

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 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	69.490,90	0,02%	1.863	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	26.173.659,01	8,60%	709	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA P...	D+0	46980	4.896.286,24	1,61%	43	2,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	13.861.181,11	4,55%	370	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	45.564.516,15	14,97%	798	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	29.074.128,22	9,55%	843	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.574.574,36	7,42%	913	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	10.697.962,31	3,51%	283	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.003.426,98	1,32%	775	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	26.552.541,74	8,72%	1.191	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	13.342.513,97	4,38%	252	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.307.783,54	3,39%	734	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	126.165,15	0,04%	13.442	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	603.745,91	0,20%	220	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	109.041,76	0,04%	1.235	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	11.555.273,27	3,80%	1.015	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.354.428,83	0,44%	246	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	316.271,87	0,10%	1.435	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	29.378.024,13	9,65%	993	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	608.548,80	0,20%	220	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2024)

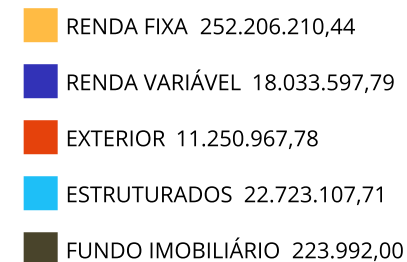
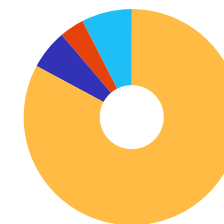
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	1.036.646,19	0,34%	31	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	507.691,31	0,17%	2.626	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.786.458,89	1,57%	1.264	0,59%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI AÇÕES	D+4	Não há	1.372.905,17	0,45%	38.453	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	249.227,47	0,08%	3.699	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	275.241,94	0,09%	4.342	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	177.427,95	0,06%	9.233	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	241.840,71	0,08%	2.045	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.754.737,77	1,89%	909	0,91%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	3.260.334,65	1,07%	82	0,84%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	175.980,58	0,06%	2.289	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	260.039,20	0,09%	146	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	234.867,79	0,08%	2.134	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+6 ou ...	Não há	169.483,02	0,06%	30	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	440.987,89	0,14%	94	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	126.373,45	0,04%	2.846	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	D+6 du	Não há	1.594.252,23	0,52%	18	1,92%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	9.392.631,39	3,09%	142	0,65%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	264.084,16	0,09%	17.010	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	867.027,43	0,28%	174	0,26%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 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	315.788,67	0,10%	3	0,34%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	18.884.459,79	6,20%	6.935	1,06%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	517.921,43	0,17%	33	0,53%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	2.137.910,39	0,70%	75	0,33%	Artigo 10º, Inciso I
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	Não se ...	Não se aplica	223.992,00	0,07%		0,38%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			304.437.875,72				
			182.678,57				Artigo 6º
			304.620.554,29				
PL Total			304.620.554,29				

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

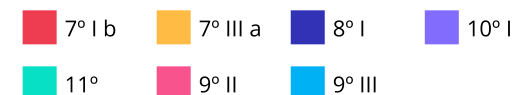
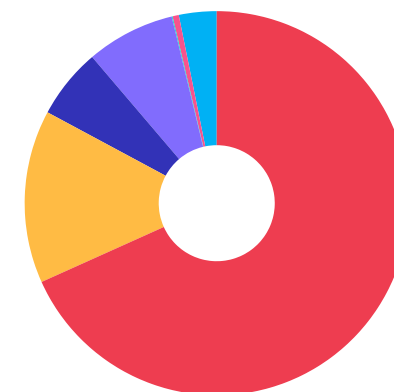
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	304.437.875,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	207.847.975,59	68,27%	25,00%	30,00%	100,00%	96.589.900,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	30.443.787,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	44.358.234,85	14,57%	10,00%	22,50%	60,00%	138.304.490,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	30.443.787,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	15.221.893,79
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	15.221.893,79
Total Renda Fixa	100,00%	252.206.210,44	82,84%	35,00%	72,50%	290,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	18.033.597,79	5,92%	5,00%	8,00%	30,00%	73.297.764,93
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	30.443.787,57
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	22.723.107,71	7,46%	5,00%	8,00%	10,00%	7.720.679,86
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	15.221.893,79
Artigo 11º	5,00%	223.992,00	0,07%	0,10%	1,50%	5,00%	14.997.901,79
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	40.980.697,50	13,46%	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%	1.594.252,23	0,52%	0,00%	1,00%	10,00%	28.849.535,34
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.656.715,55	3,17%	0,00%	4,00%	10,00%	20.787.072,02
Total Exterior	10,00%	11.250.967,78	3,70%	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 (Fevereiro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS...	220.192.056,33	72,33	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	76.820.085,09	25,23	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	2.137.910,39	0,70	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.730.216,14	0,57	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.036.646,19	0,34	0,07
AZ QUEST INVESTIMENTOS	507.691,31	0,17	0,00
META ASSET MANAGEMENT	440.987,89	0,14	0,21
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	316.271,87	0,10	0,00
BV ASSET	315.788,67	0,10	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	241.840,71	0,08	0,00
OLIVEIRA TRUST	223.992,00	0,07	0,00
BANRISUL CORRETORA	178.532,66	0,06	0,00
EQUITAS INVESTIMENTOS	169.483,02	0,06	0,01
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	126.373,45	0,04	0,00

