

Relatório Analítico dos Investimentos

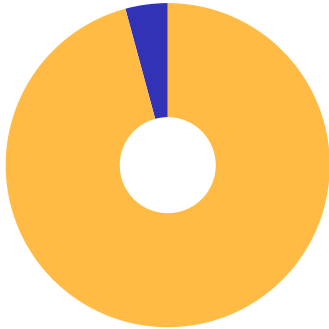
em agosto de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.903.862,64	13,98%	458	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	83.167,62	0,20%	2.181	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BANRISUL FOCO IMA GERAL FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	98.834,42	0,23%	343	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.286.137,69	19,62%	806	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.202.086,14	2,85%	229	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.744.385,41	20,70%	730	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.013.810,17	16,60%	3.057	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	4.337.590,77	10,27%	1.191	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.794.032,01	11,35%	1.059	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BANRISUL FI AÇÕES	D+4	Não há	892.554,99	2,11%	2.206	1,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	885.772,57	2,10%	198	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			42.242.234,43				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Agosto / 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%	42.242.234,43
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	31.332.284,09	74,17%	40,00%	40,00%	100,00%	10.909.950,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	9.131.622,78	21,62%	20,00%	40,00%	60,00%	16.213.717,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.224.223,44
Total Renda Fixa	100,00%	40.463.906,87	95,79%	60,00%	90,00%	270,00%	



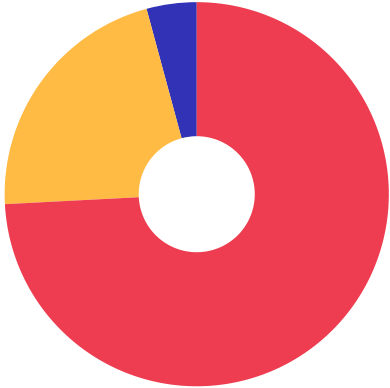
RENDA FIXA 40.463.906,87

RENDA VARIÁVEL 1.778.327,56

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	1.778.327,56	4,21%	0,00%	5,00%	10,00%	2.445.895,88
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.224.223,44
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	1.778.327,56	4,21%	0,00%	10,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.112.111,72



7º I b 7º III a 8º I 9º III

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	23.912.413,82	56,61	-
SICREDI	7.013.810,17	16,60	-
BANRISUL CORRETORA	6.978.419,67	16,52	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.337.590,77	10,27	-

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 Agosto/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,60%	4,60%	1,53%	3,33%	7,94%	20,67%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	4,32%	1,52%	3,11%	7,68%	20,09%	1,34%	1,88%

IMA Geral (Benchmark)	0,79%	4,63%	2,21%	3,49%	8,81%	23,74%	-	-
BANRISUL FOCO IMA GERAL FI RENDA FIXA LP	0,76%	4,41%	2,12%	3,32%	8,50%	23,52%	0,98%	1,84%

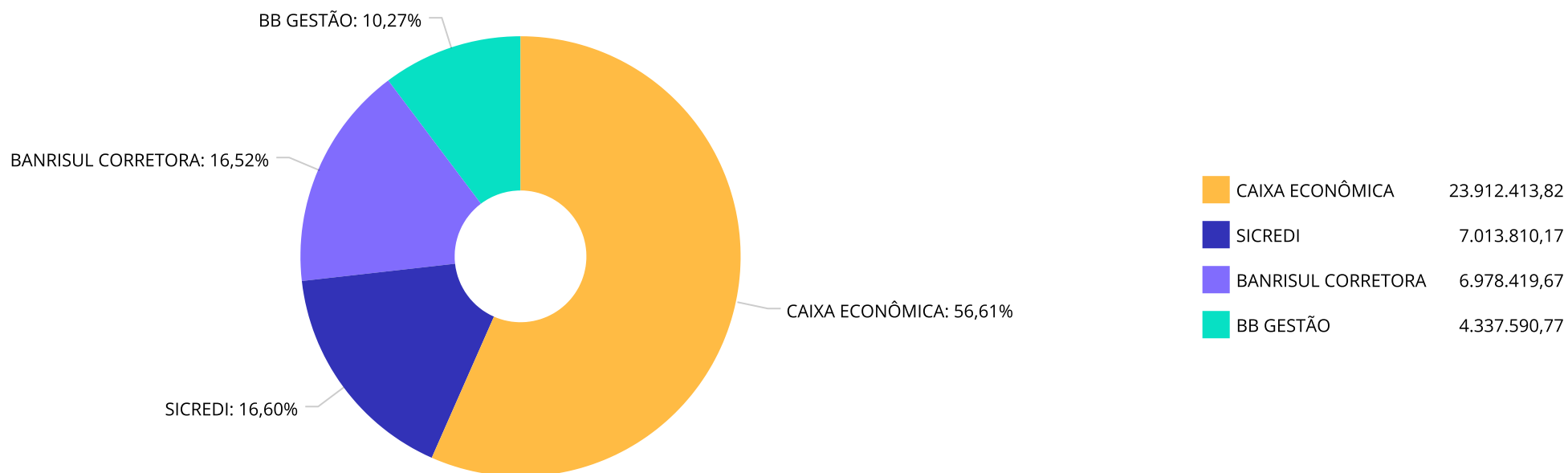
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,60%	2,39%	1,43%	1,43%	7,39%	24,61%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	2,21%	1,37%	1,30%	7,14%	23,78%	2,30%	3,77%

CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	6,88%	2,58%	5,04%	10,91%	25,87%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	7,33%	2,70%	5,39%	11,61%	26,97%	0,02%	0,07%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,88%	7,12%	2,61%	5,25%	11,18%	26,27%	0,02%	0,06%
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,69%	5,64%	2,05%	4,14%	8,96%	21,08%	0,01%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	7,21%	2,68%	5,34%	11,32%	26,39%	0,01%	0,06%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,88%	7,13%	2,61%	5,26%	11,20%	26,25%	0,01%	0,06%

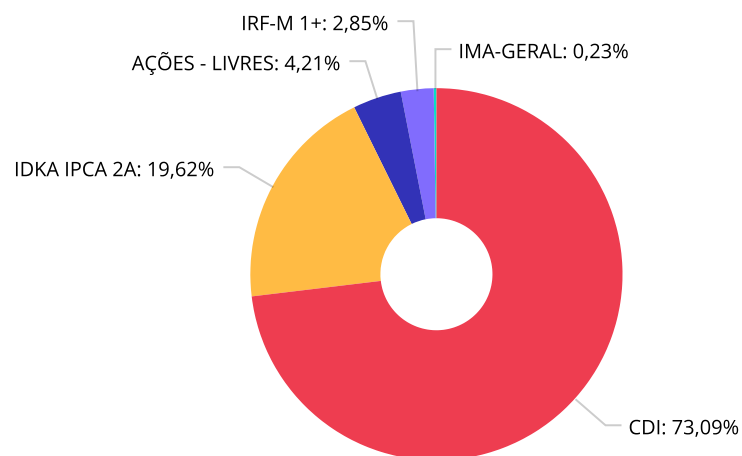
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,54%	1,36%	11,39%	5,41%	17,51%	24,18%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,54%	2,74%	10,19%	3,26%	17,40%	26,11%	7,33%	16,04%
BANRISUL FI AÇÕES	4,48%	-9,55%	5,47%	-4,49%	-5,45%	-	8,68%	16,33%

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



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

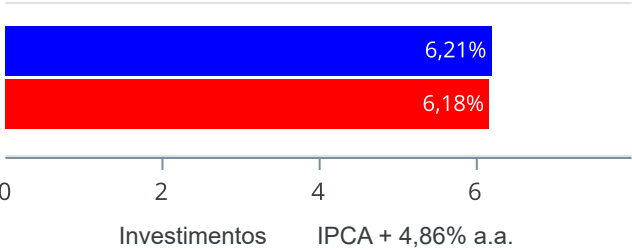


■ CDI	30.876.848,62	■ IDKA IPCA 2A	8.286.137,69	■ AÇÕES - LIVRES	1.778.327,56	■ IRF-M 1+	1.202.086,14
■ IMA-GERAL	98.834,42						

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	40.802.879,83	274.756,57	465.991,95	40.836.166,52	224.522,07	224.522,07	0,55%	0,55%	0,84%	0,84%	65,75%	0,74%
Fevereiro	40.836.166,52	364.651,83	469.520,34	41.061.647,22	330.349,21	554.871,28	0,81%	1,36%	1,19%	2,04%	66,90%	1,46%
Março	41.061.647,22	356.148,41	477.438,82	41.318.692,38	378.335,57	933.206,85	0,92%	2,30%	0,54%	2,59%	88,81%	0,66%
Abril	41.318.692,38	365.281,10	487.950,22	41.223.617,24	27.593,98	960.800,83	0,07%	2,37%	0,80%	3,40%	69,49%	0,95%
Maiο	41.223.617,24	352.369,60	472.532,39	41.384.765,48	281.311,03	1.242.111,86	0,68%	3,06%	0,86%	4,29%	71,40%	0,79%
Junho	41.384.765,48	368.880,59	498.280,44	41.579.387,23	324.021,60	1.566.133,46	0,78%	3,87%	0,59%	4,91%	78,92%	0,93%
Julho	41.579.387,23	367.195,42	501.033,86	41.879.456,94	433.908,15	2.000.041,61	1,04%	4,96%	0,82%	5,76%	86,02%	0,91%
Agosto	41.879.456,94	10.157.138,53	10.293.134,92	42.242.234,43	498.773,88	2.498.815,49	1,19%	6,21%	0,40%	6,18%	100,43%	0,68%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



