

# 2024

## Relatório Mensal

### Janeiro

### 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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.252.743,45	1,68%	5.834.557.206,92	0,09%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.002.589,27	5,76%	5.251.127.483,30	0,34%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	587.281,30	0,19%	194.648.819,70	0,30%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.411.616,81	2,69%	2.636.302.220,38	0,32%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.231.440,40	1,67%	23.377.829,40	22,38%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.915.952,64	7,97%	3.636.582.212,27	0,69%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	36.643.632,49	11,72%	585.778.628,92	6,26%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.067.602,52	1,30%	5.245.527.378,78	0,08%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.312.836,89	2,66%	7.718.818.121,25	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.465.732,32	6,87%	5.008.664.499,36	0,43%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	316.743,39	0,10%	8.572.761.910,40	0,00%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.713.237,79	1,83%	546.130.755,56	1,05%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	50.110.743,11	16,03%	16.400.080.186,89	0,31%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.406.341,24	2,37%	547.345.879,54	1,35%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.394.248,03	3,33%	9.205.921.475,18	0,11%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	34.491.260,18	11,04%	15.073.540.268,85	0,23%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	22.044.707,78	7,05%	1.285.884.378,15	1,71%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.339.038,05	0,43%	1.226.260.171,90	0,11%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	985.306,73	0,32%	552.699.682,41	0,18%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.334.363,00	2,67%	747.907.484,79	1,11%	8º I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.899.448,09	3,49%	824.406.677,56	1,32%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.162.111,73	5,49%	543.007.397,32	3,16%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.333.732,64	1,39%	384.793.450,79	1,13%	8º I
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.315.817,78	0,42%	45.792.254,41	2,87%	8º I
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.539.749,70	1,13%	221.902.973,83	1,60%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	509.443,20	0,16%	485.677.409,40	0,10%	9º III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	141.731,84	0,05%	120.228.275,72	0,12%	9º III

## Investimentos

\$ 312.545.527,97

## Disponibilidades Financeiras

\$ 64.286,44

## Total Carteira

\$ 312.609.814,41

## Governança (Pró Gestão)



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	292.899,60	0,09%	2.108.221.544,73	0,01%	9º III
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	323.176,00	0,10%	183.517.800,00	0,18%	11º

## Investimentos

\$ 312.545.527,97

## Disponibilidades Financeiras

\$ 64.286,44

## Total Carteira

\$ 312.609.814,41

## Governança (Pró Gestão)

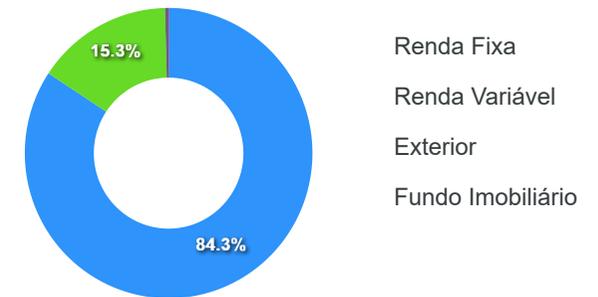


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	44,44%	138.921.409,27 55,56%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	39,81%	124.447.300,34 20,19%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	15,33%	47.909.567,72 14,67%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,30%	944.074,64 9,70%
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,10%	323.176,00 4,90%

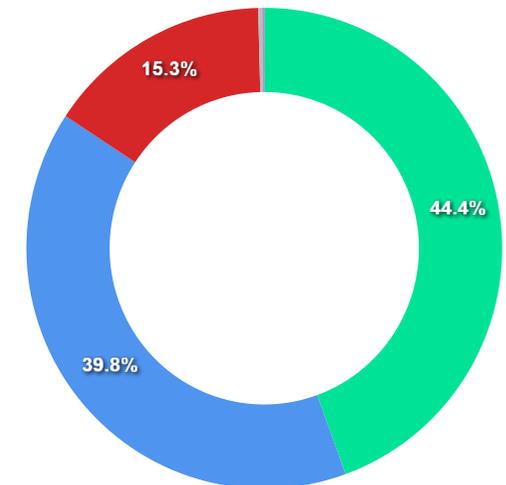
Governança (Pró Gestão)

