

2024

Relatório Mensal e 3º trimestre de 2024

Setembro

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
TÍTULOS PÚBLICOS	241.619.624,11	39,87%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.274.261,30	5,82%	6.153.638.080,30	0,57%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.998.635,94	2,81%	4.436.237.468,68	0,38%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	67.495.526,27	11,14%	8.159.464.453,76	0,83%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.532.129,91	2,56%	1.856.541.125,92	0,84%	7º I b
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.040.718,62	0,17%	14.753.446.791,76	0,01%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	55.389.563,22	9,14%	19.144.855.193,98	0,29%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	27.247.954,40	4,50%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	28.484.221,47	4,70%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	38.757.334,02	6,40%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	22.261.900,29	3,67%	0,00		7º IV
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	26.325.909,67	4,34%	1.096.030.531,90	2,40%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	17.699.622,54	2,92%	490.448.090,25	3,61%	8º I
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.836.707,09	1,95%	756.184.274,65	1,57%	9º III

Investimentos

\$ 605.964.108,85

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 605.964.108,85

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2040 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	5.000	4.431,5003	22.157.501,50
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.392,069039	13.176.207,12
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.392,069039	8.784.138,08
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.478,883538	4.478.883,54
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.432,360791	11.843.268,03
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.509,571514	35.300.925,81
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.196,145099	4.926.274,35
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.490,355315	8.980.710,63
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.436,658924	36.939.622,20
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	19/09/2024	A mercado	5.000	4.196,145099	20.980.725,50
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.474,105433	205.808,85
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.526,478656	20.369.153,95
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.466,101566	22.330.507,83
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.289,904066	9.866.779,35
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7555%	154	4.535,987302	698.542,04
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2024	A mercado	5.000	4.116,115077	20.580.575,39

Investimentos

\$ 605.964.108,85

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 605.964.108,85

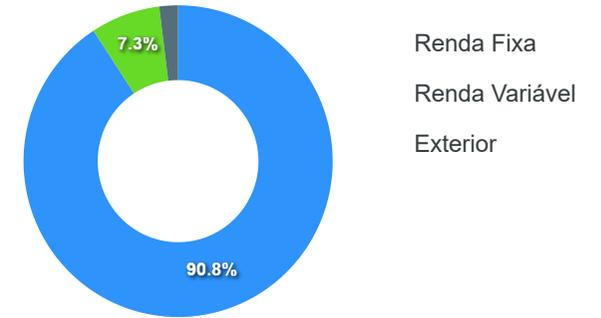
Governança (Pró Gestão)


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	39,87% 241.619.624,11	60,13% 364.344.484,74
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,33% 135.300.553,42	77,67% 470.663.555,43
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	9,31% 56.430.281,84	50,69% 307.148.183,47
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	19,27% 116.751.410,18	0,73% 4.441.411,59
8º I - Fundos de Ações	30,00%	7,27% 44.025.532,21	22,73% 137.763.700,44
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,95% 11.836.707,09	8,05% 48.759.703,80

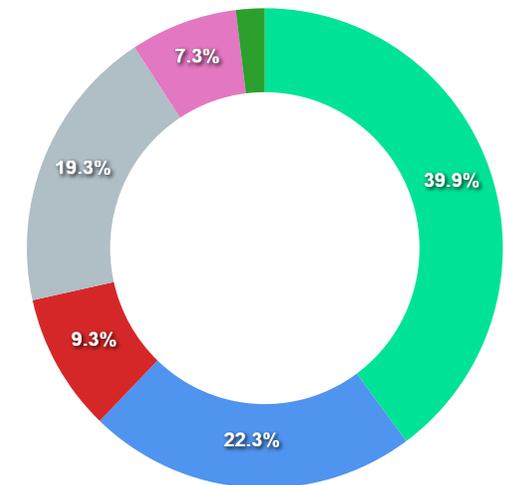
Governança (Pró Gestão)

