.414,60	1,49% ▲	2,88%	0,83%	5,85%	49,23%	1,72%
Agosto	106.312.510,51	1.879.862,57	910.340,79	108.900.028,24	1.617.995,95	4.555.410,55	1,51% ▲	4,43%	0,41%	6,28%	70,54%	1,92%
Setembro	108.900.028,24	1.480.787,53	606.550,00	109.582.741,55	-191.524,22	4.363.886,33	-0,17% ▼	4,25%	0,85%	7,18%	59,19%	1,61%
Outubro	109.582.741,55	39.818.948,33	38.684.253,94	111.147.987,45	430.551,51	4.794.437,84	0,39% ▲	4,66%	1,01%	8,27%	56,35%	0,91%
Novembro	111.147.987,45	2.961.248,68	1.777.875,17	112.445.023,00	113.662,04	4.908.099,88	0,10% ▲	4,76%	0,76%	9,09%	52,37%	1,51%
Dezembro	112.445.023,00	9.529,03	15.000,00	112.228.141,99	-211.410,04	4.696.689,84	-0,19% ▼	4,57%	0,93%	10,10%	45,25%	1,58%

Retorno Acululado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.273.490,54	1,29%	2,62%
2º Trim	102.072,11	0,08%	2,30%
1º Sem	1.375.562,65	1,37%	4,98%
3º Trim	2.988.323,68	2,84%	2,10%
4º Trim	332.803,51	0,30%	2,72%
2º Sem	3.321.127,19	3,15%	4,88%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

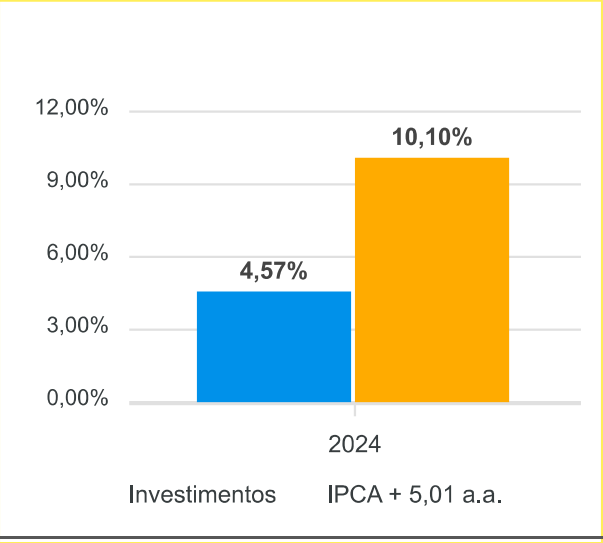


Gráfico Risco x Retorno

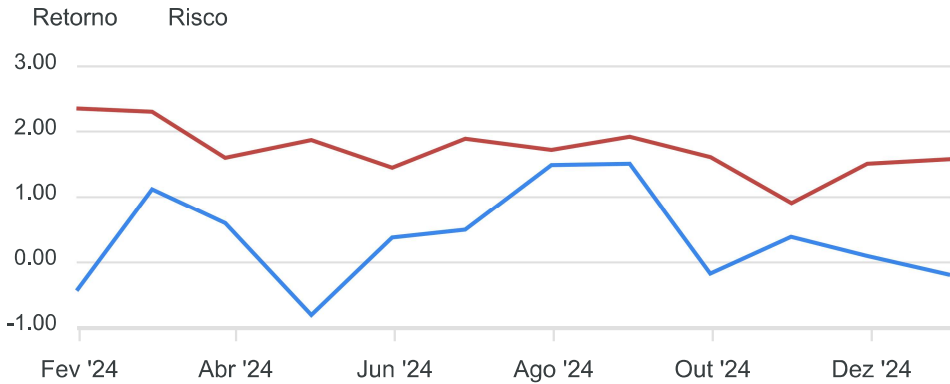
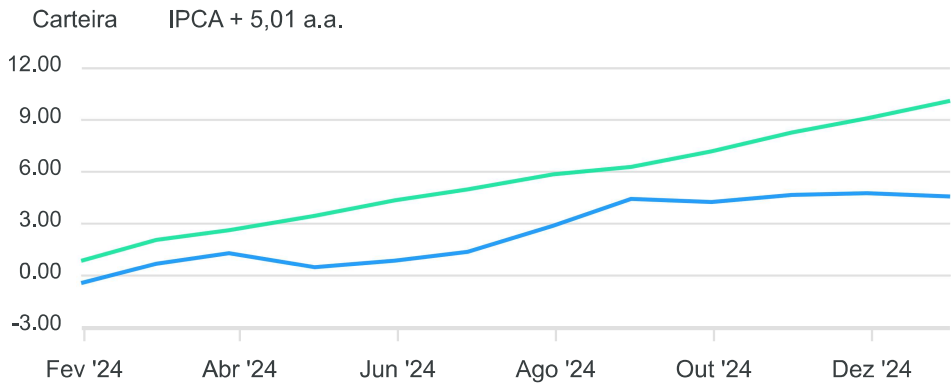
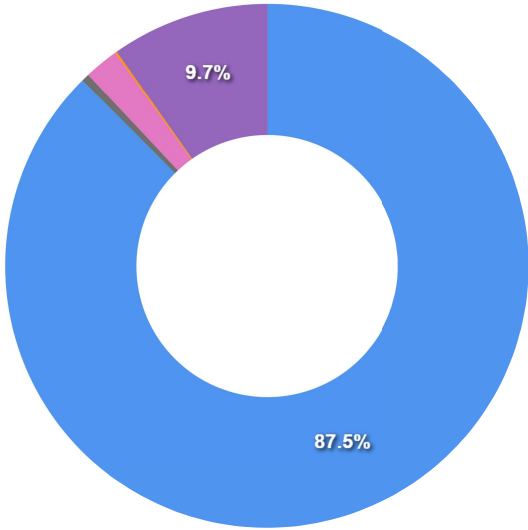


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/12/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	99.842.350,53	87,54
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	547.597,40	0,48
Até D+1800	2.410.133,93	2,11
Até D+3600	136.170,75	0,12
Acima D+3600	11.114.400,36	9,75
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	11.149.430,42	0,00	0,00	11.250.571,11	101.140,69	0,91% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.975.062,57	0,00	0,00	1.978.409,80	3.347,23	0,17% ▲	0,77%
BB FLUXO FIC RENTA FIJA SIMPLFS PREVIDENCIÁRIO	28.308,53	9.529,03	0,00	38.128,21	290,65	0,77% ▲	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO...	547.028,50	0,00	0,00	547.597,40	568,90	0,10% ▲	1,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	802.050,05	0,00	0,00	798.340,85	-3.709,20	-0,46% ▼	2,62%
BNB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENTA FIJA	2.404.102,52	0,00	0,00	2.337.757,90	-66.344,62	-2,76% ▼	4,57%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	812.814,40	0,00	0,00	802.203,08	-10.611,32	-1,31% ▼	2,70%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	20.534.494,00	0,00	15.000,00	20.694.600,87	175.106,87	0,85% ▲	0,04%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENTA FIJA REFERENCIADO DI	16.583.594,92	0,00	0,00	16.726.797,09	143.202,17	0,86% ▲	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIJA	498.151,29	0,00	0,00	499.132,69	981,40	0,20% ▲	1,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	791.944,30	0,00	0,00	789.659,00	-2.285,30	-0,29% ▼	2,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	286.153,87	0,00	0,00	285.270,34	-883,53	-0,31% ▼	2,25%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	579.097,84	0,00	0,00	563.681,47	-15.416,37	-2,66% ▼	4,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA	27.560.647,97	0,00	0,00	27.751.514,36	190.866,39	0,69% ▲	0,23%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	40.191,64	0,00	0,00	40.535,68	344,04	0,86% ▲	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENTA FIJA LP	330.753,81	0,00	0,00	322.339,20	-8.414,61	-2,54% ▼	4,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIJA	197.776,09	0,00	0,00	198.414,64	638,55	0,32% ▲	1,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	4.093.229,15	0,00	0,00	4.128.282,12	35.052,97	0,86% ▲	0,03%
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	798.458,65	0,00	0,00	806.101,91	7.643,26	0,96% ▲	-
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	798.105,36	0,00	0,00	805.691,17	7.585,81	0,95% ▲	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIJA REFERENCIA...	4.191.502,38	0,00	0,00	4.226.506,96	35.004,58	0,84% ▲	0,05%
	95.002.898,26	9.529,03	15.000,00	95.591.535,85	594.108,56	0,63%	0,35%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.682.865,55	0,00	0,00	1.611.246,87	-71.618,68	-4,26% ▼	9,06%
BRANCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.861.749,35	0,00	0,00	2.741.436,90	-120.312,45	-4,20% ▼	9,14%
BRANCO SELECTION FIC AÇÕES	1.768.522,21	0,00	0,00	1.664.874,84	-103.647,37	-5,86% ▼	8,64%
BTC PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	838.364,08	0,00	0,00	776.952,71	-61.411,37	-7,33% ▼	9,72%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.090.531,98	0,00	0,00	2.934.511,54	-156.020,44	-5,05% ▼	9,04%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.327.868,83	0,00	0,00	2.216.748,18	-111.120,65	-4,77% ▼	8,36%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.241.003,42	0,00	0,00	1.202.231,57	-38.771,85	-3,12% ▼	4,33%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.884.907,84	0,00	0,00	1.789.801,70	-95.106,14	-5,05% ▼	9,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	738.881,69	0,00	0,00	697.026,87	-41.854,82	-5,66% ▼	10,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	321.677,32	0,00	0,00	304.587,34	-17.089,98	-5,31% ▼	9,20%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	210.336,71	0,00	0,00	200.832,43	-9.504,28	-4,52% ▼	8,61%
-	16.966.708,98	0,00	0,00	16.140.250,95	-826.458,03	-4,87%	8,65%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	475.415,76	0,00	0,00	496.355,19	20.939,43	4,40% ▲	9,19%
	475.415,76	0,00	0,00	496.355,19	20.939,43	4,40%	0,00%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.951.515,95	0,00	0,00	1.978.409,80	26.893,85	1,38% ▲
BB FLUXO FIC RENTA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	39.163,01	1.529,33	38.128,21	494,53	1,26% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	560.652,15	0,00	559.253,94	0,00	-1.398,21	-0,25% ▼
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	543.420,59	0,00	547.597,40	4.176,81	0,77% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	818.153,49	0,00	22.549,39	798.340,85	2.736,75	0,33% ▲
BNB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENTA FIXA	2.416.932,13	0,00	0,00	2.337.757,90	-79.174,23	-3,28% ▼
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	16.816.874,57	0,00	16.000.000,00	802.203,08	-14.671,49	-0,09% ▼
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	20.188.238,30	1.180.000,00	1.195.000,00	20.694.600,87	521.362,57	2,44% ▲
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENTA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	16.394.000,00	0,00	16.726.797,09	332.797,09	2,03% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	1.486.833,33	0,00	1.000.000,00	499.132,69	12.299,36	0,83% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	784.382,07	0,00	0,00	789.659,00	5.276,93	0,67% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	1.777.354,67	0,00	1.500.000,00	285.270,34	7.915,67	0,45% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	13.593.385,12	0,00	13.000.000,00	563.681,47	-29.703,65	-0,22% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	8.292.643,87	18.968.251,00	0,00	27.751.514,36	490.619,49	1,80% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	39.492,87	0,00	0,00	40.535,68	1.042,81	2,64% ▲
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENTA FIXA LP	1.333.399,16	0,00	1.000.000,00	322.339,20	-11.059,96	-0,83% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIXA	3.184.477,32	0,00	3.000.000,00	198.414,64	13.937,32	0,44% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	574.615,91	3.468.251,00	0,00	4.128.282,12	85.415,21	2,11% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	783.124,68	0,00	0,00	806.101,91	22.977,23	2,93% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	782.876,70	0,00	0,00	805.691,17	22.814,47	2,91% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIXA REFERENCIA...	2.983.701,79	2.196.640,44	1.059.400,00	4.226.506,96	105.564,73	2,04% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	11.100.685,60	0,00	139.396,45	11.250.571,11	289.281,96	2,61% ▲
	89.469.339,68	42.789.726,04	38.477.129,11	95.591.535,85	1.809.599,24	1,93%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.762.104,81	0,00	0,00	1.611.246,87	-150.857,94	-8,56% ▼
BRANESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	3.003.054,43	0,00	0,00	2.741.436,90	-261.617,53	-8,71% ▼
BRANESCO SELECTION FIC AÇÕES	1.867.628,36	0,00	0,00	1.664.874,84	-202.753,52	-10,86% ▼
BIG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	890.323,97	0,00	0,00	776.952,71	-113.371,26	-12,73% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.308.557,00	0,00	0,00	2.934.511,54	-374.045,46	-11,31% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.373.531,55	0,00	0,00	2.216.748,18	-156.783,37	-6,61% ▼
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.282.872,49	0,00	0,00	1.202.231,57	-80.640,92	-6,29% ▼
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.949.905,87	0,00	0,00	1.789.801,70	-160.104,17	-8,21% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	787.777,07	0,00	0,00	697.026,87	-90.750,20	-11,52% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	343.944,08	0,00	0,00	304.587,34	-39.356,74	-11,44% ▼
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	221.328,38	0,00	0,00	200.832,43	-20.495,95	-9,26% ▼
	17.791.028,01	0,00	0,00	16.140.250,95	-1.650.777,06	-9,28%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.322.373,86	0,00	2.000.000,00	496.355,19	173.981,33	7,49% ▲
	2.322.373,86	0,00	2.000.000,00	496.355,19	173.981,33	7,49%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	531.291,18	1.300.000,00	0,00	1.978.409,80	147.118,62	8,03% ▲
BB FLUXO FIC RENTA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	39.163,01	1.529,33	38.128,21	494,53	1,26% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	557.334,31	0,00	559.253,94	0,00	1.919,63	0,34% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	0,00	543.420,59	0,00	547.597,40	4.176,81	0,77% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	810.695,87	0,00	46.242,15	798.340,85	33.887,13	4,18% ▲
BNB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENTA FIXA	2.393.513,10	0,00	0,00	2.337.757,90	-55.755,20	-2,33% ▼
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	10.741.249,27	5.500.000,00	16.000.000,00	802.203,08	560.953,81	3,45% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	4.656.979,03	15.843.100,20	1.342.210,00	20.694.600,87	1.536.731,64	7,50% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIXA	12.944.445,43	0,00	12.726.353,53	0,00	-218.091,90	-1,68% ▼
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENTA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	16.394.000,00	0,00	16.726.797,09	332.797,09	2,03% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	615.610,19	814.908,50	1.000.000,00	499.132,69	68.614,00	4,80% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	748.957,24	0,00	0,00	789.659,00	40.701,76	5,43% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	1.690.521,76	0,00	1.500.000,00	285.270,34	94.748,58	5,60% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	13.508.181,04	0,00	13.000.000,00	563.681,47	55.500,43	0,41% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	1.235.021,19	25.660.531,73	0,00	27.751.514,36	855.961,44	3,18% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	36.646,84	0,00	0,00	40.535,68	3.888,84	10,61% ▲
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENTA FIXA LP	1.322.669,02	0,00	1.000.000,00	322.339,20	-329,82	-0,02% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIXA	3.056.593,94	0,00	3.000.000,00	198.414,64	141.820,70	4,64% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	4.035.668,35	0,00	4.128.282,12	92.613,77	2,29% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	0,00	753.000,00	0,00	806.101,91	53.101,91	7,05% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	0,00	753.000,00	0,00	805.691,17	52.691,17	7,00% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIXA	787.259,85	0,00	809.706,52	0,00	22.446,67	2,85% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIXA REFERENCIA...	1.152,02	8.906.252,14	4.853.762,40	4.226.506,96	172.865,20	1,94% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.756.106,26	0,00	410.338,56	11.250.571,11	904.803,41	8,41% ▲
	66.394.227,54	80.543.044,52	56.249.396,43	95.591.535,85	4.903.660,22	5,41%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.790.038,64	0,00	0,00	1.611.246,87	-178.791,77	-9,99% ▼
BRANESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	3.058.765,51	0,00	0,00	2.741.436,90	-317.328,61	-10,37% ▼
BRANESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.022.342,55	0,00	0,00	1.664.874,84	-357.467,71	-17,68% ▼
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	975.885,55	0,00	0,00	776.952,71	-198.932,84	-20,38% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.540.661,39	0,00	0,00	2.934.511,54	-606.149,85	-17,12% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.297.559,45	0,00	0,00	2.216.748,18	-80.811,27	-3,52% ▼
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.337.794,68	0,00	0,00	1.202.231,57	-135.563,11	-10,13% ▼
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.754.048,25	0,00	0,00	1.789.801,70	35.753,45	2,04% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	824.291,46	0,00	0,00	697.026,87	-127.264,59	-15,44% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	381.702,12	0,00	0,00	304.587,34	-77.114,78	-20,20% ▼
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	227.676,43	0,00	0,00	200.832,43	-26.844,00	-11,79% ▼
	18.210.766,03	0,00	0,00	16.140.250,95	-2.070.515,08	-11,37%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	540.745,39	0,00	549.440,97	0,00	8.695,58	1,61% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.777.579,44	0,00	5.268.748,26	0,00	491.168,82	10,28% ▲
	5.318.324,83	0,00	5.818.189,23	0,00	499.864,40	9,40%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS DISRUPTIVE TECHNOLOGY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIAÇÕES	1.040.285,64	0,00	1.118.648,05	0,00	78.362,41	7,53% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.652.221,17	0,00	2.000.000,00	496.355,19	844.134,02	51,09% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.328.935,25	0,00	1.506.858,13	0,00	177.922,88	13,39% ▲
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY CLASSE INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP...	849.355,91	0,00	985.270,74	0,00	135.914,83	16,00% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR RES...	1.205.020,17	0,00	1.332.366,33	0,00	127.346,16	10,57% ▲
	6.075.818,14	0,00	6.943.143,25	496.355,19	1.363.680,30	22,44%

