

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

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	66.581,65	0,02%	1.821	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	25.972.767,06	8,74%	702	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	5.003.667,20	1,68%	43	2,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	14.153.346,15	4,76%	370	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	45.313.139,28	15,26%	791	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	28.947.042,64	9,75%	850	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.445.131,39	7,56%	914	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	10.645.020,68	3,58%	284	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.981.990,14	1,34%	771	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	26.356.919,21	8,87%	1.190	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	13.300.895,84	4,48%	251	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.823.412,58	2,97%	728	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	122.917,20	0,04%	13.451	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	600.398,09	0,20%	217	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	108.202,54	0,04%	1.177	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.497.781,25	3,20%	1.003	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.347.443,89	0,45%	247	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	314.248,41	0,11%	1.427	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	28.146.252,99	9,48%	989	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	605.462,04	0,20%	222	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

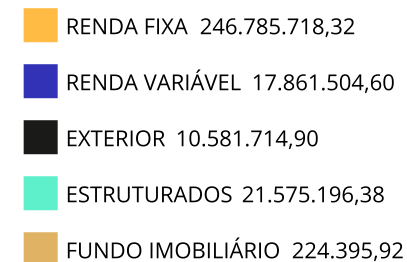
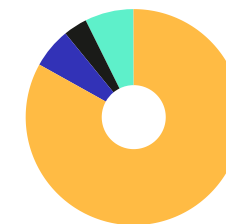
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	1.033.098,09	0,35%	31	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	499.535,97	0,17%	2.690	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.758.698,15	1,60%	1.294	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI AÇÕES	D+4	Não há	1.322.195,04	0,45%	36.879	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	243.967,30	0,08%	3.774	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	274.603,67	0,09%	4.443	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	175.399,03	0,06%	9.444	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	236.103,62	0,08%	2.105	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.713.343,48	1,92%	918	0,91%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	3.233.330,06	1,09%	82	0,84%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	174.609,56	0,06%	2.261	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	255.449,00	0,09%	147	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	234.315,19	0,08%	2.141	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+6 ou ...	Não há	175.115,96	0,06%	31	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	439.646,80	0,15%	96	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	125.191,77	0,04%	2.951	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	D+6 du	Não há	1.544.137,46	0,52%	18	1,91%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	8.794.503,86	2,96%	142	0,65%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	243.073,58	0,08%	16.167	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	860.875,12	0,29%	174	0,26%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	310.287,21	0,10%	3	0,34%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	17.866.454,31	6,02%	6.694	1,07%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	513.955,98	0,17%	35	0,50%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	2.023.623,76	0,68%	72	0,34%	Artigo 10º, Inciso I
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	Não se ...	Não se aplica	224.395,92	0,08%		0,37%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			297.028.530,12				
			1.290.942,58				Artigo 6º
			298.319.472,70				
PL Total			298.319.472,70				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2024)

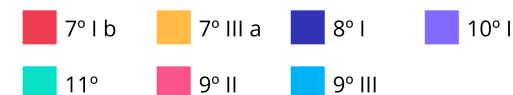
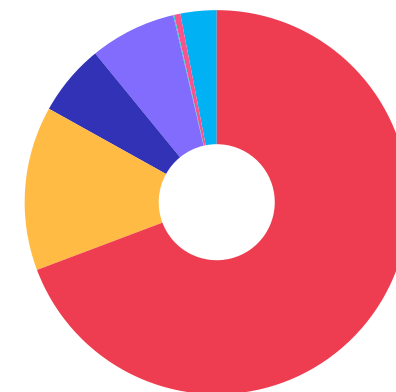
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	297.028.530,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	205.733.229,11	69,26%	25,00%	30,00%	100,00%	91.295.301,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	29.702.853,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	41.052.489,21	13,82%	10,00%	22,50%	60,00%	137.164.628,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	29.702.853,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	14.851.426,51
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	14.851.426,51
Total Renda Fixa	100,00%	246.785.718,32	83,08%	35,00%	72,50%	290,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	17.861.504,60	6,01%	5,00%	8,00%	30,00%	71.247.054,44
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	29.702.853,01
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	21.575.196,38	7,26%	5,00%	8,00%	10,00%	8.127.656,63
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	14.851.426,51
Artigo 11º	5,00%	224.395,92	0,08%	0,10%	1,50%	5,00%	14.627.030,59
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	39.661.096,90	13,35%	10,10%	22,00%	60,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	1.544.137,46	0,52%	0,00%	1,00%	10,00%	28.158.715,55
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.037.577,44	3,04%	0,00%	4,00%	10,00%	20.665.275,57
Total Exterior	10,00%	10.581.714,90	3,56%	0,00%	5,00%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	215.560.223,55	72,57	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	74.192.458,76	24,98	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	2.023.623,76	0,68	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.719.816,11	0,58	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.033.098,09	0,35	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	499.535,97	0,17	-
META ASSET MANAGEMENT	439.646,80	0,15	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	314.248,41	0,11	-
BV ASSET	310.287,21	0,10	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	236.103,62	0,08	-
OLIVEIRA TRUST	224.395,92	0,08	-
EQUITAS INVESTIMENTOS	175.115,96	0,06	-
BANRISUL CORRETORA	174.784,19	0,06	-
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	125.191,77	0,04	-

