

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

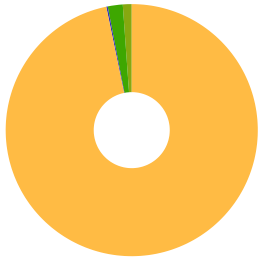
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	10.061.696,14	5,22%	1.151	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TESOUREIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	D+0	Não há	1.072.012,67	0,56%	106.422	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.255.666,23	2,21%	250	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	23.099.692,31	11,99%	1.187	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.233.037,32	27,63%	739	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.806.648,46	2,49%	221	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BARCELONA FI RENDA FIXA	D+1 ou ...	90 dias	1.391.723,83	0,72%	10	5,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	12.205.553,06	6,34%	1.141	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	36.519.070,41	18,96%	452	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	30.951.013,88	16,07%	445	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.238.186,94	1,16%	61	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.298.334,26	0,67%	95	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.305.058,63	0,68%	18	3,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.729.475,03	1,42%	33	2,27%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
ILLUMINATI FIDC 1	D+1 ou ...	30 dias	1.198.216,03	0,62%	11	2,43%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	43.535,33	0,02%	59	0,07%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	6.404,19	0,00%	58	0,49%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	2.472.217,53	1,28%	14	1,76%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	968.714,61	0,50%	17	3,52%	Artigo 10º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
GESTÃO EMPRESARIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
GESTÃO EMPRESARIAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não há	261.102,71	0,14%	7	7,40%	Artigo 10º, Inciso II
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	469.306,28	0,24%		0,16%	Artigo 11º
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	953.507,77	0,49%		0,00%	Artigo 11º
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	Não se ...	Não se aplica	766.256,13	0,40%		1,17%	Artigo 11º
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou...	Não há	353.182,06	0,18%	7	3,64%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			192.659.611,83				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			42.401,95	Artigo 6º			
PL Total			192.702.013,78				

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

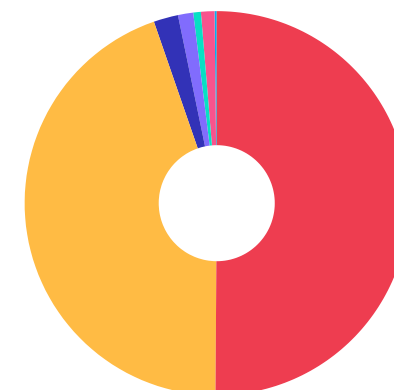
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	50,00%	96.329.805,92
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	96.528.753,13	50,10%	30,00%	44,00%	100,00%	96.130.858,70
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.632.980,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	85.908.941,01	44,59%	25,00%	40,00%	65,00%	39.319.806,68
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	3.977.630,58	2,06%	2,00%	5,00%	5,00%	5.655.350,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.632.980,59
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	1.926.596,12
Total Renda Fixa	100,00%	186.415.324,72	96,76%	57,00%	89,00%	231,00%	



- RENDA FIXA 186.415.324,72
- RENDA VARIÁVEL 353.182,06
- ESTRUTURADOS 3.702.034,87
- FUNDO IMOBILIÁRIO 2.189.070,18

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	57.797.883,55
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.632.980,59
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.472.217,53	1,28%	0,00%	2,00%	10,00%	16.793.743,65
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	1.229.817,34	0,64%	1,00%	2,00%	5,00%	8.403.163,25
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	3.853.192,24
Artigo 11º	5,00%	2.189.070,18	1,14%	1,00%	2,00%	5,00%	7.443.910,41
Desenquadrado - RV	0,00%	353.182,06	0,18%	0,00%	0,00%	0,00%	-353.182,06
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	6.244.287,11	3,24%	2,00%	11,00%	57,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	19.265.961,18
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	19.265.961,18
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	19.265.961,18
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	



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
CAIXA DTVM	107.283.743,51	55,69	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	40.774.736,64	21,16	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.339.261,87	12,11	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	8.343.169,66	4,33	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	4.639.148,17	2,41	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.682.982,80	1,91	4,27
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	3.463.038,59	1,80	-
ZION INVEST	469.306,28	0,24	-
RENDAS ASSET MANAGEMENT	353.182,06	0,18	0,59
RJI CORRETORA DE VALORES	261.102,71	0,14	0,17
VILA RICA CAPITAL	43.535,33	0,02	-
GENIAL GESTÃO LTDA	6.404,20	0,00	-
RJI GESTÃO & INVESTIMENTOS	0,01	0,00	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
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	0,81%	3,44%	3,51%	6,78%	12,76%	28,03%	-	-
ILLUMINATI FIDC 1	-2,11%	-18,98%	-18,98%	-17,36%	-39,83%	-50,45%	2,97%	22,22%

CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,11%	3,48%	3,51%	7,37%	16,29%	36,35%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,50%	14,67%	14,67%	-80,73%	811,71%	23,14%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,30%	1,74%	1,74%	179,59%	218,03%	28,78%	-	-

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,70%	3,09%	3,15%	6,04%	11,20%	24,52%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-3,38%	-3,89%	-3,89%	-4,48%	-4,03%	-13,23%	5,63%	4,79%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	2,43%	2,43%	5,30%	11,98%	26,36%	0,09%	0,25%
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%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,82%	2,46%	2,46%	5,34%	12,08%	26,55%	0,09%	0,25%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,77%	2,06%	2,06%	5,09%	9,62%	21,01%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3,01%	2,33%	2,33%	-5,22%	-14,69%	-43,11%	6,62%	32,90%

CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BB TESOIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,82%	2,57%	2,57%	5,39%	12,07%	26,61%	0,01%	0,06%

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 INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,01%	2,64%	2,64%	6,36%	11,94%	23,28%	0,30%	1,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,95%	2,55%	2,55%	5,19%	11,75%	26,81%	0,16%	0,49%
BARCELONA FI RENDA FIXA	0,24%	1,37%	1,37%	1,97%	5,13%	-33,73%	1,03%	3,37%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	2,70%	5,72%	12,96%	27,89%	0,05%	0,10%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	2,55%	2,55%	5,41%	12,25%	26,99%	0,07%	0,11%
BRADESCO 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%
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%

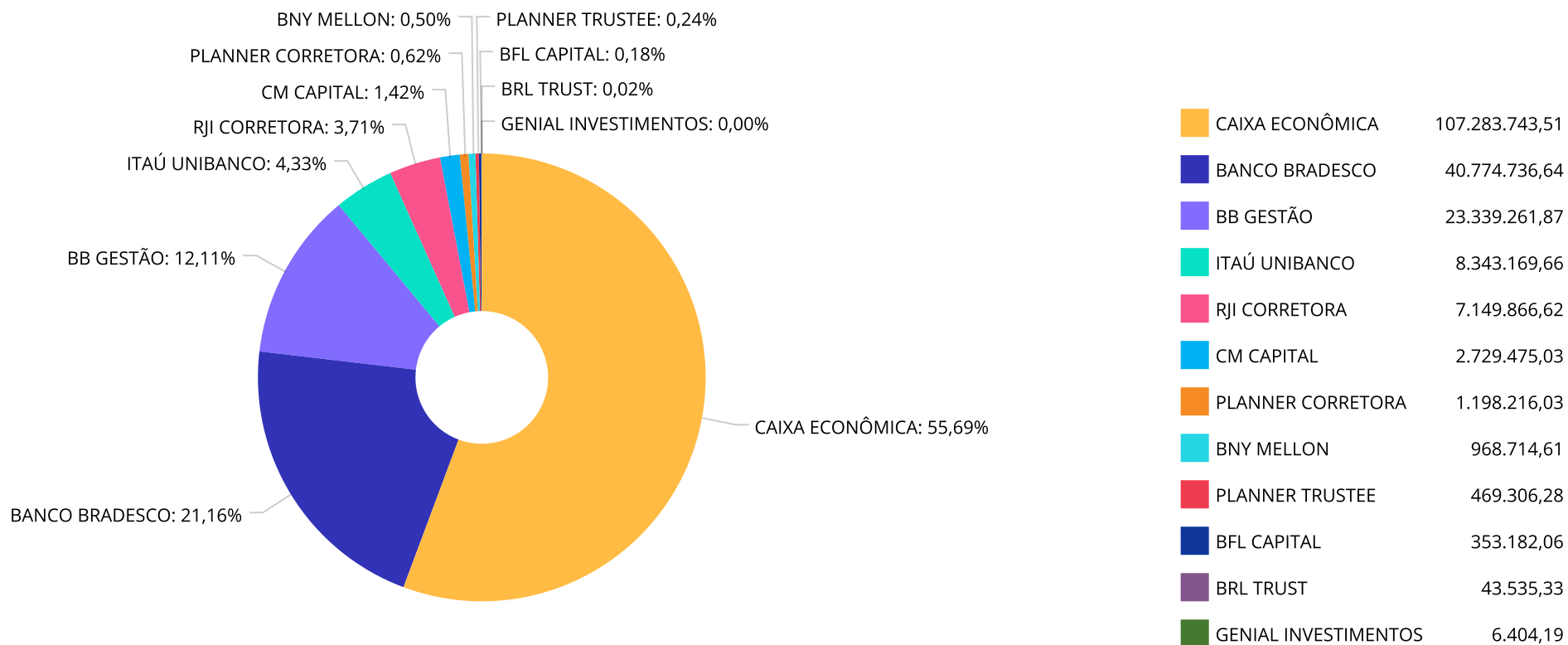
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
GESTÃO EMPRESARIAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,58%	-2,07%	-2,07%	-3,71%	-	-	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FIAÇÕES	-2,65%	-5,14%	-5,14%	3,62%	8,40%	-3,67%	5,60%	12,14%
IFIX (Benchmark)	1,43%	2,92%	2,92%	5,87%	23,44%	22,60%	-	-
HAZ FII - ATCR11	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	15,68%	56,20%	56,20%	20,90%	-4,89%	-44,85%	17,07%	38,89%
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,07%	-0,26%	-0,26%	-0,92%	-4,88%	-19,26%	0,07%	2,53%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,96%	3,90%	3,98%	7,76%	14,84%	32,80%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,77%	3,32%	3,39%	6,54%	12,24%	26,86%	-	-
GESTÃO EMPRESARIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-

