

2024

Relatório Mensal

Agosto

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	120.342,31	0,33%	5.319.492.629,16	0,00%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	431.649,61	1,17%	3.548.363.735,09	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	1.534.255,21	4,16%	1.247.479.989,66	0,12%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	3.419.451,31	9,27%	3.467.274.754,62	0,10%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.479.412,00	4,01%	821.214.445,73	0,18%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	348.668,56	0,94%	1.275.486.827,37	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.150.067,20	3,12%	1.624.970.153,09	0,07%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	508.313,67	1,38%	1.071.762.033,53	0,05%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.428.021,47	6,58%	4.410.336.954,15	0,06%	7º III a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	629.719,91	1,71%	777.957.277,97	0,08%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.341.829,15	17,18%	20.250.525.135,03	0,03%	7º III a
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.564.847,14	9,66%	15.057.333.281,43	0,02%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.087.897,78	21,92% ▲	18.688.563.354,91	0,04%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	378.705,00	1,03%	1.058.181.840,27	0,04%	7º III a
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.719.831,04	7,37%	599.691.925,89	0,45%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.048.876,60	5,55%	251.674.806,48	0,81%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.225.831,01	3,32%	309.672.357,09	0,40%	8º I
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	485.967,27	1,32%	119.255.074,34	0,41%	8º I

Investimentos

\$ 36.903.686,24

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 36.903.686,24

Governança (Pró Gestão)

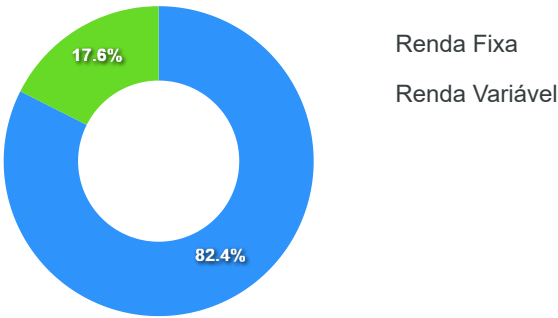
📄

Artigos	Limite (%)		Utilizado		Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	24,37%	8.992.159,87	75,63%	27.911.526,37
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	58,07%	21.431.020,45	1,93%	711.191,29
8º I - Fundos de Ações	30,00%	17,56%	6.480.505,92	12,44%	4.590.599,95

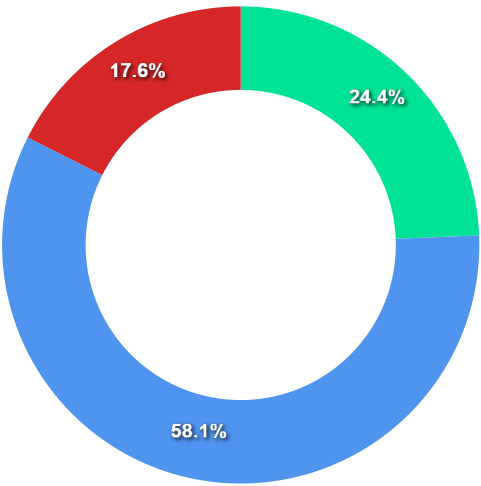
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



