

2024

Relatório

Mensal e 1º trimestre de 2024

Março

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	196.950.307,22	34,55%	0,00		7º I a
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.106.912,00	4,75%	0,00		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.869.891,27	5,94%	6.783.435.564,44	0,50%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.544.714,21	2,90%	5.431.217.487,91	0,30%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	64.363.921,30	11,29%	8.612.056.482,37	0,75%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.146.021,04	2,66%	2.398.945.450,00	0,63%	7º I b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	74.855.560,64	13,13%	16.216.695.874,70	0,46%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	25.972.997,34	4,56%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	36.910.023,07	6,47%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.269.321,05	3,73%	0,00		7º IV
BB AGRO FIC AÇÕES	13.380.805,38	2,35%	273.993.682,58	4,88%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	13.272.949,69	2,33%	1.336.503.943,21	0,99%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.058.757,03	0,36%	446.896.811,40	0,46%	8º I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.284.658,17	1,98%	1.470.371.537,25	0,77%	9º III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.026.234,66	1,76%	710.413.926,44	1,41%	9º III
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	7.070.052,50	1,24%	72.614.008,86	9,74%	10º I

Investimentos

\$ 570.083.126,57

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 570.083.126,57

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	4.355,344869	21.776.724,34
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.314,713352	12.944.140,06
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.314,713352	8.629.426,70
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.401,172254	4.401.172,25
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.355,332114	11.637.447,41
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.431,930772	34.693.154,08
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.439,261113	5.211.692,55
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.412,125246	8.824.250,49
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.358,997284	36.293.011,39
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.396,248511	202.227,43
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.447,981837	20.015.918,27
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.388,339906	21.941.699,53
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.214,350614	9.693.006,41
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7555%	154	4.457,378619	686.436,31

Investimentos

\$ 570.083.126,57

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 570.083.126,57

Governança (Pró Gestão)

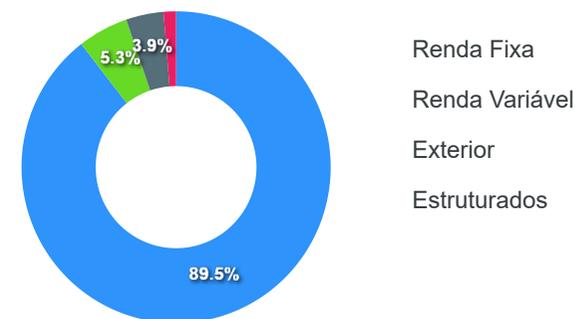


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	34,55% 196.950.307,22	65,45% 373.132.819,35
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,79% 129.924.547,82	77,21% 440.158.578,75
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	13,13% 74.855.560,64	46,87% 267.194.315,30
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	14,76% 84.152.341,46	5,24% 29.864.283,85
8º I - Fundos de Ações	30,00%	5,04% 28.712.512,10	24,96% 142.312.425,87
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,74% 21.310.892,83	6,26% 35.697.419,83
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	1,24% 7.070.052,50	8,76% 49.938.260,16

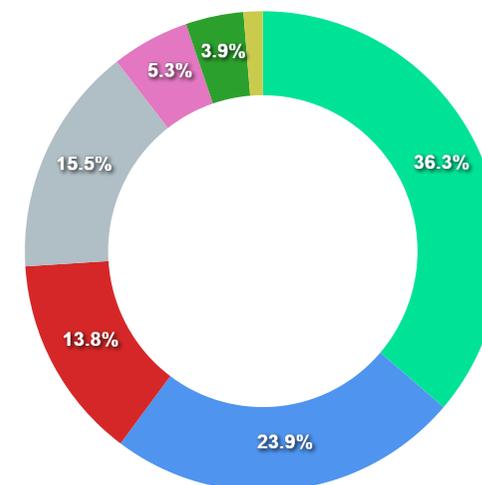
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