Cenário Econômico

O mês de dezembro continuou marcado por muita volatilidade, impactando diretamente a rentabilidade dos investimentos, e comprometendo o fechamento anual das carteiras. Na renda fixa, os ativos de inflação de longo prazo continuaram em baixa devido à manutenção do movimento de abertura da curva de juros. Na renda variável o mês de dezembro apresentou um dos piores desempenhos do ano, diante da deterioração das perspectivas de ajuste fiscal por parte do Governo. Já os ativos ligados a índices no exterior mantiveram o bom desempenho no mês, ainda beneficiados pela valorização do dólar frente ao real.

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), ficou demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2024. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstraram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2024 não foram integralmente 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, demonstraram de forma consolidada e no período resultados ainda insatisfatórios.

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, e 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 investimentos presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva de instituições com as quais os RPPS podem manter investimentos, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Como já dissemos o mês de dezembro continuou marcado por muita volatilidade, impactando diretamente a rentabilidade da carteira, e comprometendo seu fechamento anual. Na renda fixa, os ativos de inflação de longo seguiram em baixa devido à manutenção do movimento de abertura da curva de juros. Já no curto prazo, os ativos vinculados ao CDI apresentaram comportamento favorável. Na renda variável o mês de dezembro apresentou um dos piores desempenhos do ano, diante da falta de perspectivas favoráveis em relação ao ajuste fiscal por parte do Governo. Já os ativos ligados a índices no exterior mantiveram o bom desempenho no mês, ainda beneficiados pela valorização do dólar frente ao real.

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 2024, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos

Rio de Janeiro, 13 de janeiro de 2025.



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
611
Patrimônio Líquido Fundo
5.307.578.902,09

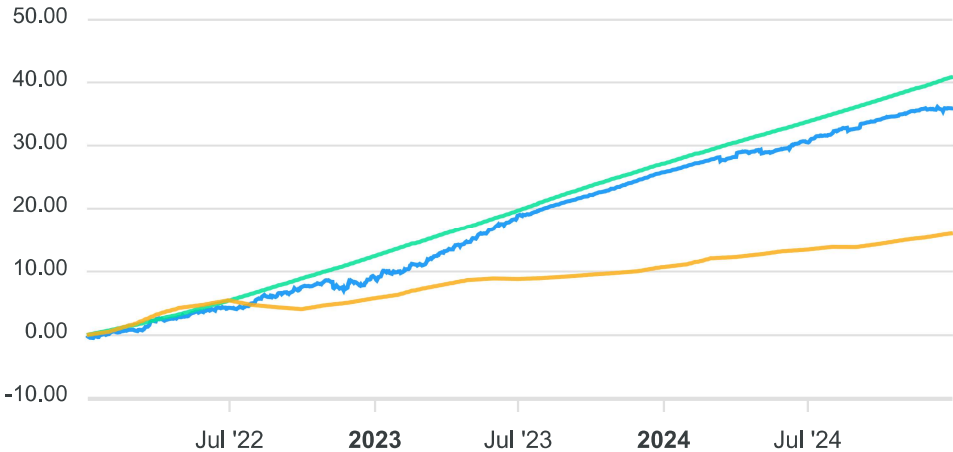
PERFIL DO FUNDO

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.

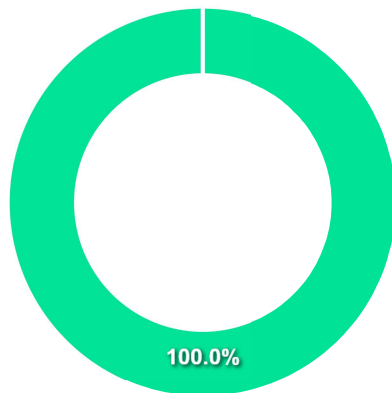
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,17%	8,12%	1,38%	4,13%	8,12%	24,33%	0,77%	1,62%
Benchmark	0,52%	4,83%	1,48%	2,29%	4,83%	9,68%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP JUROS BRASIL FI RENDA FIXA LP	5.306.592,84	99,98	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	1.130,12	0,02	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	3,39	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a receber / ANBID DIFER 31/01/25	0,84	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Cetip	-30,73	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-45,82	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-61,05	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.306.592,84	99,98%
Valores a pagar/receber	999,82	0.02%
Outros	0,84	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração
0,10%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
398
Patrimônio Líquido Fundo
3.989.816.161,41

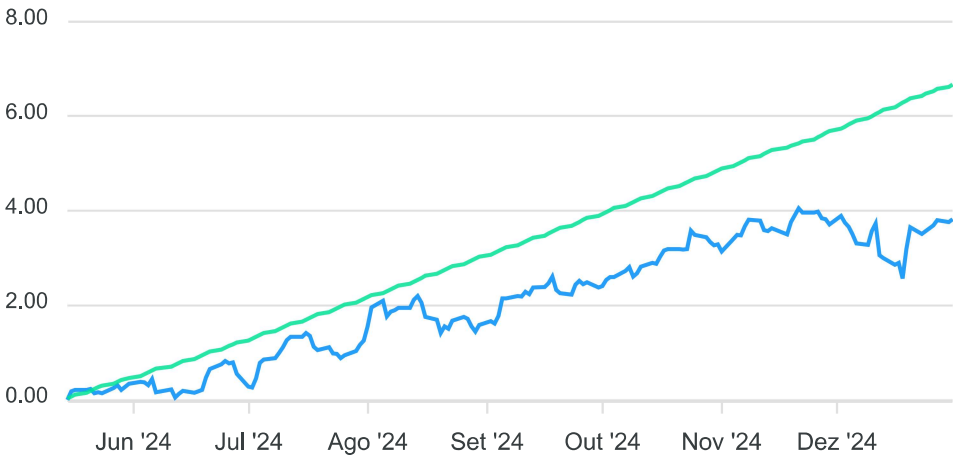
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
Não definido
Classificação ANBIMA
Não classificado
Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa relacionados à variação das taxas de juros (pós ou pré-fixados), de índices de preços, ou ambos.

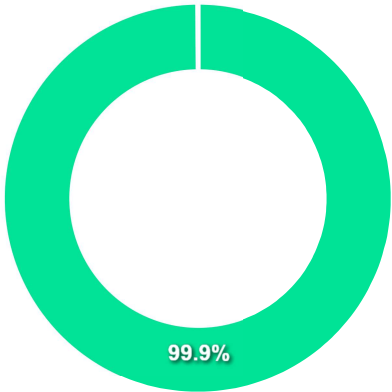
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,10%	-%	1,40%	3,24%	-%	-%	1,98%	4,17%
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



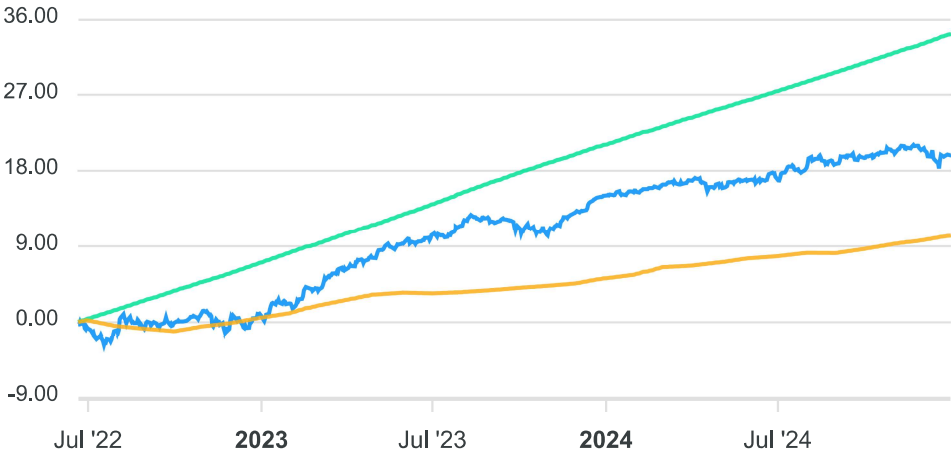
Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	3.985.442,87	99,89	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2028	4.127,11	0,10	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	303,15	0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	11,07	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	10,98	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a receber / ANBID DIFER 31/01/25	0,84	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-32,77	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.985.442,87	99.89%
Operação compromissada	4.127,11	0.10%
Valores a pagar/receber	295,44	0.01%
Outros	0,84	0.00%

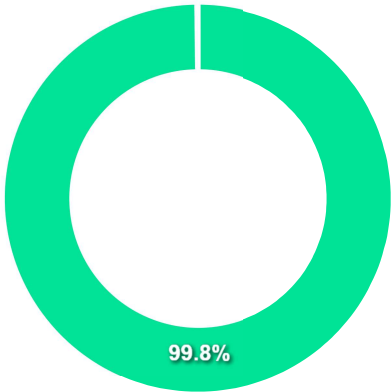
PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 222
Patrimônio Líquido Fundo 1.250.733.842,54

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	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,46%	4,23%	0,32%	2,22%	4,23%	18,44%	2,62%	5,52%
Benchmark	0,52%	4,83%	1,48%	2,29%	4,83%	9,68%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	1.248.413,60	99,81	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2028	2.246,61	0,18	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	102,35	0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,40	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	3,84	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a receber / ANBID DIFER 31/01/25	0,84	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Administração	-9,92	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-10,41	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.248.413,60	99.81%
Operação compromissada	2.246,61	0.18%
Valores a pagar/receber	91,25	0.01%
Outros	0,84	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
S3 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
103
Patrimônio Líquido Fundo
179.881.537,34

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.