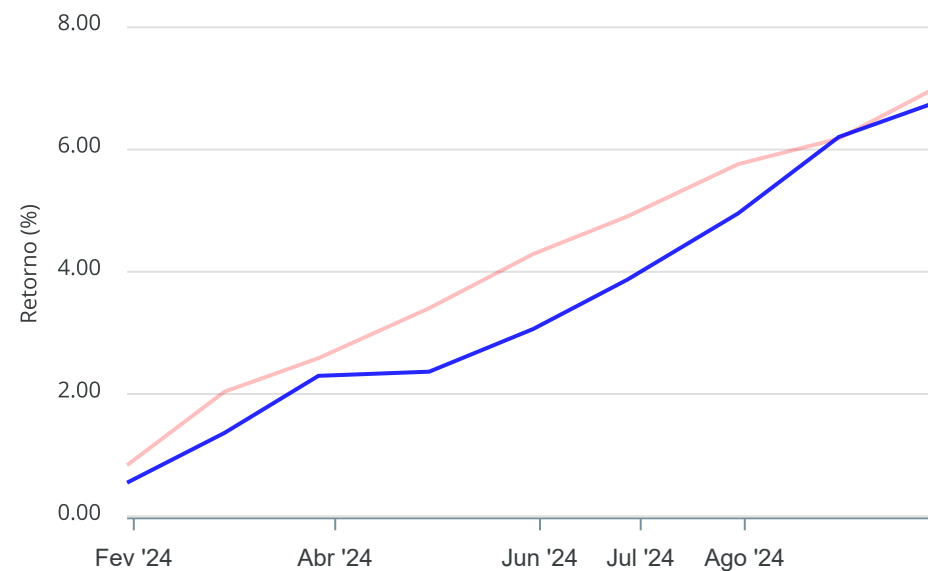
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.299.251,48	0,00	0,00	4.337.590,77	38.339,29	0,89%	0,89%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.965.451,53	0,00	215.000,00	4.794.032,01	43.580,48	0,88%	0,88%	0,02%
BANRISUL FOCO IMA GERAL FI RENDA FIXA LP	95.974,22	2.122,94	0,00	98.834,42	737,26	0,75%	0,76%	0,98%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	5.759.617,56	1.202.940,23	0,00	7.013.810,17	51.252,38	0,74%	0,88%	0,01%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	2.245.770,95	3.622.470,66	0,00	5.903.862,64	35.621,03	0,61%	0,88%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.237.421,38	0,00	0,00	8.286.137,69	48.716,31	0,59%	0,59%	1,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.195.144,65	0,00	0,00	1.202.086,14	6.941,49	0,58%	0,58%	2,30%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	932.682,97	0,00	937.684,10	0,00	5.001,13	0,54%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.907.401,73	0,00	2.922.873,05	0,00	15.471,32	0,53%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	522.574,33	0,00	525.341,44	0,00	2.767,11	0,53%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.658.993,40	5.039.537,70	0,00	8.744.385,41	45.854,31	0,53%	0,86%	0,04%
BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	1.620.152,70	0,00	1.628.211,12	0,00	8.058,42	0,50%	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1.908.190,00	0,00	1.916.550,00	0,00	8.360,00	0,44%	-	-
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	83.063,87	290.067,00	290.895,87	83.167,62	932,62	0,25%	0,69%	0,01%
Total Renda Fixa	38.431.690,77	10.157.138,53	8.436.555,58	40.463.906,87	311.633,15	0,78%		0,36%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	808.611,24	0,00	0,00	885.772,57	77.161,33	9,54%	9,54%	7,33%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.123.114,76	0,00	1.202.940,23	0,00	79.825,47	7,11%	6,31%	5,81%
BANRISUL FI AÇÕES	854.255,42	0,00	0,00	892.554,99	38.299,57	4,48%	4,48%	8,68%
Total Renda Variável	2.785.981,42	0,00	1.202.940,23	1.778.327,56	195.286,37	7,01%		8,01%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	661.784,75	0,00	653.639,11	0,00	-8.145,64	-1,23%	0,57%	9,23%
Total Exterior	661.784,75	0,00	653.639,11	0,00	-8.145,64	-1,23%		0,00%

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.