Não possui

Segmentos

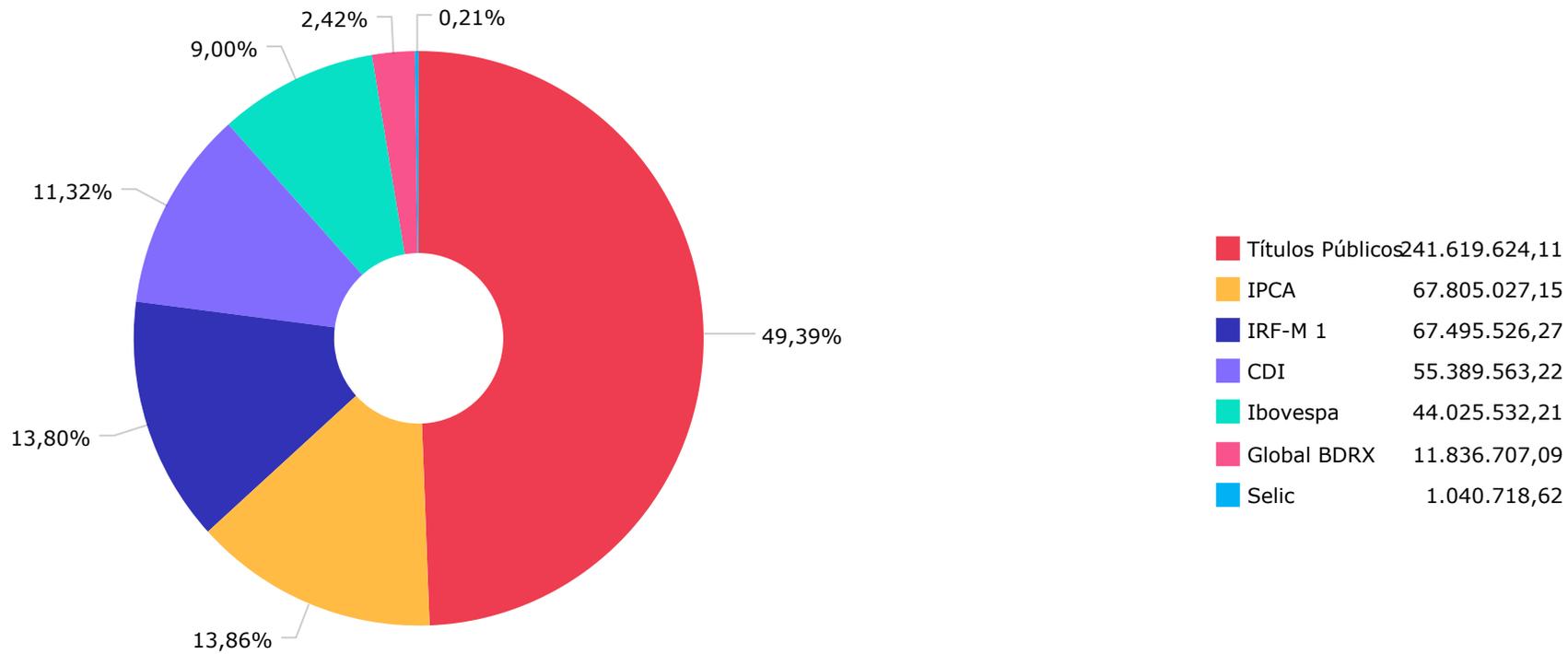


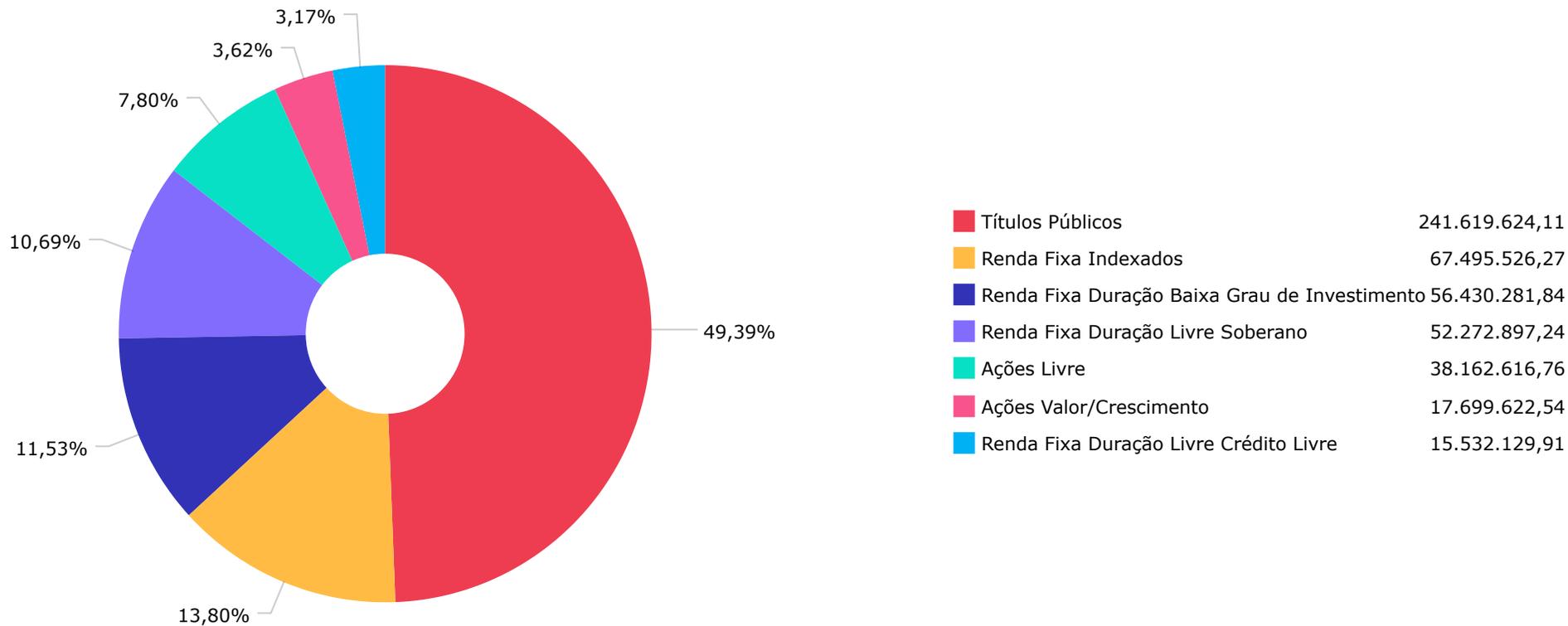
Artigos

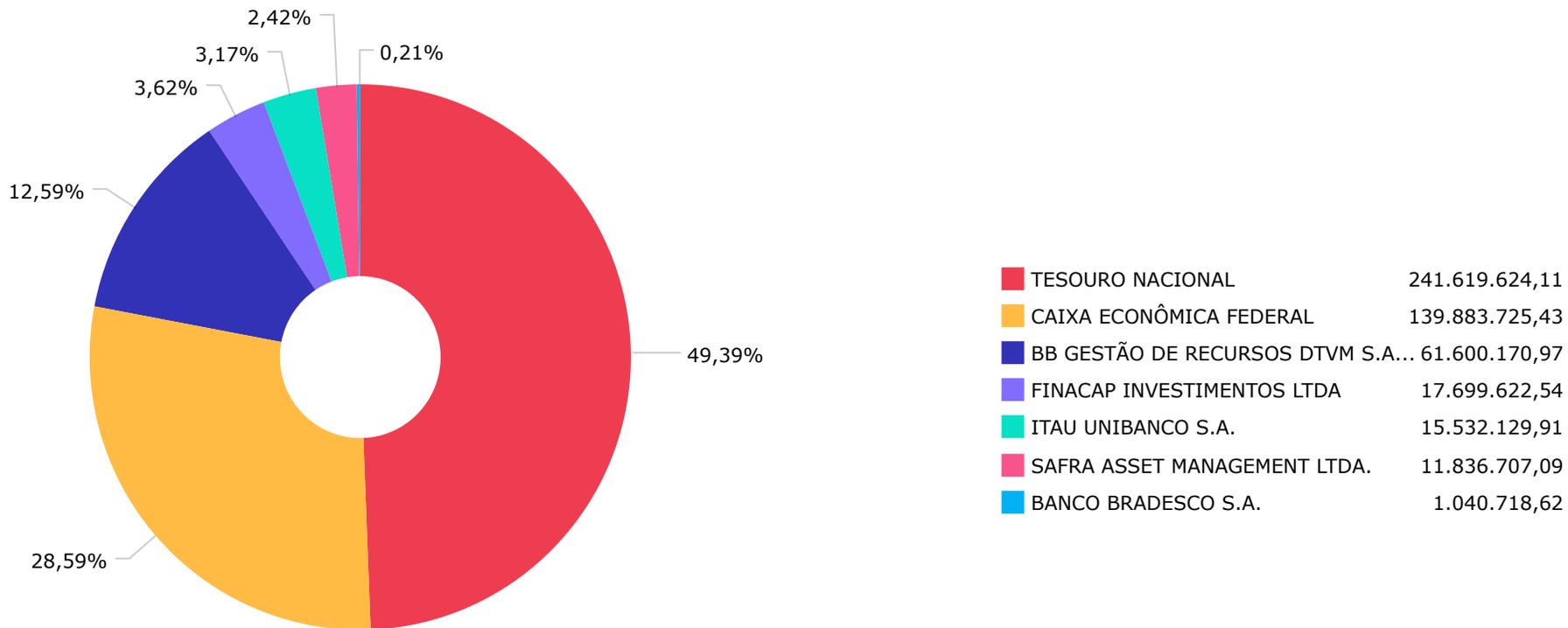


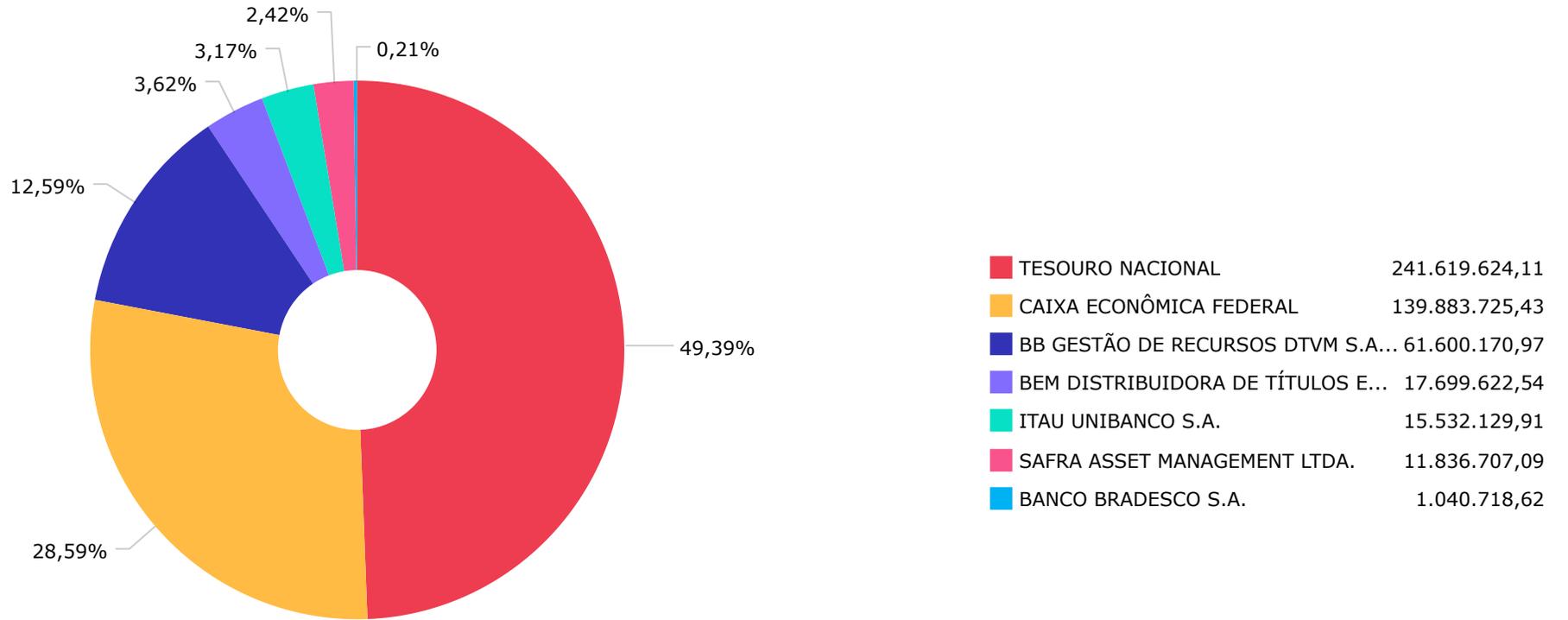
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	39,87%	0,00%	36,00%	100,00%	364.344.484,74	8° I - Fundos de Ações	7,27%	0,00%	6,00%	30,00%	137.763.700,45
7° I b - FI 100% Títulos TN	22,33%	0,00%	14,00%	100,00%	470.663.555,43	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	181.789.232,66
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	605.964.108,85	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	60.596.410,89
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.298.205,44	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	60.596.410,89
7° III a - FI Referenciados RF	9,31%	0,00%	15,00%	60,00%	307.148.183,47	9° III - Ações - BDR Nível I	1,95%	0,00%	2,00%	10,00%	48.759.703,80
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	363.578.465,31	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	60.596.410,89
