

2023

Relatório

Mensal, 4º trimestre e ano de 2023

Dezembro

Análise dos Investimentos

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

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	576.232,82	1,63%	5.798.399.930,42	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.031.715,21	2,91%	1.649.727.443,32	0,06%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	514.677,19	1,45%	5.283.374.941,87	0,01%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.401.015,60	3,96%	4.067.997.534,34	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.271.363,49	9,24%	3.596.758.160,15	0,09%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.868.263,93	5,28%	1.451.468.758,30	0,13%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.045.233,52	14,25%	2.351.648.712,32	0,21%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	485.430,91	1,37%	1.212.026.255,59	0,04%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	92.255,42	0,26%	4.049.178.389,19	0,00%	7º III a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.612.726,72	15,85%	936.281.150,45	0,60%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.936.317,58	8,29%	16.475.113.370,57	0,02%	7º III a
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.824.127,45	5,15%	10.724.175.764,47	0,02%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.357.189,54	9,48%	1.298.723.695,54	0,26%	7º III a
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.667.218,28	7,53%	613.943.691,61	0,43%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.368.216,92	6,69%	347.873.403,61	0,68%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.211.426,89	3,42%	424.700.729,97	0,29%	8º I
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	396.731,33	1,12%	114.042.233,53	0,35%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	745.047,52	2,10%	1.995.875.754,00	0,04%	9º III

Investimentos

\$ 35.405.190,32

Disponibilidades Financeiras

\$ 2.148,40

Total Carteira

\$ 35.407.338,72

Governança (Pró Gestão)

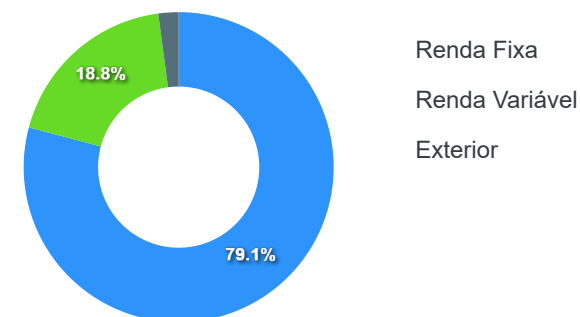
📄

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	40,09%	14.193.932,67 59,91% 21.213.406,05
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	39,04%	13.822.616,71 20,96% 7.421.786,52
8º I - Fundos de Ações	30,00%	18,76%	6.643.593,42 11,24% 3.978.608,20
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,10%	745.047,52 7,90% 2.795.686,35

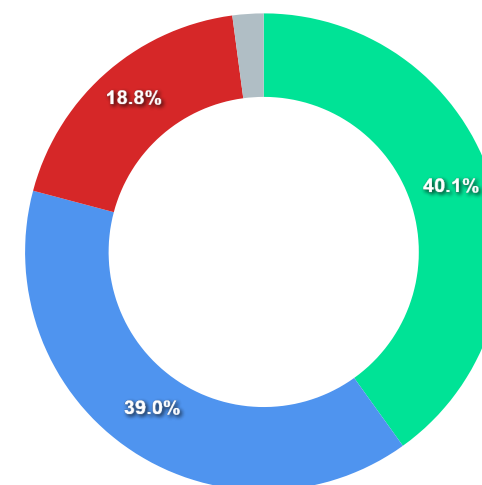
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

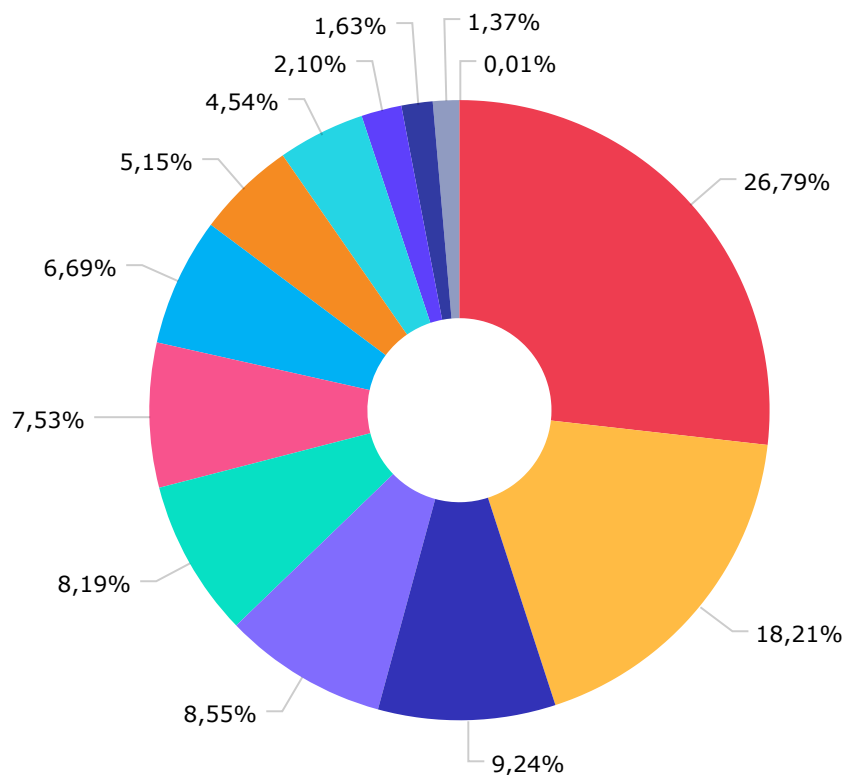


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	35.407.338,72
7º I b - FI 100% Títulos TN	40,09%	0,00%	50,00%	100,00%	21.213.406,05
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	35.407.338,72
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.770.366,94
7º III a - FI Referenciados RF	39,04%	0,00%	15,00%	60,00%	7.421.786,52
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	21.244.403,23
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	7.081.467,74
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.770.366,94
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.770.366,94
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.770.366,94

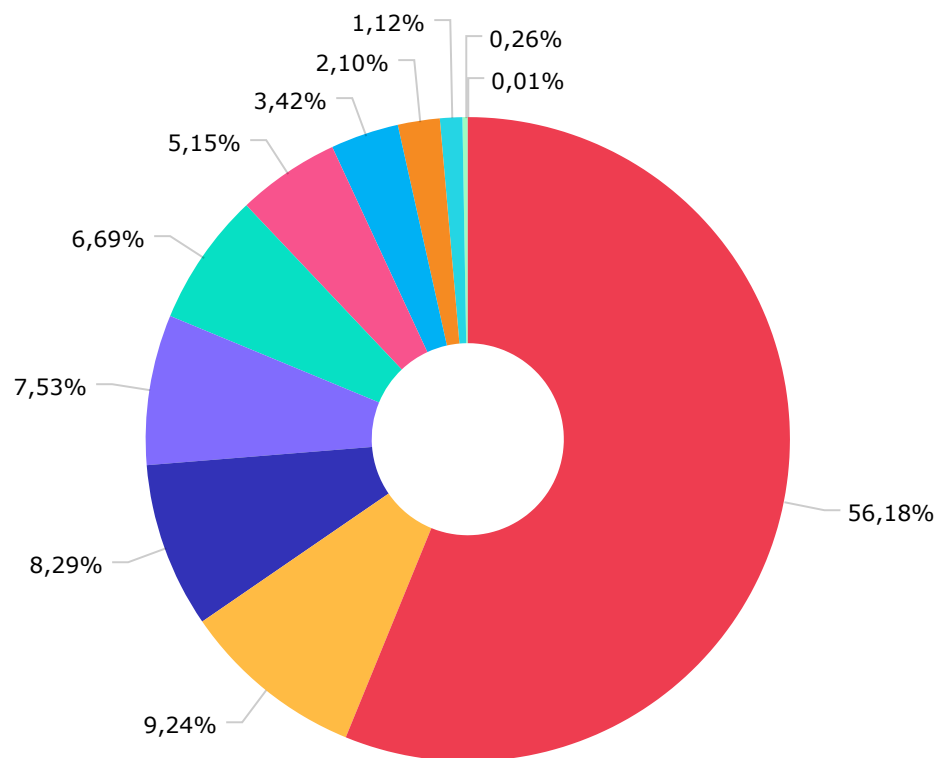
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	18,76%	0,00%	19,00%	30,00%	3.978.608,20
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	10.622.201,62
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.540.733,87
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.540.733,87
9º III - Ações - BDR Nível I	2,10%	0,00%	9,00%	10,00%	2.795.686,35
10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	3.540.733,87
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.770.366,94
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.770.366,94
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.770.366,94
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.770.366,94

