

2024

Relatório Mensal

Novembro

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	241.070.278,38	38,71%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.699.873,89	5,73%	5.659.641.883,51	0,63%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.235.858,83	2,77%	3.931.535.018,92	0,44%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	68.427.541,81	10,99%	8.183.068.409,51	0,84%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.751.168,48	2,53%	1.736.916.429,57	0,91%	7º I b
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.622.130,03	0,90%	15.384.948.340,63	0,04%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	64.079.375,44	10,29%	19.373.615.271,47	0,33%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	27.762.102,53	4,46%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	29.067.019,88	4,67%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	39.581.512,15	6,36%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	22.698.440,76	3,65%	0,00		7º IV
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	25.418.359,57	4,08%	1.002.275.983,06	2,54%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	16.737.752,64	2,69%	481.051.877,84	3,48%	8º I
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.543.888,52	2,18%	882.451.383,52	1,53%	9º III

Investimentos

 622.695.302,91

Disponibilidades Financeiras

 0,00

Total Carteira

 622.695.302,91

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	4.514,997448	22.574.987,24
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.347,221586	13.041.664,76
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.347,221586	8.694.443,17
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.434,461019	4.434.461,02
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.516,158255	12.067.174,86
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.593,849398	35.960.653,09
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	3.952,411981	4.640.131,67
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.446,147639	8.892.295,28
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.392,06975	36.568.372,74
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	19/09/2024	A mercado	5.000	3.952,411981	19.762.059,91
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.558,335691	209.683,44
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.611,113127	20.750.009,07
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.550,266775	22.751.333,88
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.372,693877	10.057.195,92
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7555%	154	4.620,691965	711.586,56
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2024	A mercado	5.000	3.990,845160	19.954.225,80

Investimentos

\$ 622.695.302,91

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 622.695.302,91

Governança (Pró Gestão)

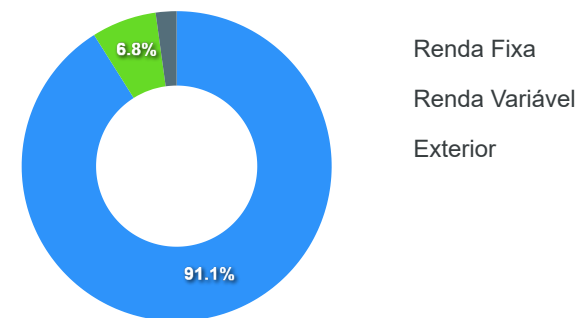


Artigos	Limite (%)		Utilizado		Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	38,71%	241.070.278,38	61,29%	381.625.024,53
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,02%	137.114.443,01	77,98%	485.580.859,90
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	11,19%	69.701.505,47	48,81%	303.915.676,28
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	19,13%	119.109.075,32	0,87%	5.429.985,26
8º I - Fundos de Ações	30,00%	6,77%	42.156.112,21	23,23%	144.652.478,66
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,18%	13.543.888,52	7,82%	48.725.641,77

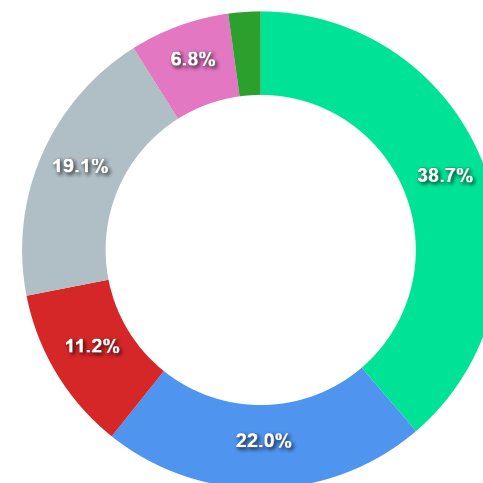
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos

