

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

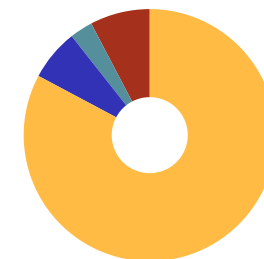
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			20.544.227,73	38,86%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	62.419,49	0,12%	652	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	15/08/2024	1.032.023,95	1,95%	317	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	526.447,91	1,00%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.439.898,63	2,72%	774	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	554.951,49	1,05%	163	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.381.303,85	6,40%	1.187	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.185.744,78	2,24%	254	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	561.925,20	1,06%	454	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	1.465.940,69	2,77%	62	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	820.153,61	1,55%	221	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	719.029,69	1,36%	46.289	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	895.343,74	1,69%	1.013	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	309.139,01	0,58%	1.141	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.331.853,25	6,30%	452	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA...	D+1 du	Não há	1.035.468,57	1,96%	42	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.566.663,31	4,86%	409	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.374.328,00	2,60%	213	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.955.562,94	3,70%	95	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	D+4	Não há	305.719,35	0,58%	5.203	0,22%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	107.758,28	0,20%	1.248	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	487.445,05	0,92%	12.216	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	101.151,43	0,19%	2.652	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB PETROBRAS I FI AÇÕES	D+3	Não há	103.366,95	0,20%	38.912	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	237.482,22	0,45%	24.204	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	100.064,76	0,19%	4.286	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	624.719,22	1,18%	5.931	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	283.556,60	0,54%	16	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	840.237,47	1,59%	8.272	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	D+92	Não há	291.553,28	0,55%	15	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	629.288,43	1,19%	140	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	230.741,76	0,44%	18.209	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	698.086,39	1,32%	465	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	2.427.624,01	4,59%	3.182	0,37%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.633.430,65	3,09%	2.524	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			52.864.651,69				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.508,89				Artigo 6º
PL Total			52.871.160,58				