7° IV - Ativos Financeiros de ...	19,27%	0,00%	14,00%	20,00%	4.441.411,59	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.298.205,44
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.298.205,44						
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.298.205,44						
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.298.205,44						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,86	8,24	2,73	5,38	11,42	26,66	0,02	0,04
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-0,21	41,96	0,63	22,50	52,98	86,40		
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,09	30,22	1,68	18,06	38,90	58,87	8,30	17,48
IBOVESPA - BENCHMARK	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79		
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-0,08	0,57	7,77	1,82	15,61	24,25	5,61	11,82
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-3,14	-7,65	3,89	-0,21	5,18	7,22	5,73	12,07
IPCA - BENCHMARK	0,30	3,16	0,66	1,72	4,27	9,68		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71	6,65	2,71	4,15	9,77	24,69	0,18	0,37
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,63	4,18	2,23	2,55	8,39	20,05	0,50	1,06
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,52	4,59	2,18	2,74	7,65	21,44	0,56	1,18
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,81	7,10	2,50	4,52	10,13	24,79	0,14	0,30
SELIC - BENCHMARK	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88	8,67	2,82	5,58	11,94	27,59	0,02	0,04









Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	555.471.939,62	3.459.435,67	6.976.737,86	555.888.364,94	3.933.727,51	3.933.727,51	0,71% ▲	0,71%	0,84%	0,84%	84,52%	0,61%
Fevereiro	555.888.364,94	13.121.177,93	9.022.822,62	565.782.661,55	5.795.941,30	9.729.668,81	1,04% ▲	1,75%	1,20%	2,05%	85,37%	0,71%
Março	565.782.661,55	29.232.887,35	30.527.818,89	570.083.126,57	5.595.396,56	15.325.065,37	0,99% ▲	2,76%	0,54%	2,60%	106,15%	0,54%
