

2024

Relatório Mensal

Julho

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	5.419.068,17	1,66%	5.421.914.339,44	0,10%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.088.257,66	0,33%	4.446.980.761,25	0,02%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	602.120,38	0,18%	199.567.512,84	0,30%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.490.443,79	8,71%	3.539.594.658,05	0,80%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.492.952,66	1,68%	24.546.453,83	22,38%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.577.375,51	7,82%	3.733.119.507,19	0,69%	7º I b
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.802.724,35	1,47%	498.541.358,61	0,96%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.187.674,46	1,28%	4.447.571.914,17	0,09%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.922.190,88	1,81%	7.242.310.243,82	0,08%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	990.659,43	0,30%	3.987.797.714,56	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.867.470,17	6,38%	7.874.458.233,45	0,27%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.786.954,91	1,77%	464.449.639,14	1,25%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	51.825.838,94	15,85%	17.211.240.215,08	0,30%	7º III a
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	436.541,27	0,13%	455.042.606,71	0,10%	7º III a
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	54.691.809,36	16,73%	12.128.254.135,40	0,45%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	58.817.032,55	17,99%	16.238.092.008,01	0,36%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.091.874,07	0,95%	1.089.610.352,93	0,28%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.378.991,54	0,42%	1.214.131.364,09	0,11%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	961.978,84	0,29%	773.992.391,10	0,12%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.356.465,84	2,56%	665.592.711,60	1,26%	8º I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.378.912,79	3,17%	711.686.146,83	1,46%	8º I
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.134.633,28	5,24%	503.648.827,54	3,40%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.346.756,81	1,33%	367.016.709,04	1,18%	8º I
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.320.058,80	0,40%	41.294.656,41	3,20%	8º I
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.469.787,21	1,06%	207.791.166,36	1,67%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	615.775,46	0,19%	661.751.650,50	0,09%	9º III
BRADERCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	184.547,71	0,06%	192.426.703,53	0,10%	9º III

Investimentos

\$ 326.952.300,67

Disponibilidades Financeiras

\$ 598.118,79

Total Carteira

\$ 327.550.419,46

Governança (Pró Gestão)
[!\[\]\(6a9b39b98eb945faa14c645ec99e4eaa_img.jpg\)](#)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	392.803,83	0,12%	2.714.087.550,41	0,01%	9º III
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	320.600,00	0,10%	182.055.000,00	0,18%	11º

Investimentos

 326.952.300,67

Disponibilidades Financeiras

 598.118,79

Total Carteira

 327.550.419,46

Governança (Pró Gestão)

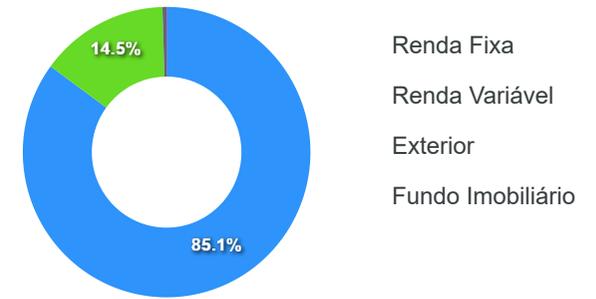


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	33,35% 109.227.892,37	66,65% 218.322.527,09
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	51,55% 168.863.096,19	8,45% 27.667.155,49
8º I - Fundos de Ações	30,00%	14,46% 47.347.585,11	15,54% 50.917.540,73
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,36% 1.193.127,00	9,64% 31.561.914,95
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,10% 320.600,00	4,90% 16.056.920,97

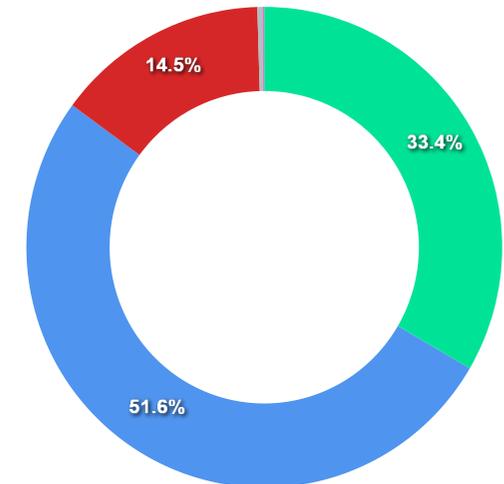
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