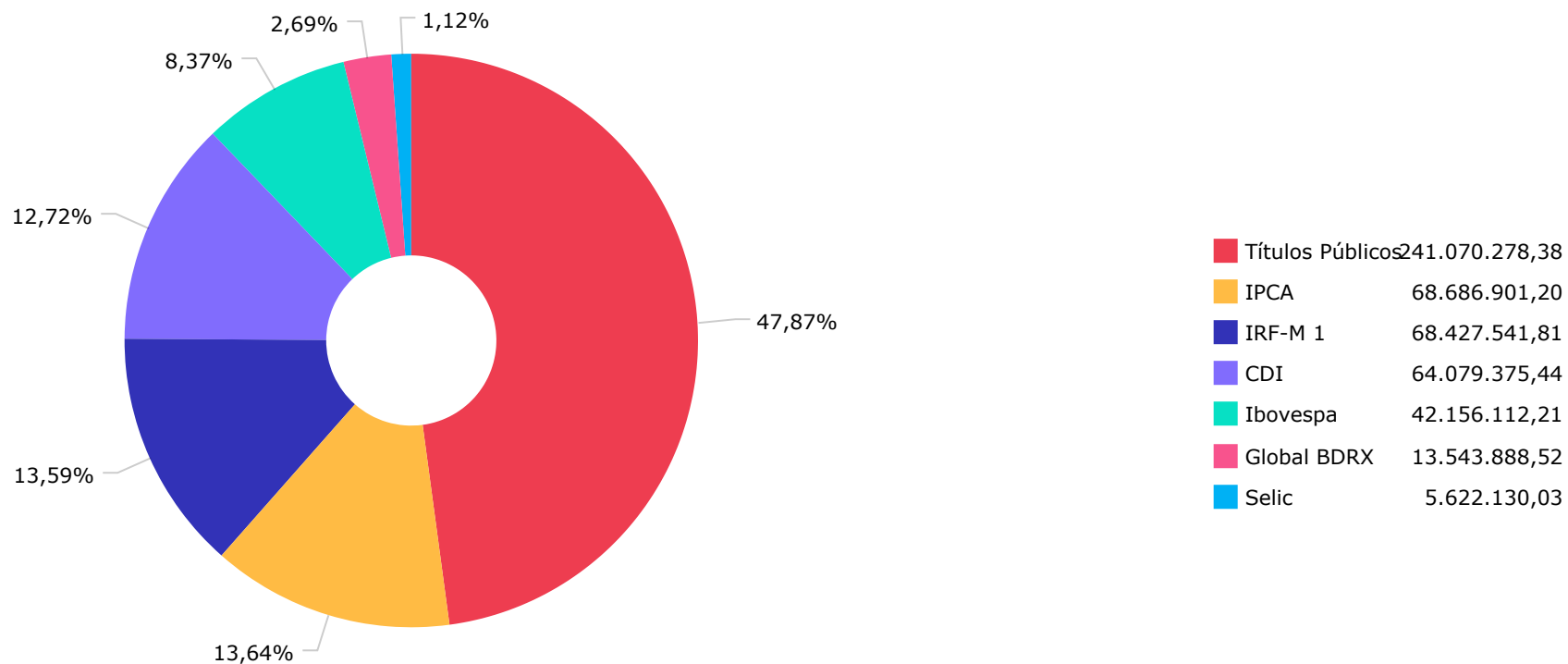


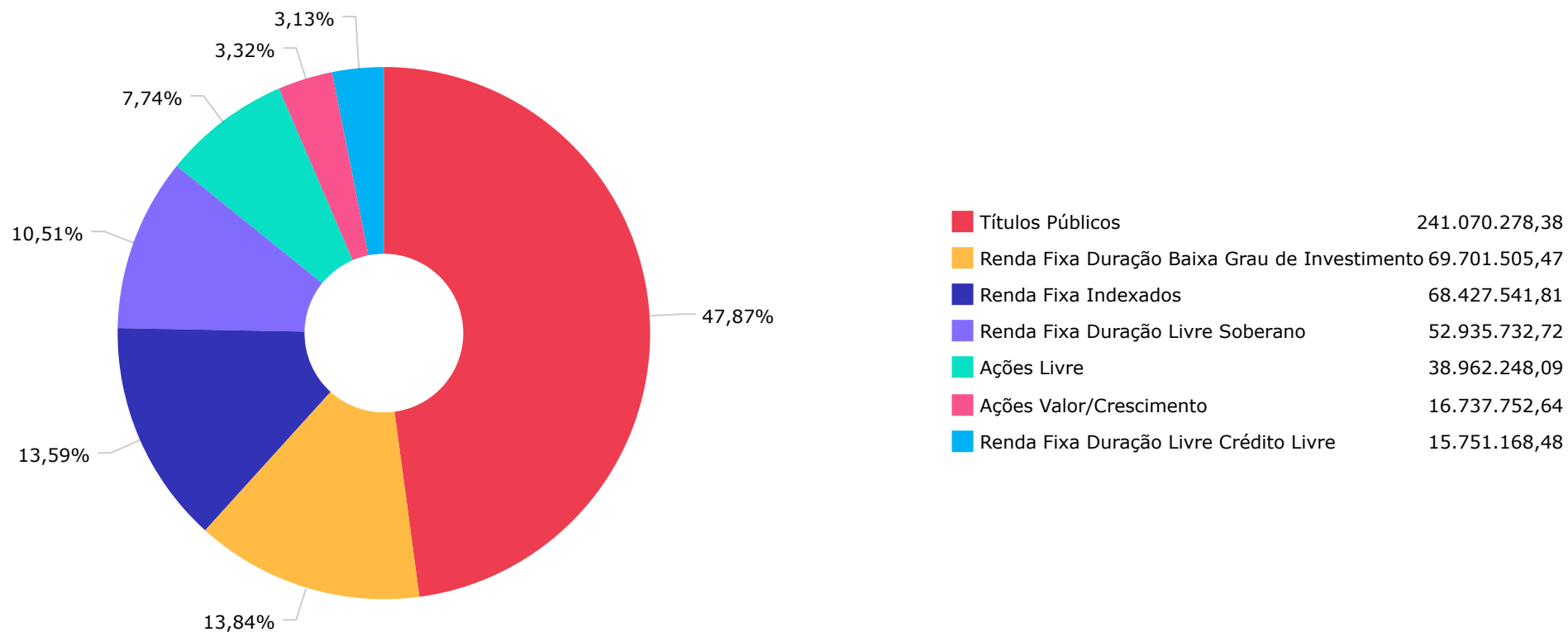
Artigos

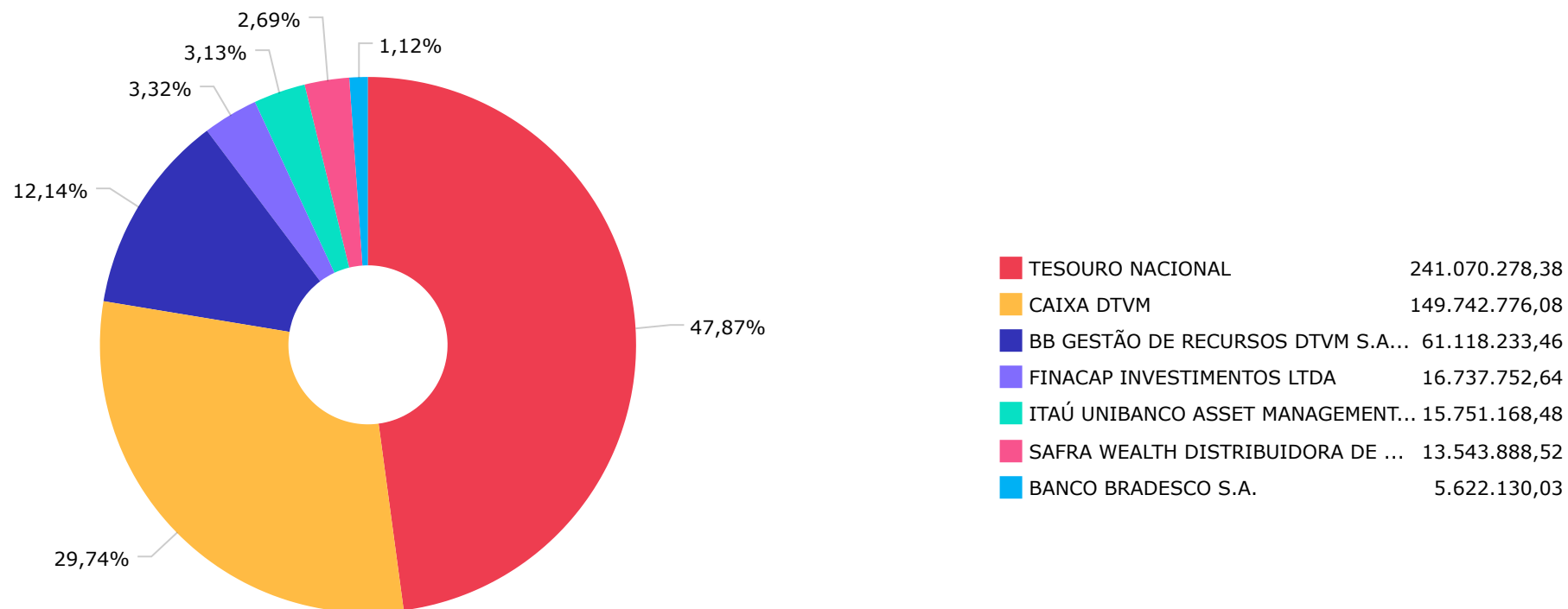


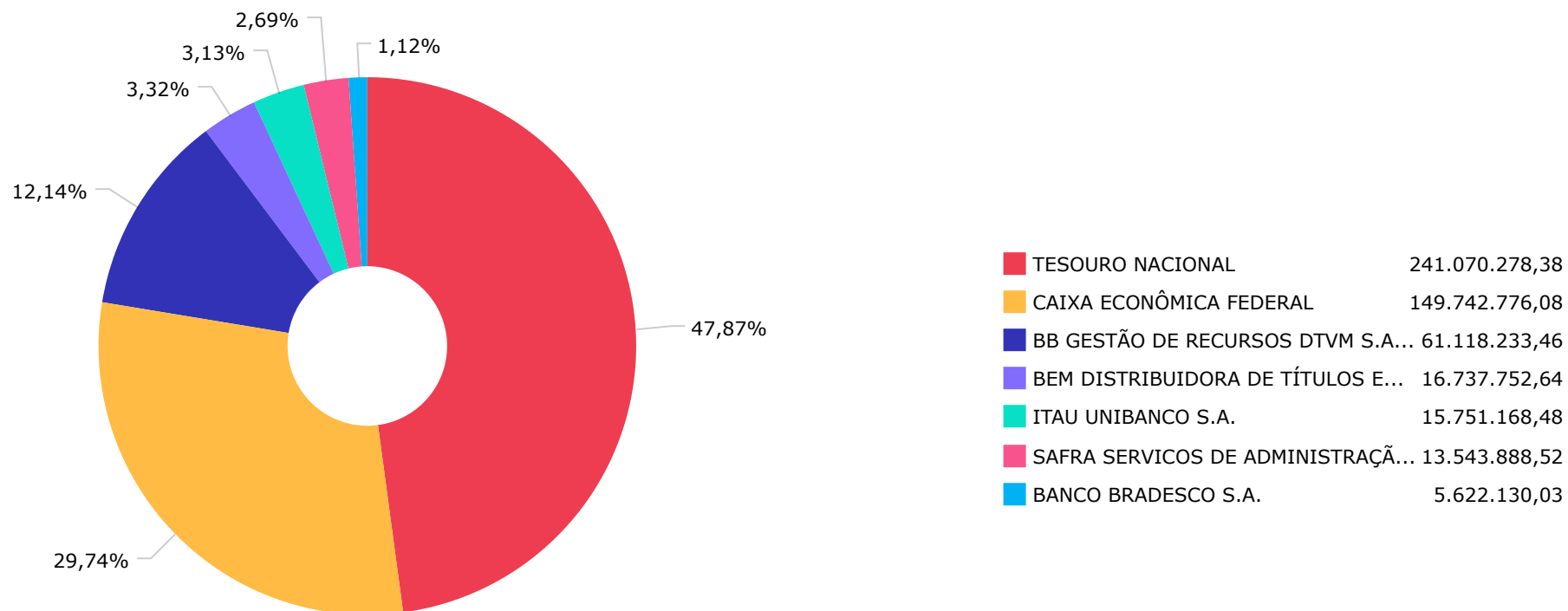
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	38,71%	0,00%	36,00%	100,00%	381.625.024,53	8º I - Fundos de Ações	6,77%	0,00%	6,00%	30,00%	144.652.478,66
7º I b - FI 100% Títulos TN	22,02%	0,00%	14,00%	100,00%	485.580.859,90	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	186.808.590,87
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	622.695.302,91	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	62.269.530,29
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	31.134.765,15	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	62.269.530,29
7º III a - FI Referenciados RF	11,19%	0,00%	15,00%	60,00%	303.915.676,28	9º III - Ações - BDR Nível I	2,18%	0,00%	2,00%	10,00%	48.725.641,77