Artigos

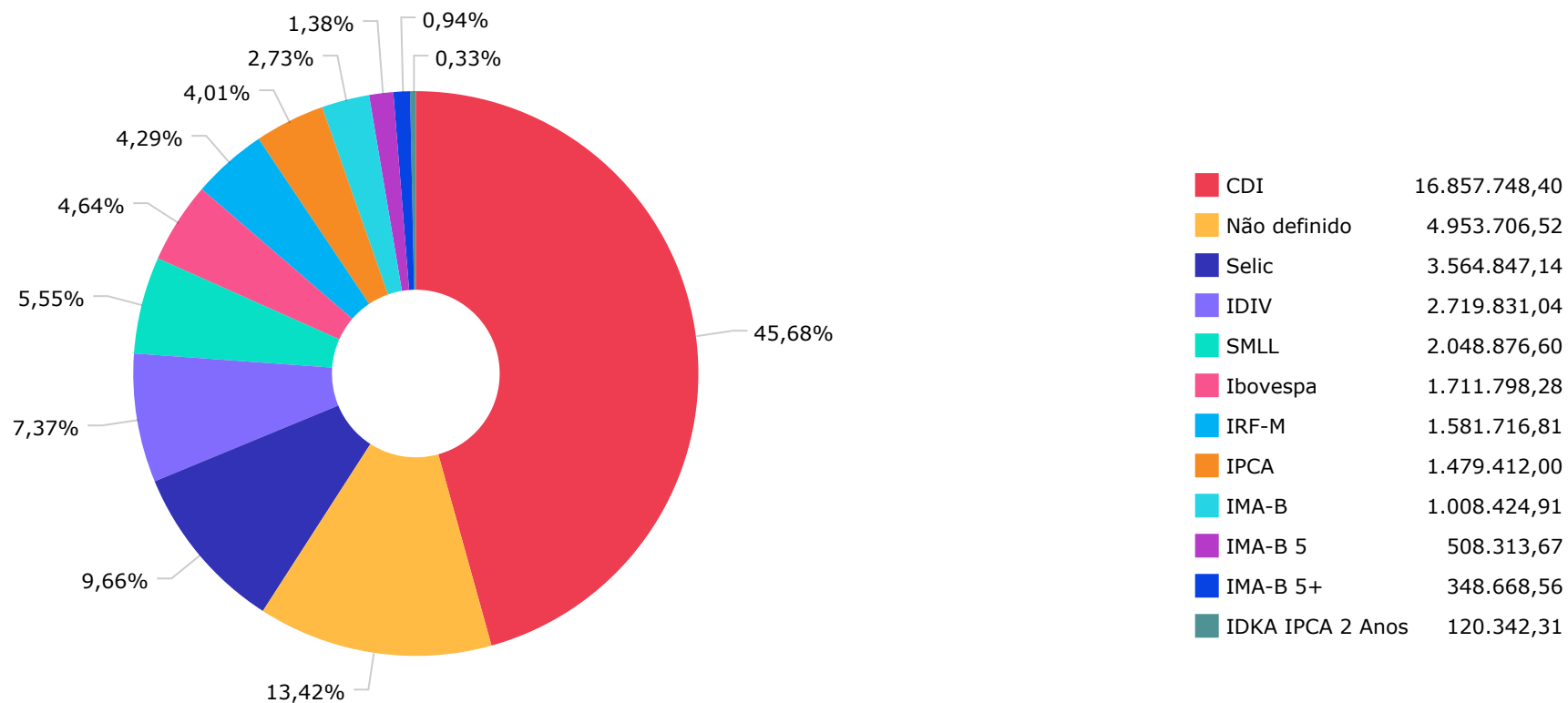


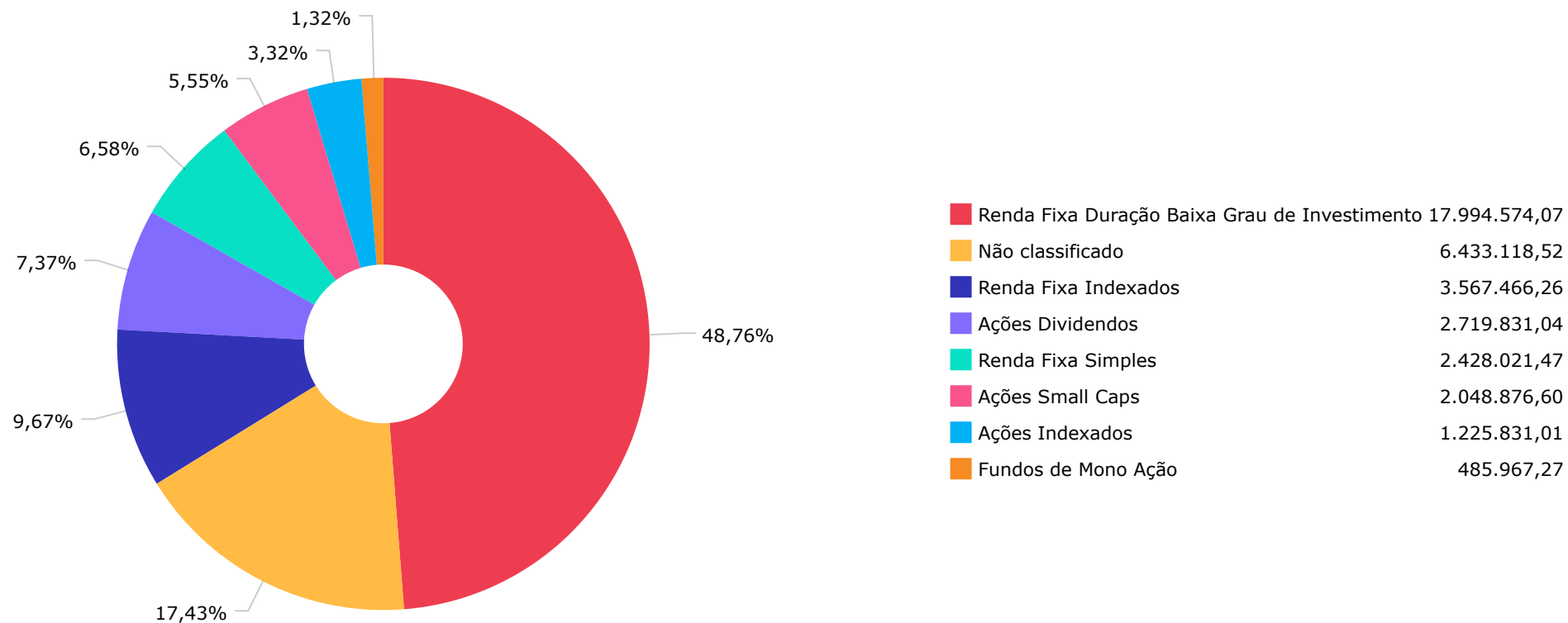
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	36.903.686,24
7º I b - FI 100% Títulos TN	24,37%	0,00%	33,00%	100,00%	27.911.526,37
7º III a - FI Referenciados RF	58,07%	0,00%	40,00%	60,00%	711.191,29
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	7.380.737,25
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.845.184,31
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.845.184,31
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.845.184,31

