

2024

Relatório Mensal

Maio

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	219.070.073,06	38,72%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.211.443,37	6,05%	6.634.026.168,29	0,52%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.607.576,61	2,94%	5.032.963.943,31	0,33%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	65.448.312,84	11,57%	8.395.304.184,88	0,78%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.223.642,50	2,69%	2.239.801.280,64	0,68%	7º I b
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.003.783,55	0,18%	11.765.933.444,23	0,01%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	49.433.806,56	8,74%	15.967.251.260,95	0,31%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	26.373.057,11	4,66%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.541.390,09	4,87%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	37.485.499,73	6,63%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.603.497,53	3,82%	0,00		7º IV
BB AGRO FIC AÇÕES	12.479.494,43	2,21%	221.630.214,85	5,63%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.511.668,57	2,21%	1.102.566.729,67	1,13%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	16.202.358,29	2,86%	447.669.675,81	3,62%	8º I
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.539.691,92	1,86%	733.091.092,91	1,44%	9º III

Investimentos

 565.735.296,16

Disponibilidades Financeiras

 0,00

Total Carteira

 565.735.296,16

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	4.426,121231	22.130.606,16
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.259,654171	12.778.962,51
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.259,654171	8.519.308,34
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.346,300402	4.346.300,40
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.426,395103	11.827.327,72
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.503,26325	35.251.544,72
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.217,315283	4.951.128,14
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.357,430728	8.714.861,46
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.304,077053	35.835.745,54
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.467,617107	205.510,39
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.519,605701	20.338.225,65
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.459,670542	22.298.352,71
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.284,799037	9.855.037,79
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7555%	154	4.529,045724	697.473,04
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2024	A mercado	5.000	4.263,937699	21.319.688,50

Investimentos

\$ 565.735.296,16

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 565.735.296,16

Governança (Pró Gestão)

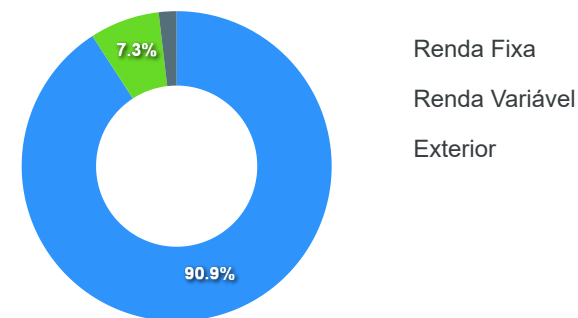


Artigos	Limite (%)		Utilizado		Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	38,72%	219.070.073,06	61,28%	346.665.223,10
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	23,24%	131.490.975,32	76,76%	434.244.320,84
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	8,92%	50.437.590,11	51,08%	289.003.587,59
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	19,97%	113.003.444,46	0,03%	143.614,77
8º I - Fundos de Ações	30,00%	7,28%	41.193.521,29	22,72%	128.527.067,56
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,86%	10.539.691,92	8,14%	46.033.837,70

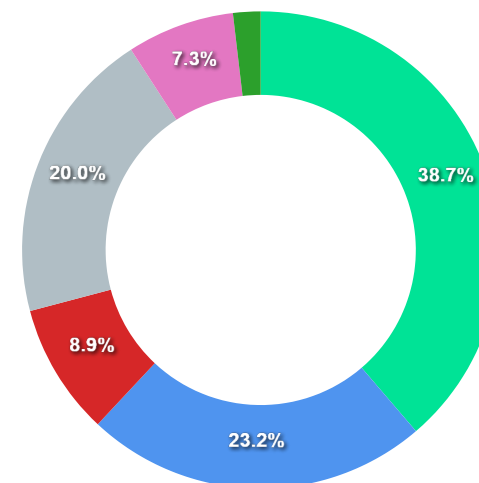
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos