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03		
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,90	12,98	2,83	6,15	12,98	27,20	0,01	0,02
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82	11,93	2,58	5,62	11,93	24,53	0,01	0,02
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	2,84	26,33	7,77	9,72	26,33	-9,11		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,59	24,92	7,65	9,07	24,92	-10,73	4,08	8,59
IBOVESPA - BENCHMARK	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01		
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	3,24	65,59	5,86	23,21	65,59	139,06	10,54	22,21
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	5,36	21,74	14,92	13,44	21,74	27,74	6,07	12,79
IDIV - BENCHMARK	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88		
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6,35	21,36	13,60	13,12	21,36	29,41	4,96	10,45
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41	11,72	2,88	4,84	11,72	22,14	0,45	0,94
IMA-B - BENCHMARK	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,77	15,98	4,76	4,21	15,98	22,96	1,48	3,12
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,74	15,77	4,71	4,04	15,77	22,83	1,46	3,08
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,74	15,77	4,70	4,00	15,77	22,78	1,47	3,09
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09		
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,44	11,86	2,91	4,62	11,86	22,56	0,49	1,02
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,93	18,90	6,40	3,86	18,90	22,53	2,38	5,01

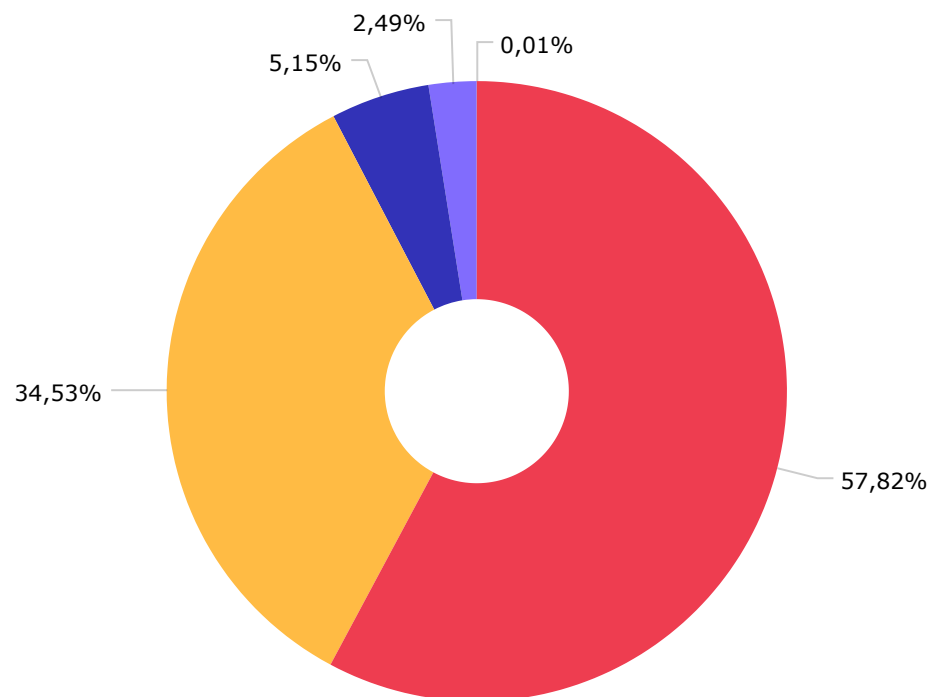
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,93	18,87	6,38	3,67	18,87	22,37	2,40	5,05
IPCA - BENCHMARK	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92	11,17	2,16	5,32	11,17		0,34	0,71
IRF-M - BENCHMARK	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46	16,32	4,33	6,17	16,32	26,46	0,66	1,40
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,46	16,06	4,33	6,05	16,06	26,02	0,66	1,39
SELIC - BENCHMARK	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03		
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88	12,74	2,74	5,98	12,74	26,34	0,01	0,02
SMLL - BENCHMARK	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	7,31	17,23	10,26	2,16	17,23	-1,38	7,55	15,90



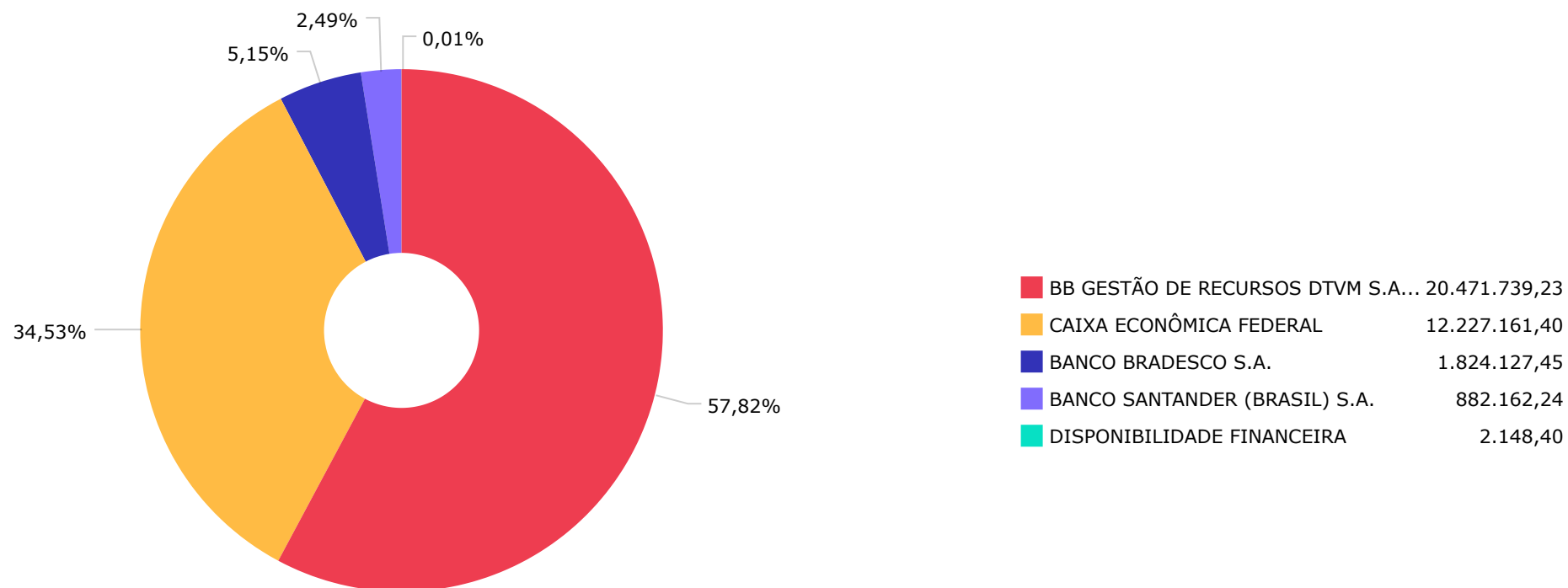
IMA-B	9.484.593,45
IRF-M	6.446.249,12
IPCA	3.271.363,49
CDI	3.028.573,00
IMA-B 5+	2.899.979,14
IDIV	2.667.218,28
SMLL	2.368.216,92
Selic	1.824.127,45
Ibovespa	1.608.158,22
Global BDRX	745.047,52
IDKA IPCA 2 Anos	576.232,82
IMA-B 5	485.430,91
Disponibilidades Financeiras	2.148,40



Renda Fixa Indexados	19.892.485,44
Renda Fixa Duração Livre Soberano	3.271.363,49
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	2.936.317,58
Ações Dividendos	2.667.218,28
Ações Small Caps	2.368.216,92
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	1.824.127,45
Ações Indexados	1.211.426,89
Ações Livre	745.047,52
Fundos de Mono Ação	396.731,33
Renda Fixa Simples	92.255,42
Disponibilidades Financeiras	2.148,40



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	20.471.739,23
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.227.161,40
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	1.824.127,45
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	882.162,24
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.148,40