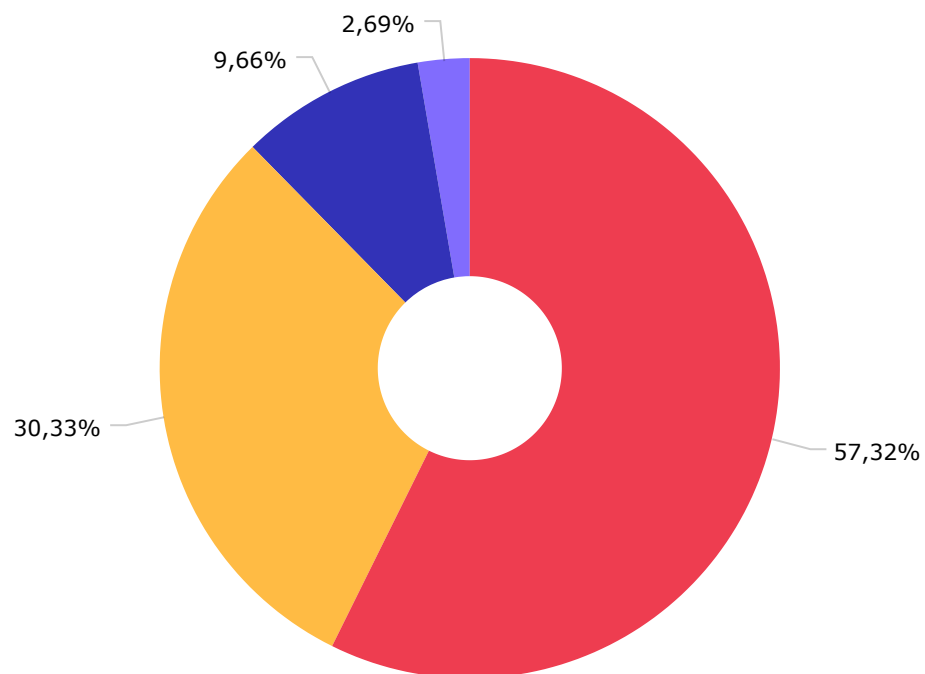
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	17,56%	0,00%	19,00%	30,00%	4.590.599,95
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	11.071.105,87
9º III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	3.690.368,62
10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	3.690.368,62
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.845.184,31