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 Fevereiro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,42%	1,23%	2,70%	4,46%	10,12%	22,51%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,44%	1,17%	2,59%	4,43%	9,99%	22,02%	0,48%	1,70%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,34%	0,94%	2,69%	5,87%	17,85%	28,53%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	0,90%	2,63%	5,76%	17,51%	27,67%	1,01%	3,37%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,51%	-0,96%	2,94%	3,37%	18,26%	24,00%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	-0,97%	2,93%	3,41%	17,93%	23,32%	1,25%	6,09%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,76%	1,61%	2,53%	5,52%	12,71%	27,14%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,74%	1,66%	2,56%	5,48%	12,54%	26,69%	0,09%	0,29%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,59%	1,28%	2,76%	4,42%	10,44%	23,21%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	1,24%	2,70%	4,32%	10,29%	22,91%	0,41%	1,75%
IMA-B (Benchmark)	0,55%	0,10%	2,85%	3,87%	14,70%	23,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,07%	2,80%	3,78%	14,54%	23,41%	0,79%	3,95%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	0,02%	2,77%	3,70%	14,42%	23,07%	0,79%	3,99%
Selic (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,68%	12,74%	27,39%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,78%	1,71%	2,59%	5,44%	12,25%	26,30%	0,01%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,61%	2,45%	5,17%	11,62%	24,88%	0,01%	0,05%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,64%	1,44%	2,18%	4,64%	10,47%	21,98%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83%	1,84%	2,78%	5,90%	13,25%	27,96%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	1,74%	2,66%	5,58%	12,63%	27,10%	0,05%	0,09%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,62%	1,37%	2,07%	4,39%	9,87%	21,04%	0,00%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,63%	2,59%	5,52%	14,98%	26,64%	0,04%	1,14%
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,65%	1,43%	2,18%	4,62%	10,40%	22,06%	0,02%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,51%	1,42%	2,56%	4,98%	12,14%	26,09%	0,33%	0,84%
IPCA (Benchmark)	0,83%	1,25%	1,82%	2,62%	4,50%	10,34%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,21%	2,44%	4,59%	12,70%	25,41%	0,42%	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	0,72%	2,72%	3,75%	-	-	0,68%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,85%	2,79%	5,19%	10,20%	22,19%	0,25%	1,07%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,34%	1,68%	2,58%	1,88%	-	-	0,69%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,56%	1,04%	2,66%	4,80%	15,14%	24,39%	0,49%	2,86%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,80%	1,78%	2,69%	5,69%	12,74%	27,40%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,77%	1,72%	2,70%	5,65%	13,16%	27,64%	0,09%	0,36%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,77%	2,38%	4,31%	5,26%	16,60%	26,25%	0,97%	2,54%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5,65%	7,37%	12,91%	15,94%	36,36%	35,36%	5,23%	12,28%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,72%	1,48%	2,62%	6,04%	12,78%	26,36%	0,43%	1,17%

