

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	51.590,41	0,02%	1.683	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	24.805.460,88	9,10%	686	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	4.853.775,53	1,78%	41	2,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	13.553.459,78	4,97%	370	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	45.894.255,97	16,84%	793	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	27.840.417,97	10,22%	876	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.640.443,58	7,94%	924	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	10.366.246,40	3,80%	283	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.857.733,15	1,42%	772	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	26.356.161,72	9,67%	1.188	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	12.615.651,71	4,63%	243	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	103.416,95	0,04%	1.138	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.902.024,61	1,80%	996	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.306.078,01	0,48%	243	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	302.252,10	0,11%	1.454	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	25.532.622,47	9,37%	989	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	576.103,88	0,21%	213	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	579.694,07	0,21%	240	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	1.017.492,87	0,37%	31	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	478.240,39	0,18%	2.982	0,04%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

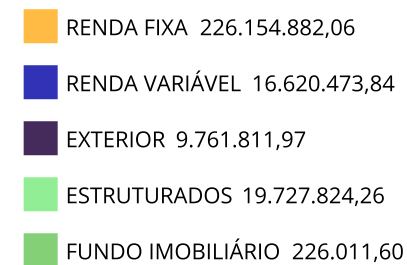
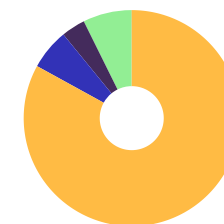
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.348.933,33	1,60%	1.426	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI AÇÕES	D+4	Não há	1.081.557,72	0,40%	30.194	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	220.381,28	0,08%	4.124	0,36%	Artigo 8º, Inciso I
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	243.809,79	0,09%	4.606	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	177.735,83	0,07%	10.548	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	215.237,82	0,08%	2.417	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.397.738,98	1,98%	1.024	0,84%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	2.939.780,72	1,08%	83	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	156.681,19	0,06%	2.221	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	232.665,45	0,09%	151	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	215.371,17	0,08%	2.301	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+6 ou ...	Não há	182.410,83	0,07%	34	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	421.881,70	0,15%	130	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	114.575,43	0,04%	3.501	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	D+6 du	Não há	1.447.382,81	0,53%	19	1,76%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	8.099.005,82	2,97%	150	0,61%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	215.423,34	0,08%	17.038	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	817.649,43	0,30%	180	0,25%	Artigo 10º, Inciso I
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	300.002,78	0,11%	4	0,28%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	16.276.005,39	5,97%	6.794	1,01%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	490.239,08	0,18%	35	0,59%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.843.927,58	0,68%	77	0,32%	Artigo 10º, Inciso I
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	Não se ...	Não se aplica	226.011,60	0,08%		0,35%	Artigo 11º
BNP PARIBAS STRATÉGIE SUSTENTÁVEL IS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	193.472,21	0,07%	8	0,61%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			272.491.003,73				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			215.828,22				Artigo 6º
PL Total			272.706.831,95				