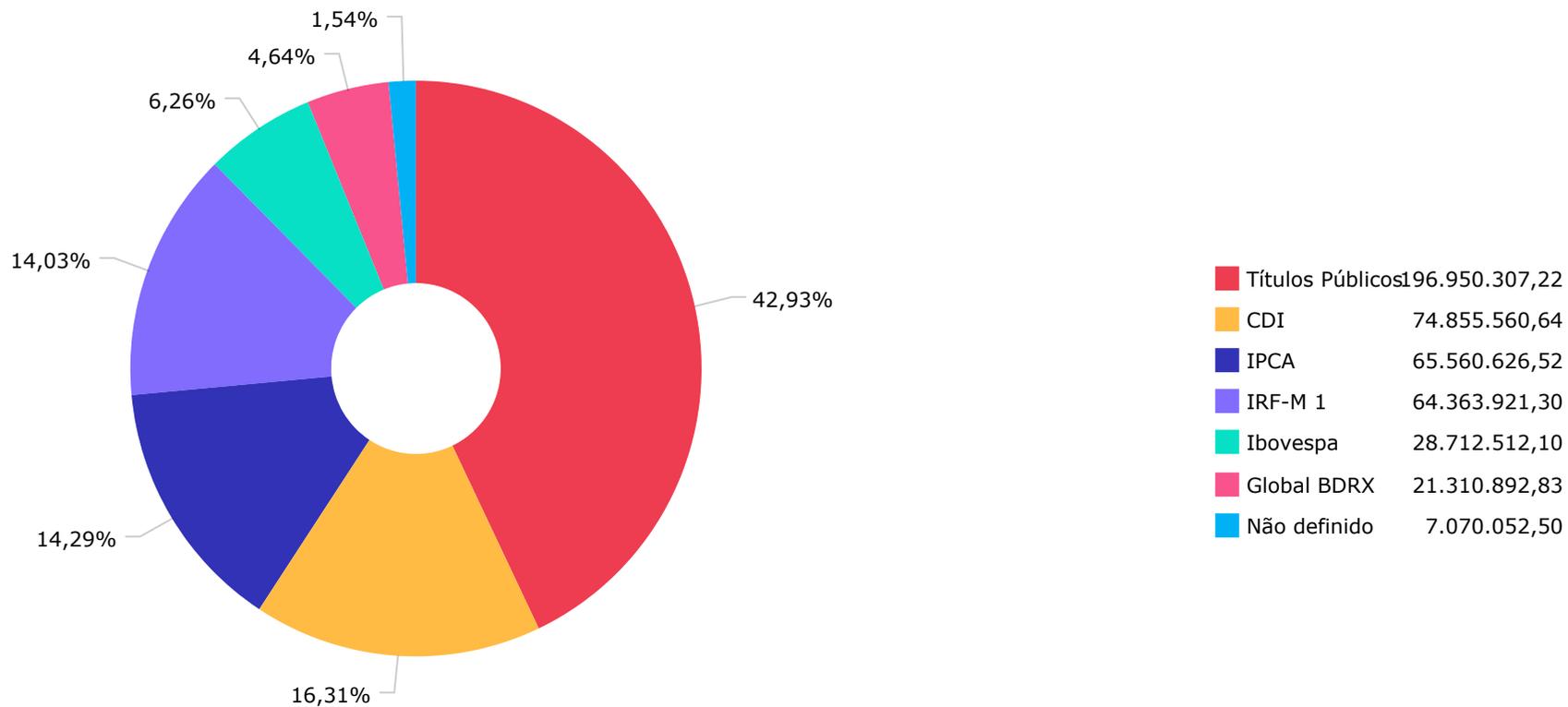
Artigos

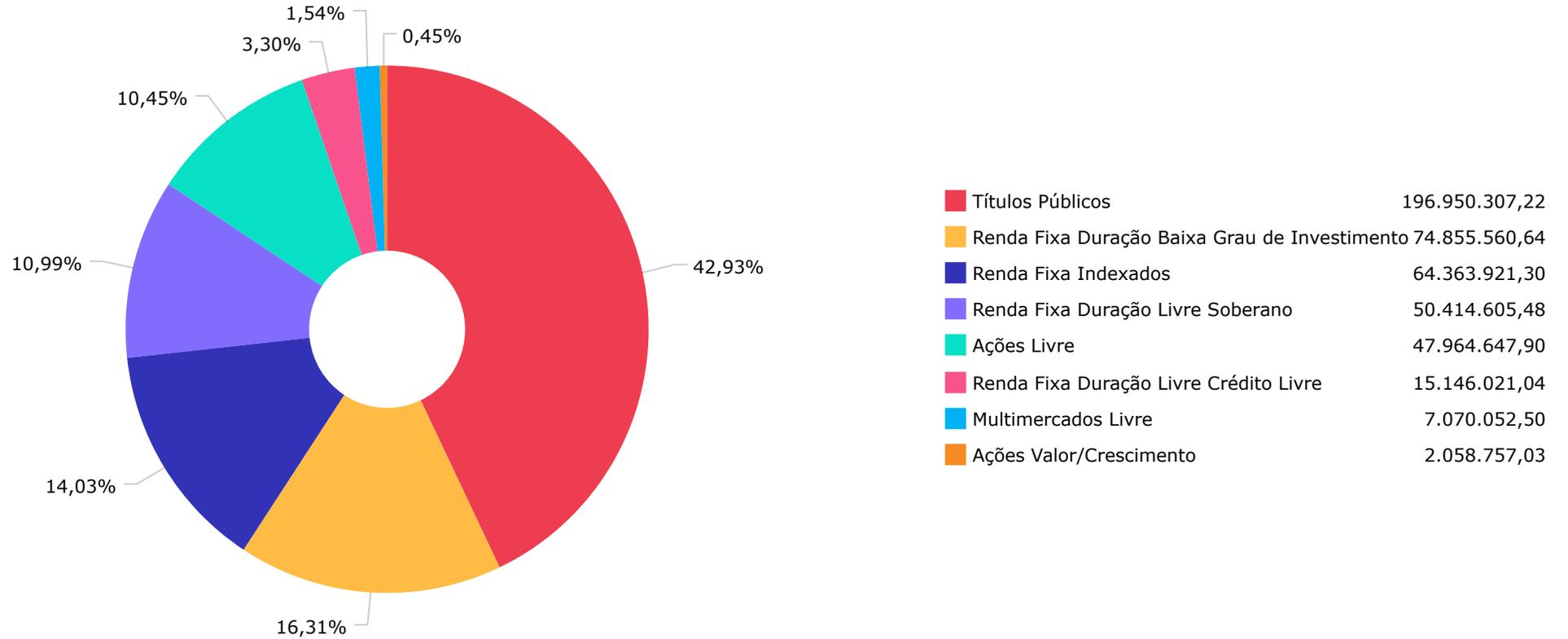


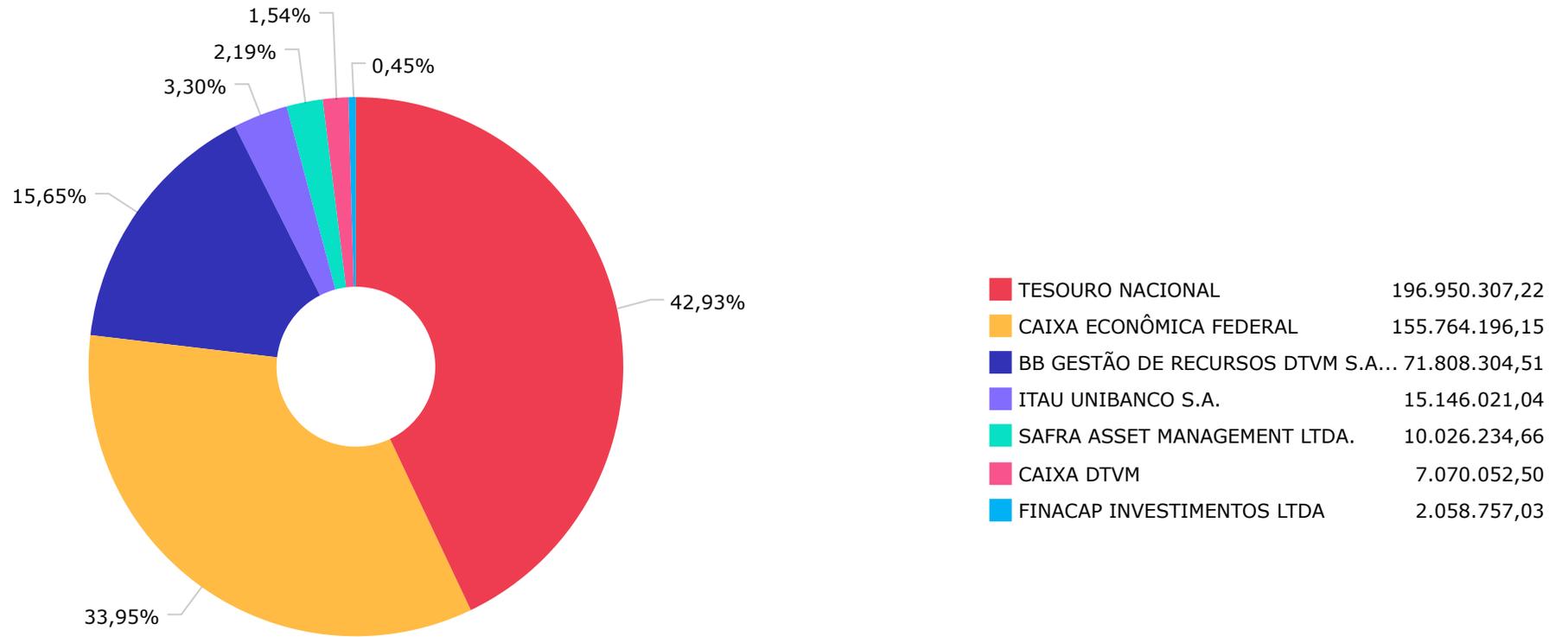
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	34,55%	0,00%	36,00%	100,00%	373.132.819,35
7° I b - FI 100% Títulos TN	22,79%	0,00%	14,00%	100,00%	440.158.578,75
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	570.083.126,57
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.504.156,33
7° III a - FI Referenciados RF	13,13%	0,00%	15,00%	60,00%	267.194.315,30
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	342.049.875,94
7° IV - Ativos Financeiros de ...	14,76%	0,00%	14,00%	20,00%	29.864.283,85
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.504.156,33
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.504.156,33
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.504.156,33