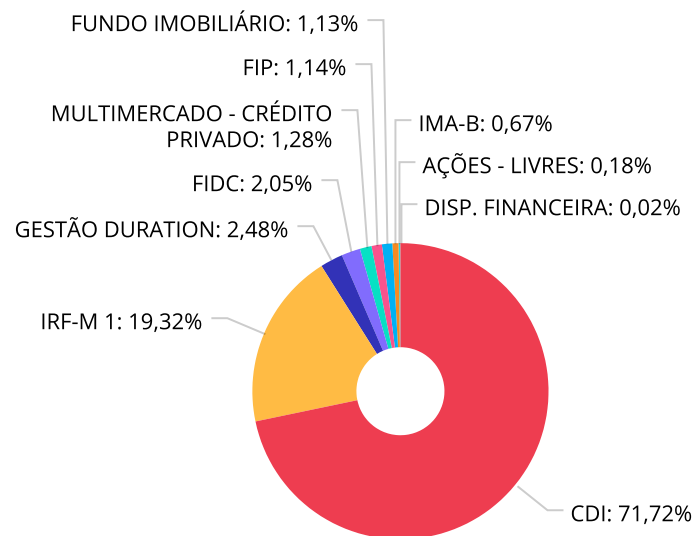
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	3,55%	3,62%	7,03%	13,28%	29,22%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,05%	-0,14%	-0,14%	-	-0,57%	-1,21%	-	-

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



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

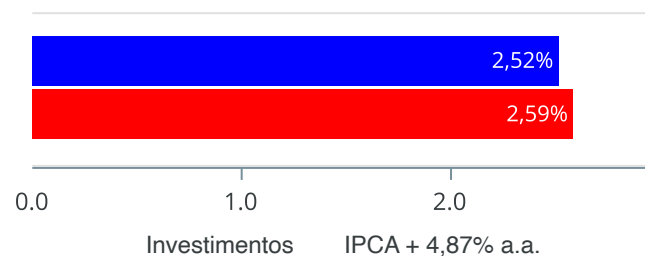


CDI	138.908.932,37	IRF-M 1	37.417.054,68	GESTÃO DURATION	4.806.648,46
FIDC	3.977.630,58	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	2.472.217,53	FIP	2.198.531,95
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.189.070,18	IMA-B	1.305.058,63	AÇÕES - LIVRES	353.182,06
DISP. FINANCEIRA	42.401,95				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