Abril	570.083.126,57	4.342.199,84	3.640.748,99	572.319.389,76	1.534.812,34	16.859.877,71	0,27% ▲	3,03%	0,80%	3,42%	88,60%	0,76%
Mai	572.319.389,76	52.454.006,19	63.085.696,36	565.735.296,16	4.047.596,57	20.907.474,28	0,71% ▲	3,76%	0,86%	4,31%	87,24%	0,58%
Junho	565.735.296,16	45.767.999,47	36.867.852,06	578.590.817,73	3.955.374,16	24.862.848,44	0,69% ▲	4,48%	0,59%	4,93%	90,87%	0,56%
Julho	578.590.817,73	15.262.466,15	5.557.260,60	595.285.843,34	6.989.820,06	31.852.668,50	1,19% ▲	5,72%	0,82%	5,79%	98,79%	0,62%
Agosto	595.285.843,34	33.594.208,52	29.375.349,62	606.648.913,83	7.144.211,59	38.996.880,09	1,19% ▲	6,98%	0,40%	6,21%	112,40%	0,73%
Setembro	606.648.913,83	25.433.585,66	27.669.780,87	605.964.108,85	1.551.390,23	40.548.270,32	0,26% ▲	7,25%	0,70%	6,96%	104,17%	0,63%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	15.325.065,37	2,76%	2,60%
2º Trim	9.537.783,07	1,67%	2,27%
1º Sem	24.862.848,44	4,48%	4,93%
3º Trim	15.685.421,88	2,66%	1,93%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráfico Risco x Retorno