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

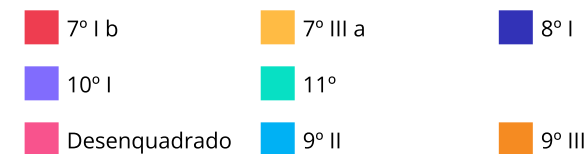
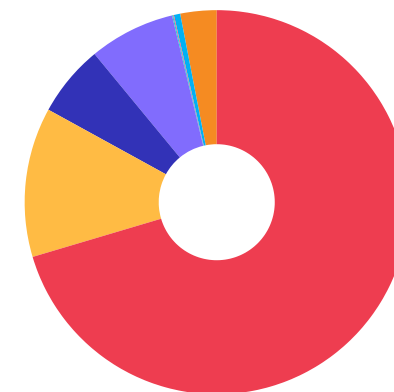
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	27.249.100,37
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	191.835.197,10	70,40%	25,00%	30,00%	100,00%	80.655.806,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	34.319.684,96	12,59%	10,00%	27,50%	60,00%	129.174.917,28
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	13.624.550,19
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	13.624.550,19
Total Renda Fixa	100,00%	226.154.882,06	83,00%	35,00%	72,50%	180,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	16.427.001,63	6,03%	5,00%	10,00%	30,00%	65.320.299,49
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.727.824,26	7,24%	5,00%	10,00%	30,00%	62.019.476,86
Artigo 11º	5,00%	226.011,60	0,08%	0,10%	2,00%	5,00%	13.398.538,59
Desenquadrado - RV	0,00%	193.472,21	0,07%	0,00%	0,00%	0,00%	-193.472,21
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	36.574.309,70	13,42%	10,10%	22,00%	65,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	1.447.382,81	0,53%	0,50%	1,00%	5,00%	12.177.167,38
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	8.314.429,16	3,05%	3,00%	4,00%	5,00%	5.310.121,03
Total Exterior	10,00%	9.761.811,97	3,58%	3,50%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	199.321.775,87	73,15	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	66.072.678,16	24,25	-
BANCO J. SAFRA S/A	1.843.927,58	0,68	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	1.155.797,95	0,42	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.017.492,87	0,37	-
ITAU UNIBANCO	490.239,08	0,18	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	478.240,39	0,18	-
META ASSET MANAGEMENT	421.881,70	0,15	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	302.252,10	0,11	-
BV ASSET	300.002,78	0,11	-
OLIVEIRA TRUST	226.011,60	0,08	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	215.237,82	0,08	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	193.472,21	0,07	-
EQUITAS INVESTIMENTOS	182.410,83	0,07	-
BANRISUL CORRETORA	155.007,36	0,06	-
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	114.575,43	0,04	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,77%	8,66%	2,75%	5,42%	11,80%	22,33%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	8,41%	2,76%	5,32%	11,53%	21,66%	0,90%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,59%	12,99%	4,10%	11,31%	16,04%	21,61%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	12,76%	4,03%	11,11%	15,53%	20,69%	1,47%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,27%	14,28%	2,80%	14,40%	15,00%	16,66%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,26%	13,86%	2,75%	14,04%	14,48%	15,70%	2,62%	0,07%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,15%	9,05%	3,44%	6,81%	13,74%	24,03%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	8,92%	3,38%	6,69%	13,51%	23,50%	0,18%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,61%	8,75%	2,66%	5,76%	11,97%	23,03%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,60%	8,67%	2,60%	5,72%	11,81%	22,71%	0,94%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,38%	11,84%	2,83%	10,43%	13,76%	20,07%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,37%	11,72%	2,79%	10,37%	13,51%	19,64%	1,71%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45%	11,66%	2,71%	10,34%	13,48%	19,44%	1,77%	0,05%
Selic (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	1,13%	8,60%	3,24%	6,46%	13,14%	24,45%	0,02%	0,00%
CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,95%	7,31%	2,76%	5,52%	11,13%	19,93%	0,02%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	10,75%	3,67%	8,97%	14,02%	22,87%	0,10%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05%	8,15%	3,07%	6,14%	12,44%	22,66%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,24%	8,97%	3,54%	6,94%	13,76%	25,76%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,65%	8,87%	2,97%	6,83%	12,95%	25,95%	0,68%	0,01%
BRANDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,95%	7,37%	2,77%	5,57%	11,17%	19,66%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,23%	3,23%	0,27%	1,83%	4,61%	13,74%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-	2,44%	-	-	-	1,36%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	7,64%	2,92%	4,76%	11,09%	-	0,62%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,63%	9,92%	3,67%	7,75%	13,76%	23,41%	0,58%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,37%	11,68%	3,52%	9,87%	12,79%	24,05%	1,25%	0,04%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,82%	-	1,75%	-	-	-	1,60%	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	-0,96%	22,95%	9,70%	17,61%	23,14%	16,57%	5,67%	0,18%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,63%	11,86%	4,24%	10,77%	13,79%	24,76%	1,12%	0,03%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,66%	8,35%	2,59%	6,36%	12,73%	23,48%	0,50%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1,11%	9,08%	3,58%	7,11%	13,61%	25,84%	0,18%	0,00%
Ibovespa (Benchmark)	-5,09%	5,47%	6,84%	10,30%	5,68%	-2,56%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,18%	2,03%	4,64%	4,03%	-2,33%	-28,58%	6,91%	0,20%
BNP PARIBAS STRATÉGIE SUSTENTÁVEL IS FI AÇÕES	-5,55%	5,16%	0,89%	8,61%	-4,54%	-11,59%	6,22%	0,20%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-5,66%	4,03%	5,76%	9,26%	3,24%	-18,19%	6,47%	0,20%
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,28%	21,39%	5,70%	10,11%	3,89%	-28,69%	8,93%	0,26%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,81%	1,76%	5,78%	6,27%	-1,60%	-6,69%	6,29%	0,20%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	-3,31%	8,88%	8,51%	10,21%	11,94%	4,42%	5,70%	0,20%
BB FI AÇÕES	-0,70%	43,70%	9,34%	21,76%	24,12%	84,58%	8,89%	0,32%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,51%	15,91%	6,77%	20,57%	8,59%	15,29%	6,31%	0,22%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-6,72%	11,35%	3,89%	16,23%	6,82%	-2,09%	8,55%	0,26%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,72%	6,08%	6,90%	10,12%	0,88%	-11,75%	6,25%	0,20%
IBX (Benchmark)	-5,01%	4,62%	6,85%	9,37%	4,16%	-4,36%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-9,25%	-7,22%	0,30%	-2,69%	-9,71%	-19,53%	7,21%	0,25%