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	373.617.181,75	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	62.269.530,29
7º IV - Ativos Financeiros de ...	19,13%	0,00%	14,00%	20,00%	5.429.985,26	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	31.134.765,15
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	31.134.765,15						
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	31.134.765,15						
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	31.134.765,15						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,81	10,12	2,60	5,37	11,13	26,22	0,01	0,03
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	8,32	63,02	14,60	30,35	67,66	97,27		
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,33	49,00	13,18	28,50	52,74	66,76	8,66	18,24
IBOVESPA - BENCHMARK	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72		
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-4,62	-4,90	-5,51	3,30	1,23	16,52	8,99	18,93
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,46	-10,83	-6,48	2,21	-6,18	3,33	6,10	12,84
IPCA - BENCHMARK	0,39	4,29	1,40	1,98	4,87	9,78		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45	7,94	1,92	4,35	8,96	25,07	0,43	0,91
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,59	5,65	2,05	3,47	7,35	21,94	0,50	1,06
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,53	6,05	1,93	3,78	7,33	21,83	0,52	1,10
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,57	8,70	2,25	4,67	9,69	24,55		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55	8,58	2,20	4,55	9,54	24,13	0,22	0,47
SELIC - BENCHMARK	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58		
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,81	10,56	2,64	5,49	11,60	27,09	0,01	0,03