Ibovespa (Benchmark)	0,99%	-3,85%	1,33%	11,47%	22,96%	14,03%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,58%	-4,01%	1,79%	10,06%	16,96%	4,65%	7,13%	15,73%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,94%	-3,33%	1,81%	10,30%	20,51%	11,21%	6,81%	15,80%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	2,16%	-2,21%	2,72%	13,09%	24,64%	24,22%	5,50%	14,10%
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,22%	-10,09%	-4,59%	-7,09%	2,31%	-13,82%	5,37%	20,91%
BB FI AÇÕES	3,84%	5,67%	8,43%	26,94%	54,56%	99,33%	9,30%	21,96%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	0,23%	-4,83%	2,15%	12,89%	31,22%	19,92%	9,84%	19,46%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,43%	-1,02%	3,76%	12,36%	16,89%	6,29%	6,19%	17,01%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,24%	-3,47%	1,09%	9,05%	31,48%	28,06%	7,22%	16,39%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,73%	-3,45%	1,76%	6,61%	17,41%	6,48%	6,41%	15,70%

IBX (Benchmark)	0,96%	-3,59%	1,70%	11,76%	22,23%	12,17%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	0,31%	-4,22%	2,99%	4,53%	1,72%	-11,33%	7,85%	21,04%

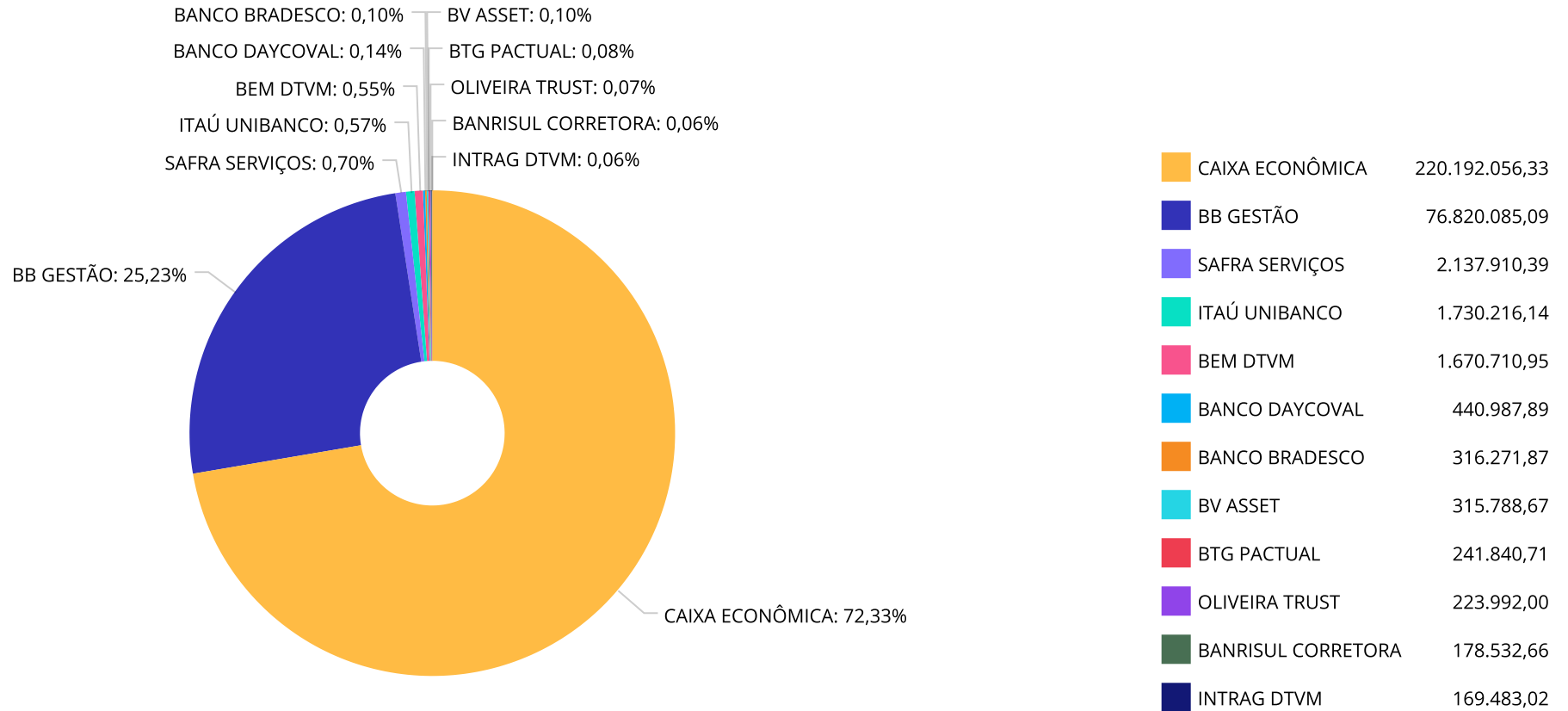
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	0,91%	-3,27%	1,87%	12,03%	21,50%	12,09%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,84%	-3,37%	2,28%	10,90%	17,48%	6,90%	6,63%	15,69%
IDIV (Benchmark)	0,91%	-2,64%	4,09%	13,07%	26,16%	32,52%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1,80%	-1,33%	4,50%	11,77%	25,83%	22,59%	6,12%	13,24%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,79%	-2,78%	3,74%	12,32%	24,33%	29,35%	5,99%	13,18%
IFIX (Benchmark)	0,79%	1,47%	5,77%	4,58%	19,64%	22,58%	-	-
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	0,63%	-0,36%	-0,73%	-0,43%	0,21%	-2,22%	5,05%	10,30%
MSCI ACWI (Benchmark)	4,79%	7,79%	10,70%	12,33%	15,81%	5,67%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,70%	7,48%	13,06%	16,03%	36,81%	35,94%	5,27%	12,36%
SMLL (Benchmark)	0,47%	-6,11%	0,51%	1,70%	19,40%	-4,74%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1,16%	-5,99%	0,88%	-0,17%	19,97%	-5,93%	9,09%	22,71%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,63%	-1,49%	3,68%	6,16%	16,93%	2,55%	6,31%	16,74%