Não possui

Segmentos



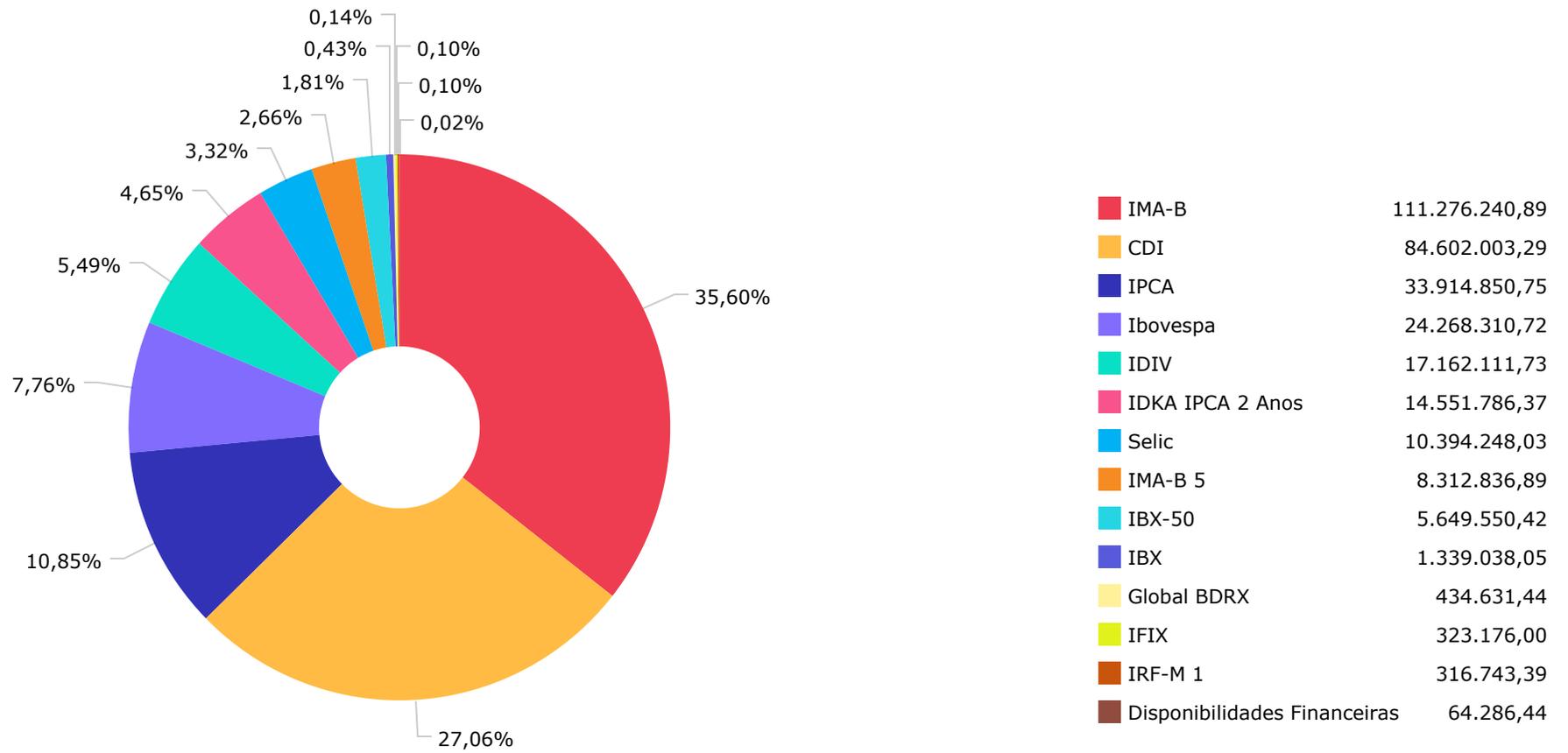
Artigos

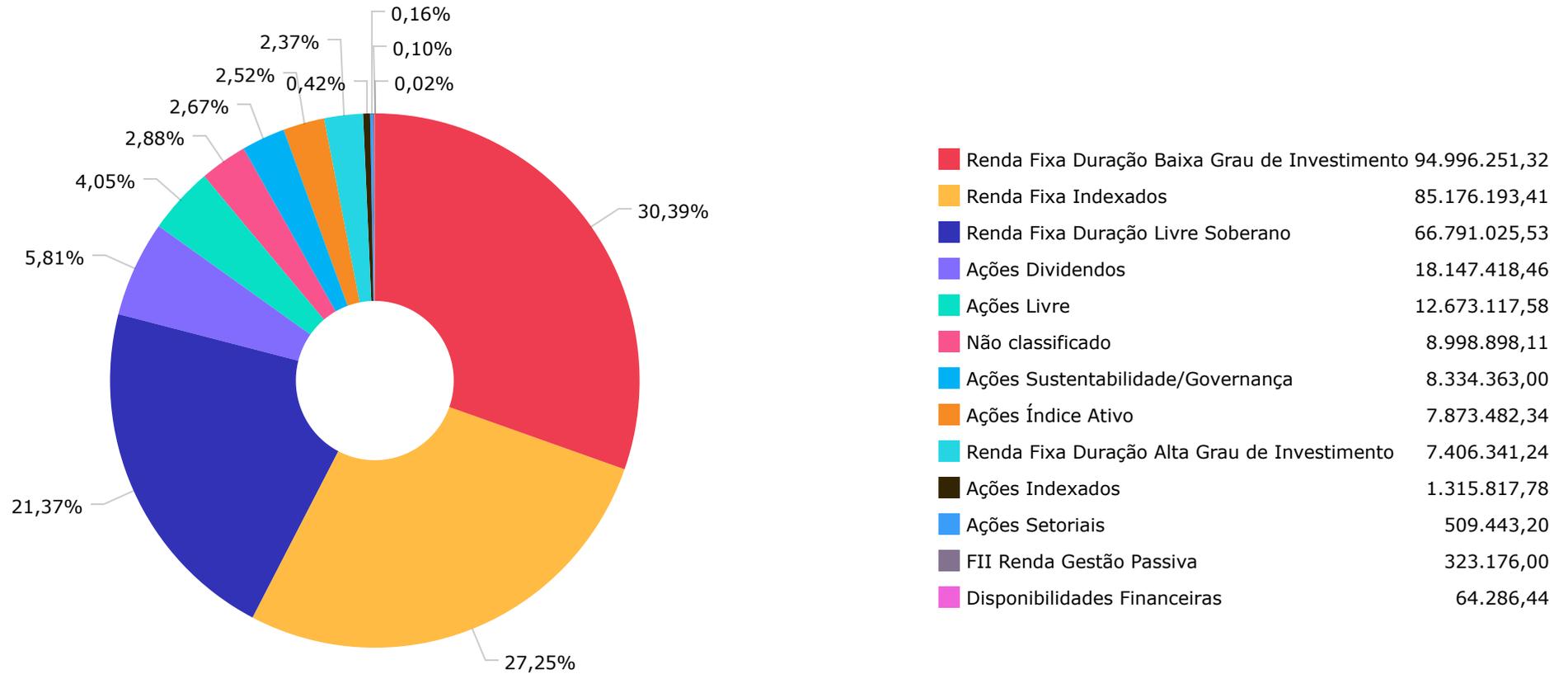


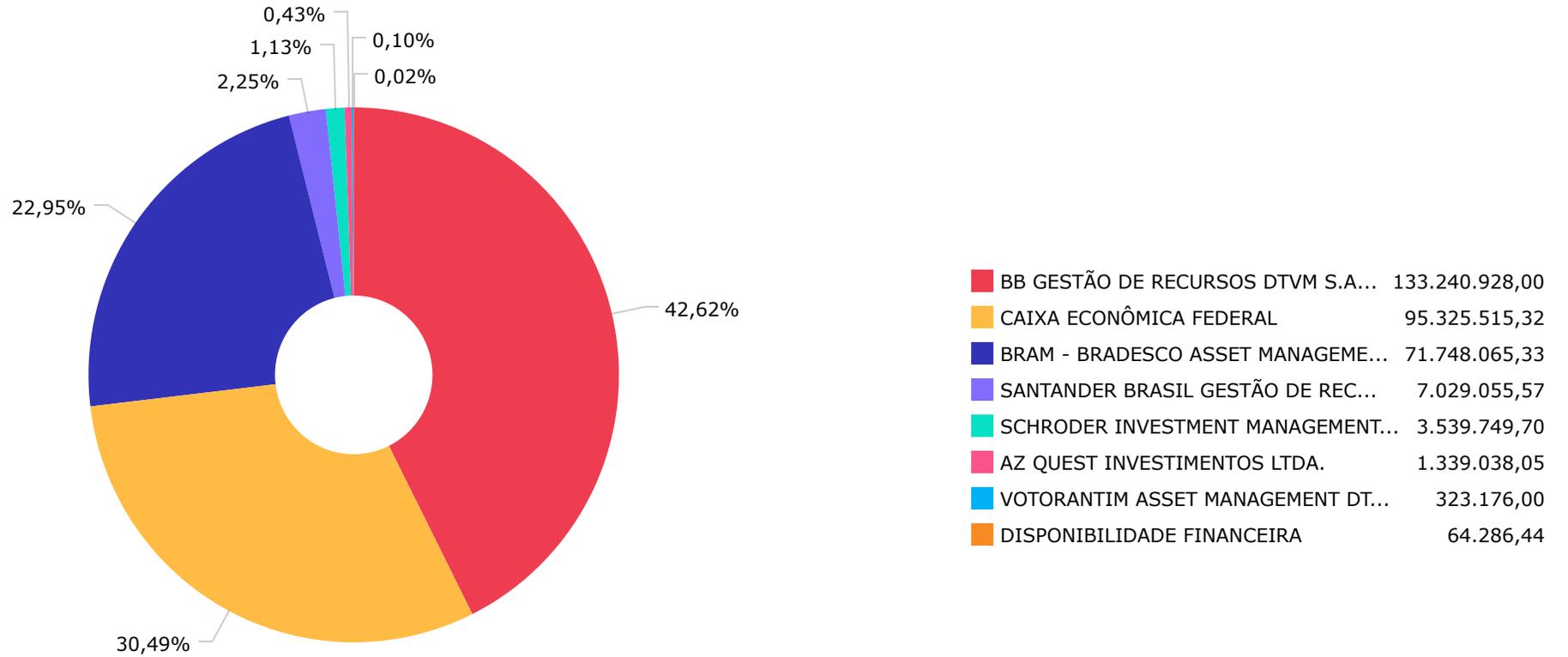
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	312.609.814,41	8° I - Fundos de Ações	15,33%	0,00%	18,00%	30,00%	45.873.376,60
7° I b - FI 100% Títulos TN	44,44%	0,00%	50,00%	100,00%	173.688.405,14	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	93.782.944,32
7° III a - FI Referenciados RF	39,81%	0,00%	25,00%	60,00%	63.118.588,31	9° III - Ações - BDR Nível I	0,30%	0,00%	2,00%	10,00%	30.316.906,80
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	62.521.962,88	11° - Fundos Imobiliários	0,10%	0,00%	1,00%	5,00%	15.307.314,72
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	15.630.490,72						