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	30.350.140,81	0,00	0,00	30.710.050,23	359.909,42	359.909,42	1,19% ▲	1,19%	0,93%	0,93%	127,96%	4,40%
Fevereiro	30.710.050,23	2.306.697,51	2.884.479,40	29.954.427,78	-177.840,56	182.068,86	-0,58% ▼	0,60%	1,17%	2,11%	28,44%	3,67%
Março	29.954.427,78	577.781,89	0,00	30.901.133,23	368.923,56	550.992,42	1,21% ▲	1,82%	1,13%	3,27%	55,66%	3,13%
Abril	30.901.133,23	2.097.776,10	2.330.922,38	31.114.978,27	446.991,32	997.983,74	1,45% ▲	3,29%	0,94%	4,24%	77,59%	3,38%
Mai	31.114.978,27	233.109,87	0,00	32.243.751,42	895.663,28	1.893.647,02	2,86% ▲	6,24%	0,63%	4,90%	127,35%	3,03%
Junho	32.243.751,42	5.233.449,83	5.075.710,97	33.374.907,02	973.416,74	2.867.063,76	3,00% ▲	9,43%	0,30%	5,21%	181,00%	3,33%
Julho	33.374.907,02	1.375.103,20	1.187.722,94	34.028.591,28	466.304,00	3.333.367,76	1,39% ▲	10,95%	0,50%	5,74%	190,77%	2,73%
Agosto	34.028.591,28	88.615,30	88.615,30	33.772.782,99	-255.808,29	3.077.559,47	-0,75% ▼	10,12%	0,65%	6,43%	157,39%	2,81%
Setembro	33.772.782,99	0,00	0,00	33.576.049,20	-196.733,79	2.880.825,68	-0,58% ▼	9,48%	0,62%	7,09%	133,71%	3,28%
Outubro	33.576.049,20	2.000.000,00	2.000.000,00	33.196.494,20	-379.555,00	2.501.270,68	-1,13% ▼	8,24%	0,62%	7,76%	106,19%	3,83%
Novembro	33.196.494,20	2.191.468,44	2.191.468,44	34.447.159,77	1.250.665,57	3.751.936,25	3,77% ▲	12,32%	0,64%	8,45%	145,80%	2,72%
Dezembro	34.447.159,77	0,00	0,00	35.405.190,32	958.030,55	4.709.966,80	2,78% ▲	15,44%	0,93%	9,46%	163,21%	2,05%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	550.992,42	1,82%	3,27%
2º Trim	2.316.071,34	7,48%	1,88%
1º Sem	2.867.063,76	9,43%	5,21%
3º Trim	13.761,92	0,04%	1,79%
4º Trim	1.829.141,12	5,45%	2,21%
2º Sem	1.842.903,04	5,49%	4,04%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

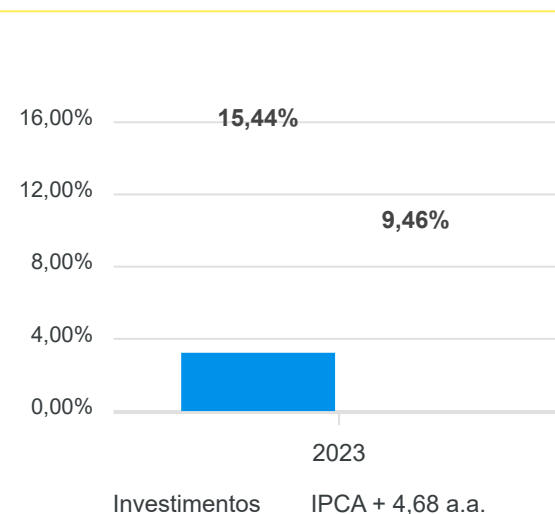
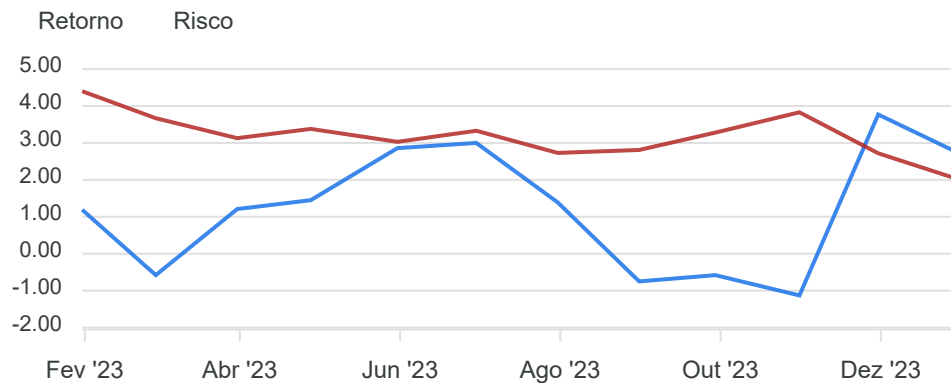
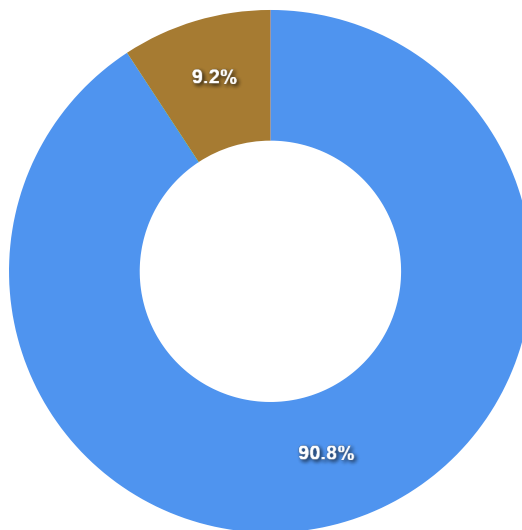


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 29/12/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	32.135.975,23	90,77
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	3.271.363,49	9,24
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENTA FIJA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	91.504,50	0,00	0,00	92.255,42	750,92	0,82% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	568.195,23	0,00	0,00	576.232,82	8.037,59	1,41% ▲	0,45%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	992.687,22	0,00	0,00	1.031.715,21	39.027,99	3,93% ▲	2,40%
BB IMA-B FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	5.462.773,99	0,00	0,00	5.612.726,72	149.952,73	2,74% ▲	1,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	500.933,95	0,00	0,00	514.677,19	13.743,24	2,74% ▲	1,46%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.380.868,45	0,00	0,00	1.401.015,60	20.147,15	1,46% ▲	0,66%
BB PERFIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.910.063,59	0,00	0,00	2.936.317,58	26.253,99	0,90% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	3.241.439,90	0,00	0,00	3.271.363,49	29.923,59	0,92% ▲	0,34%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	1.808.262,48	0,00	0,00	1.824.127,45	15.864,97	0,88% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	1.797.585,45	0,00	0,00	1.868.263,93	70.678,48	3,93% ▲	2,38%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	4.972.603,68	0,00	0,00	5.045.233,52	72.629,84	1,46% ▲	0,66%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO IMA-B LP	3.266.679,96	0,00	0,00	3.357.189,54	90.509,58	2,77% ▲	1,48%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENTA FIJA	478.532,53	0,00	0,00	485.430,91	6.898,38	1,44% ▲	0,49%
	27.472.130,93	0,00	0,00	28.016.549,38	544.418,45	1,98%	0,96%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.507.895,20	0,00	0,00	2.667.218,28	159.323,08	6,35% ▲	4,96%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.206.810,06	0,00	0,00	2.368.216,92	161.406,86	7,31% ▲	7,55%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.149.809,49	0,00	0,00	1.211.426,89	61.617,40	5,36% ▲	6,07%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	384.265,37	0,00	0,00	396.731,33	12.465,96	3,24% ▲	10,54%
-	6.248.780,12	0,00	0,00	6.643.593,42	394.813,30	6,32%	6,42%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	726.248,72	0,00	0,00	745.047,52	18.798,80	2,59% ▲	4,08%
	726.248,72	0,00	0,00	745.047,52	18.798,80	2,59%	0,00%

RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENTA FIJA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	89.894,05	97.947,59	97.947,59	92.255,42	2.361,37	1,26% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	560.076,14	0,00	0,00	576.232,82	16.156,68	2,88% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO LP	98.037,95	0,00	97.947,59	0,00	-90,36	-0,09% ▼
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.774.170,75	0,00	800.000,00	1.031.715,21	57.544,46	3,24% ▲
BB IMA-B FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	5.360.900,98	0,00	0,00	5.612.726,72	251.825,74	4,70% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	491.515,29	0,00	0,00	514.677,19	23.161,90	4,71% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.342.930,62	0,00	0,00	1.401.015,60	58.084,98	4,33% ▲
BB PERFIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.966.793,22	897.947,59	0,00	2.936.317,58	71.576,77	2,50% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	3.202.181,96	0,00	0,00	3.271.363,49	69.181,53	2,16% ▲
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	595.404,30	1.195.573,26	0,00	1.824.127,45	33.149,89	1,85% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	1.755.883,90	0,00	0,00	1.868.263,93	112.380,03	6,40% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	2.841.973,20	2.000.000,00	0,00	5.045.233,52	203.260,32	4,20% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO IMA-B LP	5.217.055,36	0,00	2.000.000,00	3.357.189,54	140.134,18	2,69% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENTA FIJA	471.711,52	0,00	0,00	485.430,91	13.719,39	2,91% ▲
	25.768.529,24	4.191.468,44	2.995.895,18	28.016.549,38	1.052.446,88	3,90%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.347.826,06	0,00	0,00	2.667.218,28	319.392,22	13,60% ▲
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.147.862,70	0,00	0,00	2.368.216,92	220.354,22	10,26% ▲
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.054.164,80	0,00	0,00	1.211.426,89	157.262,09	14,92% ▲
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	374.776,49	0,00	0,00	396.731,33	21.954,84	5,86% ▲
	5.924.630,05	0,00	0,00	6.643.593,42	718.963,37	12,14%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRABESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.190.773,22	0,00	1.195.573,26	0,00	4.800,04	0,40% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	692.116,69	0,00	0,00	745.047,52	52.930,83	7,65% ▲
	1.882.889,91	0,00	1.195.573,26	745.047,52	57.730,87	3,07%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	728.607,48	0,00	739.898,56	0,00	11.291,08	1,55% ▲
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	449.654,12	361.381,50	92.255,42	3.982,80	0,89% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.443.144,46	806.697,51	5.000.000,00	576.232,82	326.390,85	6,22% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	90.146,32	0,00	97.947,59	0,00	7.801,27	8,65% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.581.444,51	0,00	1.800.000,00	1.031.715,21	250.270,70	9,69% ▲
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.345.461,80	0,00	5.612.726,72	267.264,92	5,00% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	940.934,48	0,00	500.000,00	514.677,19	73.742,71	7,84% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.207.114,64	0,00	0,00	1.401.015,60	193.900,96	16,06% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	291.718,95	2.420.467,81	0,00	2.936.317,58	224.130,82	8,26% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.112.427,44	0,00	177.934,47	3.271.363,49	336.870,52	10,82% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.750.834,93	0,00	1.824.127,45	73.292,52	4,19% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	556.110,62	0,00	555.261,67	0,00	-848,95	-0,15% ▼
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.238.066,28	0,00	2.330.922,38	0,00	92.856,10	4,15% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.571.328,61	0,00	0,00	1.868.263,93	296.935,32	18,90% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	329.294,62	4.330.885,97	0,00	5.045.233,52	385.052,93	8,26% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.812.278,67	1.000.000,00	2.000.000,00	3.357.189,54	544.910,87	11,32% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	433.951,83	0,00	0,00	485.430,91	51.479,08	11,86% ▲
	22.336.568,91	16.104.002,14	13.563.346,17	28.016.549,38	3.139.324,50	12,62%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.197.818,69	0,00	0,00	2.667.218,28	469.399,59	21,36% ▲
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.020.160,96	0,00	0,00	2.368.216,92	348.055,96	17,23% ▲
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	995.095,27	0,00	0,00	1.211.426,89	216.331,62	21,74% ▲
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	239.590,06	0,00	0,00	396.731,33	157.141,27	65,59% ▲
	5.452.664,98	0,00	0,00	6.643.593,42	1.190.928,44	21,84%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.106.383,84	0,00	1.195.573,26	0,00	89.189,42	8,06% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.454.523,08	0,00	1.000.000,00	745.047,52	290.524,44	19,97% ▲
	2.560.906,92	0,00	2.195.573,26	745.047,52	379.713,86	14,83%

Cenário Econômico

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

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

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

Retorno dos Fundos de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 16 de janeiro de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
884

Patrimônio Líquido Fundo
5.798.399.930,42

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IDKA IPCA 2 Anos

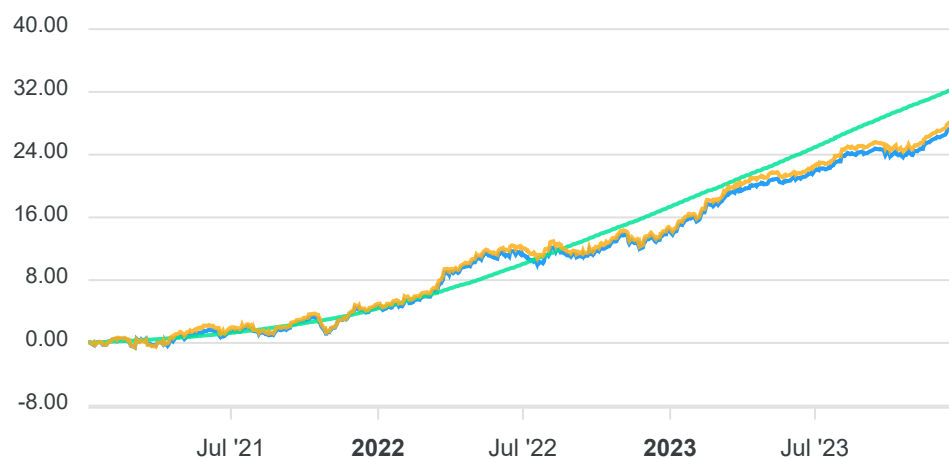
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

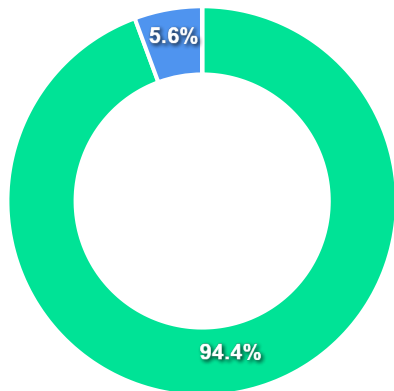
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,41%	11,72%	2,88%	4,84%	11,72%	22,14%	0,45%	0,94%
Benchmark	1,45%	12,13%	2,89%	5,00%	12,13%	22,60%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.472.134,32	94.37%
Operação compromissada	325.346,54	5.61%
Valores a pagar/receber	789,02	0.01%
Derivativos	178,22	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	3.413.462,21	58,87	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	1.850.212,61	31,91	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	325.346,54	5,61	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	165.387,92	2,85	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	43.071,59	0,74	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	884,80	0,02	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ26	135,67	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	45,93	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa Selic	16,95	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	6,77	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,34	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,02	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	-3,39	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa Cetip	-29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-45,39	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-45,95	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+2

Quantidade de Cotistas
289

Patrimônio Líquido Fundo
1.649.727.443,32

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5+

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Investe, 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.