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%
Novembro	612.431.157,92	13.457.159,24	6.705.384,57	622.695.302,91	3.512.370,32	47.990.261,45	0,57% ▲	8,56%	0,75%	8,99%	95,22%	0,76%

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

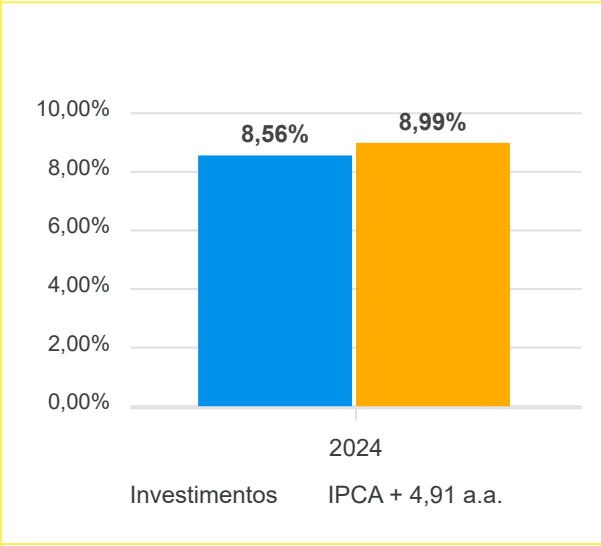


Gráfico Risco x Retorno

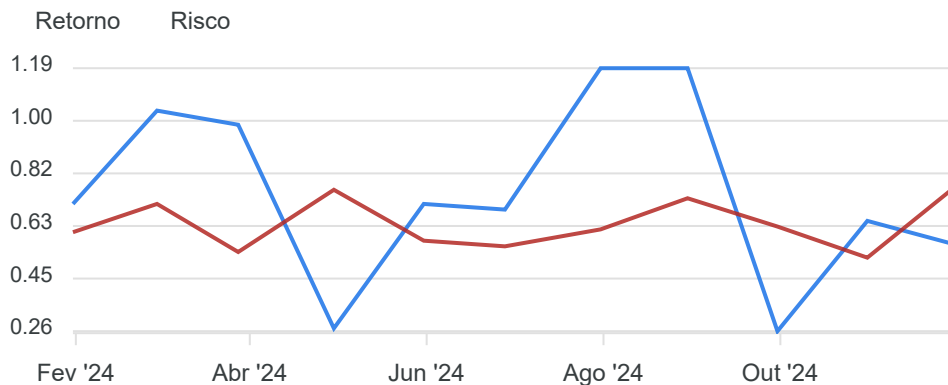
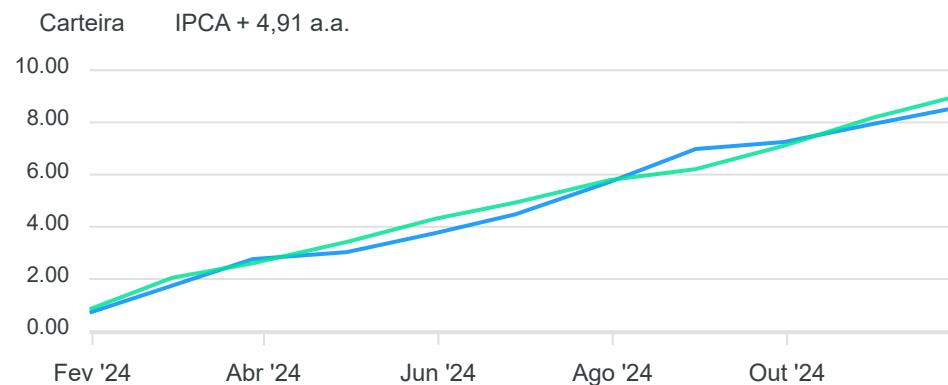
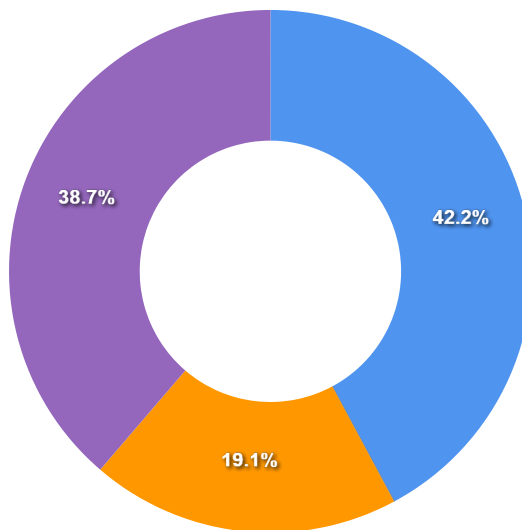


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/11/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	262.515.949,21	42,16
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	119.109.075,32	19,13
Acima D+3600	241.070.278,39	38,71
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	242.527.851,02	0,00	2.898.725,10	241.070.278,38	1.441.152,46	0,59% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.538.205,66	0,00	0,00	35.699.873,89	161.668,23	0,45% ▲	0,43%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.050.372,60	4.562.312,28	0,00	5.622.130,03	9.445,15	0,17% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	58.470.587,78	8.894.846,96	3.806.659,47	64.079.375,44	520.600,17	0,77% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.144.483,22	0,00	0,00	17.235.858,83	91.375,61	0,53% ▲	