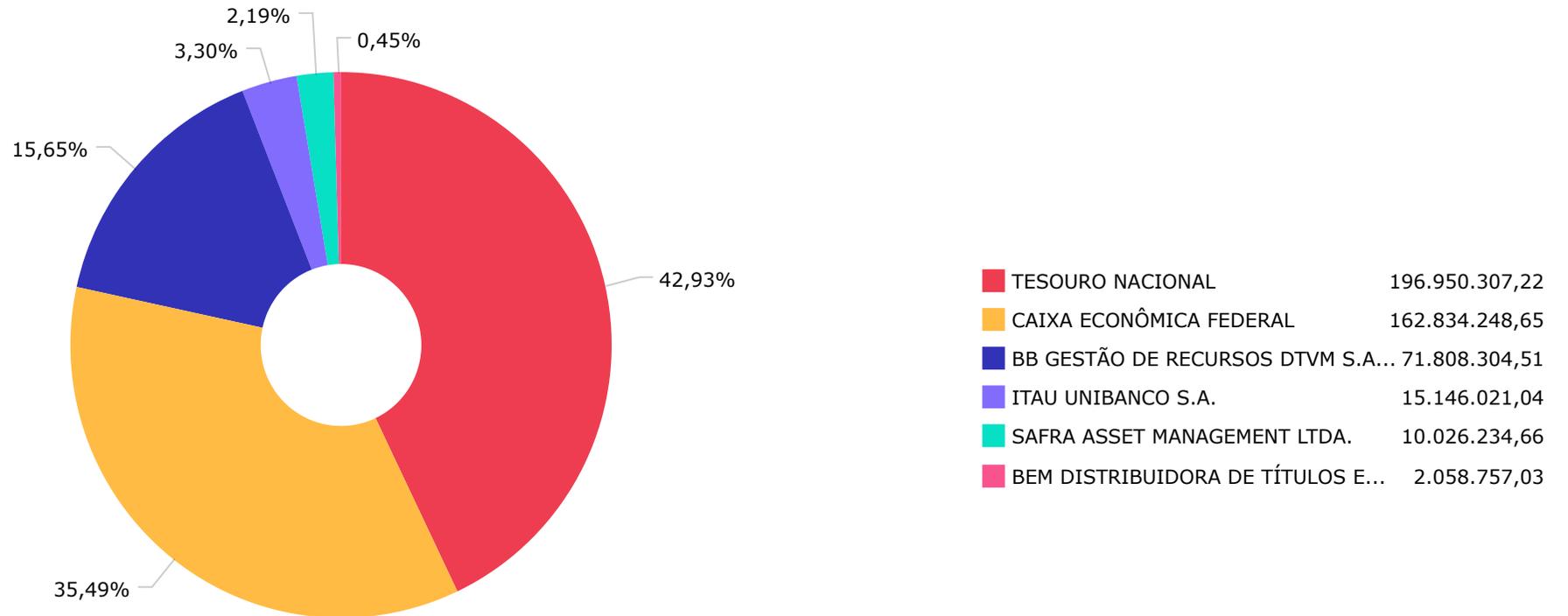
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	5,04%	0,00%	6,00%	30,00%	142.312.425,87
8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	171.024.937,97
9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	57.008.312,66
9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	57.008.312,66
9° III - Ações - BDR Nível I	3,74%	0,00%	2,00%	10,00%	35.697.419,83
10° I - Fundos Multimercados	1,24%	0,00%	1,00%	10,00%	49.938.260,16
10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.504.156,33

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	0,86	2,36	2,36	2,77	7,49	26,88	0,35	0,73
CDI - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,87	2,72	2,72	5,74	12,93	27,88	0,01	0,03
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,24	13,93	13,93	22,60	29,68	24,40	5,80	12,22
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,71	10,30	10,30	17,65	23,43	15,35	5,11	10,76
IBOVESPA - BENCHMARK								
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,56	-1,23	-1,23	13,54	32,70	16,26	4,43	9,34
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-1,58	-7,45	-7,45	5,40	19,61	-2,02	5,30	11,17
BB AGRO FIC AÇÕES	2,65	-2,07	-2,07	4,83	16,65	-0,68	6,16	12,96
IPCA - BENCHMARK								
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77	2,41	2,41	5,40	13,73	25,89	0,08	0,17
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,55	1,59	1,59	5,69	13,03	23,64	0,42	0,88
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,58	1,80	1,80	4,77	11,99	25,10	0,55	1,17
IRF-M 1 - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80	2,47	2,47	5,37	12,08	26,60	0,08	0,18