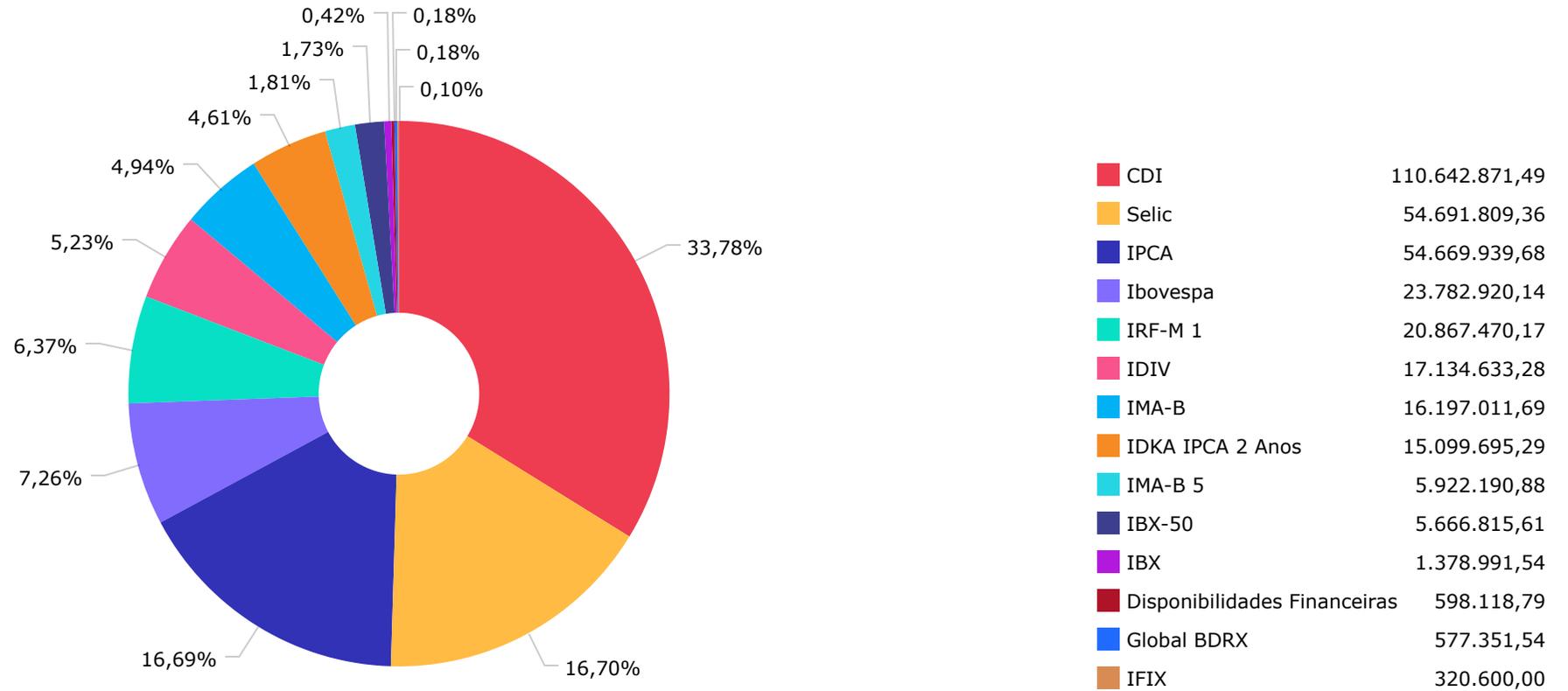
Artigos

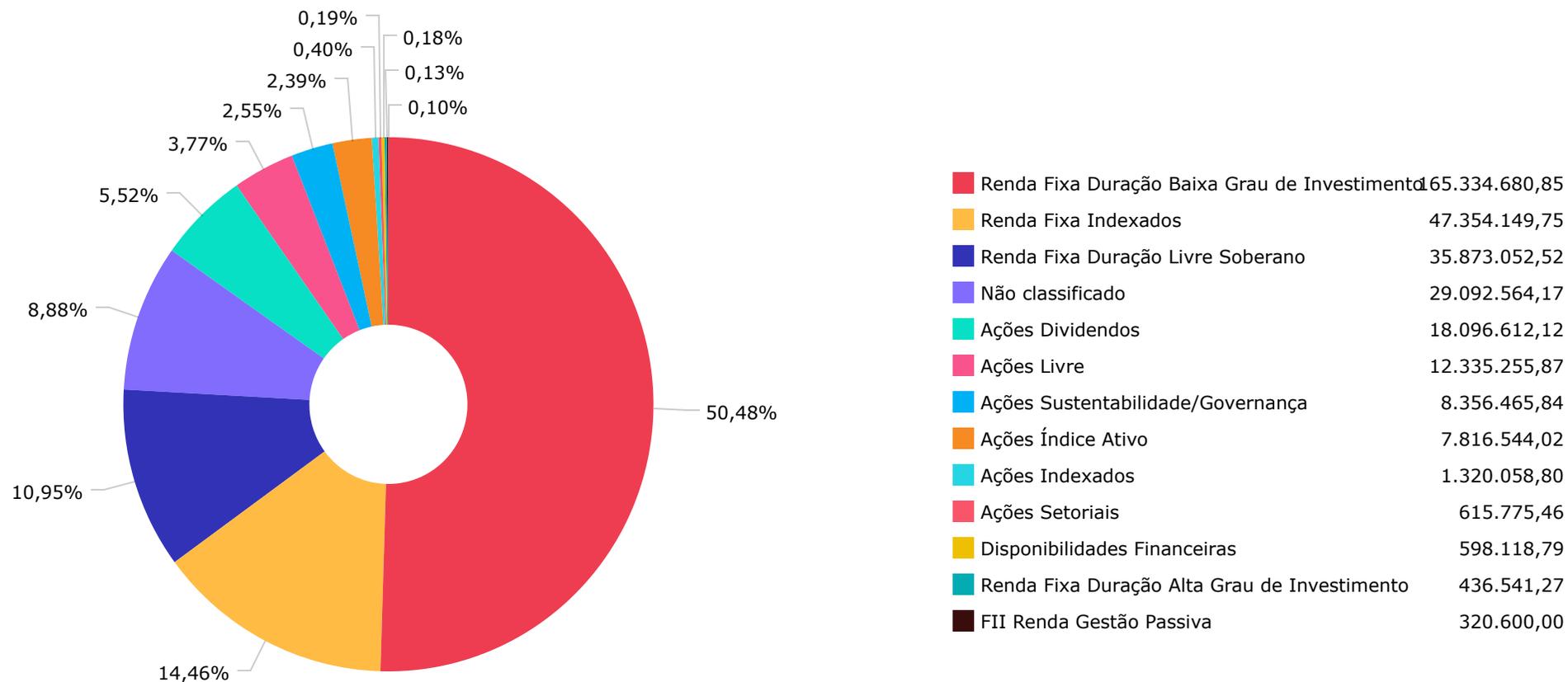


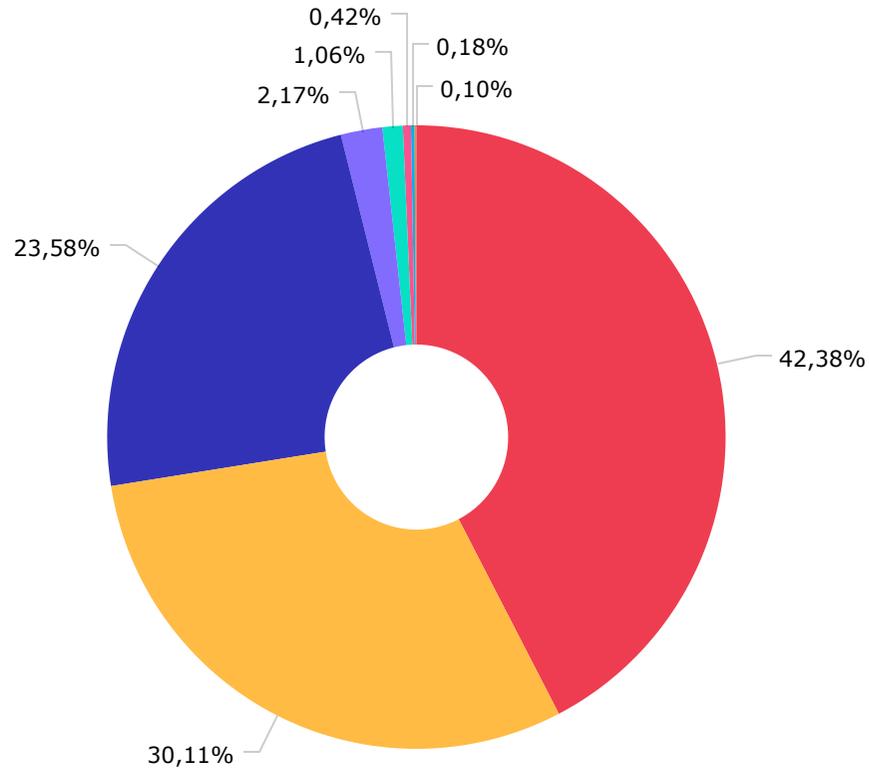
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	327.550.419,46	8° I - Fundos de Ações	14,46%	0,00%	18,00%	30,00%	50.917.540,73
7° I b - FI 100% Títulos TN	33,35%	0,00%	50,00%	100,00%	218.322.527,09	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	98.265.125,84
7° III a - FI Referenciados RF	51,55%	0,00%	25,00%	60,00%	27.667.155,49	9° III - Ações - BDR Nível I	0,36%	0,00%	2,00%	10,00%	31.561.914,95
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	65.510.083,89	11° - Fundos Imobiliários	0,10%	0,00%	1,00%	5,00%	16.056.920,97
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	16.377.520,97						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,97	6,39	2,65	5,33	12,00	27,35	0,03	0,06