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

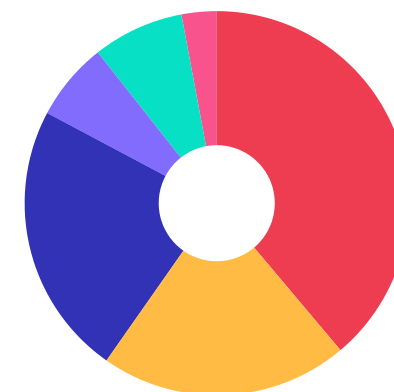
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	20.544.227,73	38,86%	22,00%	40,00%	60,00%	11.174.563,28
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.030.809,60	20,87%	0,00%	20,00%	100,00%	41.833.842,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	12.187.388,51	23,05%	0,00%	14,50%	60,00%	19.531.402,50
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.572.930,34
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	528.646,52
Total Renda Fixa	100,00%	43.762.425,84	82,78%	22,00%	75,00%	241,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.483.054,61	6,59%	0,00%	8,00%	30,00%	12.376.340,90
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.061.054,66	7,68%	0,00%	10,00%	10,00%	1.225.410,51
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	7.544.109,27	14,27%	0,00%	18,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.558.116,58	2,95%	0,00%	7,00%	10,00%	3.728.348,59
Total Exterior	10,00%	1.558.116,58	2,95%	0,00%	7,00%	10,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	20.544.227,73	38,86	-
CAIXA DTVM	10.080.060,21	19,07	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	7.556.945,33	14,29	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.847.422,02	11,06	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	3.463.092,58	6,55	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.331.853,25	6,30	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.465.940,69	2,77	0,00
TARPON INVESTIMENTOS	291.553,28	0,55	-
ITAÚ DTVM	283.556,60	0,54	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 Março/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral (Benchmark)	0,52%	1,64%	1,64%	5,51%	12,59%	24,78%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	1,60%	1,60%	5,44%	12,50%	24,64%	0,46%	1,71%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,43%	1,37%	1,37%	6,49%	15,26%	28,03%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39%	1,30%	1,30%	6,37%	15,00%	27,13%	0,97%	3,20%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,55%	-1,51%	-1,51%	4,82%	13,38%	19,08%	-	-
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,57%	-1,56%	-1,56%	4,70%	13,12%	18,52%	1,69%	6,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	2,47%	2,47%	5,37%	12,08%	26,60%	0,08%	0,24%
IMA-B (Benchmark)	0,08%	0,18%	0,18%	4,94%	11,81%	20,21%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,06%	0,13%	0,13%	4,84%	11,64%	19,81%	1,08%	3,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	0,11%	0,11%	4,82%	11,56%	19,65%	1,09%	3,88%
IRF-M (Benchmark)	0,54%	1,68%	1,68%	6,13%	14,03%	27,20%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	1,62%	1,62%	6,01%	13,79%	26,76%	0,72%	2,22%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,64%	2,06%	2,06%	5,20%	11,32%	25,05%	0,25%	0,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	2,80%	2,80%	5,92%	13,23%	28,55%	0,03%	0,09%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91%	2,92%	2,92%	6,02%	13,31%	28,84%	0,03%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85%	2,65%	2,65%	5,55%	12,40%	27,30%	0,01%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	2,38%	2,38%	5,02%	11,27%	24,78%	0,01%	0,06%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,79%	3,51%	3,51%	2,20%	9,62%	23,89%	0,72%	2,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,95%	2,55%	2,55%	5,19%	11,75%	26,81%	0,16%	0,49%
IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,55%	1,59%	1,59%	5,69%	13,03%	23,64%	0,42%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	2,78%	2,78%	5,01%	9,81%	20,12%	0,20%	0,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	2,81%	2,81%	5,06%	-	-	0,20%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,71%	2,30%	2,30%	5,17%	11,88%	-	0,55%	1,17%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,70%	2,33%	2,33%	5,12%	11,68%	26,54%	0,27%	0,37%
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,03%
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-0,13%	-4,95%	-4,95%	14,72%	33,03%	11,68%	5,72%	18,44%
BB PETROBRAS I FI AÇÕES	-6,59%	-1,16%	-1,16%	6,26%	79,73%	110,80%	19,77%	29,53%
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	6,72%	2,47%	2,47%	14,32%	67,17%	-	4,48%	17,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	0,53%	-2,92%	-2,92%	8,36%	21,61%	-1,84%	4,61%	15,46%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1,12%	-7,43%	-7,43%	3,63%	12,30%	-31,34%	7,81%	22,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,45%	-7,05%	-7,05%	5,31%	16,81%	-5,94%	5,66%	15,94%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	1,08%	-6,53%	-6,53%	9,19%	38,85%	17,07%	8,11%	25,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,27%	-4,27%	-4,27%	9,48%	20,76%	-0,83%	5,21%	15,39%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	3,01%	-0,53%	-0,53%	9,36%	21,04%	1,24%	4,61%	13,96%
IDIV (Benchmark)	-1,20%	-3,81%	-3,81%	10,25%	27,20%	19,02%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,25%	2,01%	2,01%	13,64%	33,00%	17,65%	4,69%	14,70%