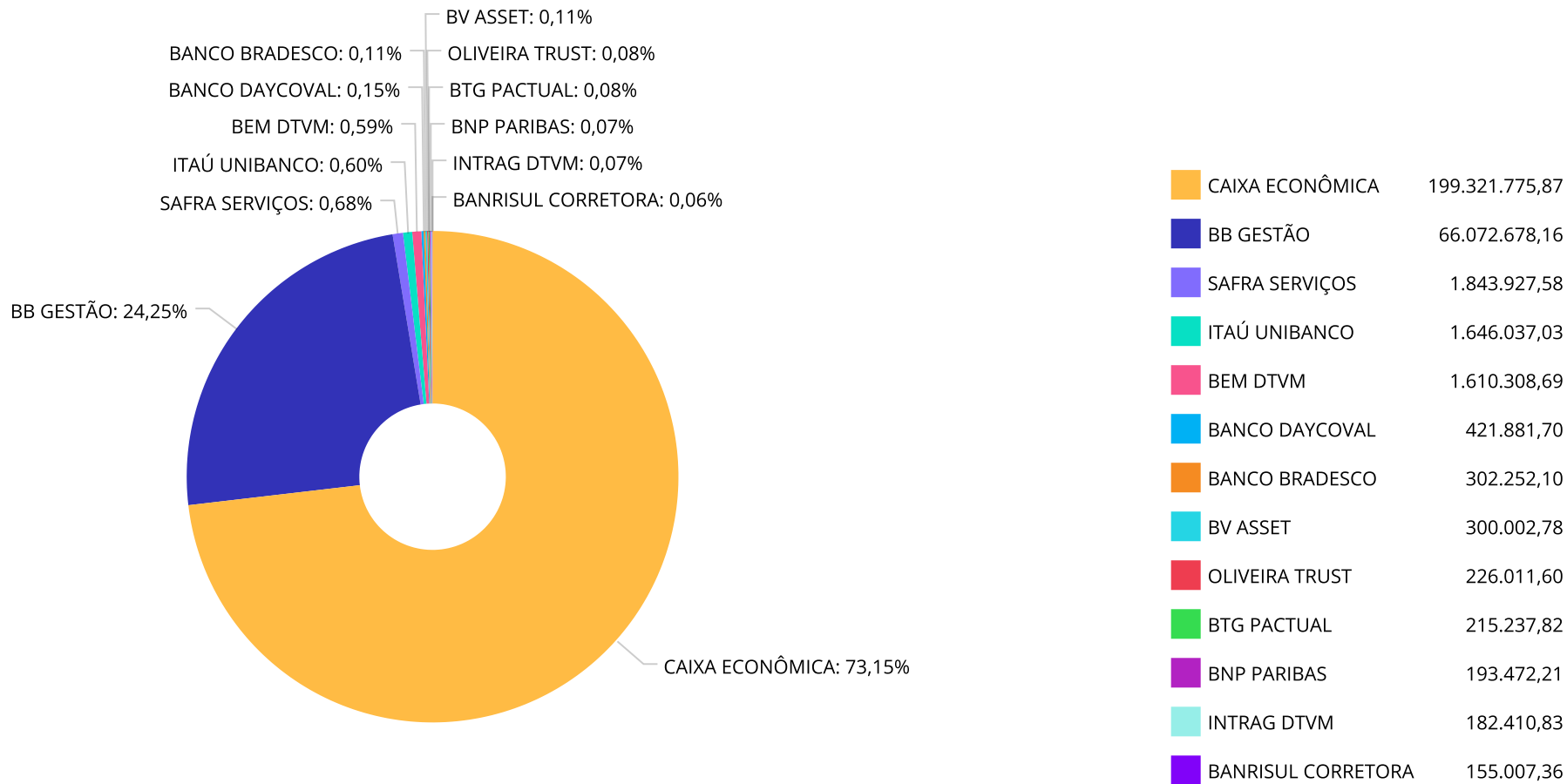
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	-4,76%	3,66%	7,43%	8,45%	4,56%	-3,16%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-5,86%	2,74%	5,34%	5,93%	1,74%	-7,94%	6,32%	0,20%
IDIV (Benchmark)	-2,83%	9,22%	8,71%	11,58%	10,64%	15,38%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,45%	9,24%	7,22%	12,59%	9,27%	6,96%	5,71%	0,18%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,83%	8,19%	8,28%	10,70%	9,25%	12,71%	5,18%	0,18%
IFIX (Benchmark)	0,49%	12,06%	6,62%	14,40%	7,95%	16,84%	-	-
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	0,10%	-0,41%	2,13%	0,64%	1,76%	-2,70%	4,09%	0,15%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,73%	6,92%	2,53%	3,09%	6,36%	-11,42%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,92%	23,40%	9,88%	17,91%	23,70%	17,13%	5,71%	0,18%
SMLL (Benchmark)	-7,43%	8,13%	3,26%	17,40%	-1,94%	-23,76%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-6,24%	6,99%	6,37%	10,14%	0,90%	-14,13%	8,39%	0,19%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-7,15%	10,39%	4,99%	20,18%	-1,12%	-24,03%	8,25%	0,26%