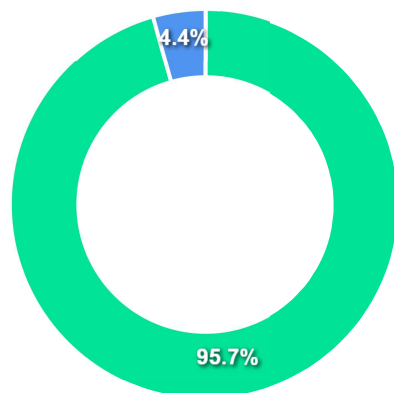
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,76%	-2,33%	-3,28%	-1,36%	-2,33%	12,98%	4,57%	9,63%
Benchmark	-2,62%	-2,44%	-3,23%	-1,36%	-2,44%	13,22%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	203.363,31	95.66%
Operação compromissada	9.255,85	4.35%
Valores a pagar/receber	-27,53	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	30.257,02	14,23	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	28.070,97	13,20	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	28.012,71	13,18	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	19.674,61	9,25	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	19.561,15	9,20	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	12.980,38	6,11	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	12.553,24	5,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	11.979,76	5,64	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	10.817,38	5,09	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	9.415,90	4,43	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	9.255,85	4,35	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	8.046,17	3,78	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	7.143,49	3,36	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	4.505,66	2,12	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	344,87	0,16	Títulos Federais
Outros Valores a receber	5,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	4,77	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-37,41	-0,02	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BRADESCO S.A.
Gestão
BANCO BRADESCO S.A.
Taxa de Administração
0,15%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
612
Patrimônio Líquido Fundo
11.056.033.371,76

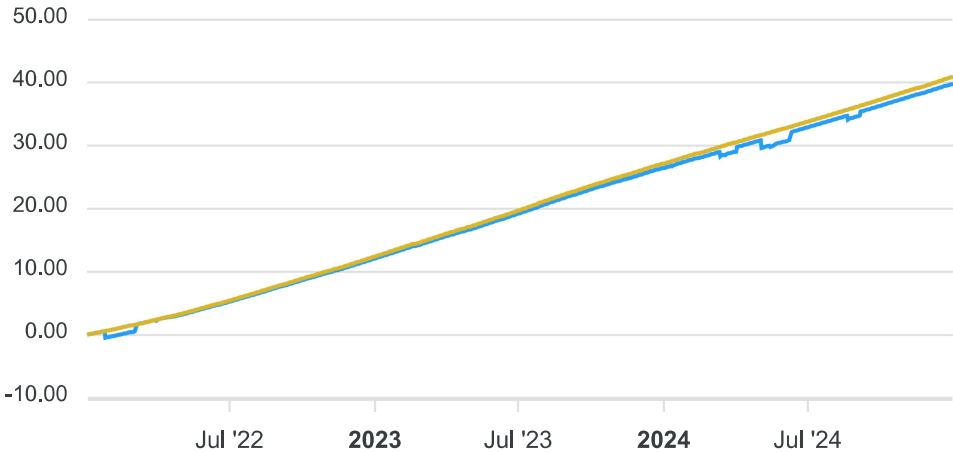
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
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.

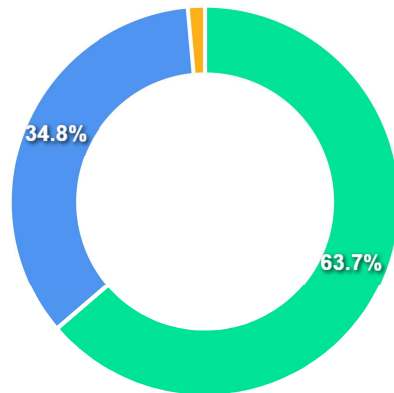
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,85%	10,58%	2,57%	5,22%	10,58%	24,67%	0,04%	0,08%
Benchmark	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.046.096,49	63.73%
Operação compromissada	3.852.039,89	34.84%
Valores a pagar/receber	157.896,99	1.43%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2027	3.852.039,89	34,84	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2027	2.431.059,96	21,99	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026	1.236.874,67	11,19	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027	1.013.509,26	9,17	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028	926.509,74	8,38	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025	724.460,57	6,55	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2028	316.252,61	2,86	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2029	166.278,29	1,50	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	160.000,00	1,45	Valores a pagar/receber
LFT - Venc.: 01/09/2026	138.270,26	1,25	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030	50.266,84	0,45	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2029	35.052,07	0,32	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	7.562,22	0,07	Títulos Federais
Outros Valores a receber	0,57	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-2.103,58	-0,02	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA DTVM
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
638
Patrimônio Líquido Fundo
3.670.341.424,26

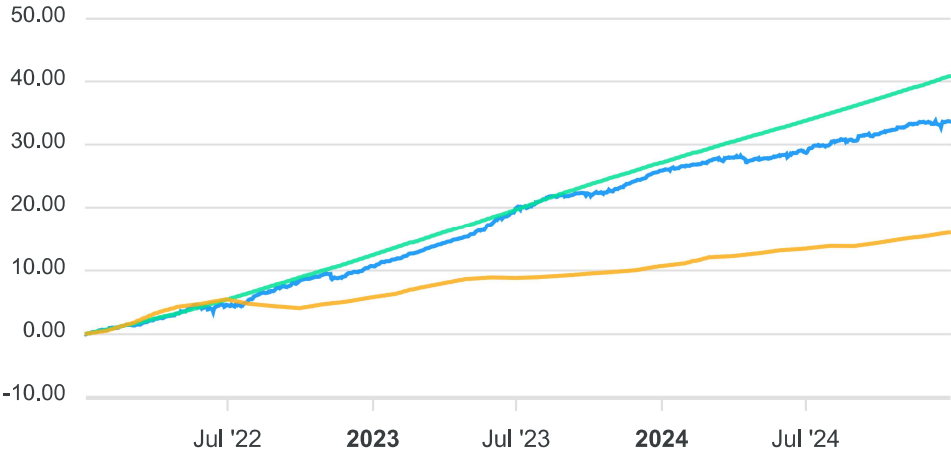
PERFIL DO FUNDO

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.

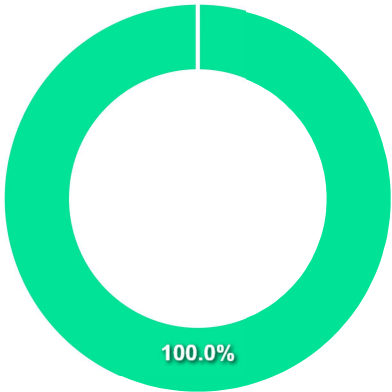
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,20%	6,26%	1,60%	3,81%	6,26%	20,70%	1,18%	2,48%
Benchmark	0,52%	4,83%	1,48%	2,29%	4,83%	9,68%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



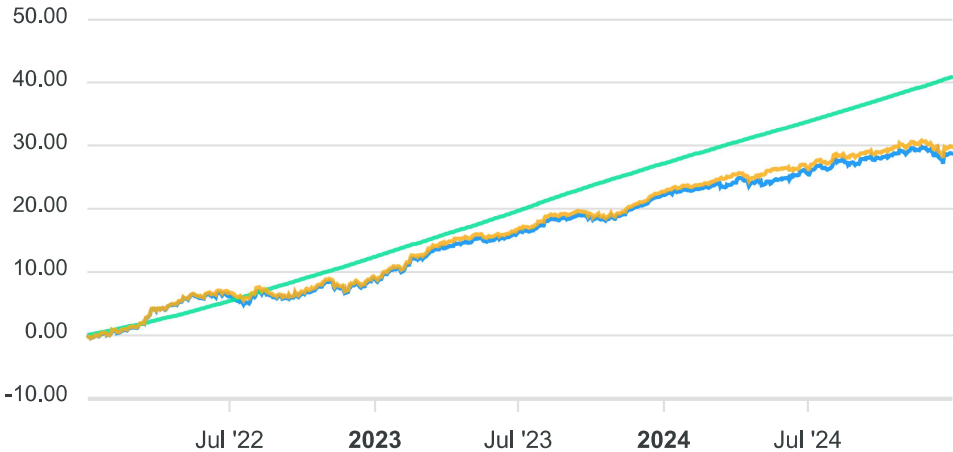
Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA LP	3.931.881,62	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	4,73	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-351,33	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	3.931.881,62	100.01%
Valores a pagar/receber	-346,60	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão CAIXA DTVM
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 741
Patrimônio Líquido Fundo 3.604.057.716,61

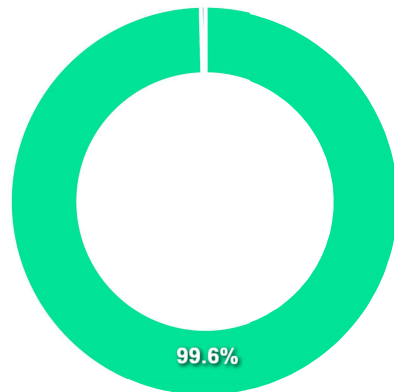
PERFIL DO FUNDO
Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IDKA IPCA 2 Anos
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.

COMPARATIVO		Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo		-0,29%	5,43%	0,67%	2,41%	5,43%	17,98%	2,40%	5,06%
Benchmark		-0,24%	5,84%	0,79%	2,55%	5,84%	18,67%		
CDI		0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



31/12/2024

CARTEIRA DO FUNDO



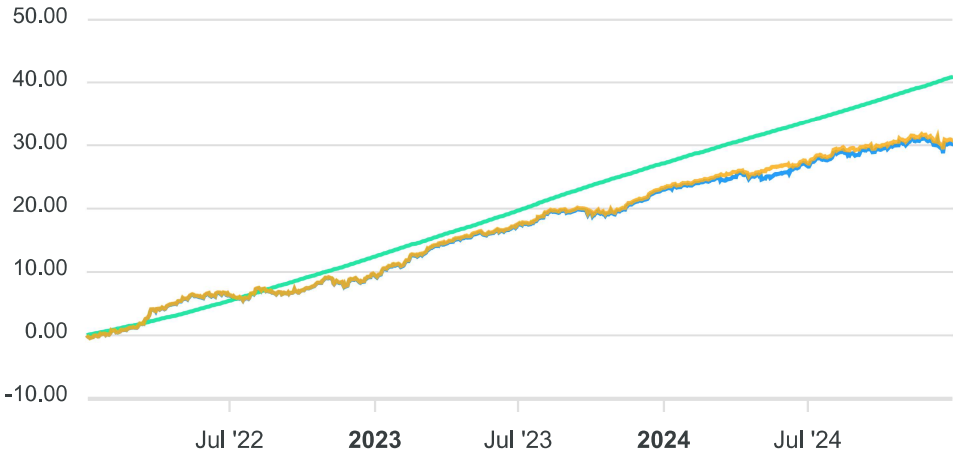
Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	2.685.236,05	69,12	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	1.158.165,98	29,81	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	26.523,06	0,68	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	15.215,86	0,39	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	154,31	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	4,73	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ26	-16,92	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK27	-18,10	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-248,18	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.869.925,09	99.61%
Operação compromissada	15.215,86	0.39%
Derivativos	-35,02	-0.00%
Valores a pagar/receber	-89,15	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão CAIXA DTVM
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 826
Patrimônio Líquido Fundo 6.393.295.147,70

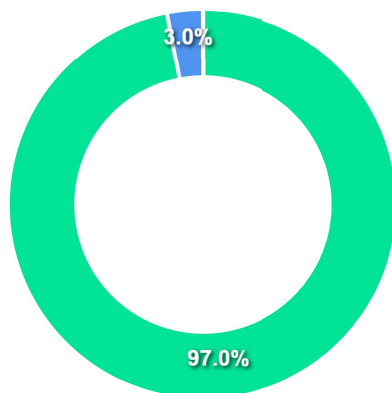
PERFIL DO FUNDO
Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B 5
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

COMPARATIVO	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,31%	5,92%	0,75%	2,63%	5,92%	18,59%	2,25%	4,73%
Benchmark	-0,28%	6,16%	0,82%	2,75%	6,16%	19,03%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



31/12/2024

CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	6.585.102,95	97.03%
Operação compromissada	201.828,65	2.97%
Derivativos	38,36	0.00%
Valores a pagar/receber	-44,34	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	2.145.098,58	31,61	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	1.745.061,02	25,71	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	1.212.192,22	17,86	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	1.086.957,14	16,02	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029 (BRSTNCNTB716)	374.822,79	5,52	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2026	201.828,65	2,97	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	11.631,40	0,17	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	7.787,69	0,11	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1.552,12	0,02	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	264,45	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	43,08	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	38,36	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-351,87	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão CAIXA DTVM
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 621
Patrimônio Líquido Fundo 2.738.410.858,21

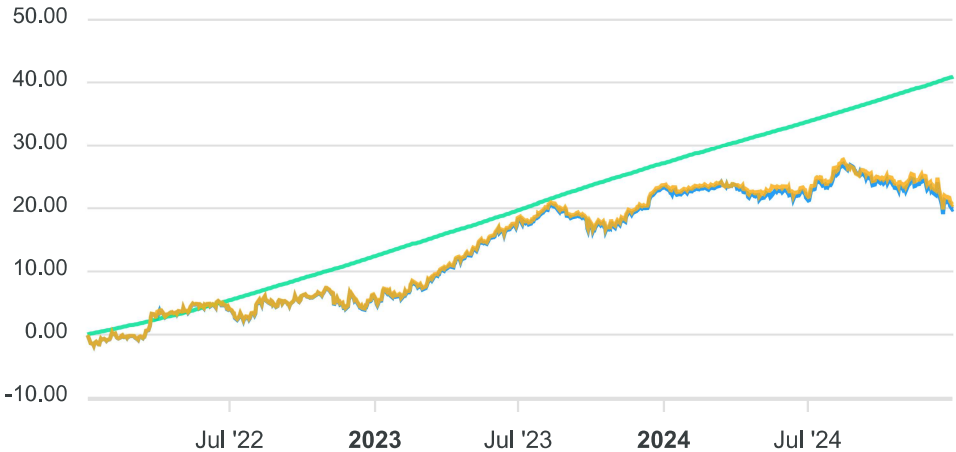
PERFIL DO FUNDO

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.