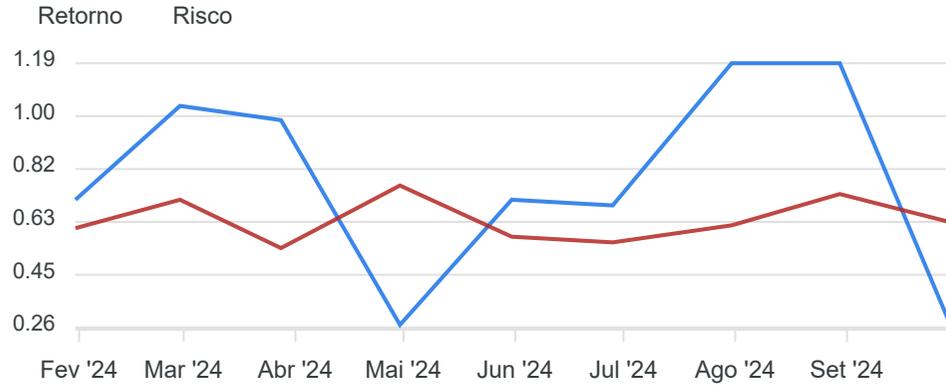
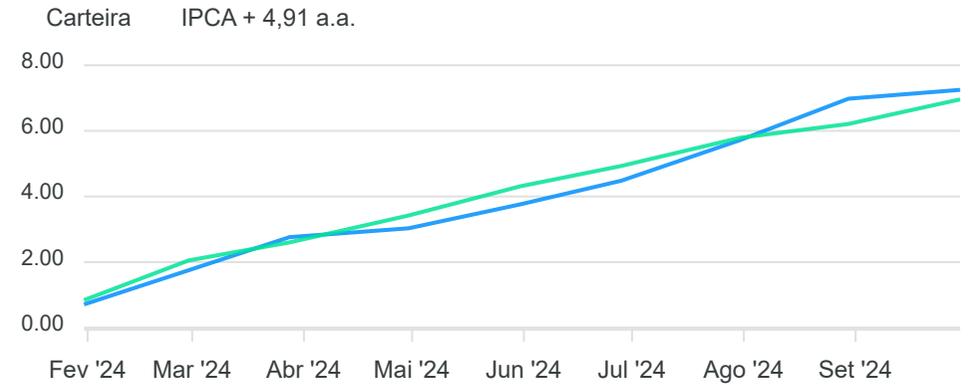
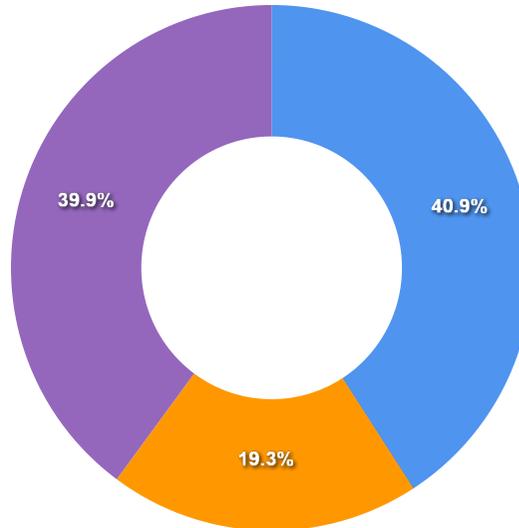