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

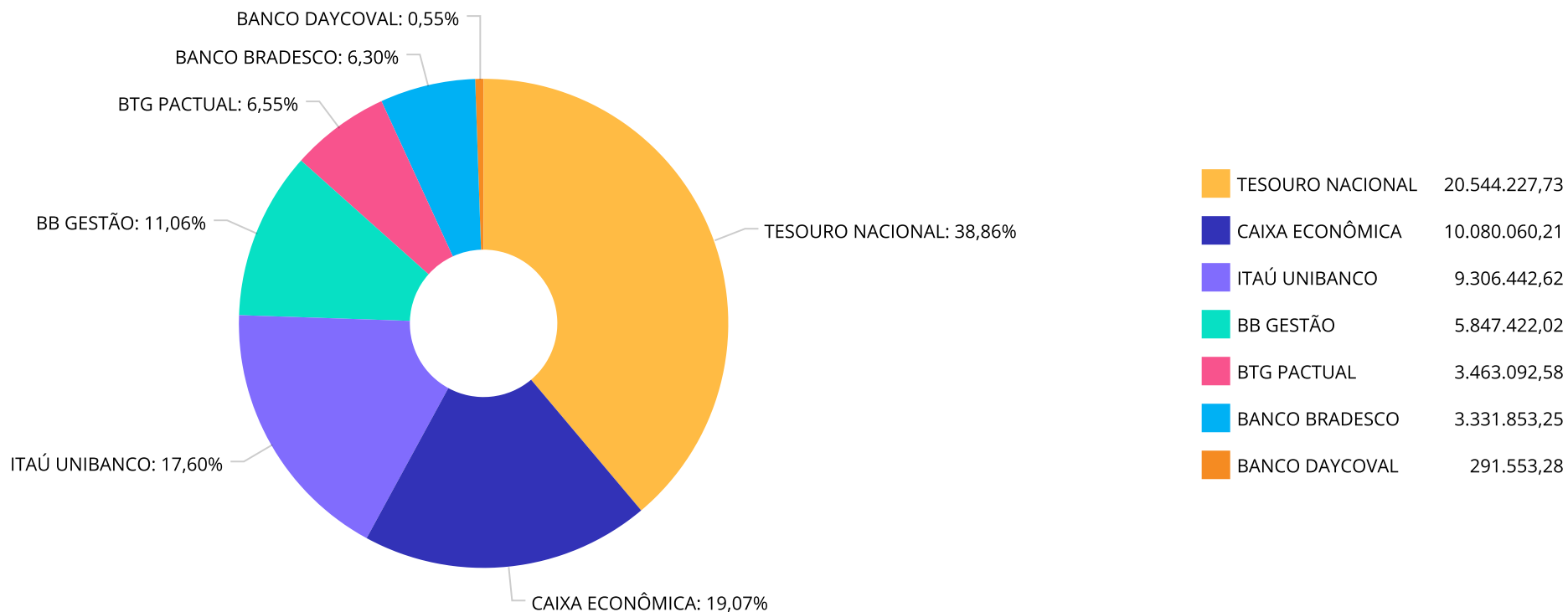
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	3,10%	10,16%	10,16%	22,53%	27,86%	15,98%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3,44%	11,26%	11,26%	25,85%	36,73%	41,02%	4,58%	11,57%

SMLL (Benchmark)	2,15%	-4,09%	-4,09%	6,93%	24,13%	-10,57%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	1,90%	-3,36%	-3,36%	7,16%	21,86%	-6,62%	6,05%	19,04%

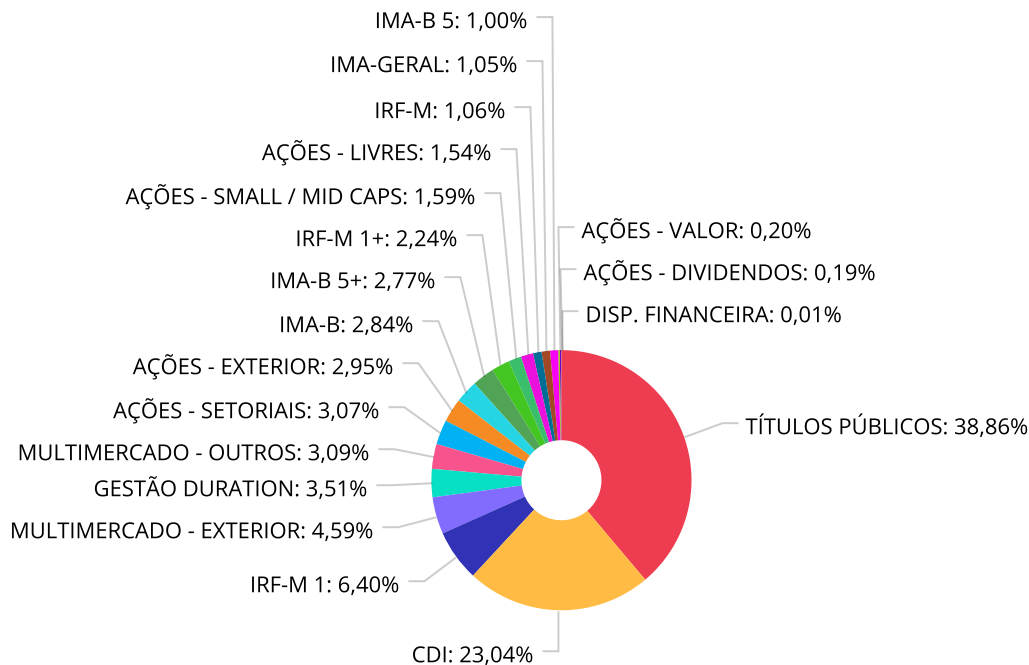
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,24%	13,93%	13,93%	22,60%	29,68%	24,40%	5,80%	13,276%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48%	14,98%	14,98%	23,77%	32,44%	27,69%	5,89%	14,034%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,87%	16,01%	16,01%	30,48%	52,08%	33,20%	7,54%	16,329%

