

# Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2024

**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2024)**

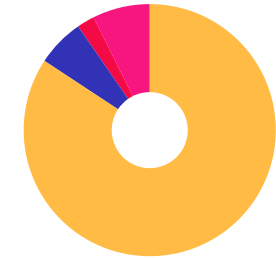
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			15.231.621,33	30,04%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	62.052,98	0,12%	650	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.044.555,12	2,06%	315	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	532.657,44	1,05%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	273.476,39	0,54%	284	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.431.377,99	2,82%	771	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	548.656,96	1,08%	158	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.329.873,92	6,57%	1.190	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.667.198,72	5,26%	251	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	556.710,45	1,10%	450	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	1.467.068,92	2,89%	58	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	529.156,69	1,04%	76	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.794.084,34	5,51%	217	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	704.591,64	1,39%	48.487	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.398.543,59	2,76%	1.003	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	304.082,81	0,60%	1.134	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.298.435,45	2,56%	447	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA...	D+1 du	Não há	758.916,57	1,50%	34	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.521.872,84	4,97%	397	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.341.692,40	6,59%	222	0,14%	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
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.923.949,89	3,79%	99	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	D+4	Não há	289.390,54	0,57%	5.440	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	107.421,19	0,21%	1.294	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	476.858,11	0,94%	12.834	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	242.249,70	0,48%	25.212	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	617.987,88	1,22%	6.061	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	280.450,12	0,55%	16	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	819.312,52	1,62%	8.781	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	D+92	Não há	267.312,65	0,53%	15	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	576.300,76	1,14%	142	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	115.192,08	0,23%	16.167	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	450.191,41	0,89%	468	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	2.125.599,23	4,19%	2.630	0,39%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.611.091,95	3,18%	2.597	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>50.699.934,58</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>6.324,18</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>50.706.258,76</b>				

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

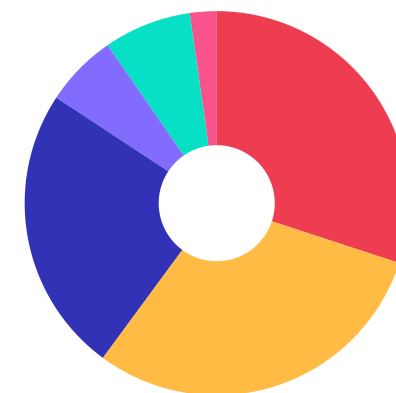
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	15.231.621,33	30,04%	22,00%	40,00%	60,00%	15.188.339,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	15.236.869,92	30,05%	0,00%	20,00%	100,00%	35.463.064,66
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	12.252.085,19	24,17%	0,00%	14,50%	60,00%	18.167.875,56
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.139.986,92
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	506.999,35
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>42.720.576,44</b>	<b>84,26%</b>	<b>22,00%</b>	<b>75,00%</b>	<b>241,00%</b>	



**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%	3.100.982,71	6,12%	0,00%	8,00%	30,00%	12.108.997,66
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.736.691,18	7,37%	0,00%	10,00%	10,00%	1.333.302,28
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>6.837.673,89</b>	<b>13,49%</b>	<b>0,00%</b>	<b>18,00%</b>	<b>40,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.141.684,25	2,25%	0,00%	7,00%	10,00%	3.928.309,21
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>1.141.684,25</b>	<b>2,25%</b>	<b>0,00%</b>	<b>7,00%</b>	<b>10,00%</b>	



**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
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	15.231.621,33	30,04	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	11.930.068,68	23,53	0,00
CAIXA DTVM	11.486.565,67	22,66	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.853.895,96	11,55	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	2.884.515,80	5,69	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.467.068,92	2,89	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.298.435,45	2,56	0,00
ITAÚ DTVM	280.450,12	0,55	0,00
TARPON INVESTIMENTOS	267.312,65	0,53	-

**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
<b>IMA Geral (Benchmark)</b>	0,47%	0,47%	3,98%	5,14%	14,53%	26,21%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	0,45%	3,95%	5,01%	14,44%	26,03%	0,58%	1,84%
<b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-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%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,48%	-1,48%	5,83%	1,44%	18,74%	22,79%	2,03%	6,50%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,45%	-0,45%	4,97%	2,91%	15,53%	23,80%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,48%	-0,48%	4,92%	2,78%	15,23%	23,18%	1,28%	4,15%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,56%	-0,56%	4,91%	2,15%	15,08%	22,01%	1,59%	4,50%
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%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,67%	0,67%	4,68%	6,05%	16,31%	27,74%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,67%	0,67%	4,66%	5,95%	16,08%	27,41%	0,79%	2,44%