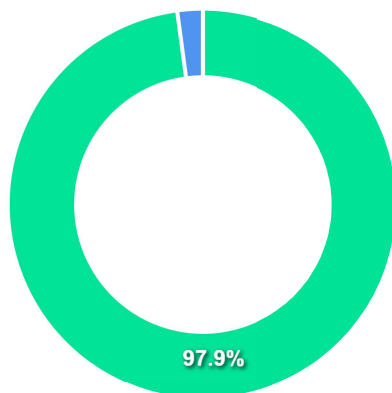
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,66%	-2,72%	-3,33%	-1,51%	-2,72%	12,71%	4,62%	9,74%
Benchmark	-2,62%	-2,44%	-3,23%	-1,36%	-2,44%	13,22%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.121.345,14	97.88%
Operação compromissada	67.603,82	2.12%
Valores a pagar/receber	-4,18	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	435.916,23	13,67	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	351.661,50	11,03	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	350.914,43	11,00	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB0O7)	320.914,07	10,06	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	231.622,08	7,26	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	225.713,82	7,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	219.041,13	6,87	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	211.280,13	6,63	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	208.232,17	6,53	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	187.561,80	5,88	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	115.356,37	3,62	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	101.327,56	3,18	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	84.733,50	2,66	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2029 (BRSTNCNTB716)	75.533,90	2,37	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	67.603,82	2,12	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1.536,44	0,05	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	173,86	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	4,73	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-182,76	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA DTVM
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
1.130
Patrimônio Líquido Fundo
8.167.774.869,09

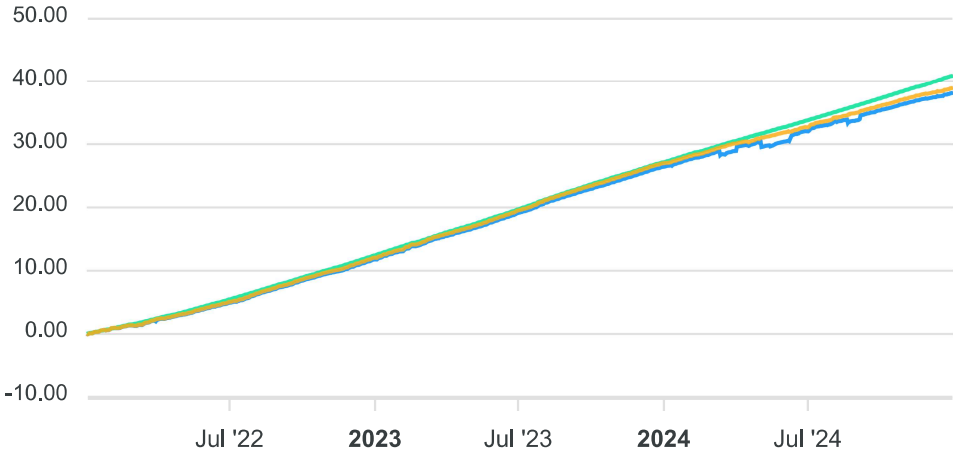
PERFIL DO FUNDO

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.

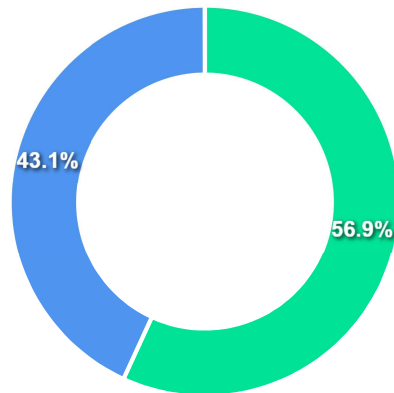
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,69%	9,33%	2,08%	4,64%	9,33%	23,57%	0,23%	0,48%
Benchmark	0,70%	9,46%	2,13%	4,74%	9,46%	23,96%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.653.150,57	56.87%
Operação compromissada	3.527.061,97	43.11%
Valores a pagar/receber	2.855,87	0.03%
Derivativos	-848,01	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2027	3.527.061,97	43,10	Operação compromissada
LTN - Venc.: 01/07/2025 (BRSTNCLTN7Z6)	1.424.958,50	17,41	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	1.281.937,12	15,67	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2025 (BRSTNCLTN830)	1.119.996,09	13,69	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2025 (BRSTNCLTN863)	480.600,95	5,87	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	235.151,70	2,87	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCLTN7N2)	110.506,21	1,35	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	4.124,24	0,05	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	4,73	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	-40,97	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN25	-86,25	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ25	-93,79	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV25	-626,98	-0,01	Derivativos
Outros Valores a pagar	-1.273,10	-0,02	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão CAIXA DTVM
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 740
Patrimônio Líquido Fundo 11.311.864.366,70

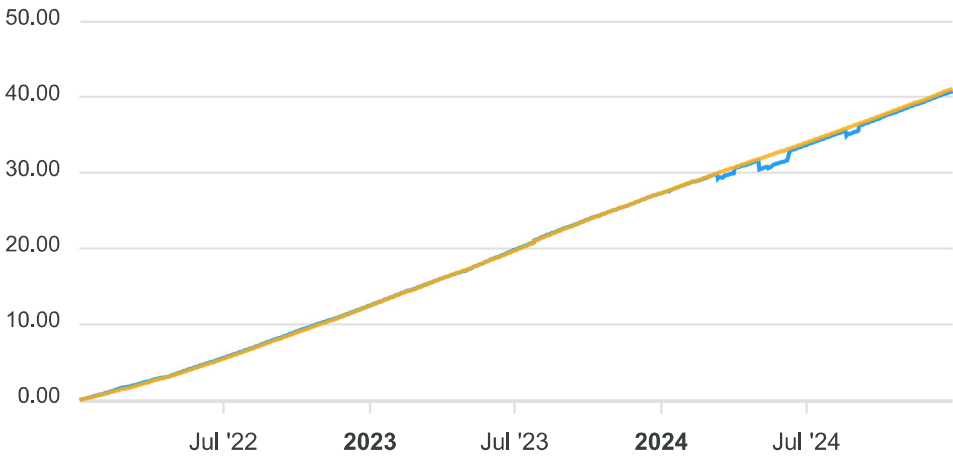
PERFIL DO FUNDO

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.

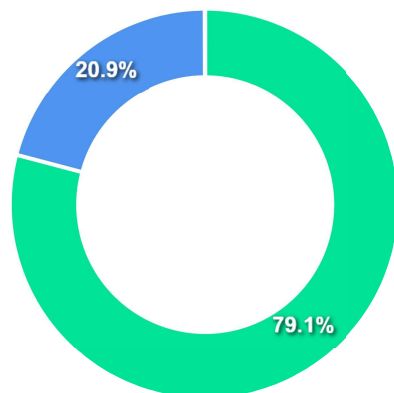
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,86%	10,61%	2,64%	5,35%	10,61%	24,97%	0,05%	0,11%
Benchmark	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	8.984.217,26	79.10%
Operação compromissada	2.368.807,74	20.86%
Valores a pagar/receber	2.858,58	0.03%
Derivativos	2.099,24	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2027	2.368.807,74	20,86	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	1.500.361,84	13,21	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	1.419.869,01	12,50	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/06/2030 (BRSTNCLF1RQ4)	1.044.068,37	9,19	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	793.067,29	6,98	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026 (BRSTNCLTN848)	656.780,68	5,78	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2029 (BRSTNCLF1RM3)	624.547,17	5,50	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	616.989,46	5,43	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	615.634,40	5,42	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2027 (BRSTNCLTN871)	590.496,26	5,20	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	586.085,71	5,16	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2030 (BRSTNCLTN8A7)	351.231,99	3,09	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	168.499,47	1,48	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	13.763,57	0,12	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	2.822,04	0,02	Títulos Federais
Outros Valores a receber	2.102,86	0,02	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	1.393,07	0,01	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN27	1.139,05	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN26	1.030,28	0,01	Derivativos
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	0,00	0,00	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	0,00	0,00	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	0,00	0,00	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF30	-70,10	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-637,35	-0,01	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
Taxa de Administração
0,40%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+1
Quantidade de Cotistas
177
Patrimônio Líquido Fundo
1.421.558.924,62

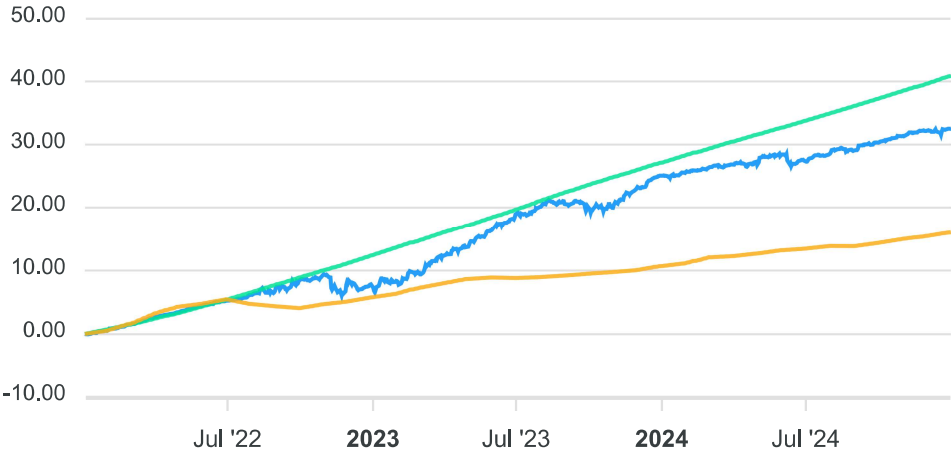
PERFIL DO FUNDO

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.

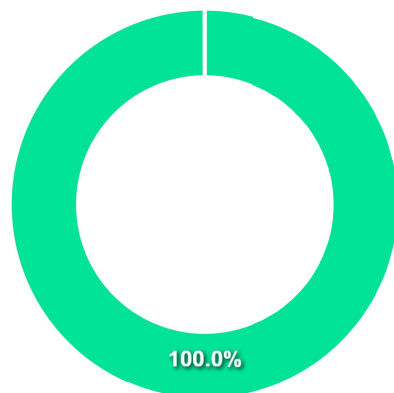
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	5,99%	1,74%	4,01%	5,99%	22,78%	1,13%	2,38%
Benchmark	0,52%	4,83%	1,48%	2,29%	4,83%	9,68%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	1.733.418,39	99,80	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ VERSO A RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFEREN...	3.035,32	0,17	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	1.042,67	0,06	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	69,54	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-649,49	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.736.453,71	99,97%
Valores a pagar/receber	462,72	0.03%

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+0
Quantidade de Cotistas
1.035
Patrimônio Líquido Fundo
4.174.516.271,82

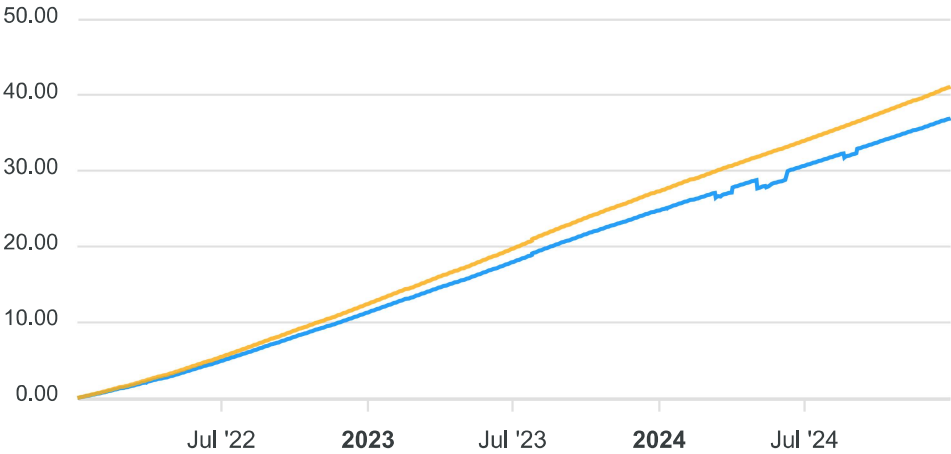
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
CDI
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Simples
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em fundos de investimento os quais investem, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