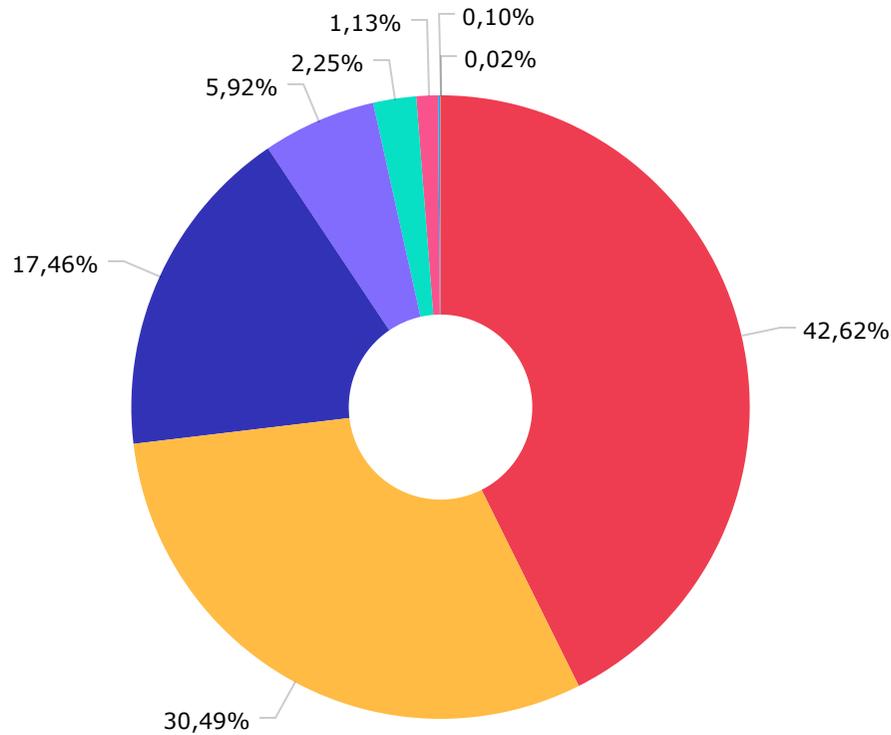
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>CDI - BENCHMARK</b>	<b>0,97</b>	<b>0,97</b>	<b>2,81</b>	<b>6,04</b>	<b>12,87</b>	<b>27,33</b>		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,00	1,00	2,92	6,34	13,22	27,95	0,01	0,02
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97	0,97	2,81	6,04	12,80	27,43	0,01	0,02
<b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>	<b>4,78</b>	<b>4,78</b>	<b>14,72</b>	<b>12,57</b>	<b>26,83</b>	<b>5,62</b>		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,56	4,56	14,15	11,69	25,21	3,42	5,69	11,99
BRASESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,72	3,72	12,95	11,12	17,75	-0,14	5,54	11,66
<b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>	<b>-4,79</b>	<b>-4,79</b>	<b>12,91</b>	<b>4,76</b>	<b>12,63</b>	<b>13,92</b>		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,80	3,80	18,95	15,19	40,84	15,82	7,33	15,44
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,73	-1,73	16,81	3,51	19,32	20,15	7,01	14,77
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-4,56	-4,56	12,95	4,14	10,74	10,15	5,69	11,97
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	-4,76	-4,76	12,42	3,30	10,73	14,04	5,78	12,17
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-5,18	-5,18	11,13	3,37	4,06	-1,34	6,01	12,65
<b>IBX - BENCHMARK</b>	<b>-4,51</b>	<b>-4,51</b>	<b>13,20</b>	<b>5,15</b>	<b>11,88</b>	<b>12,72</b>		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-3,07	-3,07	12,67	-2,06	8,87	-0,59	8,34	17,56
<b>IBX-50 - BENCHMARK</b>	<b>-4,15</b>	<b>-4,15</b>	<b>13,07</b>	<b>5,74</b>	<b>11,32</b>	<b>13,01</b>		
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	-4,25	-4,25	12,78	5,15	10,09	10,46	5,34	11,25
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-4,17	-4,17	12,72	3,54	7,84	7,15	5,38	11,32
<b>IDIV - BENCHMARK</b>	<b>-3,51</b>	<b>-3,51</b>	<b>14,18</b>	<b>8,88</b>	<b>15,58</b>	<b>28,28</b>		
BRASESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,56	-4,56	12,64	3,53	10,91	17,05	5,14	10,81
<b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>	<b>0,81</b>	<b>0,81</b>	<b>4,15</b>	<b>4,81</b>	<b>11,43</b>	<b>23,53</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94	0,94	2,73	5,87	12,54	28,95	0,00	0,00

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73	0,73	3,91	4,78	11,15	22,88	0,53	1,11
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71	0,71	3,96	4,60	10,93	23,00	0,57	1,19
<b>IMA-B - BENCHMARK</b>	<b>-0,45</b>	<b>-0,45</b>	<b>4,97</b>	<b>2,91</b>	<b>15,53</b>	<b>23,80</b>		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,49	-0,49	5,00	2,86	15,52	23,30	1,31	2,76
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,47	-0,47	4,92	2,84	15,36	23,40	1,27	2,67
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,46	-0,46	4,79	2,62	15,28	23,07	1,28	2,69
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,48	-0,48	4,90	2,77	15,26	23,19	1,28	2,69
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,48	-0,48	4,91	2,78	15,23	23,18	1,28	2,70
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,48	-0,48	4,89	2,74	15,18	23,00	1,27	2,68
<b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>	<b>0,68</b>	<b>0,68</b>	<b>3,99</b>	<b>4,44</b>	<b>11,33</b>	<b>23,79</b>		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66	0,66	3,94	4,34	11,18	23,49	0,55	1,15
<b>IPCA - BENCHMARK</b>	<b>0,42</b>	<b>0,42</b>	<b>1,27</b>	<b>2,01</b>	<b>4,51</b>	<b>10,54</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11	1,11	2,84	5,37	10,86	22,58	0,33	0,70
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10	1,10	2,83	5,35	10,83	23,83	0,33	0,70
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12	1,12	2,87	5,42			0,33	0,70
<b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>	<b>0,83</b>	<b>0,83</b>	<b>2,77</b>	<b>5,92</b>	<b>12,95</b>	<b>27,12</b>		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91	0,91	2,80	5,87	12,79	26,67	0,11	0,23
<b>SELIC - BENCHMARK</b>	<b>0,97</b>	<b>0,97</b>	<b>2,80</b>	<b>6,04</b>	<b>12,87</b>	<b>27,33</b>		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09	1,09	3,04	6,56	13,58	28,79	0,07	0,15
<b>IFIX - BENCHMARK</b>	<b>0,67</b>	<b>0,67</b>	<b>5,63</b>	<b>4,26</b>	<b>18,16</b>	<b>20,04</b>		
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	-1,01	-1,01	0,80	5,03	20,85	15,98	3,88	8,17