**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
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,43%	1,43%	-1,22%	4,41%	9,29%	-	0,99%	2,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,89%	0,89%	2,65%	5,37%	12,41%	27,77%	0,20%	0,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	0,90%	3,29%	5,13%	12,54%	26,56%	0,21%	0,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01%	1,01%	2,98%	6,53%	13,43%	28,71%	0,02%	0,11%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,04%	6,56%	13,58%	28,79%	0,07%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,80%	27,43%	0,01%	0,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,88%	0,88%	2,56%	5,51%	11,76%	24,82%	0,01%	0,05%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,42%	0,42%	1,27%	2,01%	4,51%	10,54%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,12%	2,87%	5,42%	-	-	0,33%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,48%	0,48%	4,75%	4,60%	15,81%	24,85%	0,65%	3,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	2,84%	5,37%	10,86%	22,58%	0,33%	1,26%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,84%	0,84%	3,23%	4,84%	12,79%	-	0,33%	1,12%

**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
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,97%	0,97%	2,81%	6,04%	12,87%	27,33%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,93%	0,93%	2,81%	5,52%	12,33%	27,52%	0,09%	0,31%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	4,78%	4,78%	14,72%	12,57%	26,83%	5,62%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,56%	4,56%	14,16%	11,69%	25,21%	3,42%	5,69%	14,74%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-4,79%	-4,79%	12,91%	4,76%	12,63%	13,92%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-5,18%	-5,18%	11,13%	3,37%	4,06%	-1,34%	6,01%	16,60%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-8,56%	-8,56%	13,78%	-4,77%	29,15%	12,58%	10,82%	27,05%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,57%	-4,57%	13,44%	3,06%	7,75%	3,66%	5,68%	16,19%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	-5,84%	-5,84%	7,05%	2,45%	4,68%	-3,15%	5,34%	14,71%
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	-6,05%	-6,05%	11,42%	10,30%	43,25%	-	10,45%	19,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-3,98%	-3,98%	13,06%	0,35%	7,93%	2,31%	6,44%	16,28%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-8,43%	-8,43%	12,59%	-11,83%	-5,88%	-30,20%	9,43%	23,55%
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	1,59%	1,59%	15,54%	5,59%	18,86%	7,31%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1,72%	1,72%	17,05%	9,04%	27,92%	32,08%	5,17%	12,83%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-6,55%	-6,55%	12,50%	-6,30%	6,34%	-10,11%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-5,76%	-5,76%	13,19%	-5,09%	6,01%	-5,82%	8,95%	19,86%

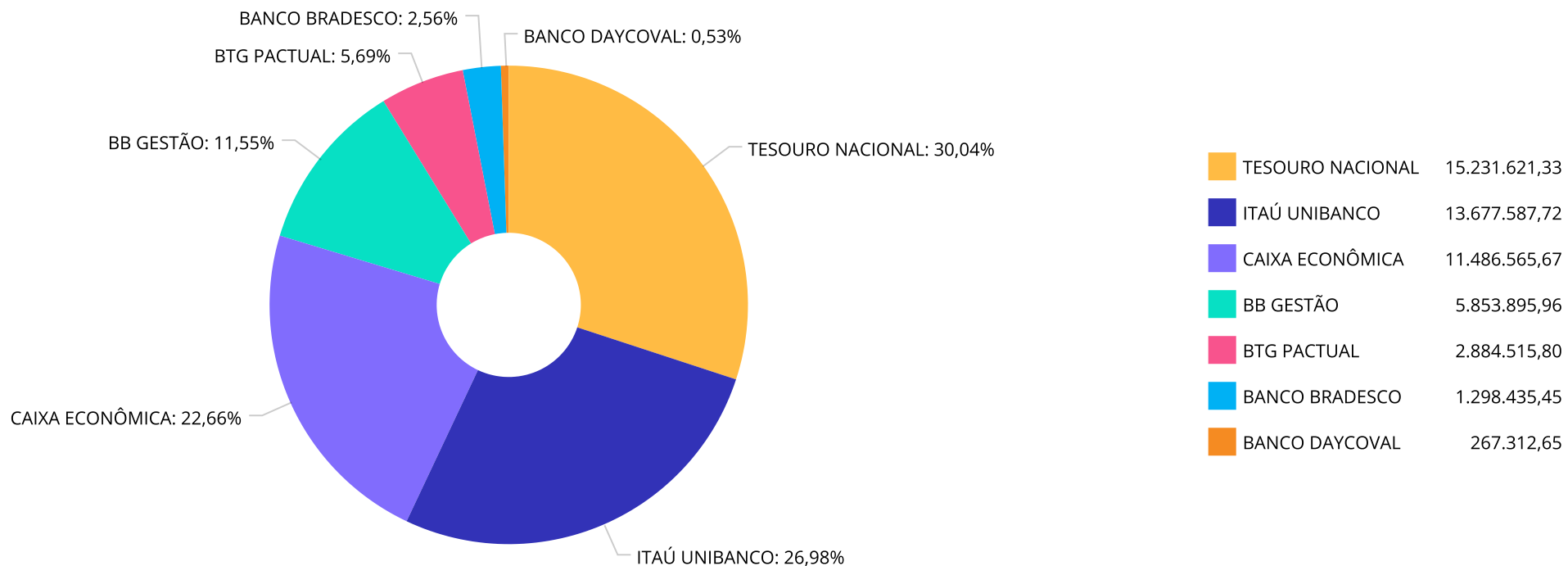
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - RENDA VARIÁVEL