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97	6,26	2,62	5,25	11,61	26,75	0,04	0,08
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,29	41,47	21,39	35,02	51,99	65,02		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,51	40,23	20,99	34,11	49,78	60,78	10,12	21,31
BRAPRESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,93	35,06	20,13	30,21	44,68	46,91	7,71	16,23
IBOVESPA - BENCHMARK	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,75	25,46	11,51	20,87	39,24	67,67	11,29	23,77
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2,84	-4,31	1,40	0,27	4,42	21,09	4,74	9,99
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	4,77	-6,64	1,47	-1,98	1,26	18,97	4,97	10,46
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,90	-4,06	0,14	-2,37	1,06	25,89	6,65	14,00
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	3,36	-9,71	1,35	-4,78	-1,57	4,69	4,74	9,98
IBX - BENCHMARK	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,73	-0,18	2,58	2,98	0,86	15,02	5,31	11,18
IBX-50 - BENCHMARK	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69		
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	2,98	-3,94	1,27	0,32	5,49	21,58	4,62	9,72
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3,79	-3,88	1,72	0,30	3,86	19,24	4,45	9,38
IDIV - BENCHMARK	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85		
BRAPRESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,52	-4,71	1,54	-0,16	3,36	19,72	4,90	10,32
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88	5,99	2,47	5,00	11,17	26,01	0,00	0,00