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 Janeiro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,81%	0,81%	4,15%	4,81%	11,43%	23,53%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	0,73%	3,91%	4,78%	11,15%	22,88%	0,53%	1,87%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,60%	0,60%	5,55%	6,14%	18,37%	28,70%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	0,59%	5,52%	6,01%	18,02%	27,84%	1,08%	3,56%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,47%	-1,47%	5,89%	1,54%	19,03%	23,38%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,46%	-1,46%	5,87%	1,60%	18,68%	22,73%	2,01%	6,40%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,77%	5,92%	12,95%	27,12%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,91%	2,80%	5,87%	12,79%	26,67%	0,11%	0,33%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,68%	0,68%	3,99%	4,44%	11,33%	23,79%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	0,66%	3,94%	4,34%	11,18%	23,49%	0,55%	1,85%
IMA-B (Benchmark)	-0,45%	-0,45%	4,97%	2,91%	15,53%	23,80%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,47%	-0,47%	4,92%	2,84%	15,36%	23,40%	1,27%	4,14%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,49%	-0,49%	4,89%	2,70%	15,25%	23,11%	1,28%	4,18%
Selic (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,80%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,93%	0,93%	2,68%	5,81%	12,40%	26,40%	0,01%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,95%	2,78%	5,94%	12,79%	27,22%	0,02%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,88%	0,88%	2,56%	5,51%	11,76%	24,82%	0,01%	0,05%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,79%	0,79%	2,29%	4,96%	10,60%	21,89%	0,01%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,85%	2,92%	5,79%	15,22%	26,51%	0,07%	1,31%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,00%	1,00%	2,92%	6,34%	13,22%	27,95%	0,01%	0,07%
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,78%	0,78%	2,28%	4,94%	10,52%	22,00%	0,02%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	0,90%	3,29%	5,13%	12,54%	26,56%	0,21%	0,83%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,75%	0,75%	2,16%	4,67%	9,99%	20,98%	0,00%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66%	0,66%	3,33%	4,67%	13,16%	25,72%	0,46%	1,30%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1,33%	1,33%	1,07%	2,36%	-	-	0,53%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	2,84%	5,37%	10,86%	22,58%	0,33%	1,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,07%	0,07%	4,62%	3,08%	-	-	1,02%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,48%	0,48%	4,75%	4,60%	15,81%	24,85%	0,65%	3,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,60%	0,60%	4,51%	4,08%	15,04%	25,13%	0,73%	2,59%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	1,63%	1,63%	16,83%	8,69%	26,81%	25,34%	5,13%	12,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,94%	0,94%	2,91%	6,00%	13,08%	27,82%	0,13%	0,36%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	0,76%	3,85%	5,98%	12,77%	26,37%	0,31%	1,17%