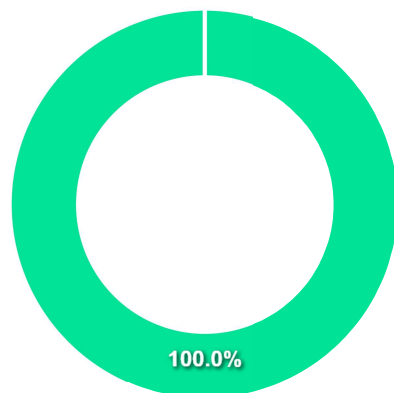
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,82%	9,77%	2,40%	4,84%	9,77%	22,87%	0,04%	0,08%
Benchmark	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP FI RENDA FIXA SIMPLES	4.174.721,34	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	5,15	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,49	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,95	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,05	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR_a_recolher	0,02	0,00	Outros
Valores a pagar / IOF_a_recolher	0,02	0,00	Outros
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-30,73	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-165,66	0,00	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	4.174.721,34	100.00%
Valores a pagar/receber	-25,24	-0.00%
Outros	-160,47	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BRADESCO S.A.
Gestão
BANCO BRADESCO S.A.
Taxa de Administração
0,40%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4
Quantidade de Cotistas
118
Patrimônio Líquido Fundo
436.366.481,99

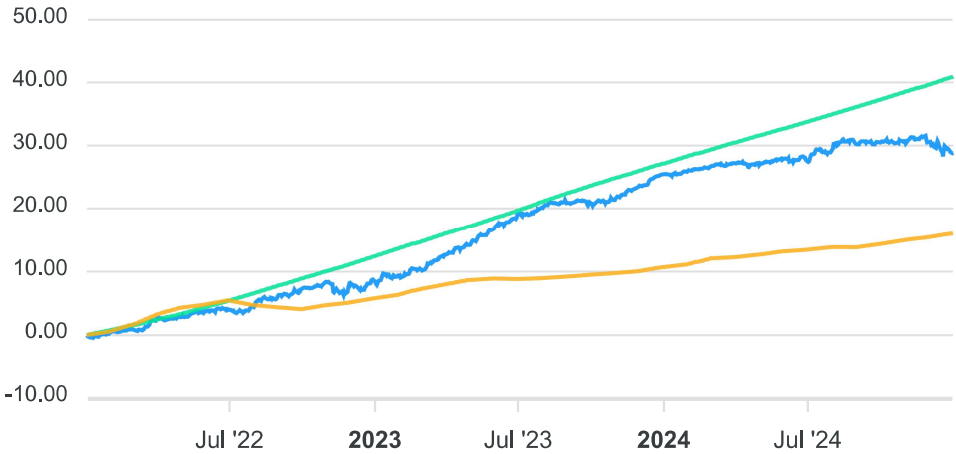
PERFIL DO FUNDO

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.

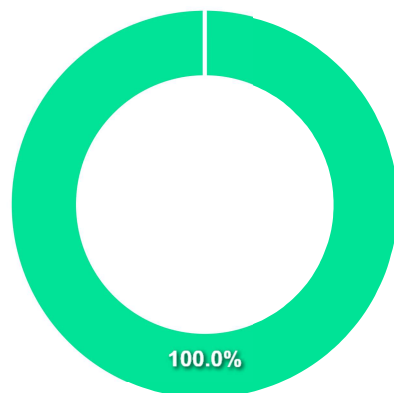
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,31%	2,72%	-1,26%	0,90%	2,72%	18,37%	2,70%	5,69%
Benchmark	0,52%	4,83%	1,48%	2,29%	4,83%	9,68%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	199.550,86	45,73	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	76.688,85	17,57	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	71.818,43	16,46	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	34.558,22	7,92	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	26.673,99	6,11	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	19.397,74	4,45	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.744,57	1,09	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	2.978,12	0,68	Fundos de Investimento
Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	125,57	0,03	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,51	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-180,38	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	436.536,36	100.04%
Valores a pagar/receber	-169,87	-0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BRADESCO S.A.
Gestão
BANCO BRADESCO S.A.
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
619
Patrimônio Líquido Fundo
15.214.543.760,15

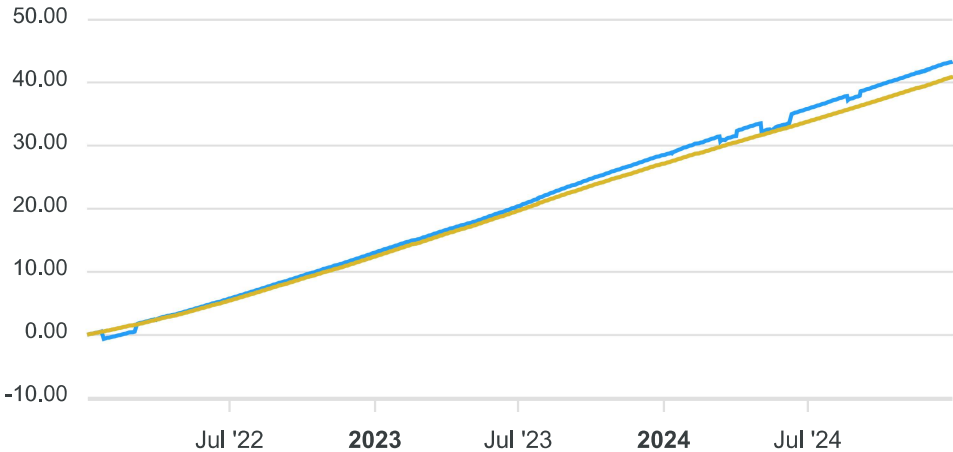
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
Selic
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação do CDI.

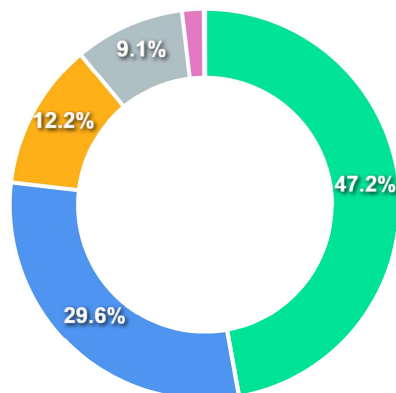
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,86%	11,52%	2,62%	5,52%	11,52%	26,71%	0,04%	0,08%
Benchmark	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	6.964.286,74	47.20%
Títulos Privados	4.372.856,28	29.64%
Títulos Federais	1.793.353,56	12.16%
Debêntures	1.345.286,67	9.12%
Fundos de Investimento	265.023,65	1.80%
Outros	15.886,46	0.11%
Derivativos	30,06	0.00%
Valores a pagar/receber	-3.276,63	-0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2026	5.230.540,53	35,45	Operação compromissada
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	1.733.746,22	11,75	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	757.554,51	5,13	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2030 (BRSTNCLF1RR2)	600.993,34	4,07	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	243.529,66	1,65	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	210.226,47	1,42	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-9...	155.578,90	1,05	Títulos Privados
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/...	148.110,78	1,00	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - ...	123.874,64	0,84	Títulos Privados
Cotas de ACR BEM BANCOS EMISSORES DE CARTÃO DE CRÉDITO RES...	120.729,52	0,82	Fundos de Investimento
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	117.371,36	0,80	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	108.846,02	0,74	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO CSF S.A. (08.357.240/0001-50) - V...	108.763,85	0,74	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	103.061,92	0,70	Títulos Privados
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/...	101.450,05	0,69	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888...	100.801,48	0,68	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	99.849,54	0,68	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2030 (BRSTNCLF1RO9)	87.134,09	0,59	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	82.717,18	0,56	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90...	72.678,89	0,49	Títulos Privados
Debênture Simples - CIEL16	69.755,52	0,47	Debêntures
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	68.149,85	0,46	Títulos Privados
Debênture Simples - CRFB16	59.999,13	0,41	Debêntures
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	59.555,10	0,40	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	57.977,60	0,39	Títulos Privados
Cotas de CLOUDWALK BIG PICTURE I SEGMENTO MEIOS DE PAGAMEN...	56.562,47	0,38	Fundos de Investimento
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	51.930,15	0,35	Títulos Privados

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA DTVM
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
180
Patrimônio Líquido Fundo
800.594.123,62

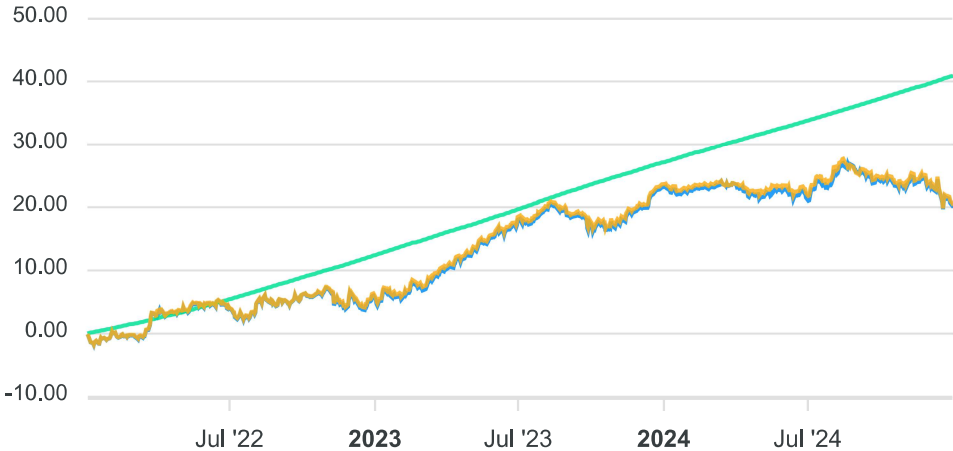
PERFIL DO FUNDO

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.

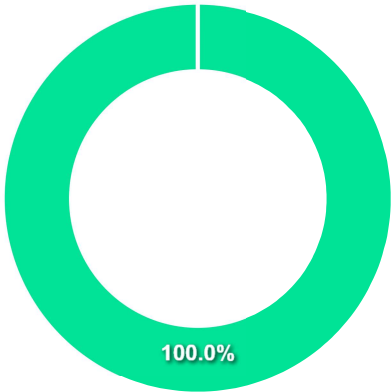
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,54%	-2,33%	-3,12%	-1,04%	-2,33%	13,27%	4,37%	9,21%
Benchmark	-2,62%	-2,44%	-3,23%	-1,36%	-2,44%	13,22%		
CDI	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER BRASIL IMA-B FI RENDA FIXA LP	800.629,52	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	0,53	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-35,92	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	800.629,52	100.00%
Valores a pagar/receber	-35,39	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
Taxa de Administração
0,18%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
458
Patrimônio Líquido Fundo
6.911.306.522,53

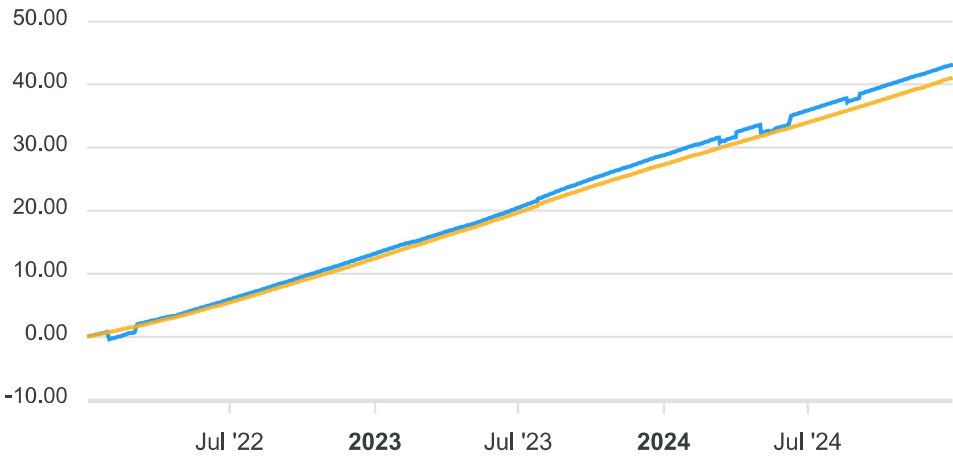
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
CDI
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em títulos da dívida pública federal, ativos financeiros de renda fixa considerados de baixo risco de crédito ou em cotas de fundos de índice que invistam nos ativos anteriormente mencionados.