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



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	20.544.227,73	■ CDI	12.183.943,89	■ IRF-M 1	3.381.303,85	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.427.624,01
■ GESTÃO DURATION	1.855.622,18	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.633.430,65	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.621.315,33	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.558.116,58
■ IMA-B	1.502.318,12	■ IMA-B 5+	1.465.940,69	■ IRF-M 1+	1.185.744,78	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	840.237,47
■ AÇÕES - LIVRES	812.592,10	■ IRF-M	561.925,20	■ IMA-GERAL	554.951,49	■ IMA-B 5	526.447,91
■ AÇÕES - VALOR	107.758,28	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	101.151,43	■ DISP. FINANCEIRA	6.508,89		

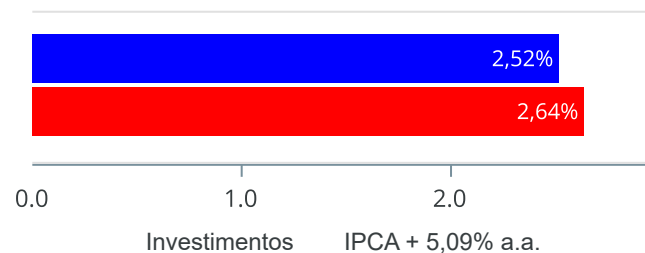
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Março / 2024)

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	4.269,710843	3.374.616,32	3.415.768,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	03/10/2023	120	4.169,170000	4.275,085293	500.300,40	513.010,23	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	15/03/2024	300	4.235,379345	4.251,295701	1.270.613,80	1.275.388,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	08/08/2023	800	4.159,770000	4.367,016439	3.327.816,00	3.493.613,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	03/10/2023	120	4.161,160000	4.355,055738	499.339,20	522.606,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	15/03/2024	300	4.329,415729	4.343,027006	1.298.824,72	1.302.908,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	03/10/2023	120	4.236,300000	4.335,211944	508.356,00	520.225,43	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	28/07/2023	100	4.294,800000	4.486,113215	429.480,00	448.611,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	03/10/2023	120	4.266,530000	4.367,654229	511.983,60	524.118,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	27/07/2023	100	4.387,000000	4.607,531549	438.700,00	460.753,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	27/11/2023	100	4.387,000000	4.472,545281	438.700,00	447.254,52	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/08/2023	390	4.457,720000	4.619,815397	1.738.510,80	1.801.728,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	27/11/2023	150	4.355,990000	4.412,325087	653.398,50	661.848,76	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/03/2024	300	4.383,075307	4.394,989937	1.314.922,59	1.318.496,98	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/03/2024	300	4.439,089022	4.451,226066	1.331.726,71	1.335.367,81	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	22/11/2023	150	4.287,850000	4.474,764793	643.177,50	671.214,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/08/2023	390	4.465,490000	4.695,674218	1.741.541,10	1.831.312,94	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