Ibovespa (Benchmark)	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	-4,28%	-4,28%	10,93%	7,04%	13,25%	19,88%	5,13%	14,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,57%	-4,57%	13,44%	3,06%	7,75%	3,66%	5,68%	16,19%
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,10%	-7,10%	6,25%	-7,15%	6,36%	-12,28%	10,13%	21,84%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-4,24%	-4,24%	12,76%	3,09%	10,49%	5,13%	5,52%	16,18%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-5,05%	-5,05%	18,18%	5,06%	23,64%	17,94%	6,43%	20,19%
BB FI AÇÕES	1,77%	1,77%	18,54%	21,39%	50,24%	106,59%	7,06%	22,24%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,37%	-3,37%	13,39%	1,81%	6,94%	1,60%	7,28%	17,28%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,15%	-4,15%	11,76%	0,85%	8,47%	4,31%	6,58%	16,00%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,70%	-3,70%	12,67%	4,98%	21,24%	27,93%	6,88%	16,81%

IBX (Benchmark)	-4,51%	-4,51%	13,20%	5,15%	11,88%	12,72%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-4,51%	-4,51%	15,75%	-5,42%	-7,83%	-13,46%	8,65%	21,19%

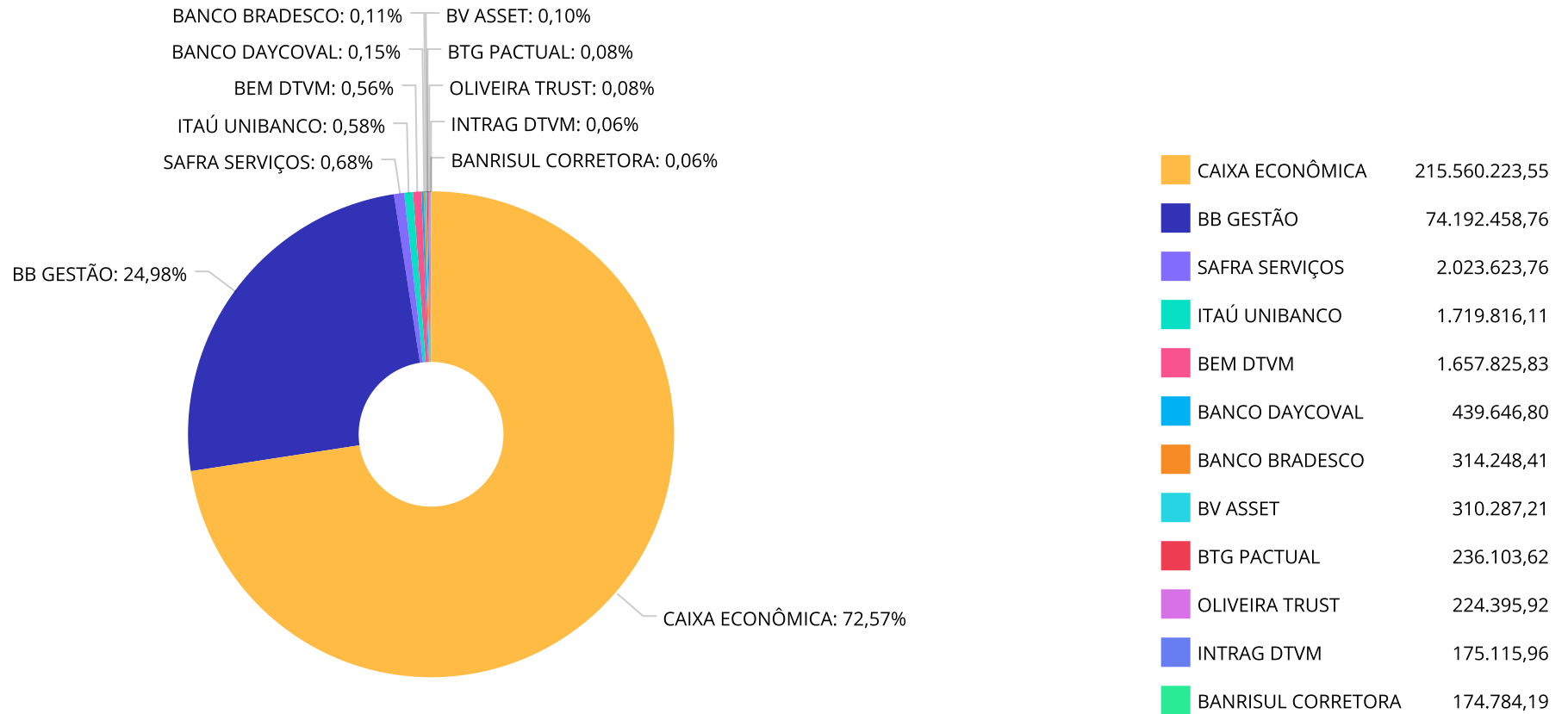
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	-4,15%	-4,15%	13,07%	5,74%	11,32%	13,01%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-4,17%	-4,17%	12,72%	3,55%	7,84%	7,15%	5,38%	16,04%
IDIV (Benchmark)	-3,51%	-3,51%	14,18%	8,88%	15,58%	28,28%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,07%	-3,07%	12,60%	6,01%	15,84%	19,58%	4,80%	13,79%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,54%	-3,54%	13,62%	8,29%	14,09%	25,29%	4,60%	13,85%
IFIX (Benchmark)	0,67%	0,67%	5,63%	4,26%	18,16%	20,04%	-	-
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	-0,98%	-0,98%	-1,20%	-0,96%	-1,50%	-3,80%	2,07%	10,43%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,86%	2,86%	12,43%	7,98%	9,50%	-5,80%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,69%	1,69%	16,97%	8,77%	27,17%	25,92%	5,15%	12,84%
SMLL (Benchmark)	-6,55%	-6,55%	12,50%	-6,30%	6,34%	-10,11%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-3,07%	-3,07%	12,67%	-2,06%	8,87%	-0,59%	8,34%	16,67%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-7,07%	-7,07%	12,05%	-8,37%	5,97%	-12,16%	9,74%	22,90%