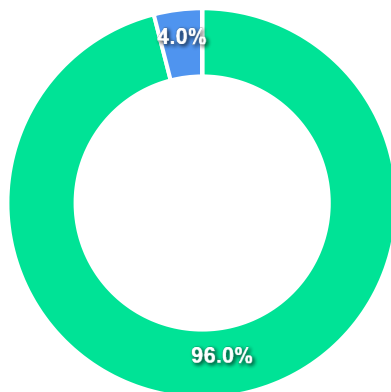
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,93%	18,87%	6,38%	3,67%	18,87%	22,37%	2,40%	5,05%
Benchmark	3,94%	19,28%	6,42%	3,80%	19,28%	23,21%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.583.766,46	96.00%
Operação compromissada	65.726,63	3.98%
Valores a pagar/receber	212,36	0.01%
Derivativos	41,38	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	353.289,41	21,42	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	246.669,76	14,95	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	218.535,98	13,25	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	215.052,27	13,04	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	183.945,33	11,15	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	132.203,84	8,01	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	80.891,73	4,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	79.415,99	4,81	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	73.762,13	4,47	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	64.427,32	3,91	Operação compromissada
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2025	1.299,31	0,08	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	242,18	0,01	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ30	41,38	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,42	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	4,24	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,03	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-12,63	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-13,05	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-14,68	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
649

Patrimônio Líquido Fundo
5.283.374.941,87

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

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

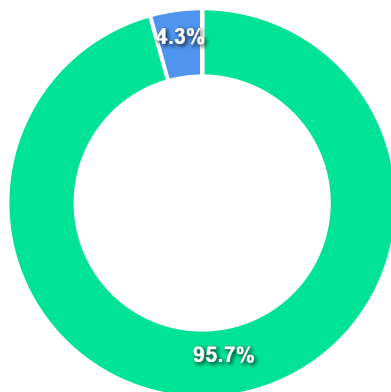
COMPARATIVO

29/12/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
633

Patrimônio Líquido Fundo
4.067.997.534,34

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IRF-M

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

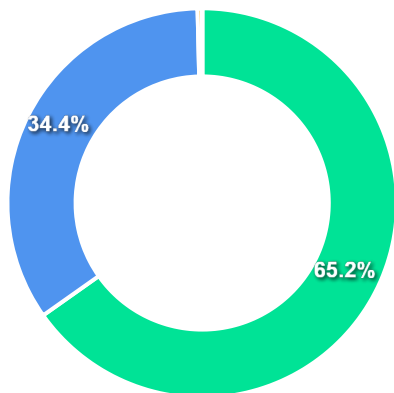
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,46%	16,06%	4,33%	6,05%	16,06%	26,02%	0,66%	1,39%
Benchmark	1,48%	16,51%	4,38%	6,28%	16,51%	26,79%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.653.902,95	65.24%
Operação compromissada	1.400.461,60	34.43%
Valores a pagar/receber	15.445,41	0.38%
Outros	0,00	0.00%
Derivativos	-1.772,16	-0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	1.400.461,60	34,43	Operação compromissada
LTN - Venc.: 01/01/2024 (BRSTNCLTN7S1)	522.766,05	12,85	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2029 (BRSTNCNTF1Q6)	228.706,01	5,62	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	202.478,69	4,98	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026 (BRSTNCLTN848)	194.337,80	4,78	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2024 (BRSTNCLTN7Y9)	184.462,47	4,53	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2027 (BRSTNCNTF1P8)	167.223,56	4,11	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2026 (BRSTNCLTN7U7)	137.109,15	3,37	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2025 (BRSTNCLTN7Z6)	119.262,88	2,93	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2025 (BRSTNCLTN830)	93.401,17	2,30	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2033 (BRSTNCNTF212)	90.359,12	2,22	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	71.348,11	1,75	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	71.343,61	1,75	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	71.322,78	1,75	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	71.279,90	1,75	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	71.202,34	1,75	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2029 (BRSTNCLF1RL5)	70.757,13	1,74	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCLTN7N2)	69.153,23	1,70	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2024 (BRSTNCLTN822)	51.569,59	1,27	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2027 (BRSTNCLTN871)	50.338,35	1,24	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2024 (BRSTNCLTN7W3)	47.559,43	1,17	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2031 (BRSTNCNTF204)	46.670,52	1,15	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/10/2025 (BRSTNCLTN863)	21.251,06	0,52	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	15.509,42	0,38	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	10,45	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,87	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	3,81	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
370

Patrimônio Líquido Fundo
3.596.758.160,15

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IPCA

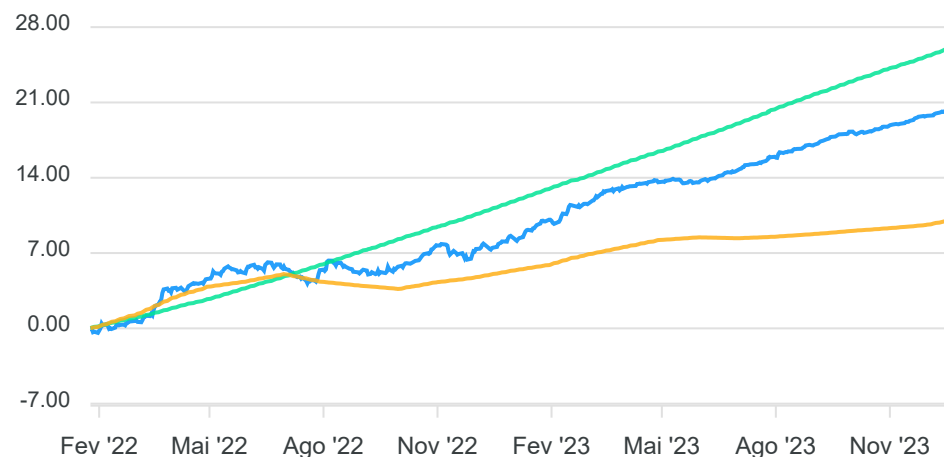
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos
Federais registrados no SELIC e ou Operações Compromissadas
lastreadas em Títulos Públicos Federais registrados no SELIC.

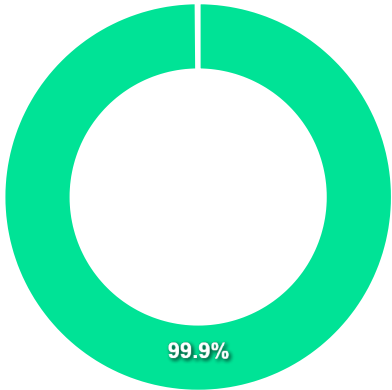
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	11,17%	2,16%	5,32%	11,17%	-%	0,34%	0,71%
Benchmark	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	3.592.205,10	99,87	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	4.592,39	0,13	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	31,90	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	10,07	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-28,38	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-28,52	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.592.205,10	99.87%
Operação compromissada	4.592,39	0.13%
Valores a pagar/receber	-8,98	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
282

Patrimônio Líquido Fundo
1.451.468.758,30

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5+

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Investe em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços.

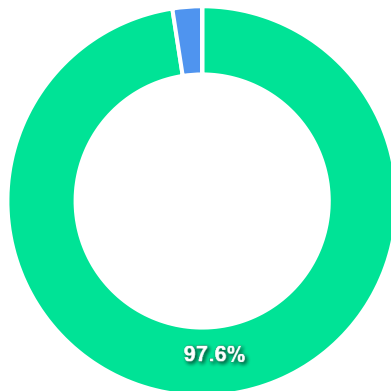
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,93%	18,90%	6,40%	3,86%	18,90%	22,53%	2,38%	5,01%
Benchmark	3,94%	19,28%	6,42%	3,80%	19,28%	23,21%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	381.124,22	26,26	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	196.143,97	13,51	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	179.851,05	12,39	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	179.604,20	12,37	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB0O7)	161.970,90	11,16	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	158.538,79	10,92	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	115.241,99	7,94	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	36.747,82	2,53	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	35.604,85	2,45	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	6.705,65	0,46	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	10,86	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-76,09	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.415.928,58	97.55%
Operação compromissada	35.604,85	2.45%
Valores a pagar/receber	-64,68	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
445