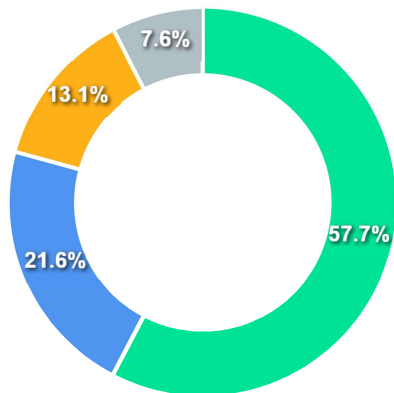
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,86%	11,18%	2,61%	5,40%	11,18%	26,27%	0,03%	0,07%
Benchmark	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	4.228.067,70	57.70%
Títulos Privados	1.579.666,71	21.56%
Títulos Federais	963.458,02	13.15%
Debêntures	559.879,53	7.64%
Derivativos	106,32	0.00%
Valores a pagar/receber	-3.966,25	-0.05%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2028	3.643.149,75	49,72	Operação compromissada
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2029	584.917,95	7,98	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	292.037,50	3,99	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2028 (BRSTNCLF1RK7)	247.248,99	3,37	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2029 (BRSTNCLF1RM3)	187.027,58	2,55	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	155.550,43	2,12	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	106.245,71	1,45	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	96.710,14	1,32	Títulos Privados
LFT - Venc.: 01/03/2028 (BRSTNCLF1RI1)	81.593,51	1,11	Títulos Federais
Letra Financeira - BANCOSEGURO S.A. (10.264.663/0001-77) -...	54.976,81	0,75	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	52.191,72	0,71	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	48.923,49	0,67	Títulos Privados
Debênture Simples - CIEL16	46.183,88	0,63	Debêntures
Letra Financeira - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305...	43.887,91	0,60	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (90.400.8...	42.292,66	0,58	Títulos Privados
Debênture Simples - HYPEA1	41.959,15	0,57	Debêntures
Debênture Simples - TLPP17	41.878,17	0,57	Debêntures
Letra Financeira - BANCO VOLKSWAGEN S.A. (59.109.165/0001-...	37.437,31	0,51	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001...	32.832,78	0,45	Títulos Privados
Letra Financeira - ITAU UNIBANCO S.A. (60.701.190/0001-04)...	32.403,39	0,44	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - ...	32.328,84	0,44	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO JOHN DEERE S.A. (91.884.981/0001-...	23.564,42	0,32	Títulos Privados
Debênture Simples - NTSD16	23.549,50	0,32	Debêntures
Debênture Simples - TOTS15	23.358,28	0,32	Debêntures
Letra Financeira - BANCO DE LAGE LANDEN BRASIL S.A. (05.04...	22.945,12	0,31	Títulos Privados
Debênture Simples - PASS12	21.672,05	0,30	Debêntures
Debênture Simples - NTSD26	21.515,78	0,29	Debêntures

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES
MOBILIARIOS 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
490

Patrimônio Líquido Fundo
3.156.991.525,99

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

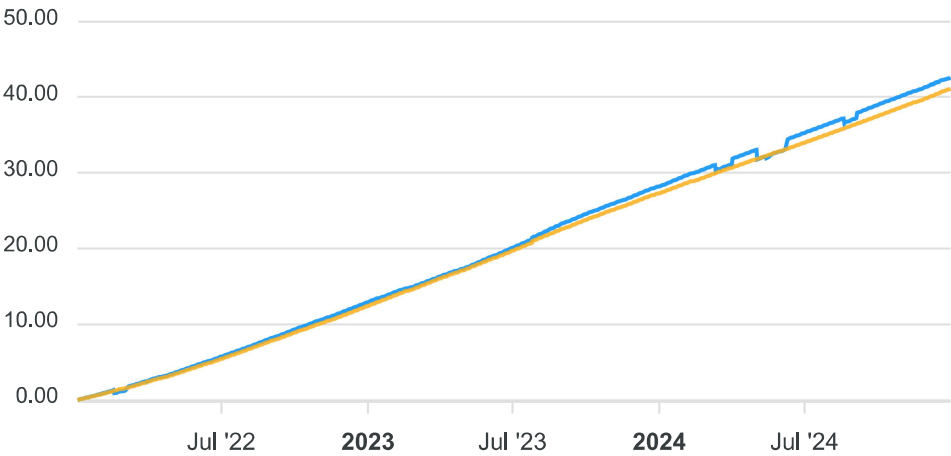
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

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.

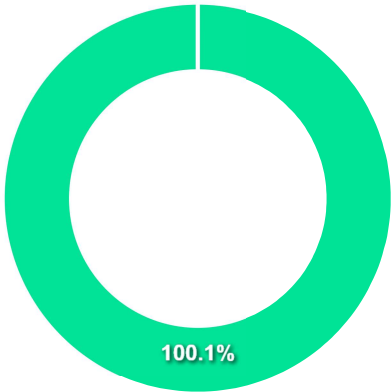
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,84%	11,18%	2,58%	5,40%	11,18%	26,01%	0,05%	0,10%
Benchmark	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	3.332.718,04	100,09	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	7,55	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-2.878,05	-0,09	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	3.332.718,04	100.09%
Valores a pagar/receber	-2.865,50	-0.09%

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
963
Patrimônio Líquido Fundo
573.702.274,63

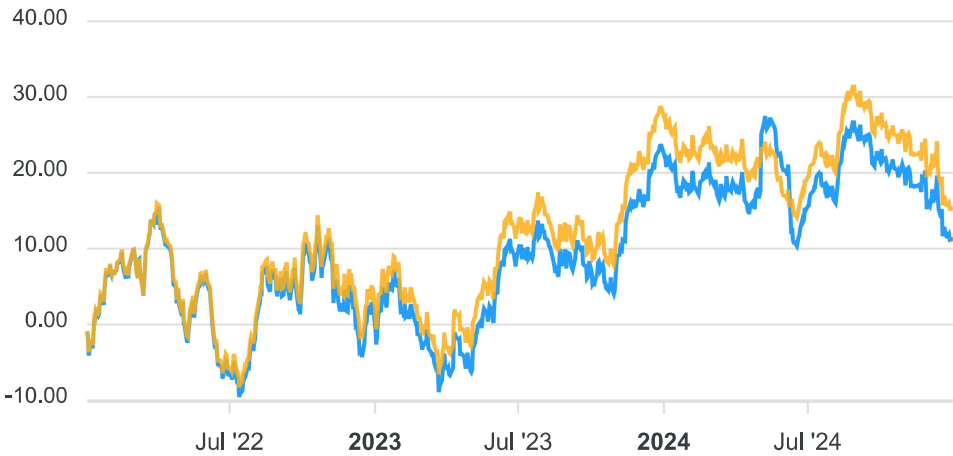
PERFIL DO FUNDO

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.

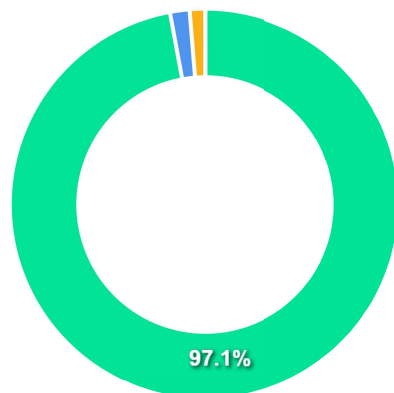
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-4,26%	-9,99%	-8,56%	-3,27%	-9,99%	8,22%	9,06%	19,07%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	556.944,85	97.09%
Operação compromissada	9.288,19	1.62%
Valores a pagar/receber	7.408,93	1.29%
Outros	14,05	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	62.670,31	10,92	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	43.134,86	7,52	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	37.372,50	6,51	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	30.312,13	5,28	Ações
WEG ON NM - WEGE3	21.697,97	3,78	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	18.614,91	3,24	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	18.396,07	3,21	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	16.426,84	2,86	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	15.691,05	2,74	Ações
B3 ON NM - B3SA3	15.637,76	2,73	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	14.232,65	2,48	Ações
EMBRAER ON NM - EMBR3	12.148,28	2,12	Ações
JBS ON NM - JBSS3	11.786,61	2,05	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	11.024,58	1,92	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	9.481,96	1,65	Ações
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/06/2030	9.288,19	1,62	Operação compromissada
PETRORIO ON NM - PRIO3	9.118,07	1,59	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	9.024,96	1,57	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	8.298,04	1,45	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	7.864,52	1,37	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	7.628,18	1,33	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7.264,94	1,27	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	5.596,41	0,98	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RADL3	5.255,58	0,92	Ações
KLABIN S.A. UNT N2 - KLBN11	5.026,28	0,88	Ações
ENEVA ON NM - ENEV3	4.864,86	0,85	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	4.830,70	0,84	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BRADESCO S.A.
Gestão
BANCO BRADESCO S.A.
Taxa de Administração
0,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+3
Quantidade de Cotistas
44
Patrimônio Líquido Fundo
201.922.608,18

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.

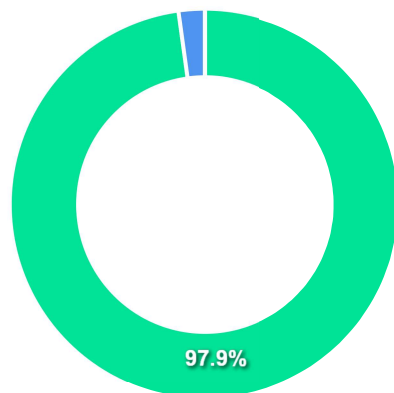
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-4,20%	-10,37%	-8,71%	-2,86%	-10,37%	9,73%	9,14%	19,25%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	197.584,47	97.85%
Operação compromissada	4.387,47	2.17%
Outros	24,31	0.01%
Valores a pagar/receber	-73,64	-0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	16.899,32	8,37	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	12.793,60	6,34	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	8.335,94	4,13	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	6.777,13	3,36	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	5.963,52	2,95	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	5.577,28	2,76	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	5.406,61	2,68	Ações
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2029	4.387,47	2,17	Operação compromissada
WEG ON NM - WEGE3	4.349,20	2,15	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	4.315,44	2,14	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	4.230,14	2,09	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	3.842,28	1,90	Ações
JBS ON NM - JBSS3	3.760,28	1,86	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	3.503,34	1,73	Ações
AMBEV S.A. ON - ABEV3	3.426,98	1,70	Ações
EMBRAER ON NM - EMBR3	3.358,59	1,66	Ações
Outros Valores a receber	3.271,83	1,62	Valores a pagar/receber
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	3.253,34	1,61	Ações
B3 ON NM - B3SA3	3.074,68	1,52	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	2.834,09	1,40	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	2.773,29	1,37	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3	2.705,54	1,34	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	2.583,78	1,28	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - WEGE3	2.456,29	1,22	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITSA4	2.352,50	1,17	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	2.290,05	1,13	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	2.242,91	1,11	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA
Gestão
BANCO BRADESCO S.A.
Taxa de Administração
1,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4
Quantidade de Cotistas
108
Patrimônio Líquido Fundo
224.524.891,97

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.

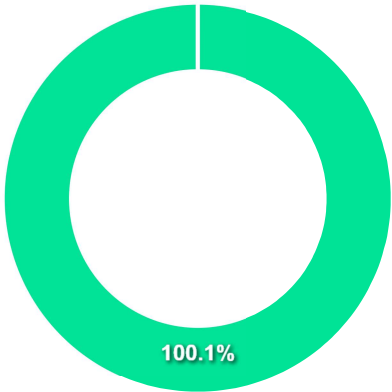
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-5,86%	-17,68%	-10,86%	-5,01%	-17,68%	-7,38%	8,64%	18,19%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL FIAÇÕES	224.744,08	100,10	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	188,68	0,08	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-417,87	-0,19	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	224.744,08	100.10%
Valores a pagar/receber	-219,19	-0.10%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM
Gestão
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM
Taxa de Administração
3,00%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4 ou D+33
Quantidade de Cotistas
1.434
Patrimônio Líquido Fundo
823.495.575,02
Patrimônio Líquido Master
1.149.535.662,64

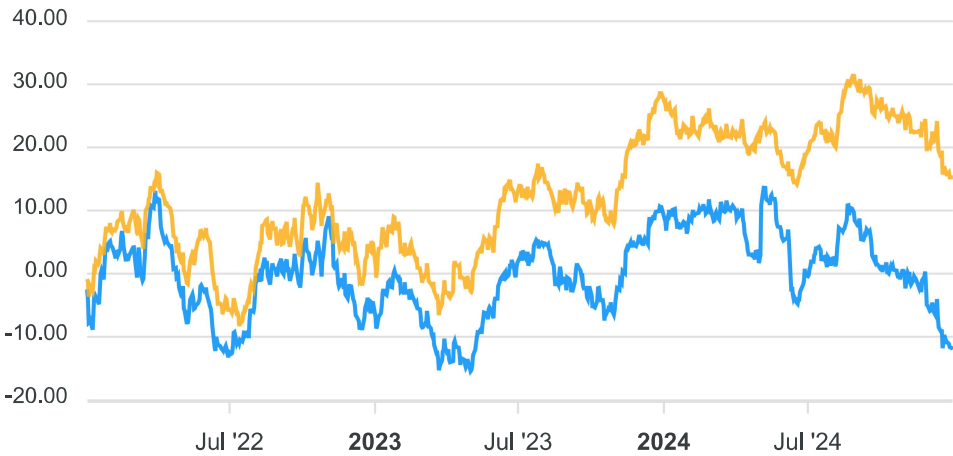
PERFIL DO FUNDO

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.