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

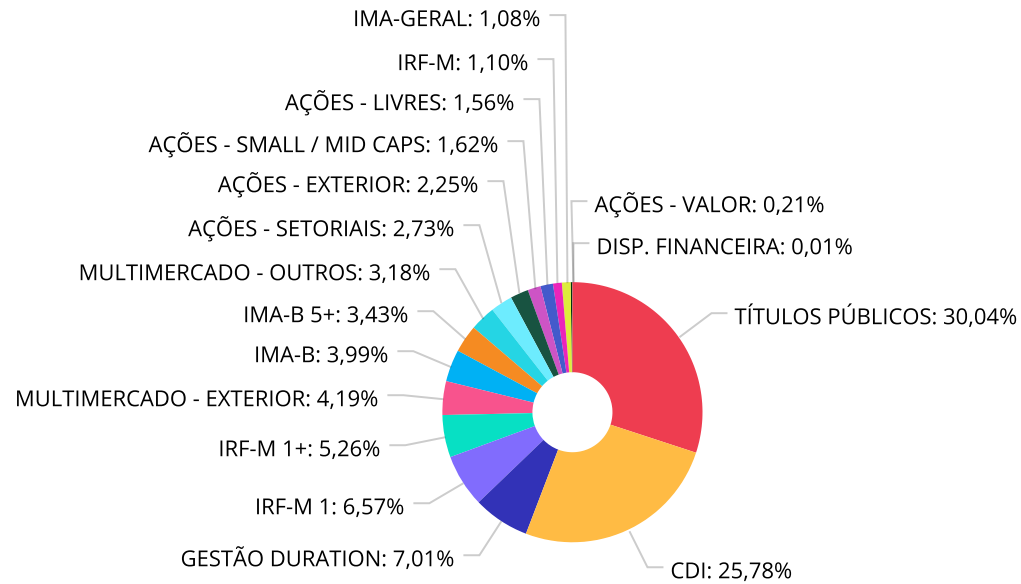
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	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 FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,34%	4,34%	14,07%	11,66%	20,51%	2,82%	5,46%	13,425%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,56%	4,56%	14,15%	11,69%	25,21%	3,42%	5,69%	14,738%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,80%	3,80%	18,95%	15,19%	40,84%	15,82%	7,33%	16,181%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	15.231.621,33	■ CDI	13.070.381,18	■ GESTÃO DURATION	3.553.000,91	■ IRF-M 1	3.329.873,92
■ IRF-M 1+	2.667.198,72	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.125.599,23	■ IMA-B	2.022.587,66	■ IMA-B 5+	1.740.545,31
■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.611.091,95	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.384.236,53	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.141.684,25	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	819.312,52
■ AÇÕES - LIVRES	790.012,47	■ IRF-M	556.710,45	■ IMA-GERAL	548.656,96	■ AÇÕES - VALOR	107.421,19
■ DISP. FINANCEIRA	6.324,18						

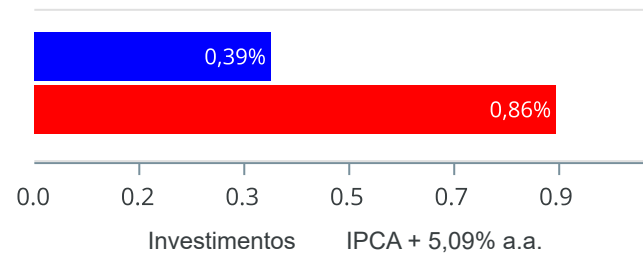
**Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2024)**