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	0,61		1,52				1,28	2,69
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	0,84		2,30				0,49	1,03
CDI - BENCHMARK								
	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88	7,33	2,70	5,39	11,61	26,97	0,02	0,05
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89	7,21	2,68	5,34	11,32	26,39	0,01	0,02
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,79	6,39	2,33	4,70	10,11	23,82	0,01	0,02
IBOVESPA - BENCHMARK								
	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18		
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	8,01	22,49	10,34	16,56	41,10	72,40	17,51	36,87
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6,47	1,19	11,25	5,22	17,06	23,57	5,44	11,46
IDIV - BENCHMARK								
	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91		
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6,48	1,97	10,57	5,42	17,17	21,58	5,73	12,06
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK								
	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64	4,56	1,66	3,36	7,81	20,28	1,25	2,63
IMA-B - BENCHMARK								
	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,70	1,46	1,68	1,36	5,23	19,40	2,46	5,17
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43	1,18	1,48	1,15	4,90	19,04	2,45	5,16
IMA-B 5 - BENCHMARK								
	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08		
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,57	4,71	1,85	3,44	7,88	20,53	1,09	2,29
IMA-B 5+ - BENCHMARK								
	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58		

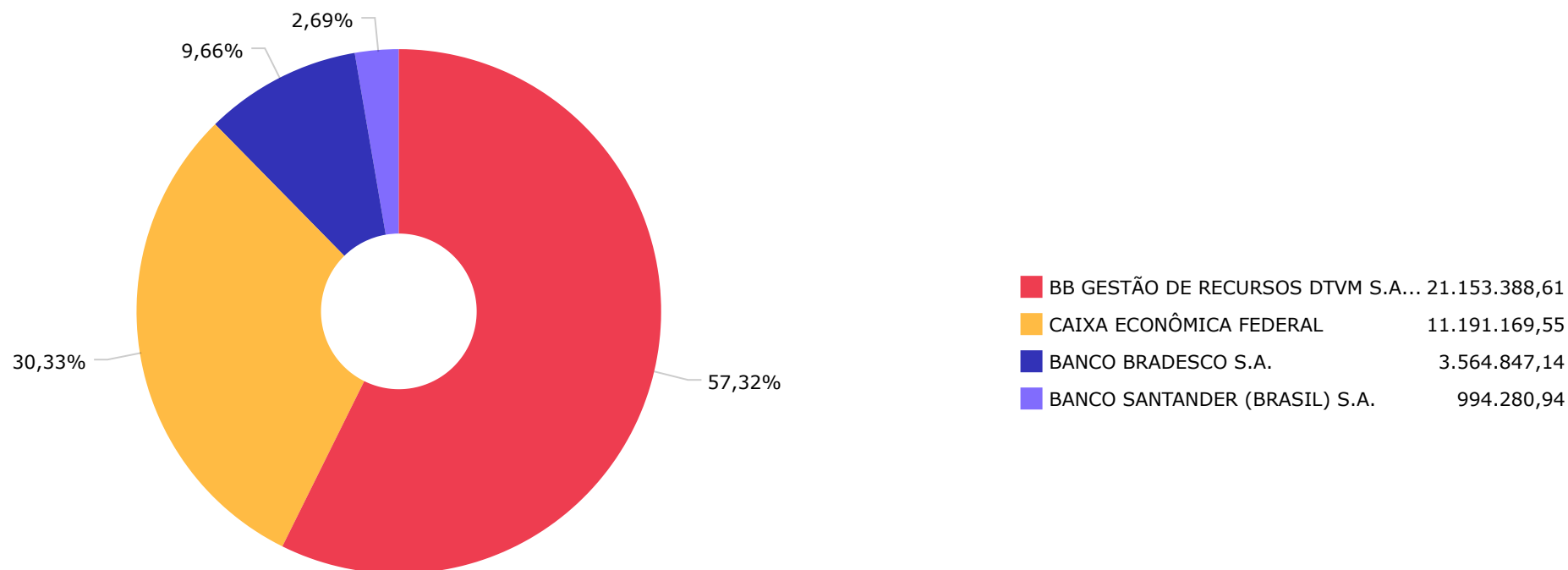
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76	-1,30	1,65	-0,34	3,06	17,99	3,76	7,91
IPCA - BENCHMARK	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68	2,34	1,46	1,61	5,43		1,93	4,07
IRF-M - BENCHMARK	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64	3,37	1,65	2,24	8,00	24,03	1,62	3,42
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65	3,37	1,66	2,25	8,00	23,62	1,62	3,41
SELIC - BENCHMARK	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91	7,71	2,77	5,61	12,12	27,88	0,04	0,08
SMLL - BENCHMARK	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	3,17	-13,48	4,07	-7,97	-8,13	-9,16	13,38	28,18