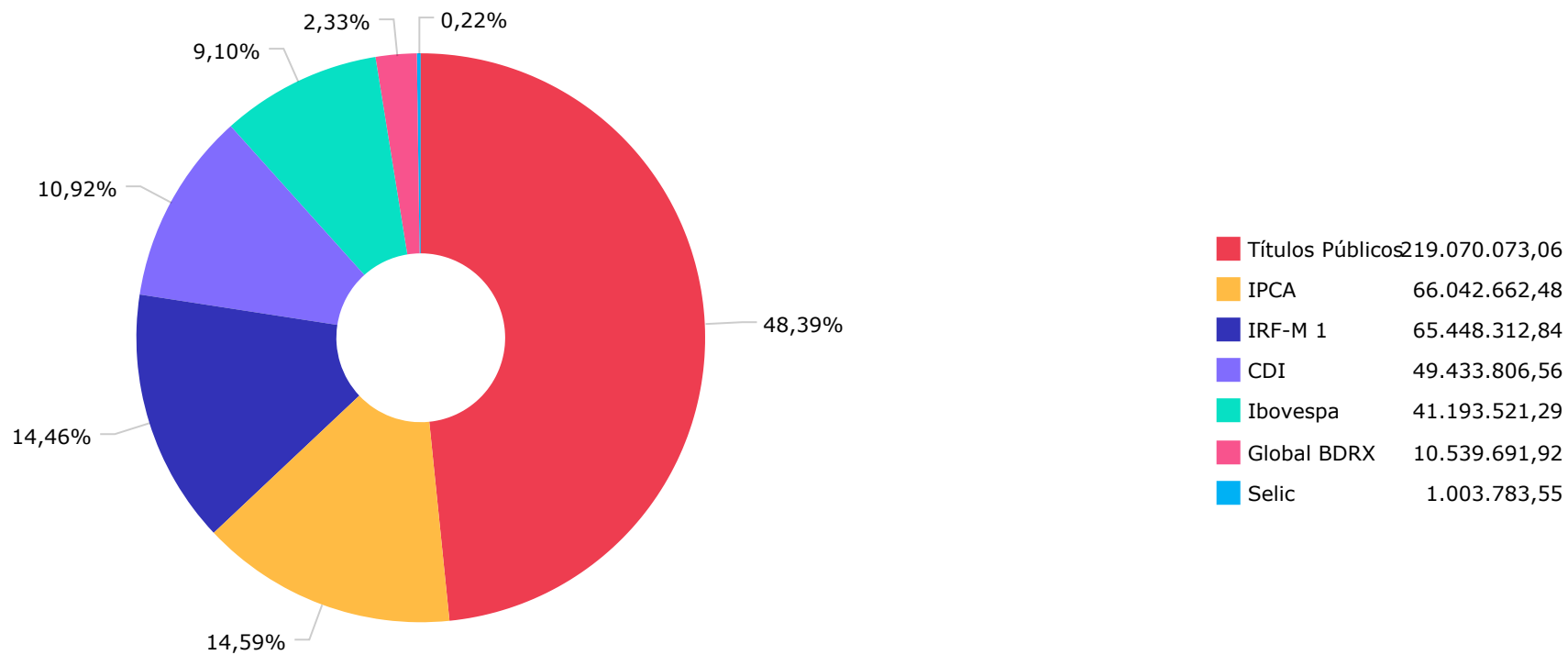


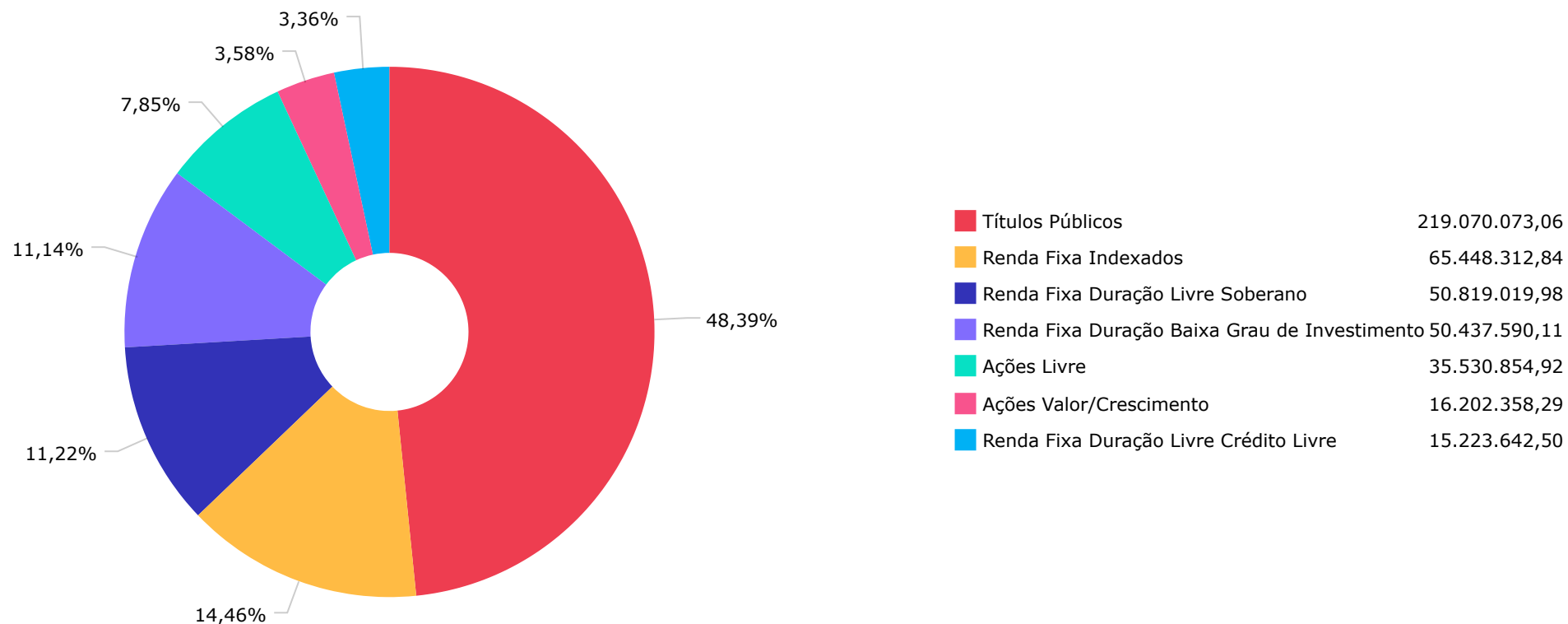
Artigos

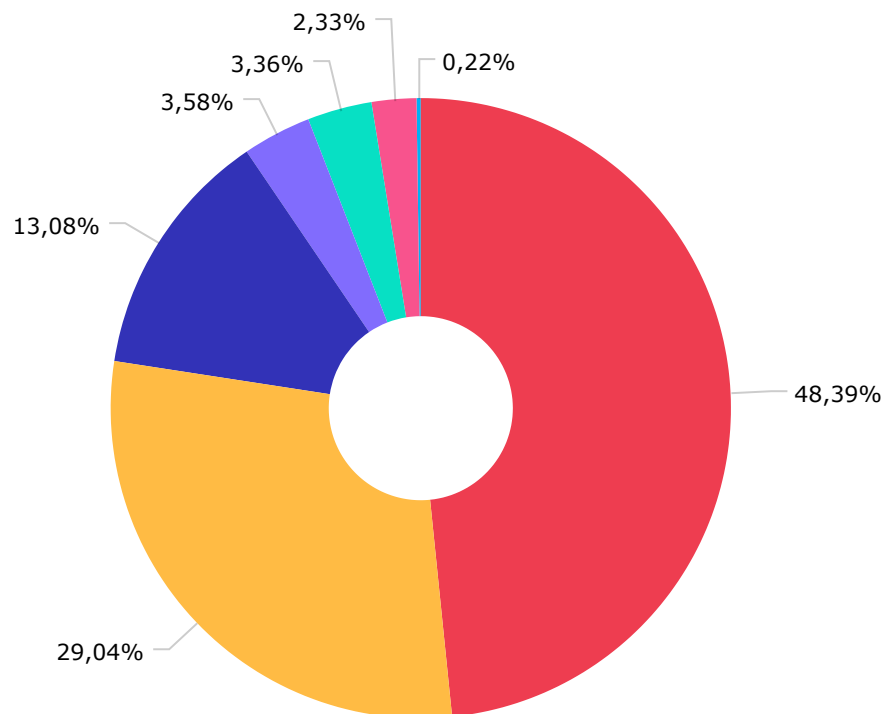


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	38,72%	0,00%	36,00%	100,00%	346.665.223,10	8º I - Fundos de Ações	7,28%	0,00%	6,00%	30,00%	128.527.067,56
7º I b - FI 100% Títulos TN	23,24%	0,00%	14,00%	100,00%	434.244.320,84	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	169.720.588,85
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	565.735.296,16	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	56.573.529,62
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.286.764,81	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	56.573.529,62
7º III a - FI Referenciados RF	8,92%	0,00%	15,00%	60,00%	289.003.587,59	9º III - Ações - BDR Nível I	1,86%	0,00%	2,00%	10,00%	46.033.837,70