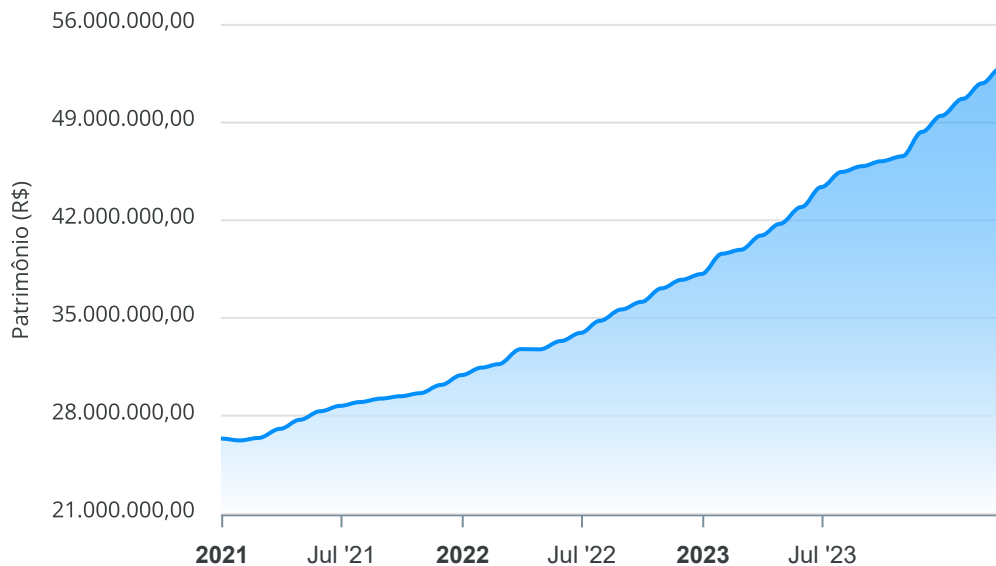
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	49.477.337,95	1.226.795,94	203.605,60	50.699.934,58	199.406,29	199.406,29	0,39%	0,39%	0,86%	0,86%	46,12%	1,66%
Fevereiro	50.699.934,58	899.460,65	587.147,14	51.580.733,77	568.485,68	767.891,97	1,11%	1,51%	1,21%	2,07%	72,96%	1,65%
Março	51.580.733,77	8.923.996,39	8.157.332,12	52.864.651,69	517.253,65	1.285.145,62	0,99%	2,52%	0,56%	2,64%	95,27%	1,63%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



