

2024

Relatório Mensal

Outubro

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	242.527.851,02	39,60%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.538.205,66	5,80%	6.119.978.979,94	0,58%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.144.483,22	2,80%	4.085.747.193,68	0,42%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	68.052.679,00	11,11%	8.121.204.821,20	0,84%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.659.533,07	2,56%	1.757.846.296,75	0,89%	7º I b
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.050.372,60	0,17%	15.416.999.740,59	0,01%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	58.470.587,78	9,55%	19.218.803.160,79	0,30%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	27.525.442,59	4,49%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	28.796.609,72	4,70%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	39.180.557,03	6,40%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	22.491.083,21	3,67%	0,00		7º IV
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	26.058.620,13	4,25%	1.072.264.613,08	2,43%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	17.547.591,80	2,87%	501.604.392,08	3,50%	8º I
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.387.541,09	2,02%	783.972.826,50	1,58%	9º III

Investimentos

 612.431.157,92

Disponibilidades Financeiras

 0,00

Total Carteira

 612.431.157,92

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	4.477,220446	22.386.102,23
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.438,275586	13.314.826,76
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.438,275586	8.876.551,17
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.525,326759	4.525.326,76
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.478,241766	11.965.862,00
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.555,718613	35.662.165,30
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.093,378230	4.805.626,04
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.536,917646	9.073.835,29
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.483,009371	37.325.536,02
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	19/09/2024	A mercado	5.000	4.093,378230	20.466.891,15
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.520,224508	207.930,33
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.572,820279	20.577.691,26
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.512,184335	22.560.921,68
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.335,222295	9.971.011,28
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7555%	154	4.582,368528	705.684,75
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2024	A mercado	5.000	4.020,377803	20.101.889,02

Investimentos

\$ 612.431.157,92

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 612.431.157,92

Governança (Pró Gestão)

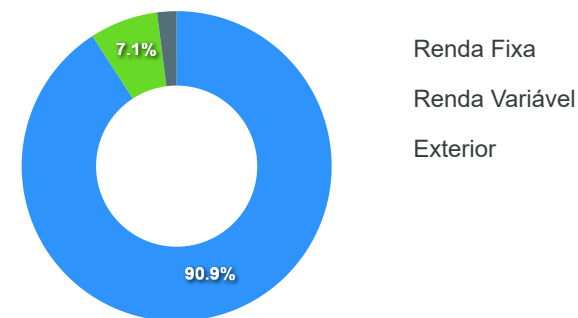


Artigos	Limite (%)		Utilizado		Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	39,60%	242.527.851,02	60,40%	369.903.306,90
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,27%	136.394.900,95	77,73%	476.036.256,97
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	9,72%	59.520.960,38	50,28%	307.937.734,37
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	19,27%	117.993.692,55	0,73%	4.492.539,03
8º I - Fundos de Ações	30,00%	7,12%	43.606.211,93	22,88%	140.123.135,45
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,02%	12.387.541,09	7,98%	48.855.574,70

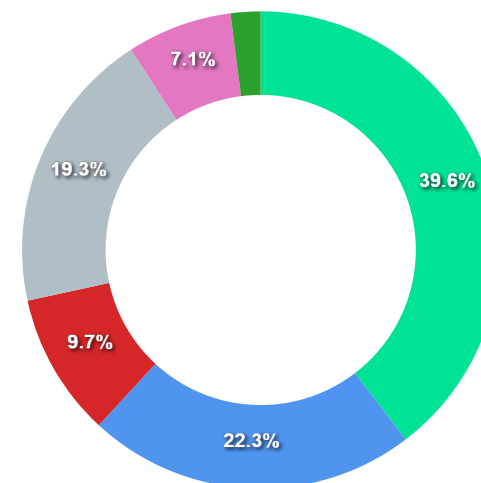
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos

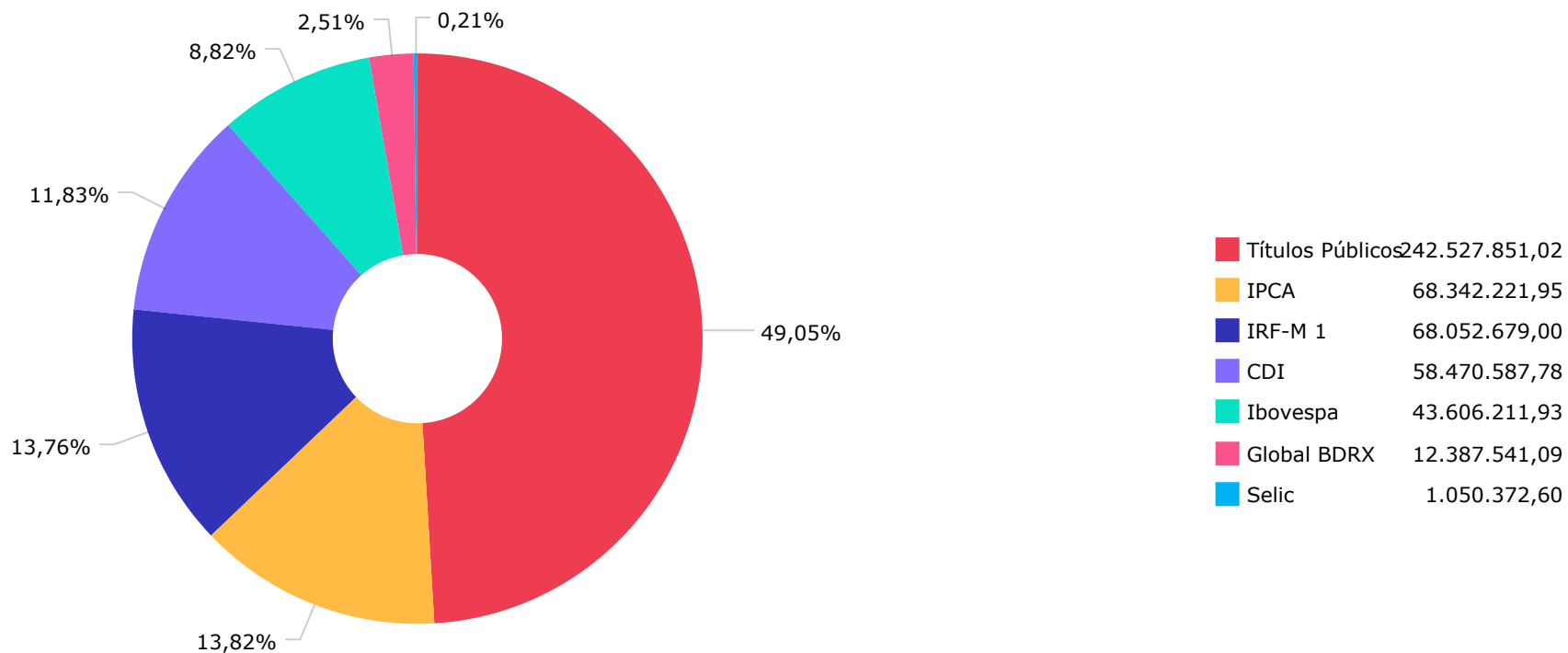


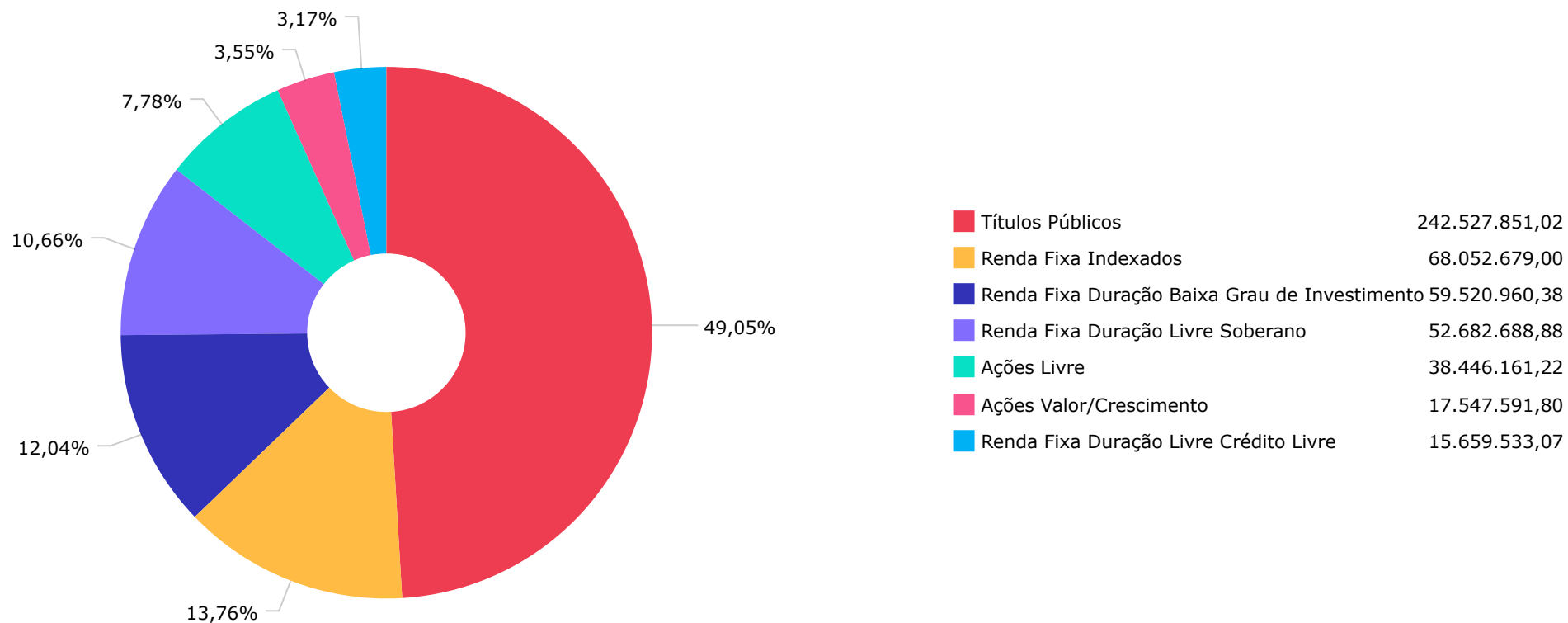
Artigos

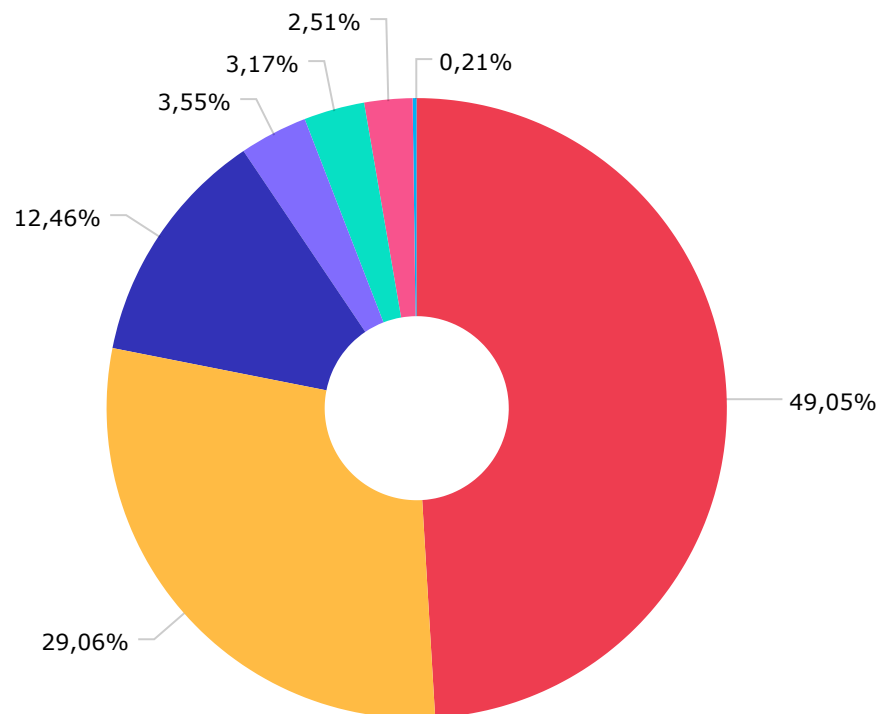


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	39,60%	0,00%	36,00%	100,00%	369.903.306,90	8º I - Fundos de Ações	7,12%	0,00%	6,00%	30,00%	140.123.135,45
7º I b - FI 100% Títulos TN	22,27%	0,00%	14,00%	100,00%	476.036.256,97	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	183.729.347,38
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	612.431.157,92	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	61.243.115,79
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.621.557,90	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	61.243.115,79
7º III a - FI Referenciados RF	9,72%	0,00%	15,00%	60,00%	307.937.734,37	9º III - Ações - BDR Nível I	2,02%	0,00%	2,00%	10,00%	48.855.574,70