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	339.441.177,70	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	56.573.529,62
7º IV - Ativos Financeiros de ...	19,97%	0,00%	14,00%	20,00%	143.614,77	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.286.764,81
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.286.764,81						
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.286.764,81						
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.286.764,81						

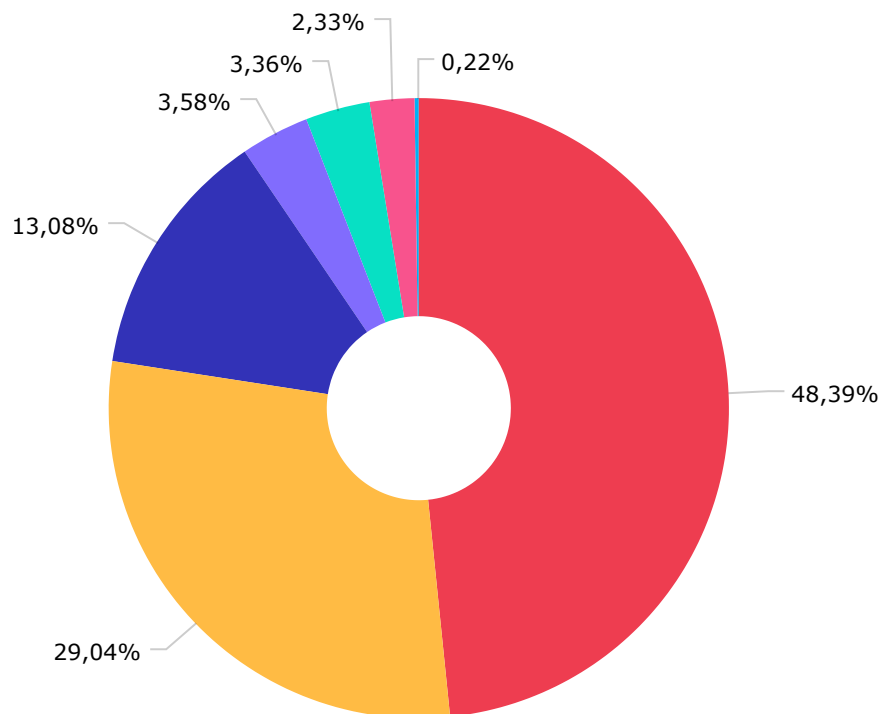
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,84	4,51	2,62	5,47	12,52	27,70	0,03	0,05
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	7,32	25,07	12,29	28,62	37,90	58,29		
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,86	15,95	7,97	18,86	26,60	36,89	4,31	9,07
IBOVESPA - BENCHMARK	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65		
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-2,01	-7,94	-5,33	-2,01	11,79	13,72	6,65	13,99
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90	-12,76	-7,23	-8,21	7,50	-3,15	4,12	8,68
BB AGRO FIC AÇÕES	-1,48	-8,66	-4,26	-4,91	6,48	-6,67	5,79	12,20
IPCA - BENCHMARK	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72	3,44	1,78	4,42	11,34	25,22	0,35	0,74
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,75	2,11	1,07	3,76	9,65	22,11	1,18	2,49
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,70	2,19	0,96	3,42	9,47	23,13	0,46	0,96
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,76	3,85	2,16	4,77	11,40	26,22	0,18	0,37
SELIC - BENCHMARK	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88	4,81	2,76	5,79	13,05	28,67	0,03	0,07