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%

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

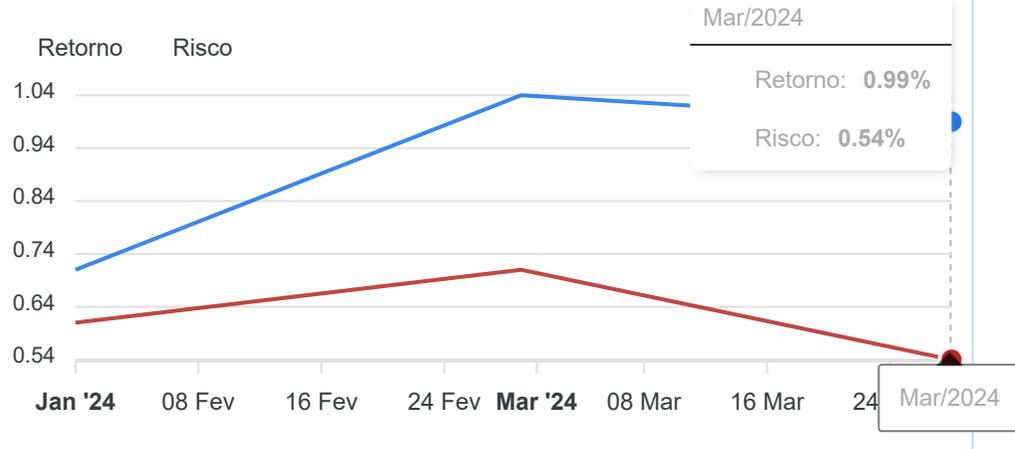
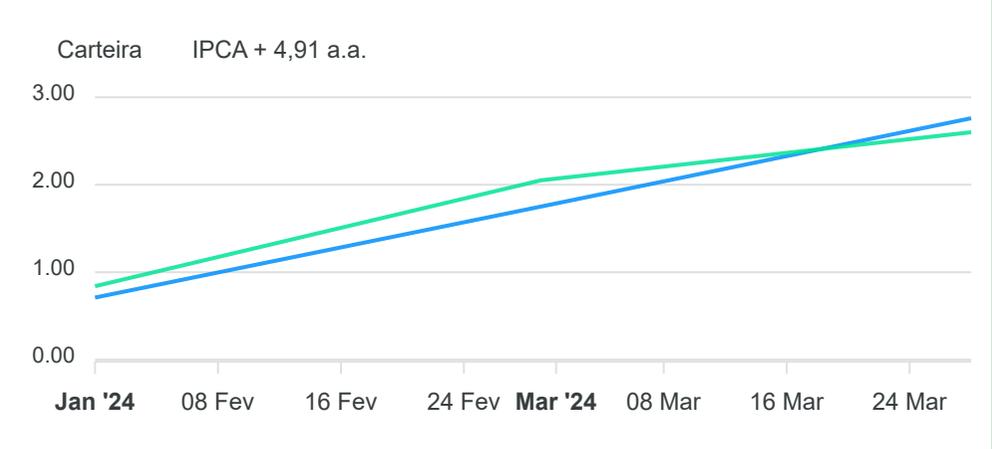
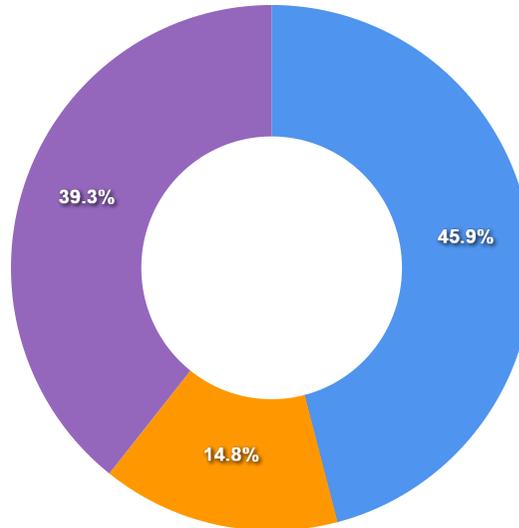