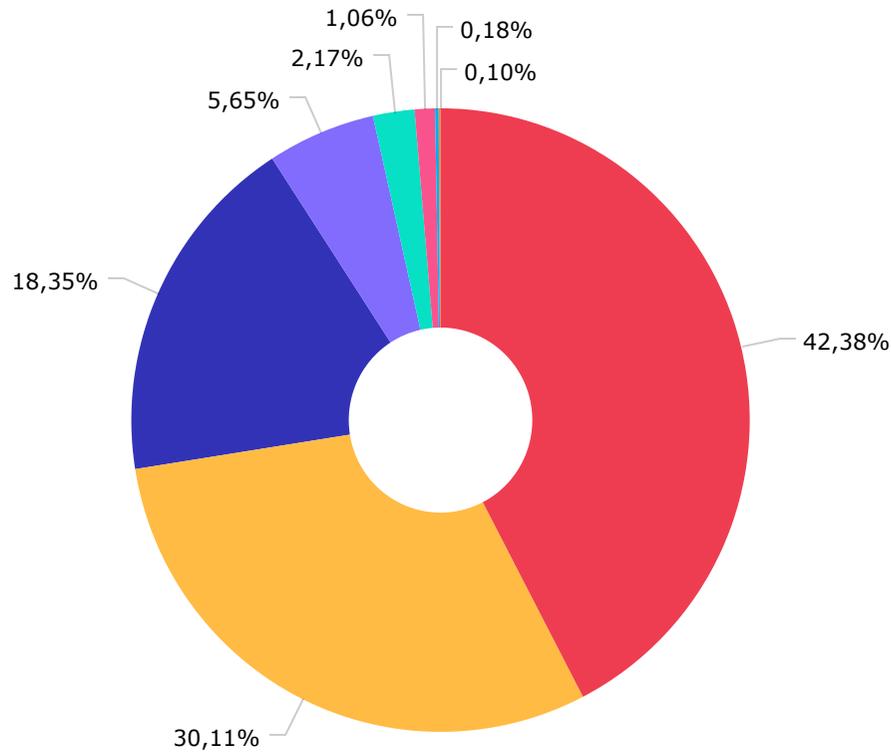
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76	3,90	2,08	3,17	7,92	19,47	0,94	1,98
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73	3,70	1,96	2,95	7,87	19,26	1,03	2,17
IMA-B - BENCHMARK	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,07	0,82	2,37	1,30	4,17	20,10	2,12	4,47
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,08	0,75	2,29	1,25	4,14	19,96	2,25	4,73
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,07	0,82	2,39	1,31	4,13	19,89	2,11	4,45
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,07	0,81	2,38	1,29	4,10	19,90	2,12	4,46
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,06	0,77	2,36	1,26	4,04	19,75	2,12	4,46
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,06	0,65	2,29	1,11	3,75	19,67	2,17	4,58
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89	4,13	2,31	3,45	7,93	20,02	0,84	1,76
IPCA - BENCHMARK	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98	6,82	3,07	5,64	11,37		0,25	0,54
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98	6,76	3,05	5,59	11,26	22,27	0,25	0,54
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96	6,72	3,03	5,55	11,20	22,17	0,25	0,52
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93	5,46	2,31	4,50	10,64	25,71	0,28	0,60
SELIC - BENCHMARK	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,00	6,74	2,74	5,59	12,51	28,26	0,05	0,11
IFIX - BENCHMARK	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57		
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	4,77	-1,80	2,42	-0,80	4,20	15,69	5,67	11,93







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	138.809.190,04
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	98.616.462,20
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	77.250.255,97
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	7.107.013,71
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.469.787,21
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.378.991,54
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	598.118,79
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT...	320.600,00



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	138.809.190,04
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	98.616.462,20
BANCO BRADESCO S.A.	60.115.622,69
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	18.513.624,82
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	7.107.013,71
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	3.469.787,21
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	598.118,79
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT...	320.600,00

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%
Fevereiro	312.545.527,97	3.948.924,16	3.130.947,83	315.760.870,89	2.397.366,59	1.095.835,14	0,77% ▲	0,35%	1,21%	2,08%	16,83%	1,42%
Março	315.760.870,89	2.913.771,29	2.090.000,00	317.650.198,95	1.065.556,77	2.161.391,91	0,34% ▲	0,69%	0,56%	2,66%	25,94%	1,24%
Abril	317.650.198,95	73.372.078,00	74.210.000,00	315.978.306,68	-833.970,27	1.327.421,64	-0,26% ▼	0,42%	0,82%	3,50%	12,00%	1,30%
Mai	315.978.306,68	3.455.461,68	2.020.000,00	318.369.437,46	955.669,10	2.283.090,74	0,30% ▲	0,72%	0,88%	4,41%	16,33%	1,06%
Junho	318.369.437,46	33.378.681,69	32.240.000,00	322.226.916,53	2.718.797,38	5.001.888,12	0,85% ▲	1,58%	0,61%	5,05%	31,29%	1,11%
Julho	322.226.916,53	3.524.608,46	3.240.000,00	326.952.300,67	4.440.775,68	9.442.663,80	1,38% ▲	2,98%	0,84%	5,93%	50,25%	0,97%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	2.161.391,91	0,69%	2,66%
2º Trim	2.840.496,21	0,89%	2,33%
1º Sem	5.001.888,12	1,58%	5,05%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