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	21.153.388,61
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.191.169,55
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	3.564.847,14
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	994.280,94



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	35.405.190,32	0,00	0,00	35.177.405,81	-227.784,51	-227.784,51	-0,64% ▼	-0,64%	0,85%	0,85%	-75,29%	2,13%
Fevereiro	35.177.405,81	6.125.933,89	6.125.933,89	35.461.311,30	283.905,49	56.120,98	0,81% ▲	0,16%	1,20%	2,06%	7,77%	1,96%
Março	35.461.311,30	0,00	0,00	35.634.249,93	172.938,63	229.059,61	0,49% ▲	0,65%	0,55%	2,62%	24,81%	1,70%
Abril	35.634.249,93	868.731,15	868.731,15	35.418.643,25	-215.606,68	13.452,93	-0,61% ▼	0,04%	0,81%	3,45%	1,16%	2,06%
Mai	35.418.643,25	2.891.460,52	2.891.460,52	35.489.225,74	70.582,49	84.035,42	0,20% ▲	0,24%	0,87%	4,35%	5,52%	1,75%
Junho	35.489.225,74	7.152.926,61	7.000.000,00	35.773.522,73	131.370,38	215.405,80	0,37% ▲	0,61%	0,60%	4,98%	12,25%	1,80%
Julho	35.773.522,73	0,00	0,00	36.278.277,42	504.754,69	720.160,49	1,41% ▲	2,03%	0,83%	5,85%	34,70%	1,71%
Agosto	36.278.277,42	12.946.879,89	12.944.862,39	36.903.686,24	623.391,32	1.343.551,81	1,72% ▲	3,78%	0,41%	6,28%	60,19%	1,99%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	229.059,61	0,65%	2,62%
2º Trim	-13.653,81	-0,04%	2,30%
1º Sem	215.405,80	0,61%	4,98%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