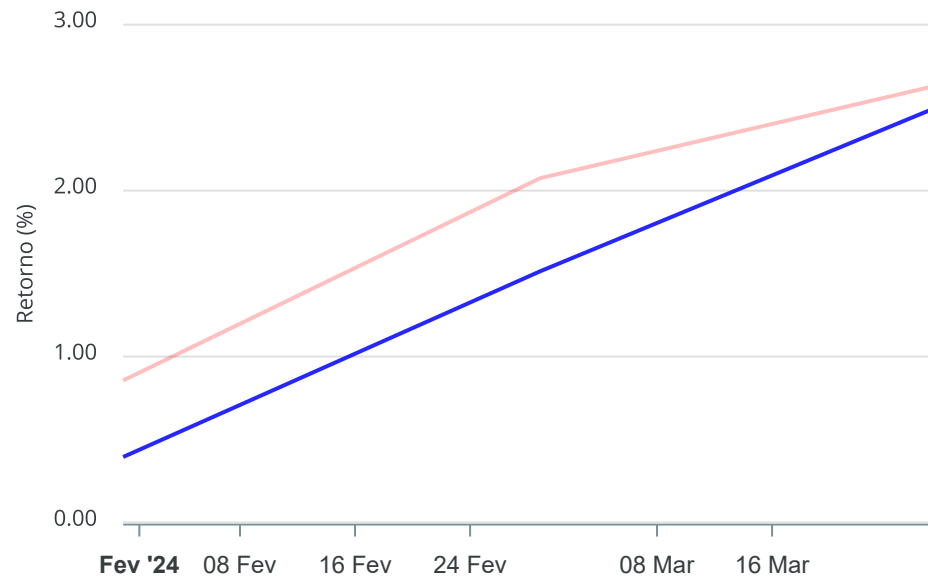
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Março/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.937.181,27	0,00	0,00	1.955.562,94	18.381,67	0,95%	0,95%	0,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.022.559,99	0,00	0,00	1.032.023,95	9.463,96	0,93%	0,93%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	521.661,89	0,00	0,00	526.447,91	4.786,02	0,92%	0,92%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.543.685,65	0,00	0,00	2.566.663,31	22.977,66	0,90%	0,90%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	306.524,96	0,00	0,00	309.139,01	2.614,05	0,85%	0,85%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	15.160.145,86	5.216.087,80	0,00	20.544.227,73	167.994,07	0,82%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.354.588,45	0,00	0,00	3.381.303,85	26.715,40	0,80%	0,80%	0,08%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	713.412,57	0,00	0,00	719.029,69	5.617,12	0,79%	0,79%	0,72%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.310.069,92	2.000.000,00	0,00	3.331.853,25	21.783,33	0,66%	0,91%	0,03%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	827.751,06	201.120,90	0,00	1.035.468,57	6.596,61	0,64%	0,71%	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	552.114,43	0,00	0,00	554.951,49	2.837,06	0,51%	0,51%	0,46%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	559.129,05	0,00	0,00	561.925,20	2.796,15	0,50%	0,50%	0,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.358.728,97	0,00	2.000.000,00	1.374.328,00	15.599,03	0,46%	0,63%	0,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.675.544,31	0,00	1.500.000,00	1.185.744,78	10.200,47	0,38%	0,39%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.809.664,13	0,00	2.000.000,00	820.153,61	10.489,48	0,37%	0,55%	0,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.929.947,77	806.787,69	1.850.374,19	895.343,74	8.982,47	0,33%	0,75%	0,01%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	530.555,15	0,00	531.877,19	0,00	1.322,04	0,25%	0,00%	1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	274.836,49	0,00	275.080,74	0,00	244,25	0,09%	-0,56%	1,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	62.382,30	0,00	0,00	62.419,49	37,19	0,06%	0,06%	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.439.083,75	0,00	0,00	1.439.898,63	814,88	0,06%	0,06%	1,08%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/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	1.474.323,91	0,00	0,00	1.465.940,69	-8.383,22	-0,57%	-0,57%	1,69%
Total Renda Fixa	43.363.891,88	8.223.996,39	8.157.332,12	43.762.425,84	331.869,69	0,76%		0,38%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	273.191,48	0,00	0,00	291.553,28	18.361,80	6,72%	6,72%	4,48%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	2.247.579,42	100.000,00	0,00	2.427.624,01	80.044,59	3,41%	3,44%	4,58%
BB PETROBRAS I FI AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	103.366,95	3.366,95	3,37%	-6,59%	19,77%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	296.787,32	0,00	0,00	305.719,35	8.932,03	3,01%	3,01%	4,61%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	824.550,72	0,00	0,00	840.237,47	15.686,75	1,90%	1,90%	6,05%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	101.151,43	1.151,43	1,15%	1,25%	4,69%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	617.781,06	0,00	0,00	624.719,22	6.938,16	1,12%	1,12%	7,81%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	482.231,05	0,00	0,00	487.445,05	5.214,00	1,08%	1,08%	8,11%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.622.102,93	0,00	0,00	1.633.430,65	11.327,72	0,70%	0,70%	0,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	282.055,80	0,00	0,00	283.556,60	1.500,80	0,53%	0,53%	4,61%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	100.064,76	64,76	0,06%	-0,13%	5,72%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	108.047,85	0,00	0,00	107.758,28	-289,57	-0,27%	-0,27%	5,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	243.452,41	0,00	0,00	237.482,22	-5.970,19	-2,45%	-2,45%	5,66%
Total Renda Variável	6.997.780,04	400.000,00	0,00	7.544.109,27	146.329,23	1,98%		4,57%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	478.417,06	200.000,00	0,00	698.086,39	19.669,33	2,90%	3,48%	5,89%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	125.148,95	100.000,00	0,00	230.741,76	5.592,81	2,48%	2,87%	7,54%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	615.495,84	0,00	0,00	629.288,43	13.792,59	2,24%	2,24%	5,80%