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 28/03/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	261.873.565,89	45,94
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	84.152.341,46	14,76
Acima D+3600	224.057.219,22	39,30
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	195.075.668,37	0,00	0,00	196.950.307,22	1.874.638,85	0,96% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.612.210,92	0,00	0,00	33.869.891,27	257.680,35	0,77% ▲	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	102.316.019,42	2.232.887,35	30.527.818,89	74.855.560,64	834.472,76	0,80% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.449.664,41	0,00	0,00	16.544.714,21	95.049,80	0,58% ▲	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	63.855.387,41	0,00	0,00	64.363.921,30	508.533,89	0,80% ▲	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.062.801,98	0,00	0,00	15.146.021,04	83.219,06	0,55% ▲	0,42%
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	25.654.134,84	0,00	0,00	25.972.997,34	318.862,50	1,24% ▲	-
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	36.377.039,54	0,00	0,00	36.910.023,07	532.983,53	1,47% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.021.496,52	0,00	0,00	21.269.321,05	247.824,53	1,18% ▲	-
	509.424.423,41	2.232.887,35	30.527.818,89	485.882.757,14	4.753.265,27	0,93%	0,06%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	13.035.071,65	0,00	0,00	13.380.805,38	345.733,73	2,65% ▲	6,16%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	13.486.563,85	0,00	0,00	13.272.949,69	-213.614,16	-1,58% ▼	5,30%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.027.127,27	0,00	0,00	2.058.757,03	31.629,76	1,56% ▲	4,43%
-	28.548.762,77	0,00	0,00	28.712.512,10	163.749,33	0,57%	5,64%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	7.010.108,78	0,00	0,00	7.070.052,50	59.943,72	0,86% ▲	0,35%
-	7.010.108,78	0,00	0,00	7.070.052,50	59.943,72	0,86%	0,35%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.037.323,78	0,00	0,00	11.284.658,17	247.334,39	2,24% ▲	5,80%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.762.042,81	0,00	0,00	10.026.234,66	264.191,85	2,71% ▲	5,11%
	20.799.366,59	0,00	0,00	21.310.892,83	511.526,24	2,46%	3,07%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.073.378,14	0,00	0,00	33.869.891,27	796.513,13	2,41% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	101.928.376,21	13.354.065,28	43.102.622,34	74.855.560,64	2.675.741,49	2,32% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.252.447,20	0,00	0,00	16.544.714,21	292.267,01	1,80% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	59.383.993,44	3.459.435,67	0,00	64.363.921,30	1.520.492,19	2,42% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.908.385,03	0,00	0,00	15.146.021,04	237.636,01	1,59% ▲
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	25.101.337,97	0,00	0,00	25.972.997,34	871.659,37	3,47% ▲
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	35.609.181,55	0,00	0,00	36.910.023,07	1.300.841,52	3,65% ▲
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	20.625.659,61	0,00	0,00	21.269.321,05	643.661,44	3,12% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	194.682.639,88	0,00	3.424.757,03	196.950.307,22	5.692.424,37	2,92% ▲
	501.565.399,03	16.813.500,95	46.527.379,37	485.882.757,14	14.031.236,53	2,80%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AGRO FIC AÇÕES	13.663.372,11	0,00	0,00	13.380.805,38	-282.566,73	-2,07% ▼
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	14.341.677,98	0,00	0,00	13.272.949,69	-1.068.728,29	-7,45% ▼
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.058.757,03	58.757,03	2,94% ▲
	28.005.050,09	2.000.000,00	0,00	28.712.512,10	-1.292.537,99	-4,31%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	6.906.959,99	0,00	0,00	7.070.052,50	163.092,51	2,36% ▲
	6.906.959,99	0,00	0,00	7.070.052,50	163.092,51	2,36%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.904.729,78	0,00	0,00	11.284.658,17	1.379.928,39	13,93% ▲
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.089.800,73	0,00	0,00	10.026.234,66	936.433,93	10,30% ▲
	18.994.530,51	0,00	0,00	21.310.892,83	2.316.362,32	12,19%

