

2. PLANO MISTO DE BENEFÍCIO

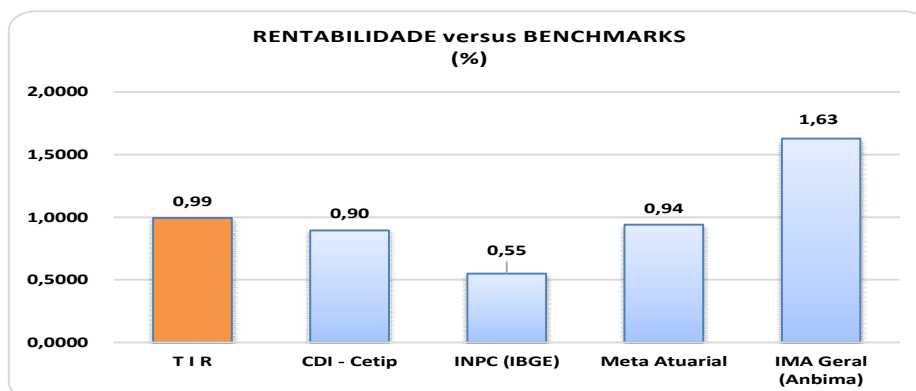
2.1. PORTFÓLIO DE INVESTIMENTOS E TAXA DE RETORNO

PATRIMÔNIO DE INVESTIMENTOS - PLANO CV							
Carteira de Investimentos	Resolução CMN n° 4.994	Novembro 2023	Dezembro 2023	Participação %	RENTABILIDADE		Variação Mensal (R\$)
					% mês	% ano	
<u>CARTEIRA GERAL</u>		60.984.012,04	60.380.669,96	100,0	0,99	11,42	(603.342,08)
<u>REDA FIXA</u>	100	39.467.422,82	38.789.964,10	64,2	1,14	13,33	(677.458,72)
<u>REDA VARIÁVEL</u>	70	319.194,89	333.047,05	0,6	8,39	29,66	13.852,16
<u>ESTRUTURADOS</u>	20	15.072.911,86	15.133.176,34	25,1	0,40	4,67	60.264,48
<u>IMOBILIÁRIO</u>	20	6.124.482,47	6.124.482,47	10,1	1,15	14,76	0,00
<u>EMPRÉSTIMO AO PARTICIPANTE</u>	15	0,00	0,00	0,0	0,00	0,00	0,00

TAXA DE RETORNO E INDICADORES DE DESEMPENHO DOS INVESTIMENTOS - PLANO CV							
Indicadores	Novembro 2023	Dezembro 2023	Performance Mensal		Performance Anual		
			TIR versus Benchmarks				
			Meta Atuarial	CDI - Cetip	Meta Atuarial	CDI - Cetip	
CDI - Cetip	0,92	0,90					
INPC (IBGE)	0,10	0,55					
Meta Atuarial	0,489	0,940	105,77	111,09	132,11	87,58	
IMA Geral (Anbima)	1,84	1,63					

Fonte: Consultoria Técnica - Investimentos.

Nota 1: dezembro/2023.



Fonte: Consultoria Técnica - Investimentos.

2.2. INFORMAÇÕES

- ✓ O **INPC** (IBGE) do mês de dezembro registrou variação positiva de **0,55%**.
- ✓ A **Meta Atuarial** mensal do Plano foi de **0,940%**.
- ✓ O desempenho **MENSAL** do portfólio de Investimentos foi:
 - (i) **105,77%** da Meta Atuarial; e
 - (ii) **111,09%** da Taxa DI – Cetip Over.
- ✓ O desempenho **ANUAL** do portfólio de Investimentos foi:
 - (i) **132,11%** da Meta Atuarial; e
 - (ii) **87,58%** da Taxa DI – Cetip Over.
- ✓ A carteira de investimentos registrou desempenhos superiores ao INPC (IBGE) de **180,0%** (mês) e **307,8%** (ano).
- ✓ O precatório **OFND** (R\$ 15,126 milhões) representa **25,1%** da carteira de investimentos. O índice de atualização do título é a variação mensal do IPCA-E (IBGE), que no mês de referência registrou variação positiva de **0,40%**.
- ✓ O valor patrimonial do precatório registrado contabilmente no mês de maio/2022 é escritural e a liquidação financeira pelo Tesouro Nacional está prevista para ocorrer a partir de maio/2023, sendo que parte dos recursos (**R\$ 12.039.038,62**), base novembro, pertence ao Plano CV Saldado, sob gestão da BB Previdência.