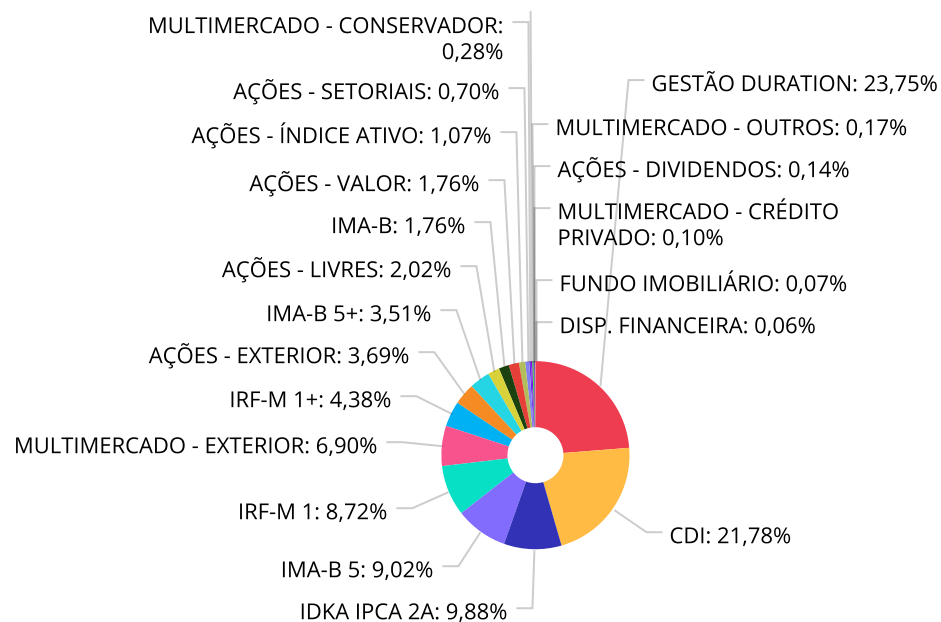
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,30%	11,38%	14,54%	15,88%	33,29%	20,49%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,80%	11,43%	14,81%	15,97%	28,22%	16,52%	8,51%	13,583%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,64%	12,77%	16,92%	22,59%	55,95%	34,34%	9,07%	16,300%
MSCI ACWI (Benchmark)	4,79%	7,79%	10,70%	12,33%	15,81%	5,67%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	3,25%	7,07%	9,84%	10,15%	11,60%	-8,26%	5,46%	14,168%