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	367.458.694,75	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	61.243.115,79
7º IV - Ativos Financeiros de ...	19,27%	0,00%	14,00%	20,00%	4.492.539,03	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.621.557,90
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.621.557,90						
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.621.557,90						
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	30.621.557,90						

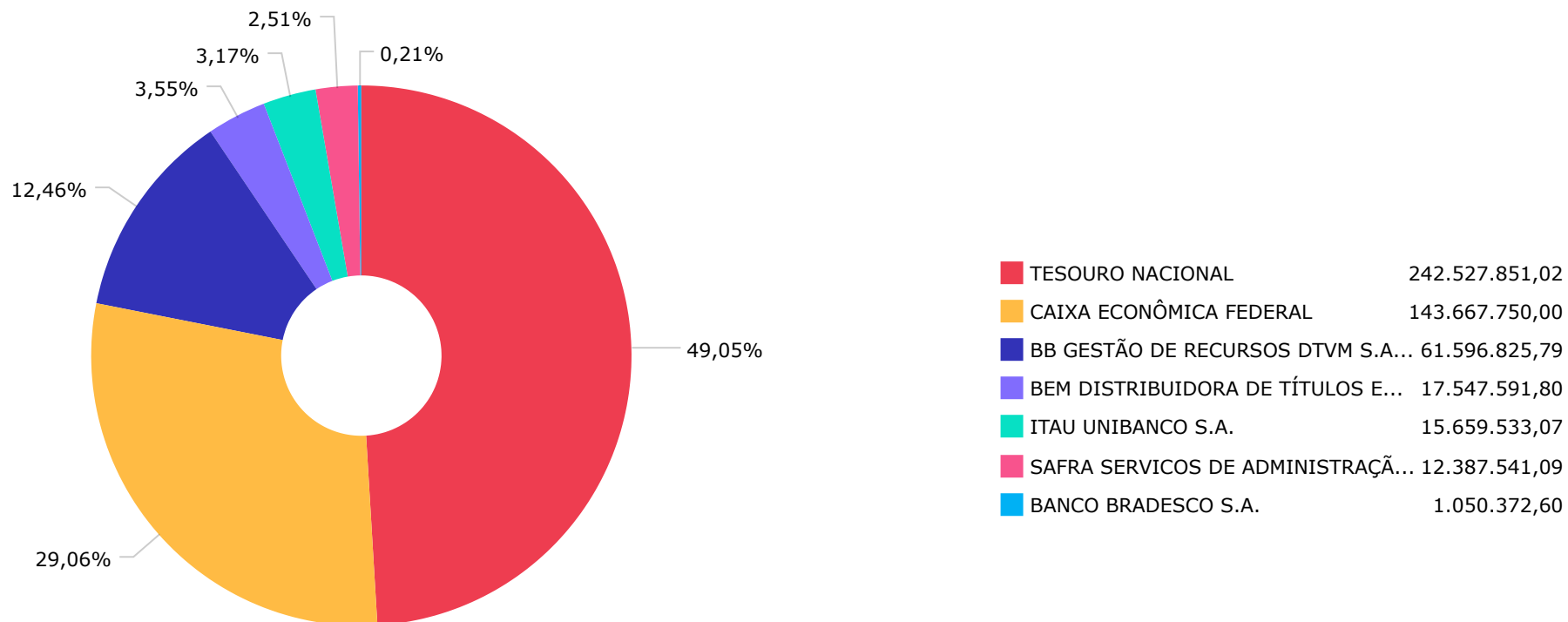
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,91	9,23	2,67	5,40	11,31	26,50	0,02	0,04
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	6,02	50,50	6,38	29,14	64,77	95,02		
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,65	36,28	5,76	24,42	48,41	62,50	6,97	14,68
IBOVESPA - BENCHMARK	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79		
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-0,86	-0,30	5,42	6,13	19,05	18,61	4,90	10,32
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-1,02	-8,59	0,36	1,75	7,22	1,69	4,43	9,33
IPCA - BENCHMARK	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75	7,45	2,42	4,63	9,66	24,36	0,25	0,54
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,82	5,04	2,17	3,63	9,50	19,98	0,44	0,92
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,86	5,49	2,07	3,96	8,29	21,29	0,41	0,86
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,83	7,99	2,40	4,77	10,00	24,59	0,14	0,30
SELIC - BENCHMARK	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87		
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93	9,68	2,75	5,56	11,80	27,41	0,02	0,05