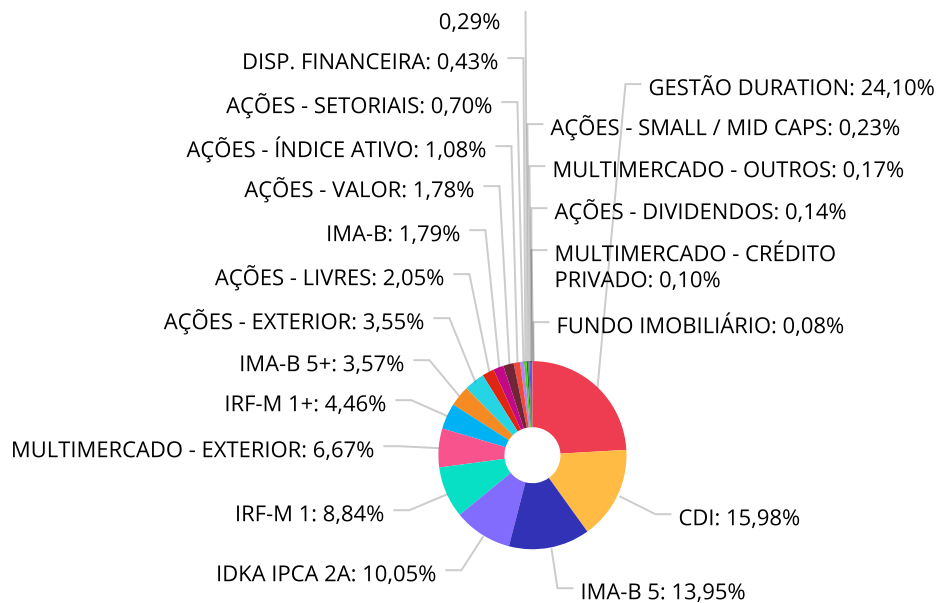
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,78%	4,78%	14,72%	12,57%	26,83%	5,62%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4,34%	4,34%	14,07%	11,66%	20,51%	2,82%	5,46%	13,425%
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3,80%	3,80%	18,95%	15,19%	40,84%	15,82%	7,33%	16,181%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,86%	2,86%	12,43%	7,98%	9,50%	-5,80%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIAÇÕES	3,70%	3,70%	12,38%	10,00%	8,98%	-15,60%	5,87%	14,680%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2024)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2024)