Total Exterior	1.219.061,85	300.000,00	0,00	1.558.116,58	39.054,73	2,57%		6,10%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	15.075.457,86	5.216.087,80	224.165,89	20.544.227,73	476.847,96	2,35%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.299.783,81	0,00	0,00	3.381.303,85	81.520,04	2,47%	2,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.496.718,86	0,00	0,00	2.566.663,31	69.944,45	2,80%	2,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.311.765,94	0,00	2.000.000,00	1.374.328,00	62.562,06	1,89%	2,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.907.024,59	0,00	0,00	1.955.562,94	48.538,35	2,55%	2,55%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.284.477,20	2.000.000,00	0,00	3.331.853,25	47.376,05	1,44%	2,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.780.860,74	0,00	2.000.000,00	820.153,61	39.292,87	1,41%	1,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.651.618,98	0,00	1.500.000,00	1.185.744,78	34.125,80	1,29%	1,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	365.450,56	2.870.207,99	2.372.443,74	895.343,74	32.128,93	0,99%	2,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	1.033.025,79	0,00	29.654,39	1.032.023,95	28.652,55	2,77%	2,81%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	694.638,80	0,00	0,00	719.029,69	24.390,89	3,51%	3,51%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA L...	752.624,42	263.957,19	0,00	1.035.468,57	18.886,96	1,86%	2,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	526.824,33	0,00	14.862,91	526.447,91	14.486,49	2,75%	2,78%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	552.996,17	0,00	0,00	561.925,20	8.929,03	1,61%	1,61%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	546.204,12	0,00	0,00	554.951,49	8.747,37	1,60%	1,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	301.171,27	0,00	0,00	309.139,01	7.967,74	2,65%	2,65%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.438.068,67	0,00	0,00	1.439.898,63	1.829,96	0,13%	0,13%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	62.353,33	0,00	0,00	62.419,49	66,16	0,11%	0,11%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	532.126,50	0,00	531.877,19	0,00	-249,31	-0,05%	-0,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	277.520,75	0,00	275.080,74	0,00	-2.440,01	-0,88%	-1,52%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.489.126,71	0,00	0,00	1.465.940,69	-23.186,02	-1,56%	-1,56%
Total Renda Fixa	41.379.839,40	10.350.252,98	8.948.084,86	43.762.425,84	980.418,32	2,29%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	2.089.600,32	100.000,00	0,00	2.427.624,01	238.023,69	10,87%	11,26%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.596.248,88	0,00	0,00	1.633.430,65	37.181,77	2,33%	2,33%
TARPON GT INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	284.513,47	0,00	0,00	291.553,28	7.039,81	2,47%	2,47%
BB PETROBRAS I FI AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	103.366,95	3.366,95	3,37%	-1,16%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	101.151,43	1.151,43	1,15%	2,01%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	100.064,76	64,76	0,06%	-4,95%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	307.337,39	0,00	0,00	305.719,35	-1.618,04	-0,53%	-0,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	112.560,80	0,00	0,00	107.758,28	-4.802,52	-4,27%	-4,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	292.078,59	0,00	0,00	283.556,60	-8.521,99	-2,92%	-2,92%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	255.483,04	0,00	0,00	237.482,22	-18.000,82	-7,05%	-7,05%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	869.422,43	0,00	0,00	840.237,47	-29.184,96	-3,36%	-3,36%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	521.496,13	0,00	0,00	487.445,05	-34.051,08	-6,53%	-6,53%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	674.889,44	0,00	0,00	624.719,22	-50.170,22	-7,43%	-7,43%
Total Renda Variável	7.003.630,49	400.000,00	0,00	7.544.109,27	140.478,78	1,90%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2024

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	552.336,79	0,00	0,00	629.288,43	76.951,64	13,93%	13,93%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	430.554,50	200.000,00	0,00	698.086,39	67.531,89	10,71%	14,98%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	110.976,77	100.000,00	0,00	230.741,76	19.764,99	9,37%	16,01%
Total Exterior	1.093.868,06	300.000,00	0,00	1.558.116,58	164.248,52	11,78%	

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.