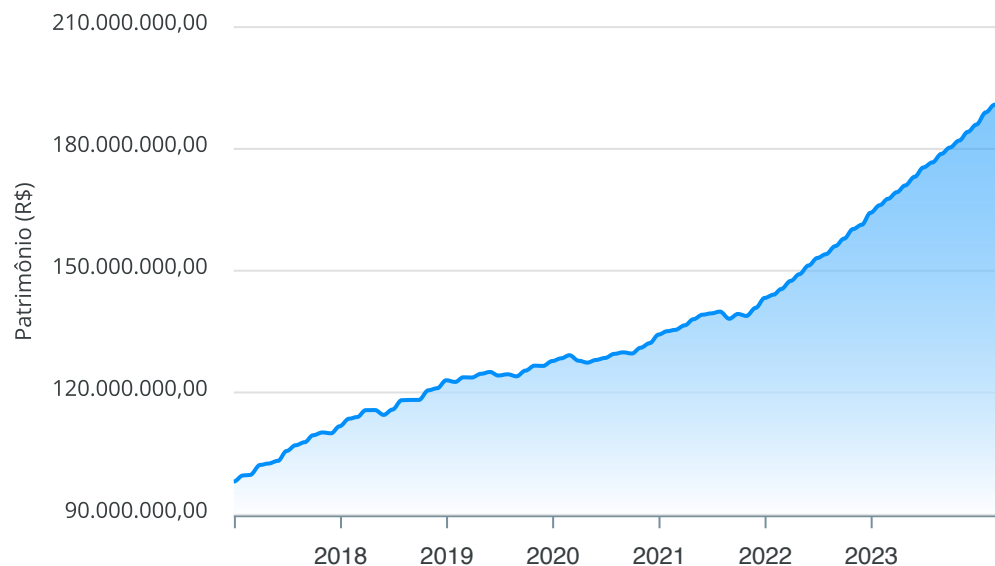
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	185.938.832,10	3.338.000,00	1.999.210,77	188.987.531,95	1.709.910,62	1.709.910,62	0,91%	0,91%	0,84%	0,84%	108,99%	0,39%
Fevereiro	188.987.531,95	3.308.000,00	2.957.652,00	190.812.844,67	1.474.964,72	3.184.875,34	0,78%	1,70%	1,19%	2,04%	83,30%	0,17%
Março	190.812.844,67	2.180.000,00	1.880.502,82	192.659.611,83	1.547.269,98	4.732.145,32	0,81%	2,52%	0,54%	2,59%	97,41%	0,27%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

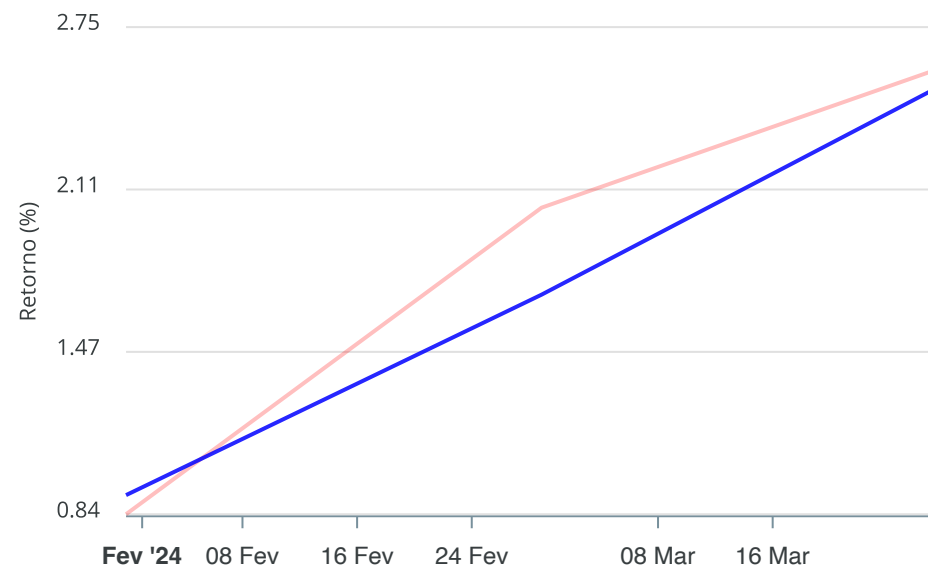
Evolução do Patrimônio



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
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.266.847,54	0,00	0,00	1.305.058,63	38.211,09	3,02%	3,01%	6,62%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	6.372,56	0,00	104,04	6.404,19	135,67	2,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.215.911,13	0,00	0,00	2.238.186,94	22.275,81	1,01%	1,01%	0,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.286.130,34	0,00	0,00	1.298.334,26	12.203,92	0,95%	0,95%	0,16%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	36.189.583,01	0,00	0,00	36.519.070,41	329.487,40	0,91%	0,91%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	12.102.343,71	0,00	0,00	12.205.553,06	103.209,35	0,85%	0,85%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	30.690.489,99	0,00	0,00	30.951.013,88	260.523,89	0,85%	0,85%	0,05%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.220.995,73	0,00	0,00	4.255.666,23	34.670,50	0,82%	0,82%	0,09%
BB TESOUREIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	1.063.344,28	0,00	0,00	1.072.012,67	8.668,39	0,82%	0,82%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	9.981.509,10	0,00	0,00	10.061.696,14	80.187,04	0,80%	0,80%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.075.184,55	740.000,00	0,00	53.233.037,32	417.852,77	0,79%	0,79%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.264.601,31	1.440.000,00	1.789.530,00	23.099.692,31	184.621,00	0,75%	0,80%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.780.238,57	0,00	0,00	4.806.648,46	26.409,89	0,55%	0,55%	0,42%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	43.404,88	0,00	0,00	43.535,33	130,45	0,30%	-	-
BARCELONA FI RENDA FIXA	1.388.389,91	0,00	0,00	1.391.723,83	3.333,92	0,24%	0,24%	1,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.824.840,28	0,00	90.868,78	2.729.475,03	-4.496,47	-0,16%	-3,38%	5,63%
ILLUMINATI FIDC 1	1.224.063,52	0,00	0,00	1.198.216,03	-25.847,49	-2,11%	-2,11%	2,97%
Total Renda Fixa	184.624.250,41	2.180.000,00	1.880.502,82	186.415.324,72	1.491.577,13	0,81%		0,22%