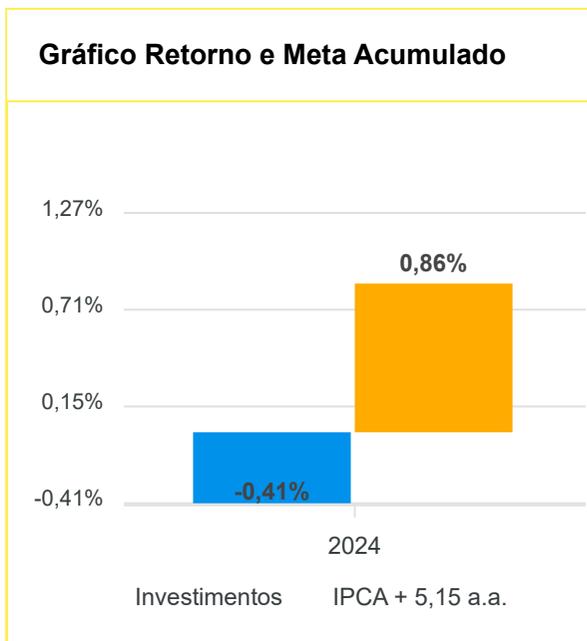






BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	133.240.928,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	95.325.515,32
BANCO BRADESCO S.A.	54.585.953,60
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	18.501.149,78
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	7.029.055,57
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	3.539.749,70
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT...	323.176,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	64.286,44

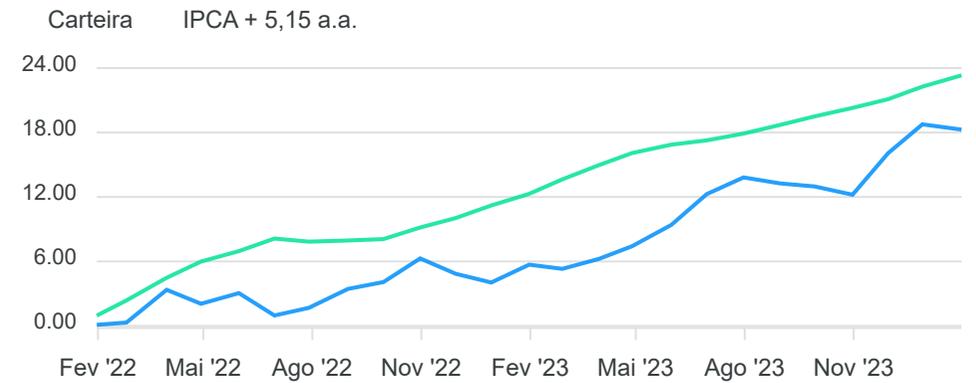
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	314.542.672,76	1.569.386,66	2.265.000,00	312.545.527,97	-1.301.531,45	-1.301.531,45	-0,41% ▼	-0,41%	0,86%	0,86%	-47,67%	1,42%