TESOIRO NACIONAL	242.527.851,02
CAIXA DTVM	143.667.750,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	61.596.825,79
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	17.547.591,80
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	15.659.533,07
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	12.387.541,09
BANCO BRADESCO S.A.	1.050.372,60



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%	0,84%	7,11%	101,97%	0,63%
Outubro	605.964.108,85	6.270.146,33	3.732.718,07	612.431.157,92	3.929.620,81	44.477.891,13	0,65% ▲	7,94%	1,00%	8,18%	97,07%	0,52%

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%	2,07%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

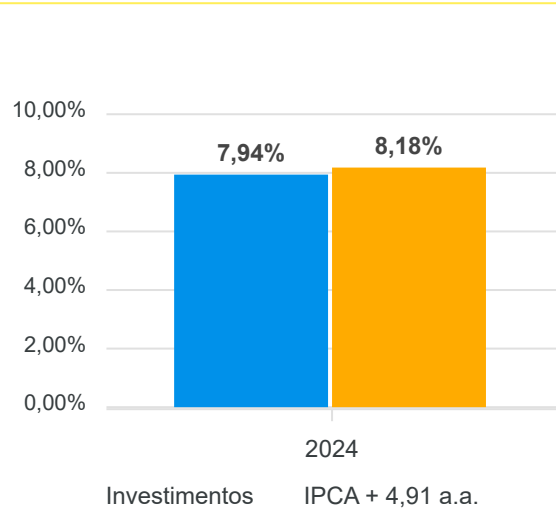


Gráfico Risco x Retorno

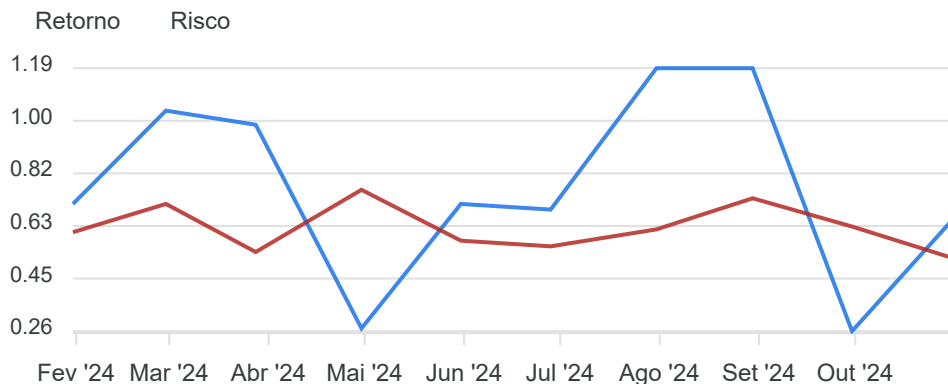
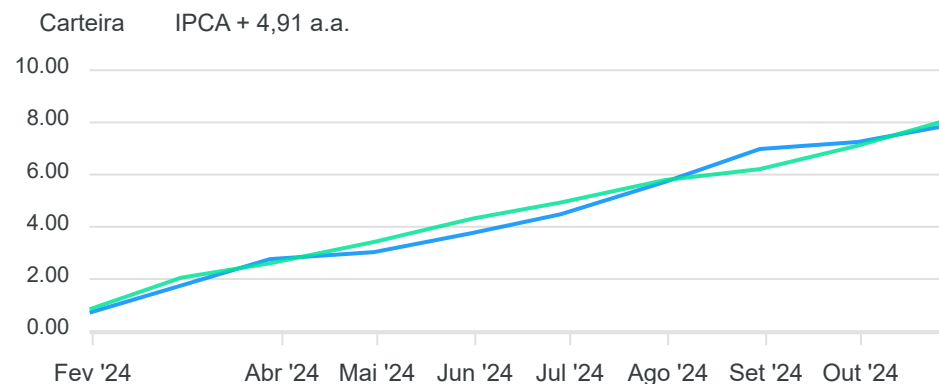
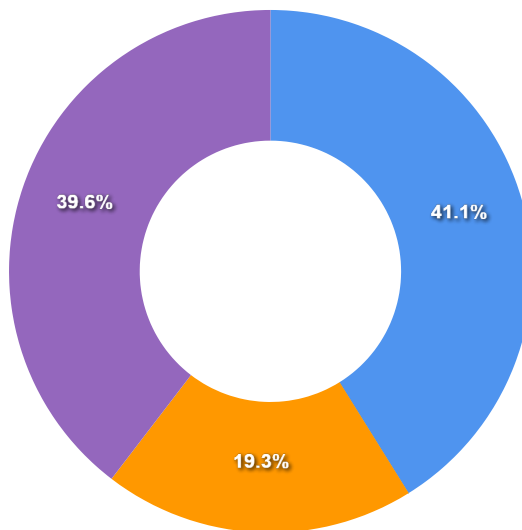


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	251.909.614,35	41,13
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	117.993.692,55	19,27
Acima D+3600	242.527.851,03	39,60
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	241.619.624,11	0,00	0,00	242.527.851,02	908.226,91	0,38% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.274.261,30	0,00	0,00	35.538.205,66	263.944,36	0,75% ▲	0,25%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.040.718,62	0,00	0,00	1.050.372,60	9.653,98	0,93% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	