Patrimônio Líquido Fundo
2.351.648.712,32

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IRF-M

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

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

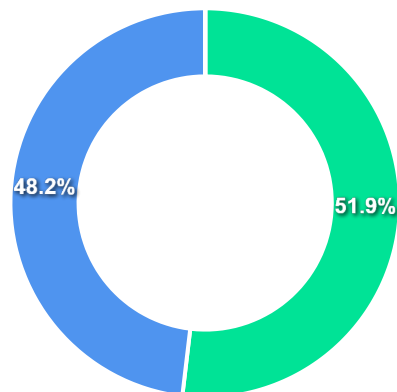
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,46%	16,32%	4,33%	6,17%	16,32%	26,46%	0,66%	1,40%
Benchmark	1,48%	16,51%	4,38%	6,28%	16,51%	26,79%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.220.711,55	51.91%
Operação compromissada	1.132.323,78	48.15%
Derivativos	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-1.386,62	-0.06%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	1.132.323,78	48,15	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	236.597,61	10,06	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2026 (BRSTNCLTN848)	146.744,87	6,24	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2026 (BRSTNCLTN7U7)	134.200,77	5,71	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2025 (BRSTNCLTN830)	106.744,20	4,54	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCLTN7N2)	100.018,32	4,25	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2029 (BRSTNCNTF1Q6)	93.496,56	3,98	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	78.186,02	3,32	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2027 (BRSTNCNTF1P8)	74.038,81	3,15	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	62.013,51	2,64	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/01/2024 (BRSTNCLTN7S1)	53.675,98	2,28	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2025 (BRSTNCLTN7Z6)	50.490,86	2,15	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2033 (BRSTNCNTF212)	42.588,66	1,81	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/04/2024 (BRSTNCLTN7Y9)	20.463,24	0,87	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2031 (BRSTNCNTF204)	19.549,76	0,83	Títulos Federais
LTN - Venc.: 01/07/2024 (BRSTNCLTN7W3)	1.902,38	0,08	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	10,45	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF26	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF27	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF29	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF33	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ25	0,00	0,00	Derivativos

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,10%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+1
Quantidade de Cotistas
122
Patrimônio Líquido Fundo
1.212.026.255,59

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark
IMA-B 5
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados
Política de Investimento
Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento.

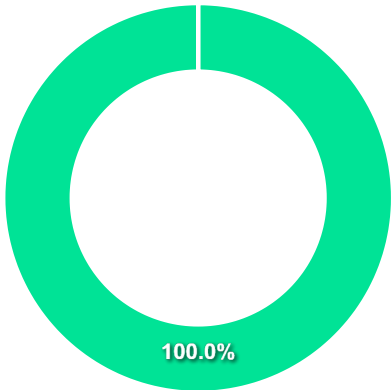
COMPARATIVO

 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,44%	11,86%	2,91%	4,62%	11,86%	22,56%	0,49%	1,02%
Benchmark	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.169.644,84	100,02	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	72,27	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-334,97	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.169.644,84	100.02%
Valores a pagar/receber	-257,70	-0.02%

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
989

Patrimônio Líquido Fundo
4.049.178.389,19

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

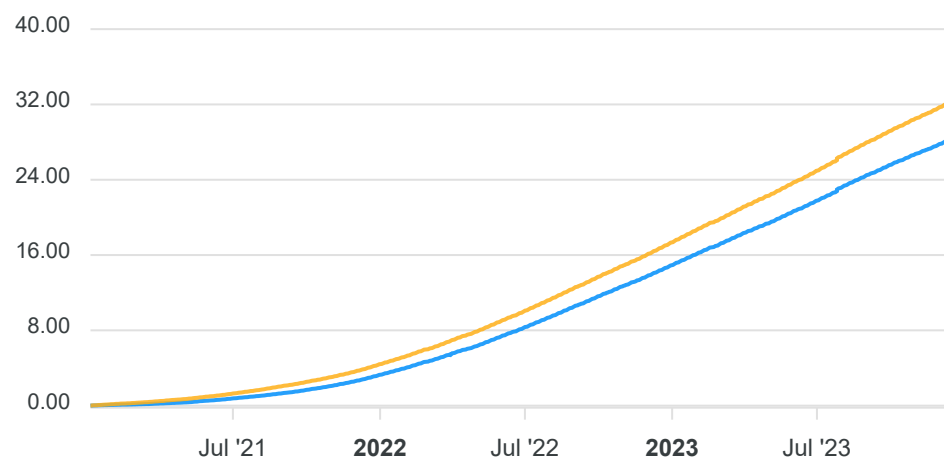
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Simples

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.

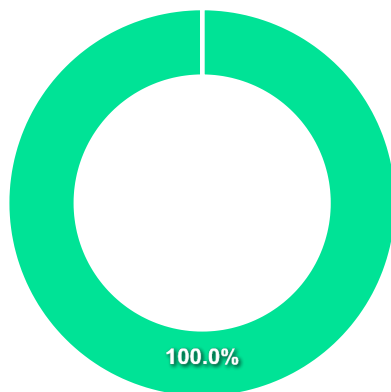
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,82%	11,93%	2,58%	5,62%	11,93%	24,53%	0,01%	0,02%
Benchmark	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP FI RENDA FIXA SIMPLES	4.049.374,57	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,25	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	2,75	0,00	Outros
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,03	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR_a_recolher	0,01	0,00	Outros
Valores a pagar / IOF_a_recolher	0,01	0,00	Outros
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-29,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-160,68	0,00	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	4.049.374,57	100.00%
Valores a pagar/receber	-24,23	-0.00%
Outros	-157,92	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,30%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
245

Patrimônio Líquido Fundo
936.281.150,45

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seu patrimônio líquido representado por ativos financeiros de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação diária da taxa de juros doméstica e/ou índice de preços.

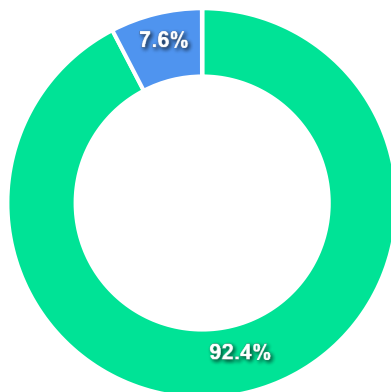
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,74%	15,77%	4,70%	4,00%	15,77%	22,78%	1,47%	3,09%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	864.843,52	92.37%
Operação compromissada	71.227,34	7.61%
Valores a pagar/receber	188,74	0.02%
Derivativos	42,14	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	107.278,19	11,46	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	99.594,70	10,64	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	89.057,44	9,51	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	75.029,29	8,01	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	71.227,34	7,61	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	67.228,79	7,18	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	66.999,71	7,16	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	65.122,49	6,96	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	64.947,48	6,94	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	63.580,63	6,79	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	54.836,88	5,86	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027 (BRSTNCNTB682)	36.610,85	3,91	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2033 (BRSTNCNTB6B1)	26.079,85	2,79	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060 (BRSTNCNTB690)	25.901,55	2,77	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032 (BRSTNCNTB674)	22.575,68	2,41	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	203,72	0,02	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	20,17	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ26	15,78	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK27	6,86	0,00	Derivativos
Valores a pagar / Auditoria	4,02	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,65	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	2,61	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ30	0,71	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK25	-0,26	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	-1,12	0,00	Derivativos

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
1.133

Patrimônio Líquido Fundo
16.475.113.370,57

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

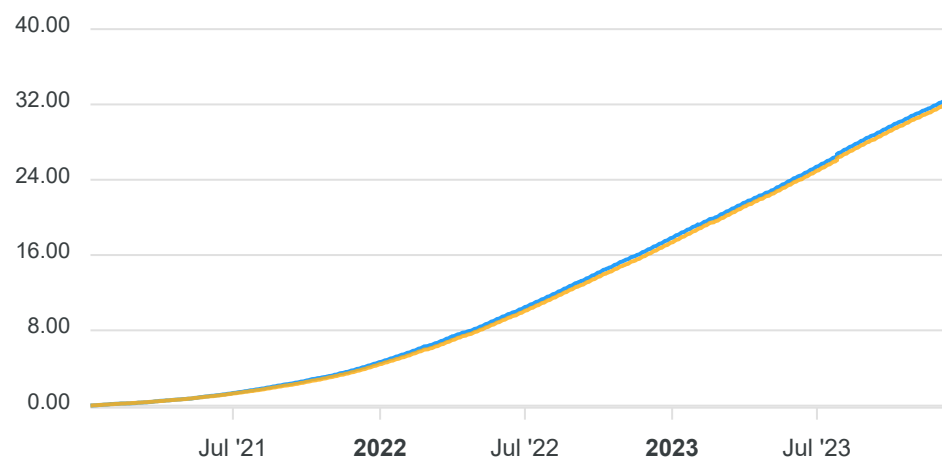
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento
Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em cotas de fundo investimento cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