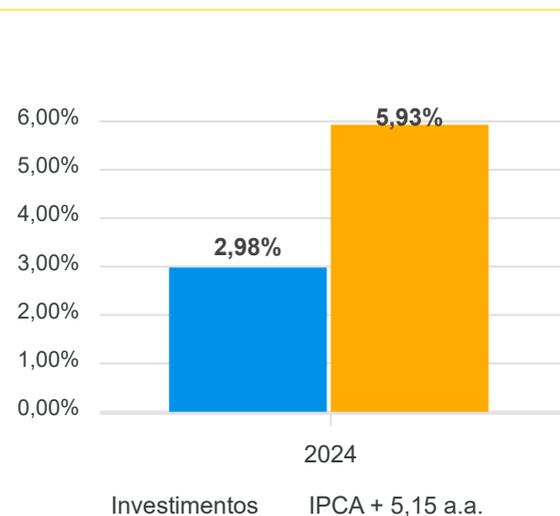


Gráfico Risco x Retorno

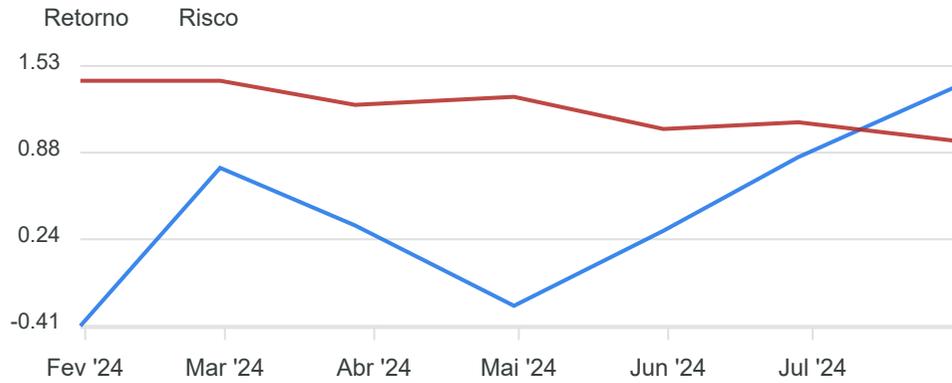
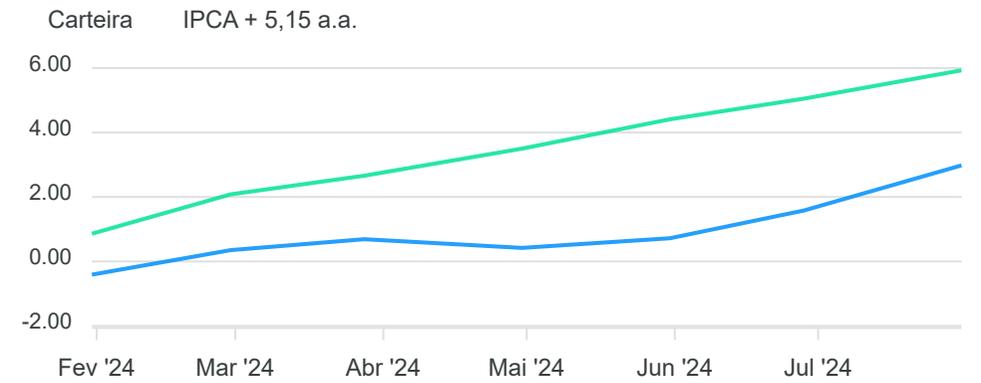
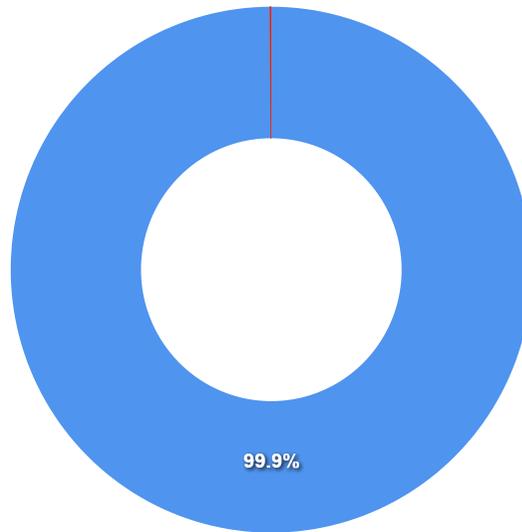