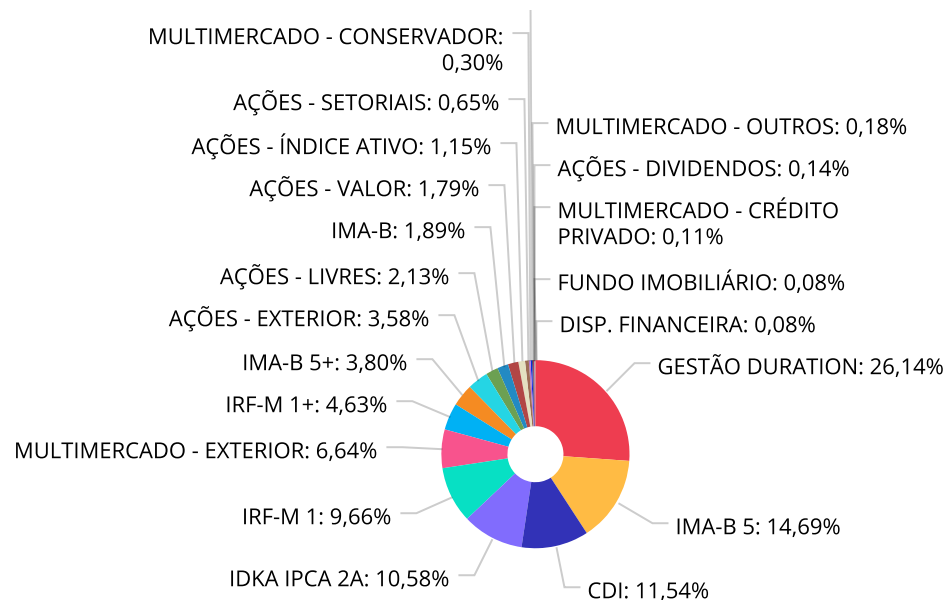
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	3,26%	21,43%	5,97%	15,02%	15,64%	-2,06%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,83%	13,17%	6,63%	10,56%	12,14%	-4,03%	7,31%	20,747%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,09%	34,32%	9,12%	27,21%	17,54%	-19,97%	8,23%	18,757%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,73%	6,92%	2,53%	3,09%	6,36%	-11,42%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	3,10%	2,23%	1,61%	1,32%	-5,07%	-20,25%	6,63%	18,120%