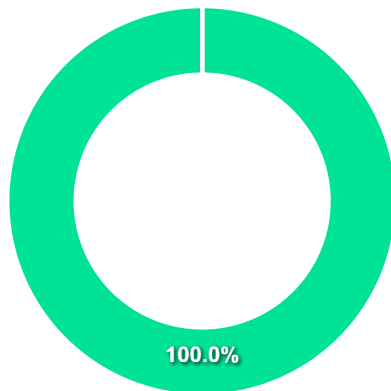
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,90%	12,98%	2,83%	6,15%	12,98%	27,20%	0,01%	0,02%
Benchmark	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.475.277,87	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa Cetip	29,99	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,25	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,84	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	0,45	0,00	Outros
Outras Disponibilidades	0,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-130,75	0,00	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	16.475.277,87	100.00%
Valores a pagar/receber	35,18	0.00%
Outros	-130,31	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,15%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+0

Quantidade de Cotistas

677

Patrimônio Líquido Fundo

10.724.175.764,47

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

Selic

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Baixa Soberano

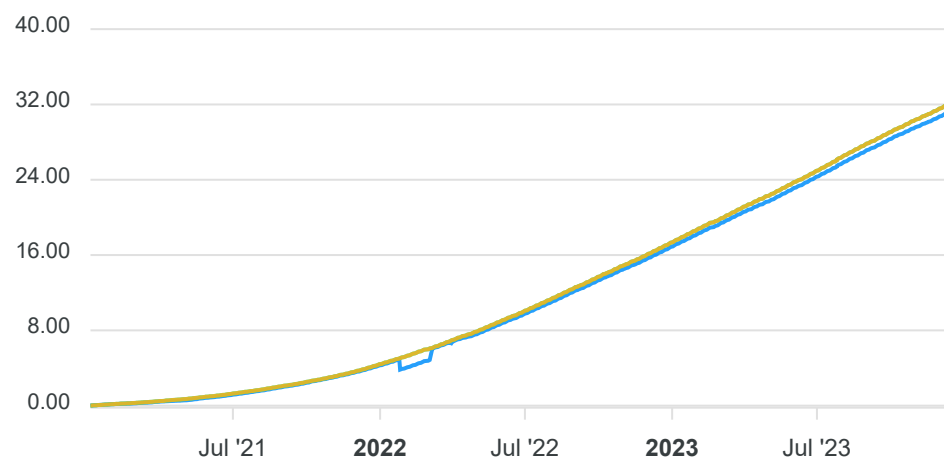
Política de Investimento

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

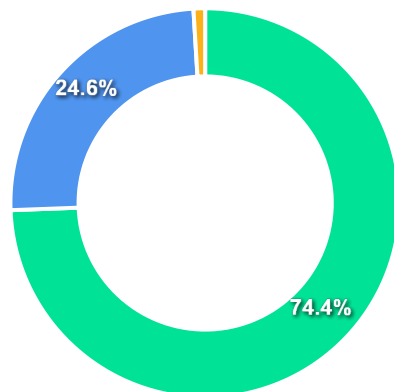
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

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



CARTEIRA DO FUNDO



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

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
226

Patrimônio Líquido Fundo
1.298.723.695,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

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

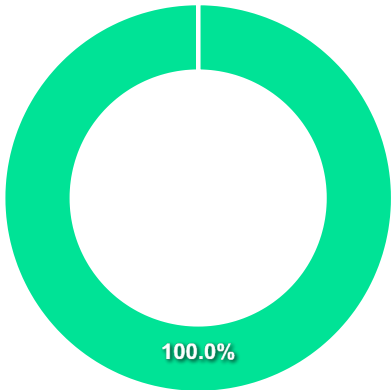
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,77%	15,98%	4,76%	4,21%	15,98%	22,96%	1,48%	3,12%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER BRASIL IMA-B FI RENDA FIXA LP	1.298.787,30	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	0,54	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-64,15	0,00	Valores a pagar/receber

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

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
20.236

Patrimônio Líquido Fundo
613.943.691,61

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
IDIV

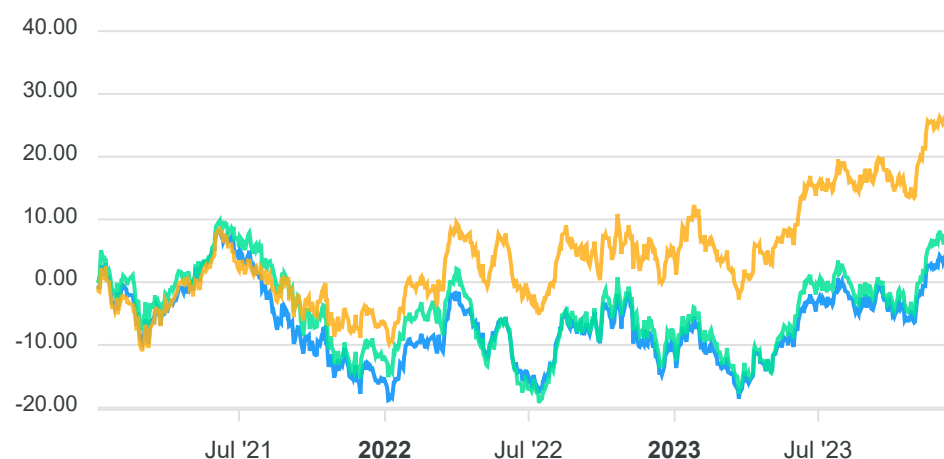
Classificação ANBIMA
Ações Dividendos

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento em ações.

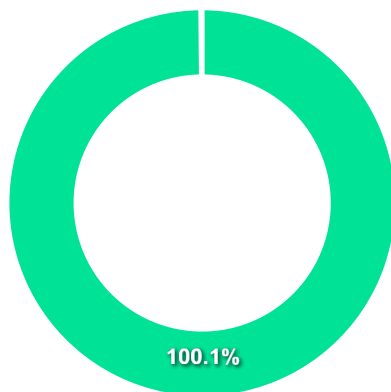
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	6,35%	21,36%	13,60%	13,12%	21,36%	29,41%	4,96%	10,45%
Benchmark	6,90%	26,84%	14,61%	16,04%	26,84%	42,88%		
IBOVESPA	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP DIVIDENDOS FIAÇÕES	614.006,15	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	951,53	0,15	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,75	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,17	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-6,95	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-7,71	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR_a_recolher	-57,59	-0,01	Outros
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-146,06	-0,02	Outros
Valores a pagar / Cotas_Resgatadas	-1.268,78	-0,21	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	614.006,15	100.09%
Valores a pagar/receber	937,80	0.15%
Outros	-1.472,42	-0.24%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4

Quantidade de Cotistas
 9.648

Patrimônio Líquido Fundo
 347.873.403,61

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 SMLL

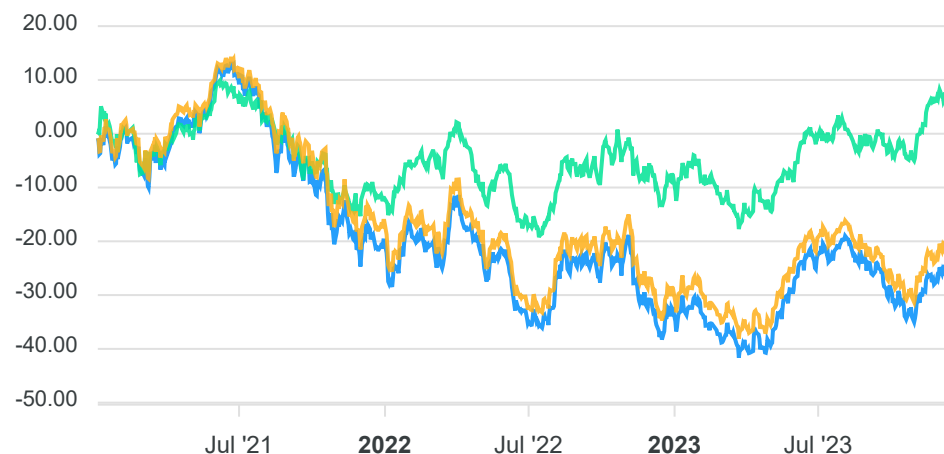
Classificação ANBIMA
 Ações Small Caps

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento em ações.