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



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

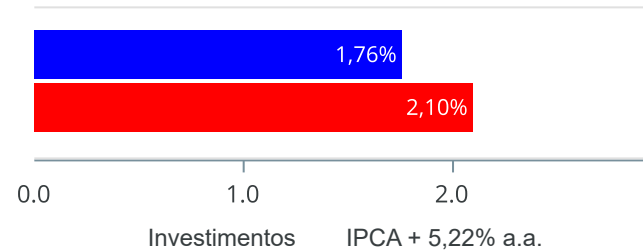


■ GESTÃO DURATION	72.341.921,07	■ CDI	66.331.780,53	■ IDKA IPCA 2A	30.110.774,41
■ IMA-B 5	27.470.860,60	■ IRF-M 1	26.552.541,74	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	21.022.370,18
■ IRF-M 1+	13.342.513,97	■ AÇÕES - EXTERIOR	11.250.967,78	■ IMA-B 5+	10.697.962,31
■ AÇÕES - LIVRES	6.166.061,50	■ IMA-B	5.357.855,81	■ AÇÕES - VALOR	5.353.820,23
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.260.334,65	■ AÇÕES - SETORIAIS	2.132.242,37	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	867.027,43
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	685.119,26	■ MULTIMERCADO - OUTROS	517.921,43	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	436.019,78
■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	315.788,67	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	223.992,00	■ DISP. FINANCEIRA	182.678,57

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%
Fevereiro	297.028.530,12	5.313.570,39	1.451.686,73	304.437.875,72	3.547.461,94	5.241.937,88	1,18%	1,76%	1,22%	2,10%	83,91%	1,36%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



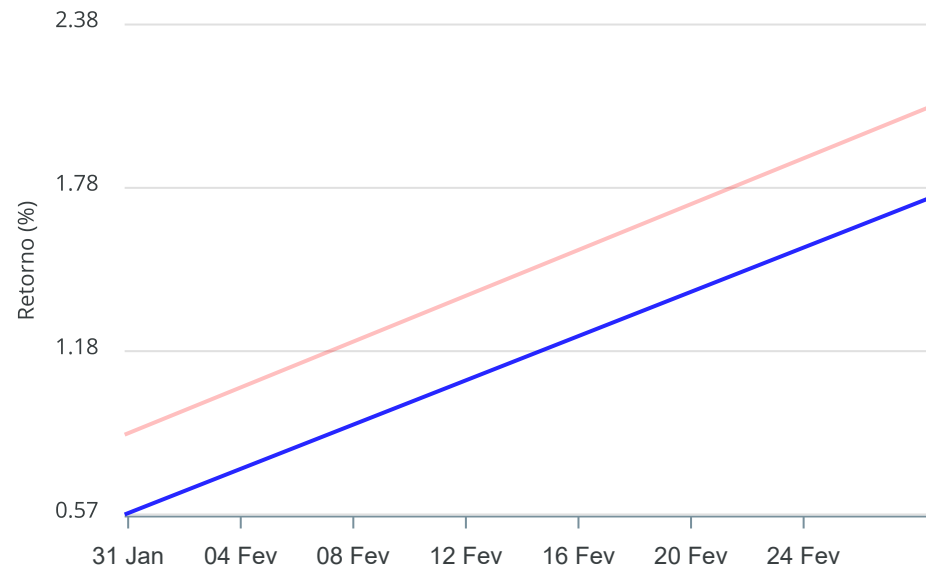
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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