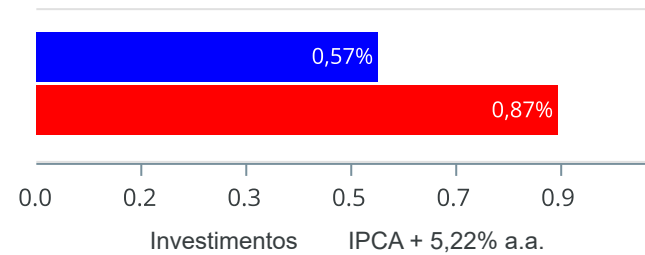


■ GESTÃO DURATION	71.886.304,43	■ CDI	47.684.858,66	■ IMA-B 5	41.602.144,74
■ IDKA IPCA 2A	29.980.140,73	■ IRF-M 1	26.356.919,21	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	19.890.078,07
■ IRF-M 1+	13.300.895,84	■ IMA-B 5+	10.645.020,68	■ AÇÕES - EXTERIOR	10.581.714,90
■ AÇÕES - LIVRES	6.124.563,06	■ IMA-B	5.329.434,03	■ AÇÕES - VALOR	5.323.536,72
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.233.330,06	■ AÇÕES - SETORIAIS	2.075.081,20	■ DISP. FINANCEIRA	1.290.942,58
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	860.875,12	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	674.935,00	■ MULTIMERCADO - OUTROS	513.955,98
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	430.058,56	■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	310.287,21	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	224.395,92

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	296.009.985,01	2.007.927,42	2.683.858,25	297.028.530,12	1.694.475,94	1.694.475,94	0,57%	0,57%	0,87%	0,87%	66,02%	1,28%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