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/08/2023	800	4.218,270404	4.303,477437	3.374.616,32	3.442.781,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	03/10/2023	120	4.169,170000	4.310,868182	500.300,40	517.304,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	08/08/2023	800	4.159,770000	4.282,015691	3.327.816,00	3.425.612,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	03/10/2023	120	4.161,160000	4.268,613135	499.339,20	512.233,57	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	03/10/2023	120	4.236,300000	4.373,941753	508.356,00	524.873,01	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	28/07/2023	100	4.294,800000	4.525,557115	429.480,00	452.555,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	03/10/2023	120	4.266,530000	4.405,997741	511.983,60	528.719,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	27/07/2023	100	4.387,000000	4.519,574732	438.700,00	451.957,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	27/11/2023	100	4.387,000000	4.384,691545	438.700,00	438.469,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/08/2023	390	4.457,720000	4.655,626649	1.738.510,80	1.815.694,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	27/11/2023	150	4.355,990000	4.449,215518	653.398,50	667.382,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	22/11/2023	150	4.287,850000	4.386,108314	643.177,50	657.916,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/08/2023	390	4.465,490000	4.605,438534	1.741.541,10	1.796.121,02	Curva

**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	49.477.337,95	1.226.795,94	203.605,60	50.699.934,58	199.406,29	199.406,29	0,39%	0,39%	0,86%	0,86%	46,12%	1,66%