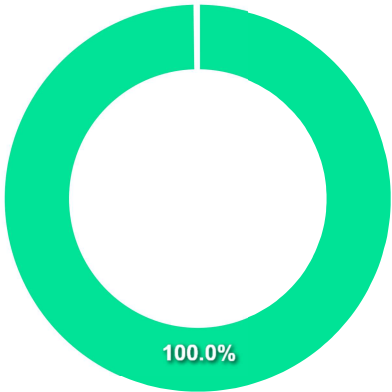
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,33%	-20,38%	-12,73%	-11,80%	-20,38%	-7,79%	9,72%	20,47%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FIAÇÃOE...	1.149.370,87	100,00	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2026	2.341,48	0,20	Operação compromissada
Outros Valores a receber	495,46	0,04	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-2.852,46	-0,25	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.149.370,87	100.00%
Operação compromissada	2.341,48	0.20%
Valores a pagar/receber	-2.357,00	-0.21%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA DTVM
Taxa de Administração
1,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+25
Quantidade de Cotistas
796
Patrimônio Líquido Fundo
434.246.813,13

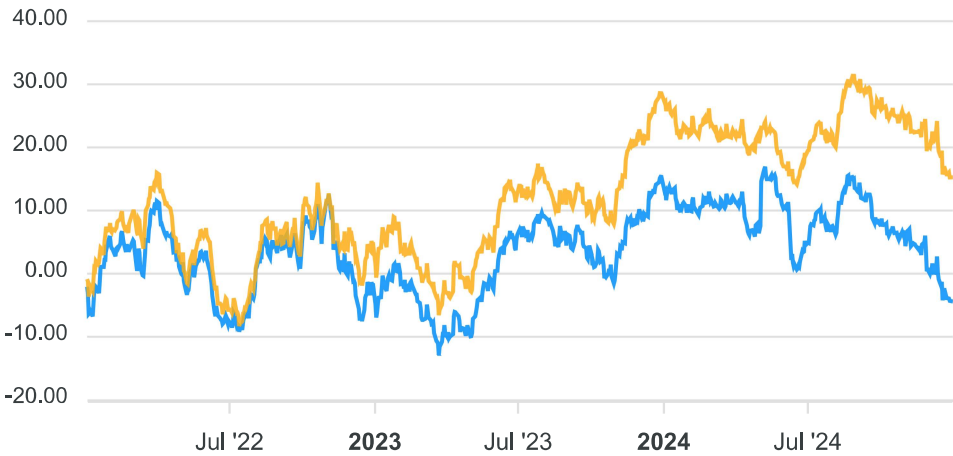
PERFIL DO FUNDO

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.

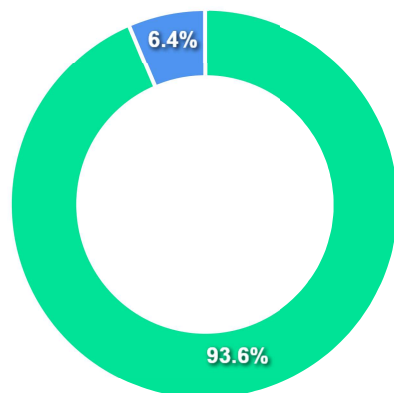
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-5,05%	-17,12%	-11,31%	-8,54%	-17,12%	-2,91%	9,04%	19,05%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	489.870,06	93,60%
Valores a pagar/receber	33.491,32	6,40%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de NAVI INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	49.778,37	10,13	Fundos de Investimento
Cotas de CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIF	44.947,90	9,15	Fundos de Investimento
Cotas de GUEPARDO INSTITUCIONAL FIF CIC AÇÕES	43.765,35	8,91	Fundos de Investimento
Cotas de REAL INVESTOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	43.200,60	8,79	Fundos de Investimento
Cotas de OCEANA SELECTION 30 E FIC AÇÕES	42.578,45	8,67	Fundos de Investimento
Cotas de PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	42.526,99	8,65	Fundos de Investimento
Cotas de SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FI...	41.230,88	8,39	Fundos de Investimento
Cotas de TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	39.866,63	8,11	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	34.219,41	6,96	Valores a pagar/receber
Cotas de OCCAM FIC AÇÕES	31.132,46	6,34	Fundos de Investimento
Cotas de TRUXT C VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	25.150,95	5,12	Fundos de Investimento
Cotas de ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	23.335,61	4,75	Fundos de Investimento
Cotas de BRASIL CAPITAL 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	22.382,62	4,56	Fundos de Investimento
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	22.041,88	4,49	Fundos de Investimento
Cotas de MOAT CAIXA AÇÕES FIC AÇÕES	9.502,89	1,93	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	8.428,50	1,72	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-728,10	-0,15	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA DTVM
Taxa de Administração
1,50%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4
Quantidade de Cotistas
2.248
Patrimônio Líquido Fundo
240.328.864,41

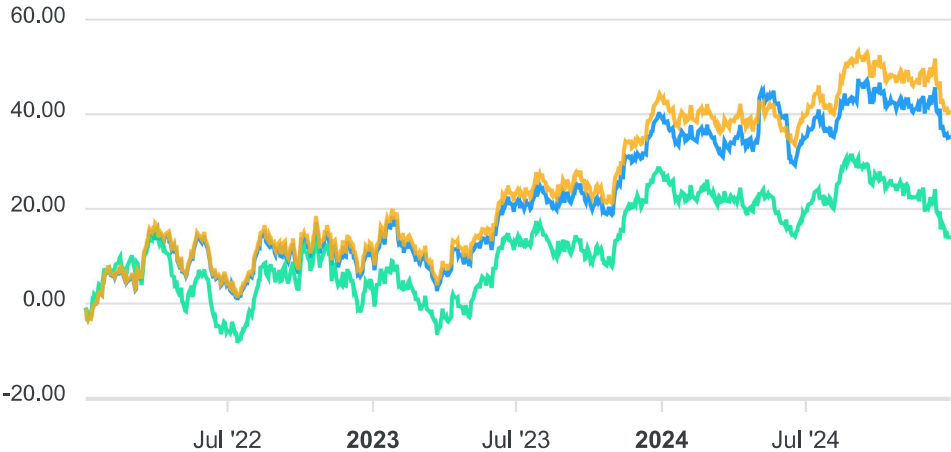
PERFIL DO FUNDO

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.

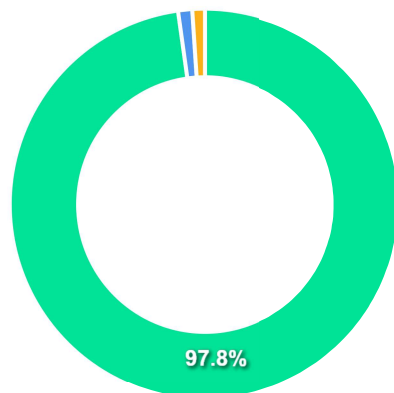
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-4,77%	-3,52%	-6,61%	0,35%	-3,52%	20,60%	8,36%	17,60%
Benchmark	-4,89%	-2,62%	-6,59%	0,81%	-2,62%	23,51%		
IBOVESPA	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	248.877,42	97.78%
Valores a pagar/receber	2.970,81	1.17%
Fundos de Investimento	2.668,05	1.05%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
GERDAU PN N1 - GGBR4	16.330,34	6,42	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	13.420,50	5,27	Ações
VALE ON N1 - VALE3	13.102,06	5,15	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	12.955,21	5,09	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	12.069,98	4,74	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	9.940,20	3,91	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	8.844,17	3,48	Ações
SANTOS BRP ON NM - STBP3	8.503,51	3,34	Ações
KLABIN S.A. UNT N2 - KLBN11	8.130,86	3,19	Ações
JBS ON NM - JBSS3	7.534,91	2,96	Ações
TELEF BRASIL ON - VIVT3	6.873,38	2,70	Ações
ISA ENERGIA PN N1 - ISAE4	6.849,36	2,69	Ações
SID NACIONAL ON - CSNA3	6.847,78	2,69	Ações
TIM ON NM - TIMS3	6.720,91	2,64	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	6.586,89	2,59	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	6.283,52	2,47	Ações
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	6.221,51	2,44	Ações
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	6.207,22	2,44	Ações
TAESA UNT N2 - TAEE11	6.170,29	2,42	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	5.851,48	2,30	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	5.823,22	2,29	Ações
CEMIG ON N1 - CMIG3	5.811,36	2,28	Ações
SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	5.245,27	2,06	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	5.075,67	1,99	Ações
FLEURY ON NM - FLRY3	5.059,80	1,99	Ações
SANEPAR PN - SAPR4	5.049,80	1,98	Ações
CSNMINERACAOON N2 - CMIN3	4.858,13	1,91	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
1.753
Patrimônio Líquido Fundo
1.101.963.255,55

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.

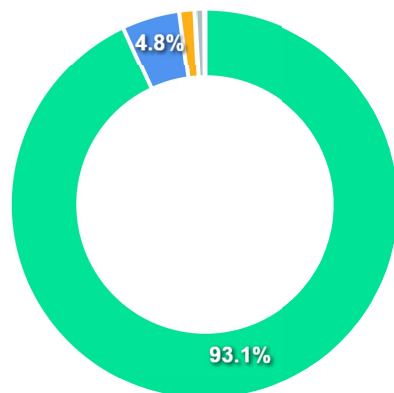
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-3,12%	-10,13%	-6,29%	-0,43%	-10,13%	7,47%	4,33%	9,11%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	1.299.001,67	93.15%
Operação compromissada	66.842,65	4.79%
Valores a pagar/receber	17.680,59	1.27%
Brazilian Depositary Receipts	10.210,14	0.73%
Títulos Federais	1.501,54	0.11%
Derivativos	-634,99	-0.05%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	66.842,65	4,79	Operação compromissada
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	38.978,53	2,79	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	38.037,85	2,73	Ações
PORTO SEGURO ON NM - PSSA3	28.423,55	2,04	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	28.001,51	2,01	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	27.958,98	2,00	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	26.739,56	1,92	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - SBSP3	25.351,78	1,82	Ações
TIM ON NM - TIMS3	23.148,72	1,66	Ações
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	22.143,02	1,59	Ações
SANEPAR UNT N2 - SAPR11	22.110,23	1,59	Ações
ABC BRASIL PN N2 - ABCB4	22.021,31	1,58	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - UGPA3	21.504,01	1,54	Ações
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	21.346,68	1,53	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	19.764,79	1,42	Ações
CURY S.A. ON NM - CURY3	19.712,12	1,41	Ações
WILSON SONS ON NM - PORT3	19.687,04	1,41	Ações
VALE ON N1 - VALE3	18.840,84	1,35	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - JBSS3	17.676,67	1,27	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	16.508,65	1,18	Ações
COPASA ON NM - CSMG3	15.639,38	1,12	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TAEE11	15.240,70	1,09	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	14.801,30	1,06	Ações
NEOENERGIA ON ATZ NM - NEOE3	14.416,82	1,03	Ações
GPS ON NM - GGPS3	14.394,50	1,03	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - EGIE3	14.026,91	1,01	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - WEGE3	13.841,44	0,99	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão	ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
Taxa de Administração	1,90%
Taxa de Performance	20,00%
Disponibilidade de Resgate	D+24
Quantidade de Cotistas	15.797
Patrimônio Líquido Fundo	1.188.970.075,54
Patrimônio Líquido Master	1.364.461.895,51

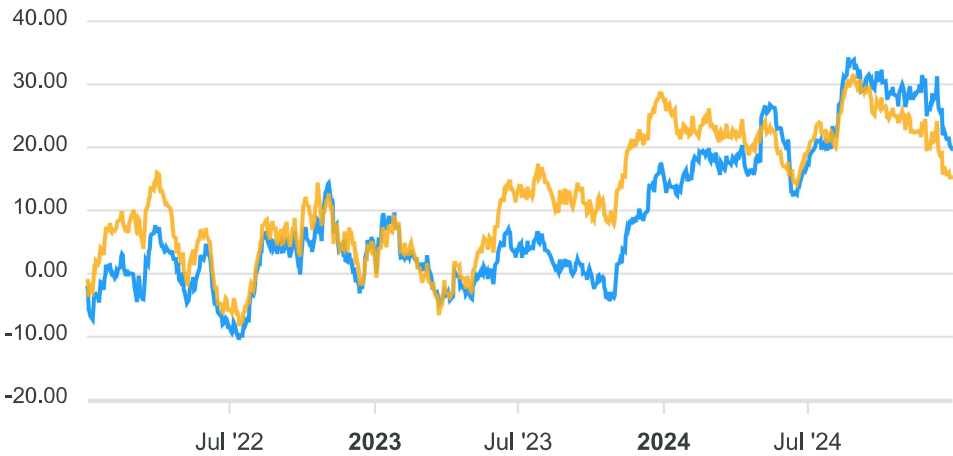
PERFIL DO FUNDO

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 FIAÇÕES, CNPJ: 18.138.837/0001-67.

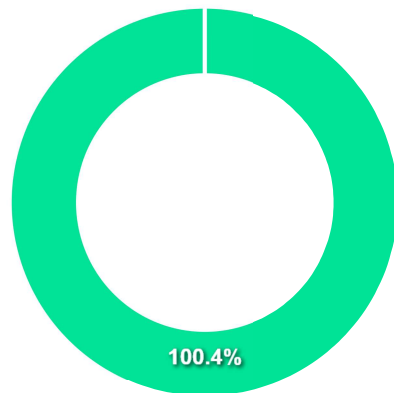
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-5,05%	2,04%	-8,21%	2,87%	2,04%	13,72%	9,12%	19,21%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ DUNAMIS MASTER RESP LIMITADA FIF AÇÕES	1.261.137,94	100,15	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	3.209,95	0,25	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	1.442,05	0,11	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	70,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-6.571,41	-0,52	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.264.347,89	100.40%
Valores a pagar/receber	-5.059,37	-0.40%

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
13
Patrimônio Líquido Fundo
72.547.559,21

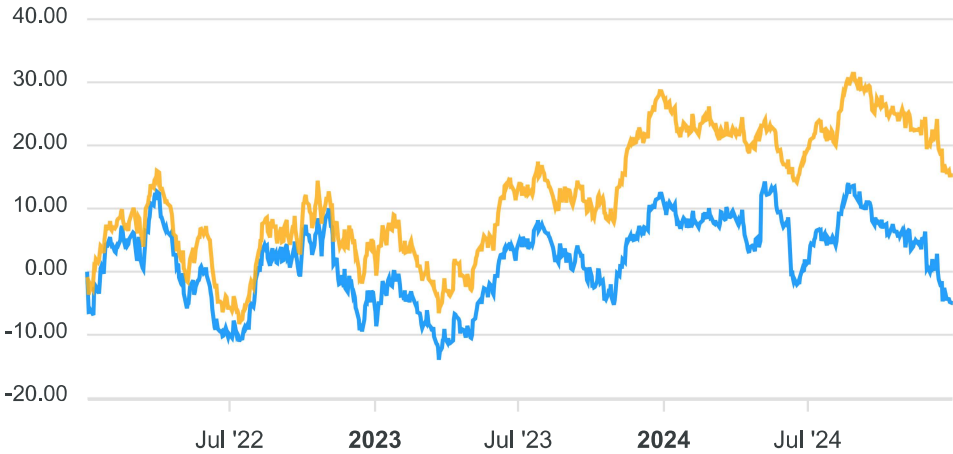
PERFIL DO FUNDO

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.