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	405.708,70	0,00	0,00	469.306,28	63.597,58	15,68%	15,68%	17,07%
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	761.060,49	0,00	0,00	766.256,13	5.195,64	0,68%	0,00%	0,00%
HAZ FII - ATCR11	953.408,78	0,00	0,00	953.507,77	98,99	0,01%	-	-
GESTÃO EMPRESARIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	969.156,50	0,00	0,00	968.714,61	-441,89	-0,05%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.473.845,01	0,00	0,00	2.472.217,53	-1.627,48	-0,07%	-0,07%	0,07%
GESTÃO EMPRESARIAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	262.619,59	0,00	0,00	261.102,71	-1.516,88	-0,58%	-	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	362.795,17	0,00	0,00	353.182,06	-9.613,11	-2,65%	-2,65%	5,60%
Total Renda Variável	6.188.594,26	0,00	0,00	6.244.287,11	55.692,85	0,90%		2,50%

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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.523.279,03	3.430.000,00	0,00	53.233.037,32	1.279.758,29	2,46%	2,55%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	35.482.605,36	0,00	0,00	36.519.070,41	1.036.465,05	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	30.154.543,93	0,00	17.000,00	30.951.013,88	813.469,95	2,70%	2,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.851.928,61	5.061.000,00	6.404.239,98	23.099.692,31	591.003,68	2,04%	2,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	11.890.967,50	0,00	0,00	12.205.553,06	314.585,56	2,65%	2,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	9.823.170,67	0,00	0,00	10.061.696,14	238.525,47	2,43%	2,43%
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.153.697,09	0,00	0,00	4.255.666,23	101.969,14	2,45%	2,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.731.233,75	0,00	0,00	4.806.648,46	75.414,71	1,59%	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.180.595,06	0,00	0,00	2.238.186,94	57.591,88	2,64%	2,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.266.108,76	0,00	0,00	1.298.334,26	32.225,50	2,55%	2,55%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.275.803,53	0,00	0,00	1.305.058,63	29.255,10	2,29%	2,33%
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	711.615,84	335.000,00	0,00	1.072.012,67	25.396,83	2,43%	2,57%
BARCELONA FI RENDA FIXA	1.372.981,11	0,00	0,00	1.391.723,83	18.742,72	1,37%	1,37%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	5.585,04	0,00	485,04	6.404,19	1.304,19	23,35%	14,67%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	42.790,14	0,00	0,00	43.535,33	745,19	1,74%	1,74%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.839.961,44	0,00	90.868,78	2.729.475,03	-19.617,63	-0,69%	-3,89%
ILLUMINATI FIDC 1	1.478.856,94	0,00	255.532,48	1.198.216,03	-25.108,43	-1,70%	-18,98%
Total Renda Fixa	179.785.723,80	8.826.000,00	6.768.126,28	186.415.324,72	4.571.727,20	2,51%	

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	300.443,74	0,00	0,00	469.306,28	168.862,54	56,20%	56,20%
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	743.847,77	0,00	0,00	766.256,13	22.408,36	3,01%	-
HAZ FII - ATR11	1.020.962,35	0,00	69.239,31	953.507,77	1.784,73	0,17%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
GESTÃO EMPRESARIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	970.032,41	0,00	0,00	968.714,61	-1.317,80	-0,14%	-0,14%
GESTÃO EMPRESARIAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	266.614,20	0,00	0,00	261.102,71	-5.511,49	-2,07%	-2,07%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.478.909,85	0,00	0,00	2.472.217,53	-6.692,32	-0,27%	-0,26%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	372.297,96	0,00	0,00	353.182,06	-19.115,90	-5,13%	-5,13%
Total Renda Variável	6.153.108,30	0,00	69.239,31	6.244.287,11	160.418,12	2,61%	

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.