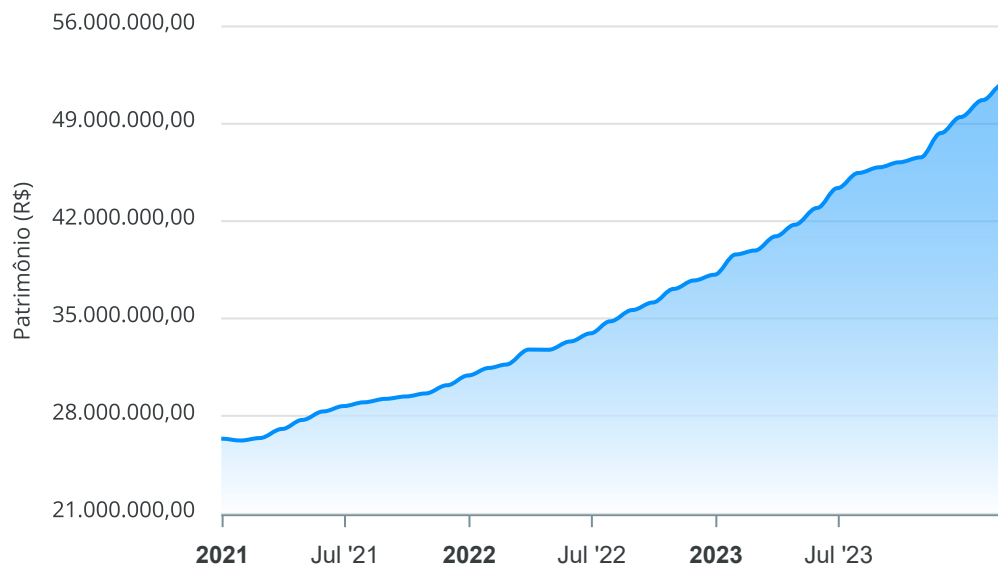
Investimentos x Meta de Rentabilidade





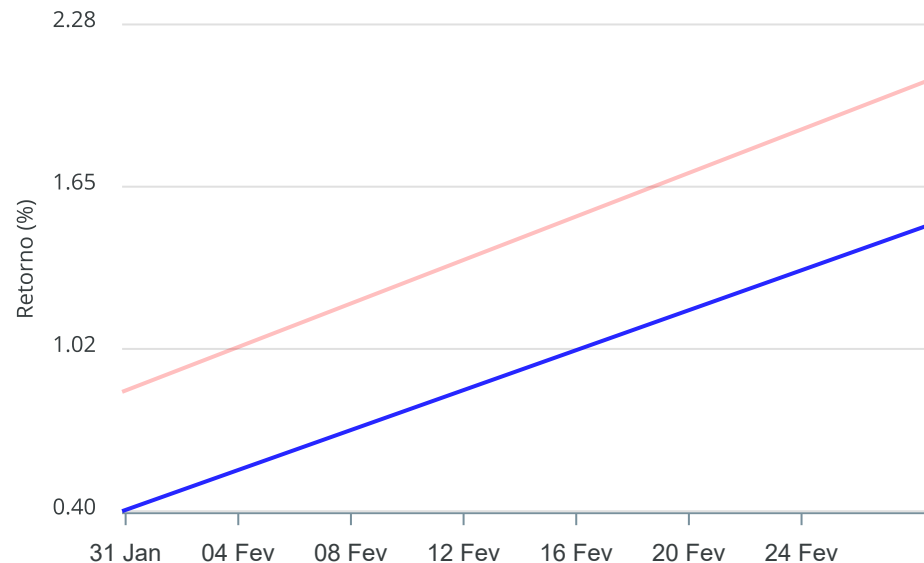
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	694.638,80	0,00	0,00	704.591,64	9.952,84	1,43%	1,43%	0,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.033.025,79	0,00	0,00	1.044.555,12	11.529,33	1,12%	1,12%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	526.824,33	0,00	0,00	532.657,44	5.833,11	1,11%	1,11%	0,33%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.284.477,20	0,00	0,00	1.298.435,45	13.958,25	1,09%	1,09%	0,07%
TÍTULOS PÚBLICOS	15.075.457,86	0,00	0,00	15.231.621,33	156.163,47	1,04%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.496.718,86	0,00	0,00	2.521.872,84	25.153,98	1,01%	1,01%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	301.171,27	0,00	0,00	304.082,81	2.911,54	0,97%	0,97%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.299.783,81	0,00	0,00	3.329.873,92	30.090,11	0,91%	0,91%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.311.765,94	0,00	0,00	3.341.692,40	29.926,46	0,90%	0,90%	0,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.907.024,59	0,00	0,00	1.923.949,89	16.925,30	0,89%	0,89%	0,20%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	752.624,42	0,00	0,00	758.916,57	6.292,15	0,84%	0,84%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	552.996,17	0,00	0,00	556.710,45	3.714,28	0,67%	0,67%	0,79%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	365.450,56	1.226.795,94	203.605,60	1.398.543,59	9.902,69	0,62%	0,88%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.651.618,98	0,00	0,00	2.667.198,72	15.579,74	0,59%	0,59%	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.780.860,74	0,00	0,00	2.794.084,34	13.223,60	0,48%	0,48%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	546.204,12	0,00	0,00	548.656,96	2.452,84	0,45%	0,45%	0,58%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.438.068,67	0,00	0,00	1.431.377,99	-6.690,68	-0,47%	-0,47%	1,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	62.353,33	0,00	0,00	62.052,98	-300,35	-0,48%	-0,48%	1,28%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	532.126,50	0,00	0,00	529.156,69	-2.969,81	-0,56%	-0,56%	1,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	277.520,75	0,00	0,00	273.476,39	-4.044,36	-1,46%	-1,46%	2,01%

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
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.489.126,71	0,00	0,00	1.467.068,92	-22.057,79	-1,48%	-1,48%	2,03%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>41.379.839,40</b>	<b>1.226.795,94</b>	<b>203.605,60</b>	<b>42.720.576,44</b>	<b>317.546,70</b>	<b>0,75%</b>		<b>0,54%</b>

**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
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	2.089.600,32	0,00	0,00	2.125.599,23	35.998,91	1,72%	1,72%	5,17%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.596.248,88	0,00	0,00	1.611.091,95	14.843,07	0,93%	0,93%	0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	292.078,59	0,00	0,00	280.450,12	-11.628,47	-3,98%	-3,98%	6,44%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	112.560,80	0,00	0,00	107.421,19	-5.139,61	-4,57%	-4,57%	5,68%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	255.483,04	0,00	0,00	242.249,70	-13.233,34	-5,18%	-5,18%	6,01%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	869.422,43	0,00	0,00	819.312,52	-50.109,91	-5,76%	-5,76%	8,95%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	307.337,39	0,00	0,00	289.390,54	-17.946,85	-5,84%	-5,84%	5,34%
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	284.513,47	0,00	0,00	267.312,65	-17.200,82	-6,05%	-6,05%	10,45%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	674.889,44	0,00	0,00	617.987,88	-56.901,56	-8,43%	-8,43%	9,43%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	521.496,13	0,00	0,00	476.858,11	-44.638,02	-8,56%	-8,56%	10,82%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.003.630,49</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>6.837.673,89</b>	<b>-165.956,60</b>	<b>-2,37%</b>		<b>5,51%</b>

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	430.554,50	0,00	0,00	450.191,41	19.636,91	4,56%	4,56%	5,69%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	552.336,79	0,00	0,00	576.300,76	23.963,97	4,34%	4,34%	5,46%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	110.976,77	0,00	0,00	115.192,08	4.215,31	3,80%	3,80%	7,33%
<b>Total Exterior</b>	<b>1.093.868,06</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.141.684,25</b>	<b>47.816,19</b>	<b>4,37%</b>		<b>5,74%</b>

## 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.