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



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

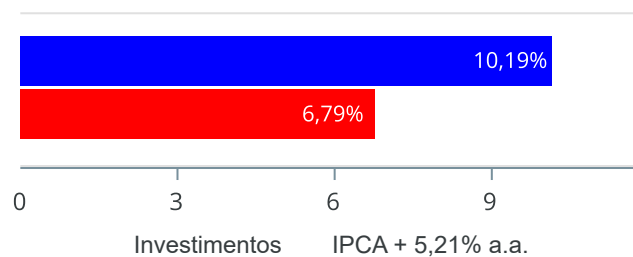


■ GESTÃO DURATION	71.275.820,73	■ IMA-B 5	40.047.678,89	■ CDI	31.471.600,61
■ IDKA IPCA 2A	28.857.910,84	■ IRF-M 1	26.356.161,72	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	18.119.932,97
■ IRF-M 1+	12.615.651,71	■ IMA-B 5+	10.366.246,40	■ AÇÕES - EXTERIOR	9.761.811,97
■ AÇÕES - LIVRES	5.795.387,63	■ IMA-B	5.163.811,16	■ AÇÕES - VALOR	4.885.390,46
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.133.252,93	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.761.119,96	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	817.649,43
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	655.976,22	■ MULTIMERCADO - OUTROS	490.239,08	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	389.346,64
■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	300.002,78	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	226.011,60	■ DISP. FINANCEIRA	215.828,22

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

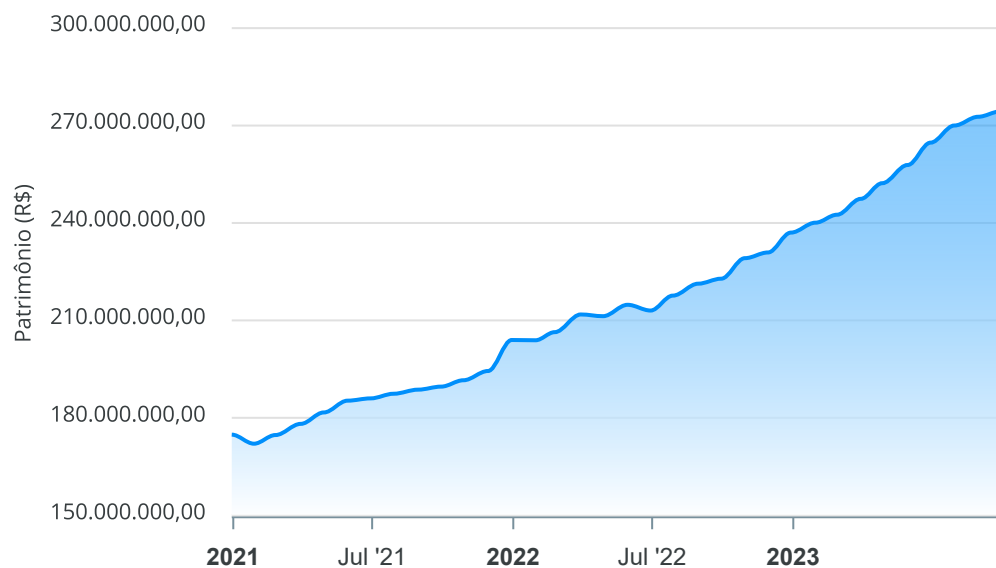
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	230.184.077,94	6.575.328,45	2.020.243,62	238.432.610,97	3.693.448,20	3.693.448,20	1,57%	1,57%	0,98%	0,98%	161,09%	2,33%
Fevereiro	238.432.610,97	2.928.817,14	0,00	242.109.378,19	747.950,08	4.441.398,28	0,31%	1,89%	1,21%	2,19%	86,02%	2,07%
Março	242.109.378,19	1.956.368,43	52.000,00	247.248.771,71	3.235.025,09	7.676.423,37	1,33%	3,24%	1,18%	3,40%	95,30%	1,92%
Abril	247.248.771,71	14.215.028,35	12.336.855,33	251.773.636,94	2.646.692,21	10.323.115,58	1,06%	4,34%	0,98%	4,41%	98,37%	1,71%
Mai	251.773.636,94	13.096.354,48	11.236.491,97	257.716.369,75	4.082.870,30	14.405.985,88	1,61%	6,02%	0,68%	5,11%	117,65%	1,66%
Junho	257.716.369,75	2.166.519,36	1.378.000,00	264.505.203,84	6.000.314,73	20.406.300,61	2,32%	8,48%	0,34%	5,47%	154,84%	1,80%
Julho	264.505.203,84	2.170.978,40	286.500,00	269.806.784,96	3.417.102,72	23.823.403,33	1,28%	9,87%	0,54%	6,05%	163,14%	1,56%
Agosto	269.806.784,96	2.695.600,38	802.281,18	272.491.003,73	790.899,57	24.614.302,90	0,29%	10,19%	0,70%	6,79%	150,12%	1,61%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