TESOURO NACIONAL	219.070.073,06
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	131.489.696,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	59.202.606,37
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	16.202.358,29
ITAU UNIBANCO S.A.	15.223.642,50
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	10.539.691,92
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	1.003.783,55



TESOIRO NACIONAL	219.070.073,06
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	131.489.696,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	59.202.606,37
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	16.202.358,29
ITAU UNIBANCO S.A.	15.223.642,50
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	10.539.691,92
BANCO BRADESCO S.A.	1.003.783,55

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%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	15.325.065,37	2,76%	2,60%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

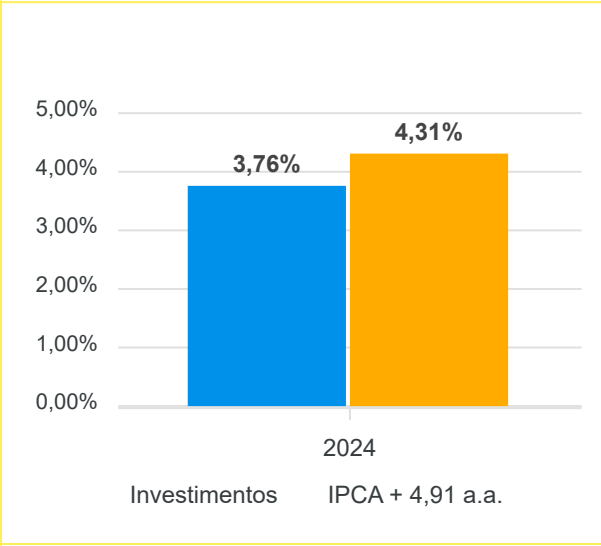


Gráfico Risco x Retorno

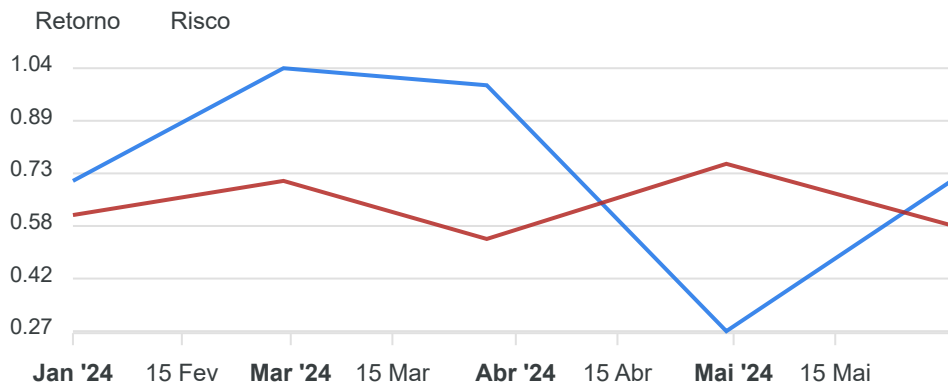
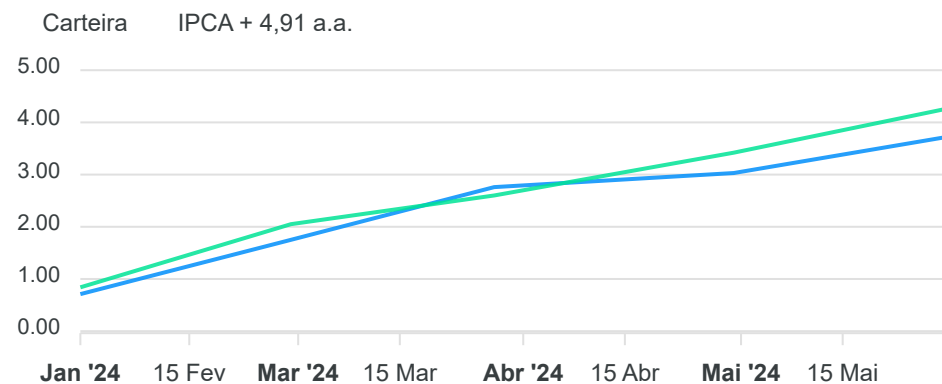
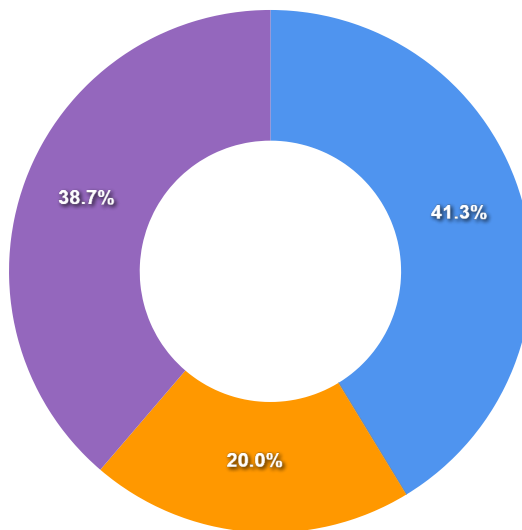