### Gráfico Risco x Retorno

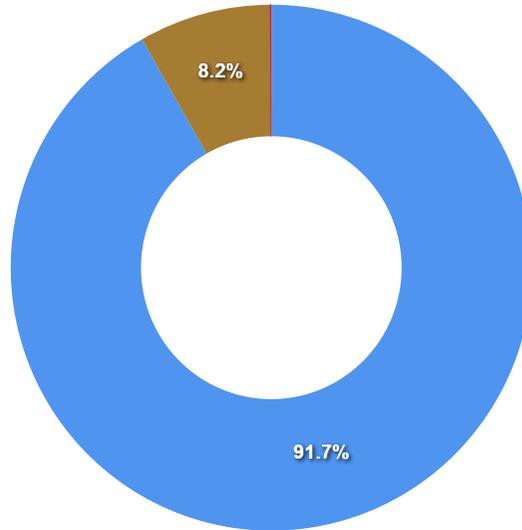


### Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



### Liquidez - 31/01/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	286.783.404,47	91,76
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	25.503.233,94	8,16
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	323.176,00	0,10



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.215.617,01	0,00	0,00	5.252.743,45	37.126,44	0,71% ▲	0,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.089.725,13	0,00	0,00	18.002.589,27	-87.135,86	-0,48% ▼	1,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	49.630.942,57	0,00	0,00	50.110.743,11	479.800,54	0,97% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	580.867,22	0,00	0,00	587.281,30	6.414,08	1,10% ▲	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.318.773,18	0,00	0,00	8.411.616,81	92.843,63	1,12% ▲	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.182.575,30	0,00	0,00	5.231.440,40	48.865,10	0,94% ▲	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.643.099,14	0,00	0,00	24.915.952,64	272.853,50	1,11% ▲	0,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.440.250,23	0,00	0,00	7.406.341,24	-33.908,99	-0,46% ▼	1,28%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	36.819.437,90	0,00	0,00	36.643.632,49	-175.805,41	-0,48% ▼	1,27%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.963.234,06	1.569.386,66	2.265.000,00	10.394.248,03	126.627,31	1,01% ▲	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	34.148.711,96	0,00	0,00	34.491.260,18	342.548,22	1,00% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.038.145,80	0,00	0,00	4.067.602,52	29.456,72	0,73% ▲	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.258.013,14	0,00	0,00	8.312.836,89	54.823,75	0,66% ▲	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.566.069,41	0,00	0,00	21.465.732,32	-100.337,09	-0,47% ▼	1,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	313.881,17	0,00	0,00	316.743,39	2.862,22	0,91% ▲	0,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	22.153.185,54	0,00	0,00	22.044.707,78	-108.477,76	-0,49% ▼	1,31%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.740.565,28	0,00	0,00	5.713.237,79	-27.327,49	-0,48% ▼	1,28%
	263.103.094,04	1.569.386,66	2.265.000,00	263.368.709,61	961.228,91	0,37%	0,63%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.381.428,48	0,00	0,00	1.339.038,05	-42.390,43	-3,07% ▼	8,34%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.002.693,95	0,00	0,00	985.306,73	-17.387,22	-1,73% ▼	7,01%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.732.475,90	0,00	0,00	8.334.363,00	-398.112,90	-4,56% ▼	5,69%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	11.494.850,56	0,00	0,00	10.899.448,09	-595.402,47	-5,18% ▼	6,01%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.981.247,16	0,00	0,00	17.162.111,73	-819.135,43	-4,56% ▼	5,14%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.522.143,22	0,00	0,00	4.333.732,64	-188.410,58	-4,17% ▼	5,38%
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.374.178,41	0,00	0,00	1.315.817,78	-58.360,63	-4,25% ▼	5,34%
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.716.511,63	0,00	0,00	3.539.749,70	-176.761,93	-4,76% ▼	5,78%
-	50.205.529,31	0,00	0,00	47.909.567,72	-2.295.961,59	-4,57%	5,64%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	326.480,00	0,00	0,00	323.176,00	-3.304,00	-1,01% ▼	3,88%
-	326.480,00	0,00	0,00	323.176,00	-3.304,00	-1,01%	3,88%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	490.800,78	0,00	0,00	509.443,20	18.642,42	3,80% ▲	7,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	136.645,03	0,00	0,00	141.731,84	5.086,81	3,72% ▲	5,54%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	280.123,60	0,00	0,00	292.899,60	12.776,00	4,56% ▲	5,69%
	907.569,41	0,00	0,00	944.074,64	36.505,23	4,02%	4,79%