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	68.052.679,00	0,00	0,00	68.427.541,81	374.862,81	0,55% ▲	0,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.659.533,07	0,00	0,00	15.751.168,48	91.635,41	0,59% ▲	0,50%
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	27.525.442,59	0,00	0,00	27.762.102,53	236.659,94	0,86% ▲	-
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	28.796.609,72	0,00	0,00	29.067.019,88	270.410,16	0,94% ▲	-
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	39.180.557,03	0,00	0,00	39.581.512,15	400.955,12	1,02% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	22.491.083,21	0,00	0,00	22.698.440,76	207.357,55	0,92% ▲	-
	556.437.404,90	13.457.159,24	6.705.384,57	566.995.302,18	3.806.122,61	0,68%	0,11%

REDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	26.058.620,13	0,00	0,00	25.418.359,57	-640.260,56	-2,46% ▼	6,10%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	17.547.591,80	0,00	0,00	16.737.752,64	-809.839,16	-4,62% ▼	8,99%
-	43.606.211,93	0,00	0,00	42.156.112,21	-1.450.099,72	-3,33%	7,25%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.387.541,09	0,00	0,00	13.543.888,52	1.156.347,43	9,33% ▲	8,66%
	12.387.541,09	0,00	0,00	13.543.888,52	1.156.347,43	9,33%	0,00%