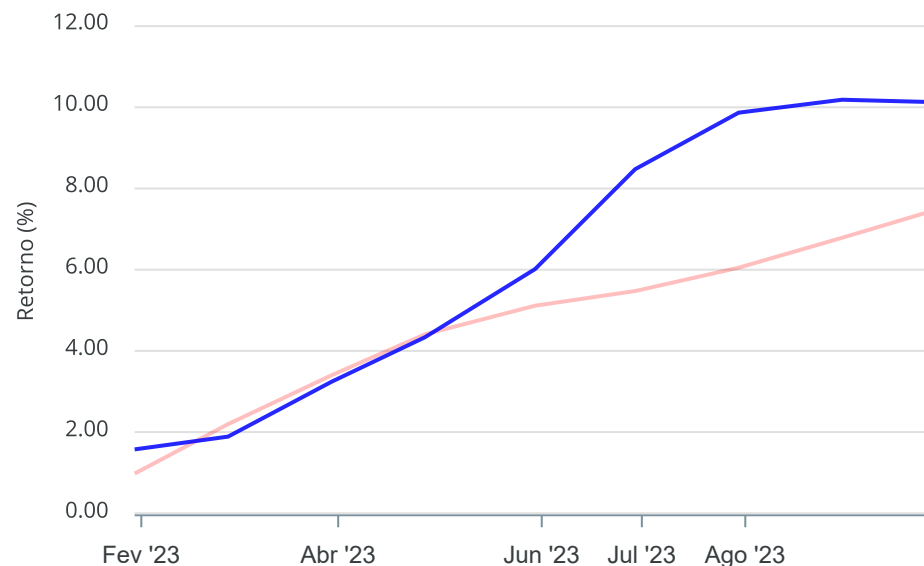
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.583.370,71	644.800,00	0,00	25.532.622,47	304.451,76	1,21%	1,24%	0,03%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	102.265,99	0,00	0,00	103.416,95	1.150,96	1,13%	1,13%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	26.349.835,97	0,00	284.900,00	26.356.161,72	291.225,75	1,11%	1,11%	0,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	24.550.369,08	0,00	0,00	24.805.460,88	255.091,80	1,04%	1,04%	0,10%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	299.405,32	0,00	0,00	302.252,10	2.846,78	0,95%	0,95%	0,01%
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	48.309,99	2.806,86	0,00	51.590,41	473,56	0,93%	0,95%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	13.809.108,87	0,00	379.189,97	13.553.459,78	123.540,88	0,89%	0,90%	0,62%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1.009.241,39	0,00	0,00	1.017.492,87	8.251,48	0,82%	0,82%	1,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	27.626.471,44	0,00	0,00	27.840.417,97	213.946,53	0,77%	0,77%	0,90%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.818.443,88	2.047.993,52	0,00	4.902.024,61	35.587,21	0,73%	1,05%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	575.924,77	0,00	0,00	579.694,07	3.769,30	0,65%	0,65%	0,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	45.606.616,78	0,00	0,00	45.894.255,97	287.639,19	0,63%	0,63%	0,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.511.998,01	0,00	0,00	21.640.443,58	128.445,57	0,60%	0,60%	0,94%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	12.546.884,08	0,00	0,00	12.615.651,71	68.767,63	0,55%	0,55%	1,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	573.978,49	0,00	0,00	576.103,88	2.125,39	0,37%	0,37%	1,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	4.991.222,35	0,00	138.191,21	4.853.775,53	744,39	0,01%	-0,01%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.872.090,24	0,00	0,00	3.857.733,15	-14.357,09	-0,37%	-0,37%	1,71%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.312.037,44	0,00	0,00	1.306.078,01	-5.959,43	-0,45%	-0,45%	1,77%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	10.498.636,19	0,00	0,00	10.366.246,40	-132.389,79	-1,26%	-1,26%	2,62%
Total Renda Fixa	222.686.210,99	2.695.600,38	802.281,18	226.154.882,06	1.575.351,87	0,70%		0,68%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	223.404,48	0,00	0,00	226.011,60	2.607,12	1,17%	1,36%	4,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	484.871,66	0,00	0,00	490.239,08	5.367,42	1,11%	1,11%	0,18%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	812.296,65	0,00	0,00	817.649,43	5.352,78	0,66%	0,66%	0,50%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	298.121,78	0,00	0,00	300.002,78	1.881,00	0,63%	0,63%	1,12%