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/05/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	233.661.778,64	41,30
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	113.003.444,46	19,97
Acima D+3600	219.070.073,06	38,72
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	198.172.849,99	21.528.176,20	2.209.356,21	219.070.073,06	1.578.403,08	0,72% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.966.396,71	0,00	0,00	34.211.443,37	245.046,66	0,72% ▲	0,35%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	76.258.035,33	14.711.203,78	41.976.311,49	49.433.806,56	440.878,94	0,48% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.491.669,52	0,00	0,00	16.607.576,61	115.907,09	0,70% ▲	0,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	64.740.141,51	214.626,21	0,00	65.448.312,84	493.545,12	0,76% ▲	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.110.783,47	0,00	0,00	15.223.642,50	112.859,03	0,75% ▲	1,18%
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	26.136.584,26	0,00	0,00	26.373.057,11	236.472,85	0,90% ▲	-
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.277.331,28	0,00	0,00	27.541.390,09	264.058,81	0,97% ▲	-
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	37.127.562,73	0,00	0,00	37.485.499,73	357.937,00	0,96% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.422.096,47	0,00	0,00	21.603.497,53	181.401,06	0,85% ▲	-
BRAPSCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.000.000,00	0,00	1.003.783,55	3.783,55	0,38% ▲	0,03%
	516.703.451,27	37.454.006,19	44.185.667,70	514.002.082,95	4.030.293,19	0,78%	0,10%

RENDÁ VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	12.666.346,12	0,00	0,00	12.479.494,43	-186.851,69	-1,48% ▼	5,79%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.885.326,07	0,00	0,00	12.511.668,57	-373.657,50	-2,90% ▼	4,12%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.958.310,82	15.000.000,00	0,00	16.202.358,29	-755.952,53	-4,46% ▼	6,65%
-	27.509.983,01	15.000.000,00	0,00	41.193.521,29	-1.316.461,72	-3,10%	5,62%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	7.095.681,72	0,00	7.154.019,89	0,00	58.338,17	0,82% ▲	0,49%
-	7.095.681,72	0,00	7.154.019,89	0,00	58.338,17	0,82%	0,00%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.053.926,37	0,00	11.746.008,77	0,00	692.082,40	6,26% ▲	4,50%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.956.347,39	0,00	0,00	10.539.691,92	583.344,53	5,86% ▲	4,31%
	21.010.273,76	0,00	11.746.008,77	10.539.691,92	1.275.426,93	6,07%	0,00%