55.389.563,22	6.270.146,33	3.732.718,07	58.470.587,78	543.596,30	0,88% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.998.635,94	0,00	0,00	17.144.483,22	145.847,28	0,86% ▲	0,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	67.495.526,27	0,00	0,00	68.052.679,00	557.152,73	0,83% ▲	0,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.532.129,91	0,00	0,00	15.659.533,07	127.403,16	0,82% ▲	0,44%
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	27.247.954,40	0,00	0,00	27.525.442,59	277.488,19	1,02% ▲	-
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	28.484.221,47	0,00	0,00	28.796.609,72	312.388,25	1,10% ▲	-
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	38.757.334,02	0,00	0,00	39.180.557,03	423.223,01	1,09% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	22.261.900,29	0,00	0,00	22.491.083,21	229.182,92	1,03% ▲	-
	550.101.869,55	6.270.146,33	3.732.718,07	556.437.404,90	3.798.107,09	0,69%	0,08%

RENDÁ VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	26.325.909,67	0,00	0,00	26.058.620,13	-267.289,54	-1,02% ▼	4,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	17.699.622,54	0,00	0,00	17.547.591,80	-152.030,74	-0,86% ▼	4,90%
-	44.025.532,21	0,00	0,00	43.606.211,93	-419.320,28	-0,95%	4,62%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.836.707,09	0,00	0,00	12.387.541,09	550.834,00	4,65% ▲	6,97%
	11.836.707,09	0,00	0,00	12.387.541,09	550.834,00	4,65%	0,00%