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	28.146.252,99	1.039.300,00	39.500,00	29.378.024,13	231.971,14	0,79%	0,82%	0,02%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	108.202,54	0,00	0,00	109.041,76	839,22	0,78%	0,78%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	25.972.767,06	0,00	0,00	26.173.659,01	200.891,95	0,77%	0,77%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	26.356.919,21	0,00	0,00	26.552.541,74	195.622,53	0,74%	0,74%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.823.412,58	1.409.600,00	0,00	10.307.783,54	74.770,96	0,73%	0,79%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	14.153.346,15	0,00	394.925,36	13.861.181,11	102.760,32	0,73%	0,73%	0,25%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	314.248,41	0,00	0,00	316.271,87	2.023,46	0,64%	0,64%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	9.497.781,25	1.984.142,37	0,00	11.555.273,27	73.349,65	0,64%	0,73%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PRE...	5.003.667,20	0,00	139.217,01	4.896.286,24	31.836,05	0,64%	0,64%	0,68%
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	66.581,65	2.471,46	0,00	69.490,90	437,79	0,63%	0,64%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.445.131,39	0,00	0,00	22.574.574,36	129.442,97	0,58%	0,58%	0,41%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	600.398,09	0,00	0,00	603.745,91	3.347,82	0,56%	0,56%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	45.313.139,28	0,00	0,00	45.564.516,15	251.376,87	0,55%	0,55%	0,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.981.990,14	0,00	0,00	4.003.426,98	21.436,84	0,54%	0,54%	0,79%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.347.443,89	0,00	0,00	1.354.428,83	6.984,94	0,52%	0,52%	0,79%
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	605.462,04	0,00	0,00	608.548,80	3.086,76	0,51%	0,51%	0,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	10.645.020,68	0,00	0,00	10.697.962,31	52.941,63	0,50%	0,50%	1,25%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	28.947.042,64	0,00	0,00	29.074.128,22	127.085,58	0,44%	0,44%	0,48%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1.033.098,09	0,00	0,00	1.036.646,19	3.548,10	0,34%	0,34%	0,69%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	13.300.895,84	0,00	0,00	13.342.513,97	41.618,13	0,31%	0,31%	1,01%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	122.917,20	878.056,56	875.572,90	126.165,15	764,29	0,08%	0,62%	0,00%
Total Renda Fixa	246.785.718,32	5.313.570,39	1.449.215,27	252.206.210,44	1.556.137,00	0,62%		0,34%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17.866.454,31	0,00	0,00	18.884.459,79	1.018.005,48	5,70%	5,70%	5,27%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2.023.623,76	0,00	0,00	2.137.910,39	114.286,63	5,65%	5,65%	5,23%
BB FI AÇÕES	1.322.195,04	0,00	0,00	1.372.905,17	50.710,13	3,84%	3,84%	9,30%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	236.103,62	0,00	0,00	241.840,71	5.737,09	2,43%	2,43%	6,19%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	243.967,30	0,00	0,00	249.227,47	5.260,17	2,16%	2,16%	5,50%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	255.449,00	0,00	0,00	260.039,20	4.590,20	1,80%	1,80%	6,12%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	310.287,21	0,00	0,00	315.788,67	5.501,46	1,77%	1,77%	0,97%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	499.535,97	0,00	0,00	507.691,31	8.155,34	1,63%	1,63%	6,31%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	175.399,03	0,00	0,00	177.427,95	2.028,92	1,16%	1,16%	9,09%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	125.191,77	0,00	0,00	126.373,45	1.181,68	0,94%	0,94%	6,81%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	224.395,92	0,00	2.471,46	223.992,00	2.067,54	0,92%	1,76%	5,05%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.233.330,06	0,00	0,00	3.260.334,65	27.004,59	0,84%	0,84%	6,63%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	174.609,56	0,00	0,00	175.980,58	1.371,02	0,79%	0,79%	5,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	513.955,98	0,00	0,00	517.921,43	3.965,45	0,77%	0,77%	0,09%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5.713.343,48	0,00	0,00	5.754.737,77	41.394,29	0,72%	0,72%	6,41%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	860.875,12	0,00	0,00	867.027,43	6.152,31	0,71%	0,71%	0,43%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.758.698,15	0,00	0,00	4.786.458,89	27.760,74	0,58%	0,58%	7,13%
META VALOR FI AÇÕES	439.646,80	0,00	0,00	440.987,89	1.341,09	0,31%	0,31%	7,85%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	234.315,19	0,00	0,00	234.867,79	552,60	0,24%	0,24%	7,22%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	274.603,67	0,00	0,00	275.241,94	638,27	0,23%	0,23%	9,84%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/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	175.115,96	0,00	0,00	169.483,02	-5.632,94	-3,22%	-3,22%	5,37%
Total Renda Variável	39.661.096,90	0,00	2.471,46	40.980.697,50	1.322.072,06	3,33%		5,80%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	243.073,58	0,00	0,00	264.084,16	21.010,58	8,64%	8,64%	9,07%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	8.794.503,86	0,00	0,00	9.392.631,39	598.127,53	6,80%	6,80%	8,51%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI ...	1.544.137,46	0,00	0,00	1.594.252,23	50.114,77	3,25%	3,25%	5,46%
Total Exterior	10.581.714,90	0,00	0,00	11.250.967,78	669.252,88	6,32%		8,09%

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.