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/09/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	247.593.074,56	40,86
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	116.751.410,18	19,27
Acima D+3600	241.619.624,16	39,87
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	219.799.568,24	21.623.977,84	0,00	241.619.624,11	196.078,03	0,08% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.026.689,87	0,00	0,00	35.274.261,30	247.571,43	0,71% ▲	0,18%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.031.589,06	0,00	0,00	1.040.718,62	9.129,56	0,88% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	78.630.950,49	3.809.607,82	27.669.780,87	55.389.563,22	618.785,78	0,75% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.909.934,75	0,00	0,00	16.998.635,94	88.701,19	0,52% ▲	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	66.955.425,50	0,00	0,00	67.495.526,27	540.100,77	0,81% ▲	0,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.434.422,45	0,00	0,00	15.532.129,91	97.707,46	0,63% ▲	0,50%
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	27.041.446,05	0,00	0,00	27.247.954,40	206.508,35	0,76% ▲	-
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	28.286.524,39	0,00	0,00	28.484.221,47	197.697,08	0,70% ▲	-
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	38.528.889,87	0,00	0,00	38.757.334,02	228.444,15	0,59% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	22.142.326,18	0,00	0,00	22.261.900,29	119.574,11	0,54% ▲	-
	549.787.766,85	25.433.585,66	27.669.780,87	550.101.869,55	2.550.297,91	0,46%	0,08%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	27.180.567,50	0,00	0,00	26.325.909,67	-854.657,83	-3,14% ▼	5,73%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	17.713.818,78	0,00	0,00	17.699.622,54	-14.196,24	-0,08% ▼	5,61%
-	44.894.386,28	0,00	0,00	44.025.532,21	-868.854,07	-1,94%	5,68%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.966.760,70	0,00	0,00	11.836.707,09	-130.053,61	-1,09% ▼	8,30%
	11.966.760,70	0,00	0,00	11.836.707,09	-130.053,61	-1,09%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.342.453,24	0,00	0,00	35.274.261,30	931.808,06	2,71% ▲
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.012.163,58	0,00	0,00	1.040.718,62	28.555,04	2,82% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.485.476,93	40.034.448,89	36.856.080,96	55.389.563,22	1.725.718,36	1,91% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.635.884,77	0,00	0,00	16.998.635,94	362.751,17	2,18% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	65.846.512,86	0,00	0,00	67.495.526,27	1.649.013,41	2,50% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.193.061,26	0,00	0,00	15.532.129,91	339.068,65	2,23% ▲
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	26.619.961,98	0,00	0,00	27.247.954,40	627.992,42	2,36% ▲
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.806.462,86	0,00	0,00	28.484.221,47	677.758,61	2,44% ▲
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	37.852.949,16	0,00	0,00	38.757.334,02	904.384,86	2,39% ▲
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.791.923,79	0,00	0,00	22.261.900,29	469.976,50	2,16% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	240.190.948,48	21.623.977,84	25.746.310,13	241.619.624,11	5.551.007,92	2,12% ▲
	537.777.798,91	61.658.426,73	62.602.391,09	550.101.869,55	13.268.035,00	2,47%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.748.867,48	12.631.833,60	0,00	26.325.909,67	945.208,59	3,72% ▲
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	16.423.447,24	0,00	0,00	17.699.622,54	1.276.175,30	7,77% ▲
	29.172.314,72	12.631.833,60	0,00	44.025.532,21	2.221.383,89	5,31%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.640.704,10	0,00	0,00	11.836.707,09	196.002,99	1,68% ▲
	11.640.704,10	0,00	0,00	11.836.707,09	196.002,99	1,68%