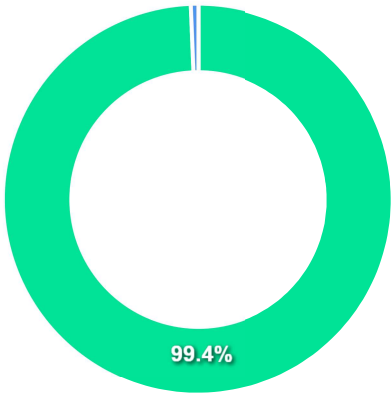
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-5,66%	-15,44%	-11,52%	-5,94%	-15,44%	-2,00%	10,00%	21,05%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
STOR x FUNDO	112.207,26	99,39	Derivativos
Cotas de ITAÚ CAIXA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	725,24	0,64	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	40,01	0,04	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	1,68	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-77,10	-0,07	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Derivativos	112.207,26	99,39%
Fundos de Investimento	725,24	0.64%
Valores a pagar/receber	-35,41	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
Taxa de Administração
2,50%
Taxa de Performance
20,00%
Disponibilidade de Resgate
D+24
Quantidade de Cotistas
42
Patrimônio Líquido Fundo
70.841.619,39
Patrimônio Líquido Master
109.521.621,08

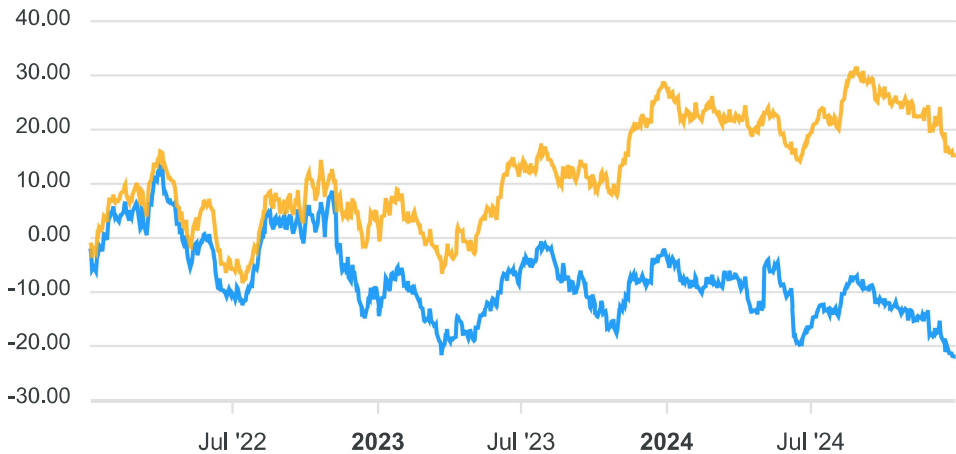
PERFIL DO FUNDO

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.

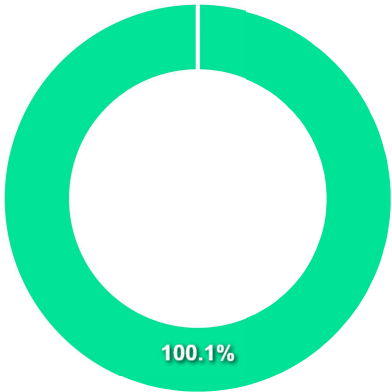
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-5,31%	-20,20%	-11,44%	-6,16%	-20,20%	-14,29%	9,20%	19,38%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ PHOENIX RESP LIMITADA FIF AÇÕES	75.049,11	99,76	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	284,25	0,38	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	30,00	0,04	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	2,52	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-139,45	-0,19	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	75.333,37	100.14%
Valores a pagar/receber	-106,93	-0.14%

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
1.939
Patrimônio Líquido Fundo
37.940.487,92

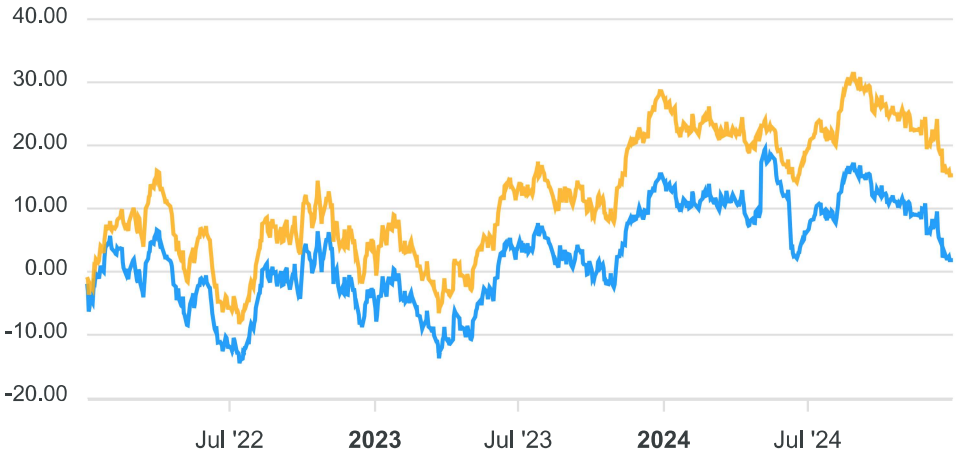
PERFIL DO FUNDO

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.

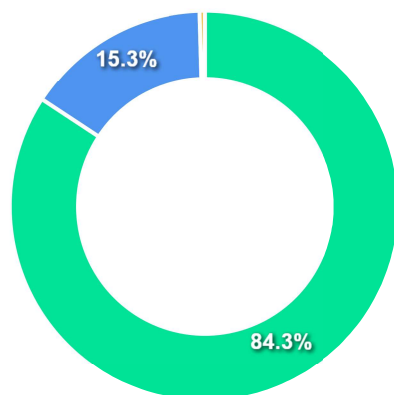
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-4,52%	-11,79%	-9,26%	-3,98%	-11,79%	4,70%	8,61%	18,13%
Benchmark	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	55.008,73	84.28%
Operação compromissada	9.996,97	15.32%
Valores a pagar/receber	284,89	0.44%
Outros	2,33	0.00%
Derivativos	-24,57	-0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2029	9.996,97	15,32	Operação compromissada
VALE ON N1 - VALE3	5.767,79	8,84	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	5.039,76	7,72	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	3.262,70	5,00	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	2.914,63	4,47	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	2.318,43	3,55	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	2.208,36	3,38	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	2.134,87	3,27	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	1.652,73	2,53	Ações
WEG ON NM - WEGE3	1.493,53	2,29	Ações
B3 ON NM - B3SA3	1.251,33	1,92	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	1.246,01	1,91	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	1.225,28	1,88	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	1.155,89	1,77	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	1.109,67	1,70	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	1.079,40	1,65	Ações
JBS ON NM - JBSS3	1.064,91	1,63	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	1.006,66	1,54	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	957,77	1,47	Ações
AMBEV S.A. ON - ABEV3	939,04	1,44	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	907,54	1,39	Ações
ENEVA ON NM - ENEV3	845,82	1,30	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	832,17	1,27	Ações
VIBRA ON NM - VBRR3	708,51	1,09	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	694,71	1,06	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	683,74	1,05	Ações
BRF SA ON NM - BRFS3	664,23	1,02	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão
CAIXA DTVM
Taxa de Administração
0,70%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+4
Quantidade de Cotistas
455
Patrimônio Líquido Fundo
3.298.833.640,03

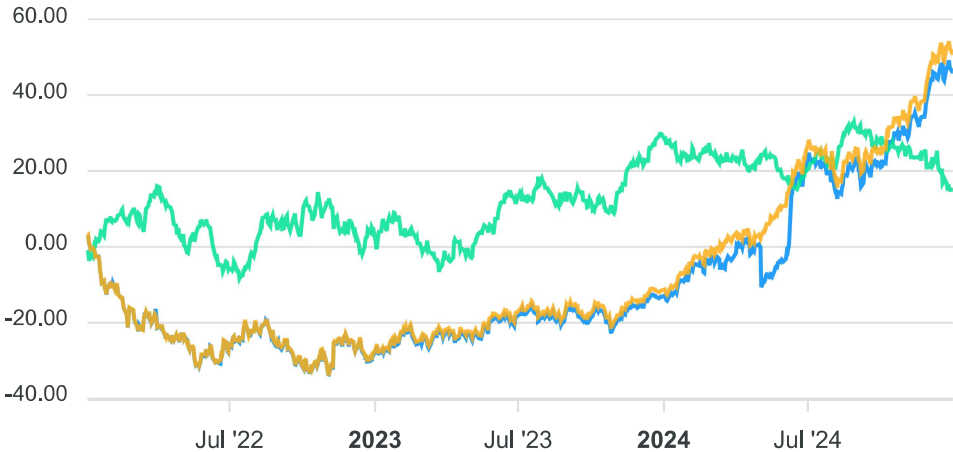
PERFIL DO FUNDO

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.

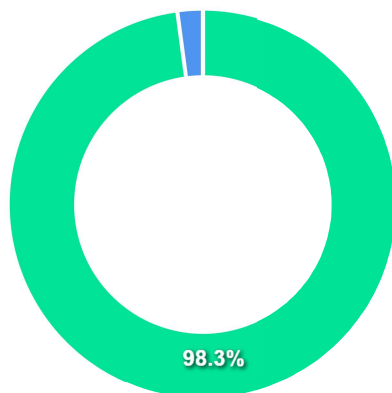
COMPARATIVO

31/12/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	4,40%	68,28%	19,72%	20,62%	68,28%	110,22%	9,19%	19,35%
Benchmark	4,64%	70,59%	20,17%	20,93%	70,59%	115,52%		
IBOVESPA	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depositary Receipts	3.031.589,07	98.33%
Fundos de Investimento	65.542,99	2.13%
Outros	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-14.190,66	-0.46%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
APPLE INC - AAPL34	298.437,51	9,73	Brazilian Depositary Rece...
NVIDIA CORP - NVDC34	284.713,40	9,28	Brazilian Depositary Rece...
MICROSOFT CORPORATION - MSFT34	257.266,08	8,38	Brazilian Depositary Rece...
AMAZONCOM, INC - AMZO34	181.301,36	5,91	Brazilian Depositary Rece...
META PLATFORMS, INC - M1TA34	103.672,80	3,38	Brazilian Depositary Rece...
TESLA, INC - TSLA34	92.636,64	3,02	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL34	81.803,40	2,67	Brazilian Depositary Rece...
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD - TSMC34	79.927,56	2,60	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET INC - GOGL35	77.080,65	2,51	Brazilian Depositary Rece...
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIA...	65.542,99	2,14	Fundos de Investimento
ELI LILLY AND COMPANY - LILY34	62.969,60	2,05	Brazilian Depositary Rece...
BROADCOM INC - AVGO34	62.760,22	2,05	Brazilian Depositary Rece...
WALMART INC - WALM34	62.093,47	2,02	Brazilian Depositary Rece...
JPMORGAN CHASE & CO - JPMC34	59.434,84	1,94	Brazilian Depositary Rece...
UNITEDHEALTH GROUP INC - UNHH34	46.844,47	1,53	Brazilian Depositary Rece...
EXXON MOBIL CORPORATION - EXXO34	43.715,99	1,42	Brazilian Depositary Rece...
ORACLE CORPORATION - ORCL34	42.625,92	1,39	Brazilian Depositary Rece...
MASTERCARD INCORPORATED - MSCD34	40.693,70	1,33	Brazilian Depositary Rece...
COSTCO WHOLESALE CORPORATION - COWC34	36.013,55	1,17	Brazilian Depositary Rece...
PROCTER & GAMBLE COMPANY - PGCO34	34.985,33	1,14	Brazilian Depositary Rece...
THE HOME DEPOT, INC - HOME34	34.116,81	1,11	Brazilian Depositary Rece...
NETFLIX, INC - NFLX34	31.576,08	1,03	Brazilian Depositary Rece...
BANK OF AMERICA CORPORATION - BOAC34	30.818,89	1,00	Brazilian Depositary Rece...
NOVO NORDISK S.A. - N1VO34	29.519,99	0,96	Brazilian Depositary Rece...
SALESFORCE, INC - SSFO34	26.734,54	0,87	Brazilian Depositary Rece...
ABBVIE INC - ABBV34	25.913,43	0,84	Brazilian Depositary Rece...
CHEVRON CORPORATION - CHVX34	24.710,48	0,81	Brazilian Depositary Rece...