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/07/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	327.229.819,46	100,08
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	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	320.600,00	0,10



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.378.001,01	0,00	0,00	5.419.068,17	41.067,16	0,76% ▲	0,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.066.142,30	0,00	0,00	1.088.257,66	22.115,36	2,07% ▲	2,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	51.326.831,16	0,00	0,00	51.825.838,94	499.007,78	0,97% ▲	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	596.395,27	0,00	0,00	602.120,38	5.725,11	0,96% ▲	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.212.724,59	0,00	0,00	28.490.443,79	277.719,20	0,98% ▲	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.445.218,35	0,00	0,00	5.492.952,66	47.734,31	0,88% ▲	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.330.343,00	0,00	0,00	25.577.375,51	247.032,51	0,98% ▲	0,25%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	427.743,28	0,00	0,00	436.541,27	8.797,99	2,06% ▲	2,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.705.659,69	0,00	0,00	4.802.724,35	97.064,66	2,06% ▲	2,12%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	51.904.040,21	2.260.000,00	0,00	54.691.809,36	527.769,15	0,97% ▲	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	56.991.993,33	1.264.608,46	0,00	58.817.032,55	560.430,76	0,96% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.157.486,97	0,00	0,00	4.187.674,46	30.187,49	0,73% ▲	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.523.126,40	0,00	2.670.000,00	5.922.190,88	69.064,48	0,81% ▲	0,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.539.567,40	0,00	570.000,00	990.659,43	21.092,03	1,37% ▲	2,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.675.454,46	0,00	0,00	20.867.470,17	192.015,71	0,93% ▲	0,28%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.028.881,20	0,00	0,00	3.091.874,07	62.992,87	2,08% ▲	2,25%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.669.601,25	0,00	0,00	5.786.954,91	117.353,66	2,07% ▲	2,12%
	274.979.209,87	3.524.608,46	3.240.000,00	278.090.988,56	2.827.170,23	1,03%	0,27%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.304.315,71	0,00	0,00	1.378.991,54	74.675,83	5,73% ▲	5,31%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	944.070,52	0,00	0,00	961.978,84	17.908,32	1,90% ▲	6,65%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.126.034,76	0,00	0,00	8.356.465,84	230.431,08	2,84% ▲	4,74%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.041.204,17	0,00	0,00	10.378.912,79	337.708,62	3,36% ▲	4,74%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	16.551.961,68	0,00	0,00	17.134.633,28	582.671,60	3,52% ▲	4,90%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.188.078,41	0,00	0,00	4.346.756,81	158.678,40	3,79% ▲	4,45%
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.281.803,67	0,00	0,00	1.320.058,80	38.255,13	2,98% ▲	4,62%
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.311.936,64	0,00	0,00	3.469.787,21	157.850,57	4,77% ▲	4,97%
-	45.749.405,56	0,00	0,00	47.347.585,11	1.598.179,55	3,49%	4,84%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	306.012,00	0,00	0,00	320.600,00	14.588,00	4,77% ▲	5,67%
-	306.012,00	0,00	0,00	320.600,00	14.588,00	4,77%	5,67%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	620.410,68	0,00	0,00	615.775,46	-4.635,22	-0,75% ▼	11,29%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	181.059,92	0,00	0,00	184.547,71	3.487,79	1,93% ▲	7,71%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	390.818,50	0,00	0,00	392.803,83	1.985,33	0,51% ▲	10,12%
	1.192.289,10	0,00	0,00	1.193.127,00	837,90	0,07%	7,02%