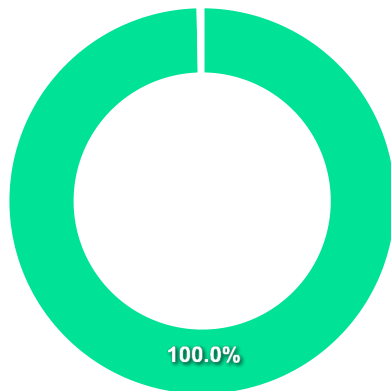
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	7,31%	17,23%	10,26%	2,16%	17,23%	-1,38%	7,55%	15,90%
Benchmark	7,05%	17,12%	11,48%	3,40%	17,12%	-0,52%		
IBOVESPA	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP SMALL CAPS FIAÇÕES	347.911,16	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	1.036,89	0,30	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	15,84	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,75	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,08	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR_a_recolher	-3,97	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Cetip	-4,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-6,95	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas_a_Emitir_Passi	-15,84	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-83,01	-0,02	Outros
Valores a pagar / Cotas_Resgatadas	-977,51	-0,28	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	347.911,16	100.01%
Valores a pagar/receber	1.042,57	0.30%
Outros	-1.080,33	-0.31%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
88

Patrimônio Líquido Fundo
424.700.729,97

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos financeiros de renda variável.

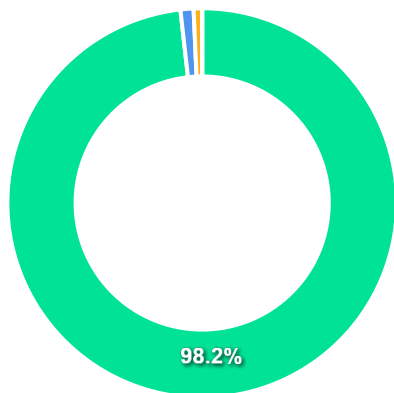
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	5,36%	21,74%	14,92%	13,44%	21,74%	27,74%	6,07%	12,79%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	417.463,45	98.21%
Fundos de Investimento	4.601,14	1.08%
Valores a pagar/receber	2.987,65	0.70%
Outros	11,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	58.991,69	13,89	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	31.233,00	7,35	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	29.662,13	6,98	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	17.083,96	4,02	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	16.004,67	3,77	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	15.280,91	3,60	Ações
B3 ON NM - B3SA3	15.076,55	3,55	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	14.450,25	3,40	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	10.991,62	2,59	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	10.114,06	2,38	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	9.986,41	2,35	Ações
WEG ON NM - WEGE3	9.971,46	2,35	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	7.883,06	1,86	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	7.102,21	1,67	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	6.907,30	1,63	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	6.905,94	1,63	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	6.810,80	1,60	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	6.029,94	1,42	Ações
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	5.269,82	1,24	Ações
JBS ON NM - JBSS3	5.153,33	1,21	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	5.099,86	1,20	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	4.877,74	1,15	Ações
Outros Valores a receber	4.848,01	1,14	Valores a pagar/receber
SABESP ON NM - SBSP3	4.636,23	1,09	Ações
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIA...	4.601,14	1,08	Fundos de Investimento
VIBRA ON NM - VBBR3	4.567,39	1,08	Ações
BRF SA ON NM - BRFS3	4.191,10	0,99	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.

Gestão
 SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+3

Quantidade de Cotistas
 3.914

Patrimônio Líquido Fundo
 114.042.233,53

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

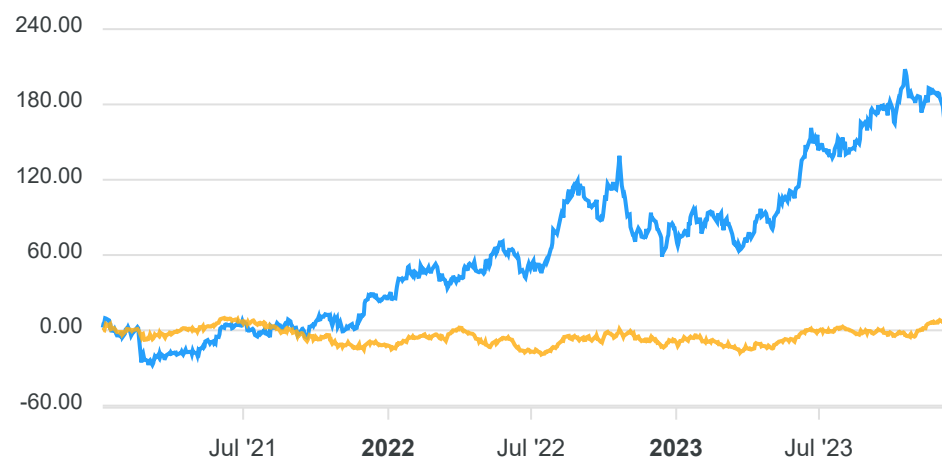
Classificação ANBIMA
 Fundos de Mono Ação

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento os
 quais aplicam em ações de emissão da PETROBRAS.

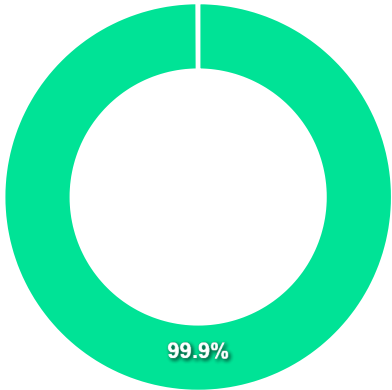
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	3,24%	65,59%	5,86%	23,21%	65,59%	139,06%	10,54%	22,21%
Benchmark	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER PETRO TOP FIAÇÕES	113.967,26	99,93	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	522,68	0,46	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-452,70	-0,40	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	113.967,26	99.93%
Valores a pagar/receber	74,97	0.07%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,70%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
468

Patrimônio Líquido Fundo
1.995.875.754,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
Global BDRX

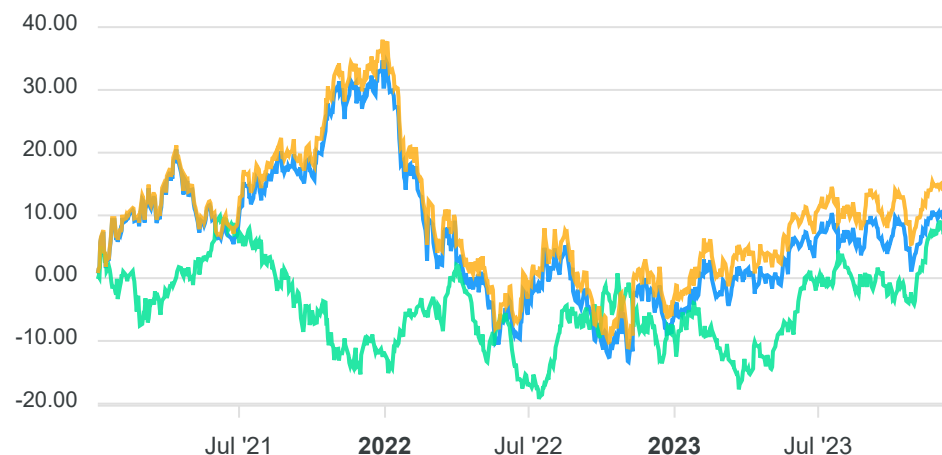
Classificação ANBIMA
Ações Livre

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

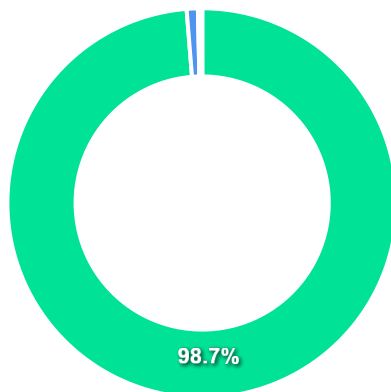
COMPARATIVO

29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,59%	24,92%	7,65%	9,07%	24,92%	-10,73%	4,08%	8,59%
Benchmark	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%		
IBOVESPA	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depositary Receipts	1.967.717,23	98.72%
Fundos de Investimento	18.412,74	0.92%
Valores a pagar/receber	7.031,18	0.35%
Outros	0,00	0.00%

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