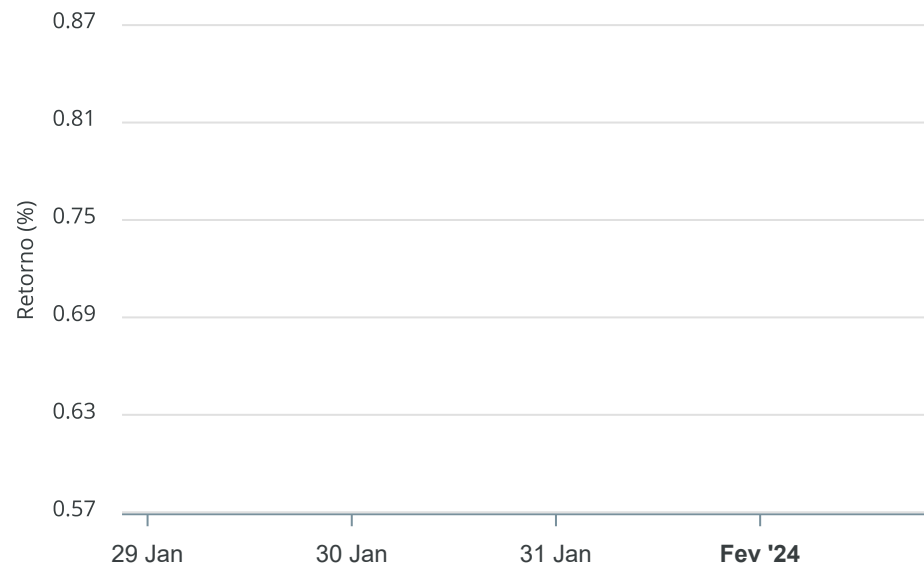


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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 Janeiro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1.019.534,63	0,00	0,00	1.033.098,09	13.563,46	1,33%	1,33%	0,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	13.998.353,48	0,00	0,00	14.153.346,15	154.992,67	1,11%	1,11%	0,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.966.891,67	63.570,27	165.000,00	28.146.252,99	280.791,05	1,00%	1,00%	0,01%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	107.205,64	0,00	0,00	108.202,54	996,90	0,93%	0,93%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	26.118.747,15	0,00	0,00	26.356.919,21	238.172,06	0,91%	0,91%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	600.039,84	0,00	0,00	605.462,04	5.422,20	0,90%	0,90%	0,21%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.650.700,88	1.093.880,50	0,00	8.823.412,58	78.831,20	0,90%	0,95%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	9.414.923,54	0,00	0,00	9.497.781,25	82.857,71	0,88%	0,88%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	25.754.072,64	0,00	0,00	25.972.767,06	218.694,42	0,85%	0,85%	0,07%
BRASESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	311.797,12	0,00	0,00	314.248,41	2.451,29	0,79%	0,79%	0,01%
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	63.762,56	2.310,09	0,00	66.581,65	509,00	0,77%	0,78%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	28.737.414,28	0,00	0,00	28.947.042,64	209.628,36	0,73%	0,73%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.297.104,14	0,00	0,00	22.445.131,39	148.027,25	0,66%	0,66%	0,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	46.758.209,34	0,00	1.750.000,00	45.313.139,28	304.929,94	0,65%	0,66%	0,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	13.223.202,12	0,00	0,00	13.300.895,84	77.693,72	0,59%	0,59%	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	597.556,58	0,00	0,00	600.398,09	2.841,51	0,48%	0,48%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	4.999.950,97	0,00	0,00	5.003.667,20	3.716,23	0,07%	0,07%	1,02%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	42.954,62	848.166,56	768.858,25	122.917,20	654,27	0,07%	0,75%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.000.603,13	0,00	0,00	3.981.990,14	-18.612,99	-0,47%	-0,47%	1,27%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.354.117,38	0,00	0,00	1.347.443,89	-6.673,49	-0,49%	-0,49%	1,28%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	10.802.446,42	0,00	0,00	10.645.020,68	-157.425,74	-1,46%	-1,46%	2,01%
Total Renda Fixa	245.819.588,13	2.007.927,42	2.683.858,25	246.785.718,32	1.642.061,02	0,67%		0,43%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI AÇÕES	1.299.214,03	0,00	0,00	1.322.195,04	22.981,01	1,77%	1,77%	7,06%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17.570.338,65	0,00	0,00	17.866.454,31	296.115,66	1,69%	1,69%	5,15%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	1.991.208,42	0,00	0,00	2.023.623,76	32.415,34	1,63%	1,63%	5,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	509.173,12	0,00	0,00	513.955,98	4.782,86	0,94%	0,94%	0,13%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	854.406,86	0,00	0,00	860.875,12	6.468,26	0,76%	0,76%	0,31%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	308.438,65	0,00	0,00	310.287,21	1.848,56	0,60%	0,60%	0,73%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	224.726,40	0,00	0,00	224.395,92	-330,48	-0,15%	0,05%	2,07%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	515.349,96	0,00	0,00	499.535,97	-15.813,99	-3,07%	-3,07%	8,34%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	263.545,47	0,00	0,00	255.449,00	-8.096,47	-3,07%	-3,07%	4,80%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	244.334,31	0,00	0,00	236.103,62	-8.230,69	-3,37%	-3,37%	7,28%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	181.012,66	0,00	0,00	174.609,56	-6.403,10	-3,54%	-3,54%	4,60%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	243.316,46	0,00	0,00	234.315,19	-9.001,27	-3,70%	-3,70%	6,88%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5.960.596,42	0,00	0,00	5.713.343,48	-247.252,94	-4,15%	-4,15%	6,58%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.373.900,24	0,00	0,00	3.233.330,06	-140.570,18	-4,17%	-4,17%	5,38%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	130.730,32	0,00	0,00	125.191,77	-5.538,55	-4,24%	-4,24%	5,52%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	254.867,62	0,00	0,00	243.967,30	-10.900,32	-4,28%	-4,28%	5,13%
META VALOR FI AÇÕES	460.400,32	0,00	0,00	439.646,80	-20.753,52	-4,51%	-4,51%	8,65%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.986.379,75	0,00	0,00	4.758.698,15	-227.681,60	-4,57%	-4,57%	5,68%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	289.217,09	0,00	0,00	274.603,67	-14.613,42	-5,05%	-5,05%	6,43%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	188.739,71	0,00	0,00	175.399,03	-13.340,68	-7,07%	-7,07%	9,74%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	188.508,05	0,00	0,00	175.115,96	-13.392,09	-7,10%	-7,10%	10,13%
Total Renda Variável	40.038.404,51	0,00	0,00	39.661.096,90	-377.307,61	-0,94%		5,43%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	8.428.807,35	0,00	0,00	8.794.503,86	365.696,51	4,34%	4,34%	5,46%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	234.178,62	0,00	0,00	243.073,58	8.894,96	3,80%	3,80%	7,33%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI ...	1.489.006,40	0,00	0,00	1.544.137,46	55.131,06	3,70%	3,70%	5,87%
Total Exterior	10.151.992,37	0,00	0,00	10.581.714,90	429.722,53	4,23%		5,56%

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.