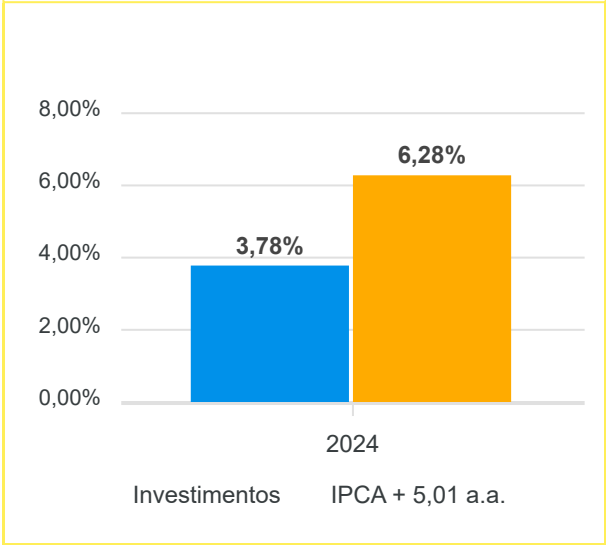


Gráfico Risco x Retorno

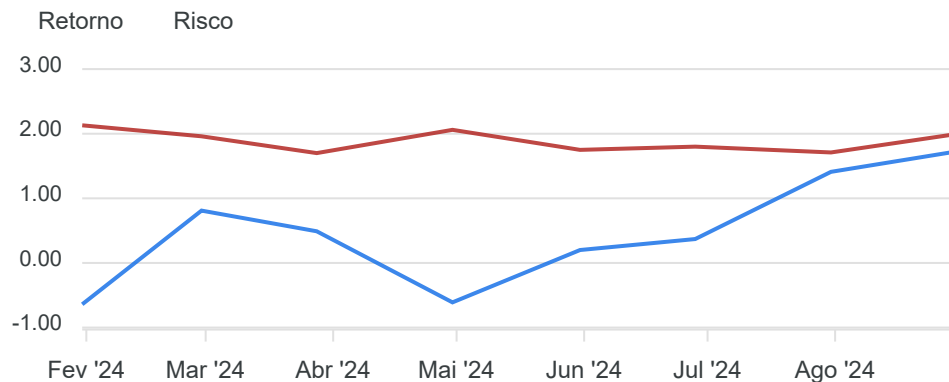
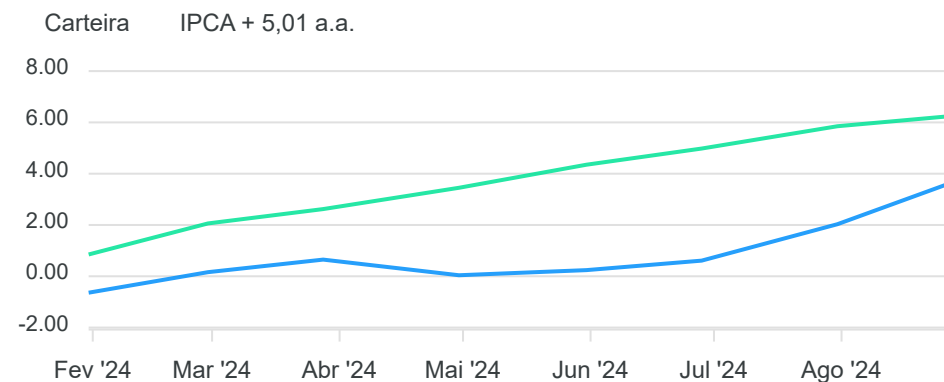
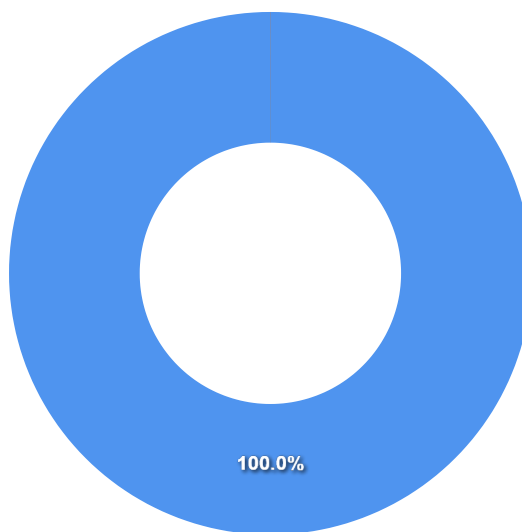


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/08/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	36.903.686,24	100,00
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	367.739,93	7.933.246,81	5.887.152,06	2.428.021,47	14.186,79	0,17% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.112.963,37	0,00	1.000.328,09	120.342,31	7.707,03	0,69% ▲	1,25%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.608.081,03	0,00	1.000.000,00	629.719,91	21.638,88	1,35% ▲	2,45%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	428.854,40	0,00	0,00	431.649,61	2.795,21	0,65% ▲	1,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.285.774,70	0,00	0,00	6.341.829,15	56.054,45	0,89% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	1.521.435,00	0,00	0,00	1.534.255,21	12.820,21	0,84% ▲	0,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.512.574,87	0,00	43.749,16	1.479.412,00	10.586,29	0,70% ▲	1,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.395.388,37	0,00	3.413.633,08	0,00	18.244,71	0,54% ▲	0,08%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.938.399,74	1.600.000,00	0,00	3.564.847,14	26.447,40	0,75% ▲	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.615.236,12	0,00	600.000,00	8.087.897,78	72.661,66	0,84% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	346.038,50	0,00	0,00	348.668,56	2.630,06	0,76% ▲	3,76%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.142.734,34	0,00	0,00	1.150.067,20	7.332,86	0,64% ▲	1,62%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.356.343,87	0,00	1.000.000,00	378.705,00	22.361,13	1,65% ▲	2,46%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	505.410,15	0,00	0,00	508.313,67	2.903,52	0,57% ▲	1,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	0,00	3.413.633,08	0,00	3.419.451,31	5.818,23	0,17% ▲	1,28%
	30.136.974,39	12.946.879,89	12.944.862,39	30.423.180,32	284.188,43	0,94%	0,51%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.554.193,67	0,00	0,00	2.719.831,04	165.637,37	6,48% ▲	5,73%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.985.878,32	0,00	0,00	2.048.876,60	62.998,28	3,17% ▲	13,38%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.151.322,12	0,00	0,00	1.225.831,01	74.508,89	6,47% ▲	5,44%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	449.908,92	0,00	0,00	485.967,27	36.058,35	8,01% ▲	17,51%
-	6.141.303,03	0,00	0,00	6.480.505,92	339.202,89	5,52%	8,98%