BB FI AÇÕES	1.089.185,38	0,00	0,00	1.081.557,72	-7.627,66	-0,70%	-0,70%	8,89%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16.426.603,37	0,00	0,00	16.276.005,39	-150.597,98	-0,92%	-0,92%	5,71%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	1.861.842,97	0,00	0,00	1.843.927,58	-17.915,39	-0,96%	-0,96%	5,67%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	161.244,08	0,00	0,00	156.681,19	-4.562,89	-2,83%	-2,83%	5,18%
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	188.598,80	0,00	0,00	182.410,83	-6.187,97	-3,28%	-3,28%	8,93%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	227.932,10	0,00	0,00	220.381,28	-7.550,82	-3,31%	-3,31%	5,70%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	240.975,36	0,00	0,00	232.665,45	-8.309,91	-3,45%	-3,45%	5,71%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	223.205,74	0,00	0,00	215.371,17	-7.834,57	-3,51%	-3,51%	6,31%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5.665.140,01	0,00	0,00	5.397.738,98	-267.401,03	-4,72%	-4,72%	6,25%
BNP PARIBAS STRATÉGIE SUSTENTÁVEL IS FI AÇÕES	204.829,08	0,00	0,00	193.472,21	-11.356,87	-5,54%	-5,54%	6,22%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	121.442,79	0,00	0,00	114.575,43	-6.867,36	-5,65%	-5,65%	6,47%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.617.403,63	0,00	0,00	4.348.933,33	-268.470,30	-5,81%	-5,81%	6,29%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.122.640,82	0,00	0,00	2.939.780,72	-182.860,10	-5,86%	-5,86%	6,32%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	510.064,12	0,00	0,00	478.240,39	-31.823,73	-6,24%	-6,24%	8,39%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	261.380,30	0,00	0,00	243.809,79	-17.570,51	-6,72%	-6,72%	8,55%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	191.430,32	0,00	0,00	177.735,83	-13.694,49	-7,15%	-7,15%	8,25%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	231.898,08	0,00	0,00	215.237,82	-16.660,26	-7,18%	-7,18%	6,91%
META VALOR FIAÇÕES	464.856,91	0,00	0,00	421.881,70	-42.975,21	-9,24%	-9,24%	7,21%
Total Renda Variável	37.629.368,43	0,00	0,00	36.574.309,70	-1.055.058,73	-2,80%		5,87%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Agosto / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI ...	1.403.808,65	0,00	0,00	1.447.382,81	43.574,16	3,10%	3,10%	6,63%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	7.876.381,01	0,00	0,00	8.099.005,82	222.624,81	2,83%	2,83%	7,31%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	211.015,88	0,00	0,00	215.423,34	4.407,46	2,09%	2,09%	8,23%
Total Exterior	9.491.205,54	0,00	0,00	9.761.811,97	270.606,43	2,85%		7,23%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da MOSAICO CONSULTORIA. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

