

2024

Relatório Mensal

Agosto

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	5.453.501,76	1,64%	5.319.492.629,16	0,10%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.093.291,82	0,33%	4.414.843.191,53	0,02%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	26.503.237,09	7,95%	756.786.886,39	3,50%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.539.013,68	1,66%	23.667.347,92	23,40%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.825.939,30	1,45%	466.521.869,13	1,03%	7º I b
CAIXA BRASIL 2028 X II TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA F...	28.408.938,81	8,53%	744.519.192,28	3,82%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.212.440,47	1,26%	4.335.355.090,03	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.595.253,25	1,08%	7.132.951.786,05	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	995.607,57	0,30%	3.888.604.125,92	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.023.647,15	6,31%	8.028.368.624,38	0,26%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.815.743,25	1,75%	504.694.691,80	1,15%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	52.351.014,32	15,71%	20.250.525.135,03	0,26%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	438.636,87	0,13%	449.453.157,55	0,10%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	57.402.219,42	17,23%	15.057.333.281,43	0,38%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	60.609.213,77	18,19%	18.688.563.354,91	0,32%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.113.569,23	0,93%	1.058.181.840,27	0,29%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.440.952,88	0,43%	1.263.586.408,92	0,11%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.027.439,97	0,31%	822.113.263,16	0,12%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.896.391,74	2,67%	671.510.119,38	1,32%	8º I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.946.891,92	3,29%	732.318.670,95	1,49%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	18.272.116,35	5,48%	532.624.382,56	3,43%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.603.241,44	1,38%	325.553.506,41	1,41%	8º I
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.406.280,87	0,42%	43.100.463,89	3,26%	8º I
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.688.720,47	1,11%	213.482.577,40	1,73%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	620.724,43	0,19%	611.995.647,76	0,10%	9º III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	186.891,17	0,06%	200.256.435,41	0,09%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	395.025,03	0,12%	2.663.493.555,95	0,01%	9º III

Investimentos

\$ 333.190.184,03

Disponibilidades Financeiras

\$ 256.404,04

Total Carteira

\$ 333.446.588,07

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

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	324.240,00	0,10%	184.122.000,00	0,18%	11º

Investimentos

\$ 333.190.184,03

Disponibilidades Financeiras

\$ 256.404,04


Total Carteira

\$ 333.446.588,07

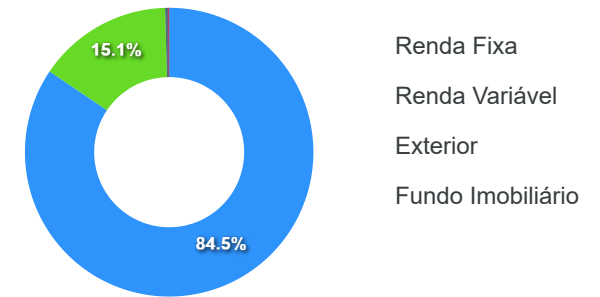
Governança (Pró Gestão)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	32,23% 107.466.614,15	67,77% 225.979.973,92
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	52,16% 173.914.653,61	7,84% 26.153.299,23
8º I - Fundos de Ações	30,00%	15,08% 50.282.035,64	14,92% 49.751.940,78
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,36% 1.202.640,63	9,64% 32.142.018,18
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,10% 324.240,00	4,90% 16.348.089,40

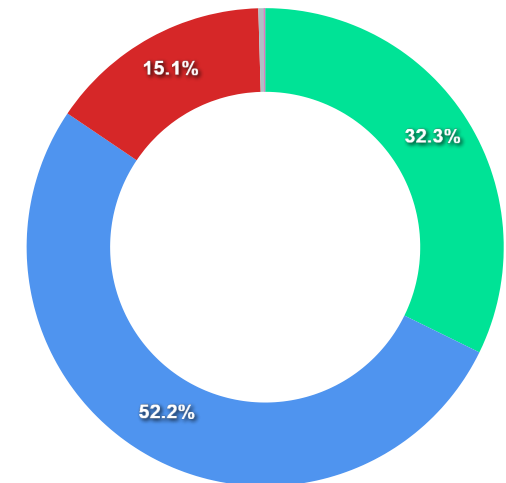
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



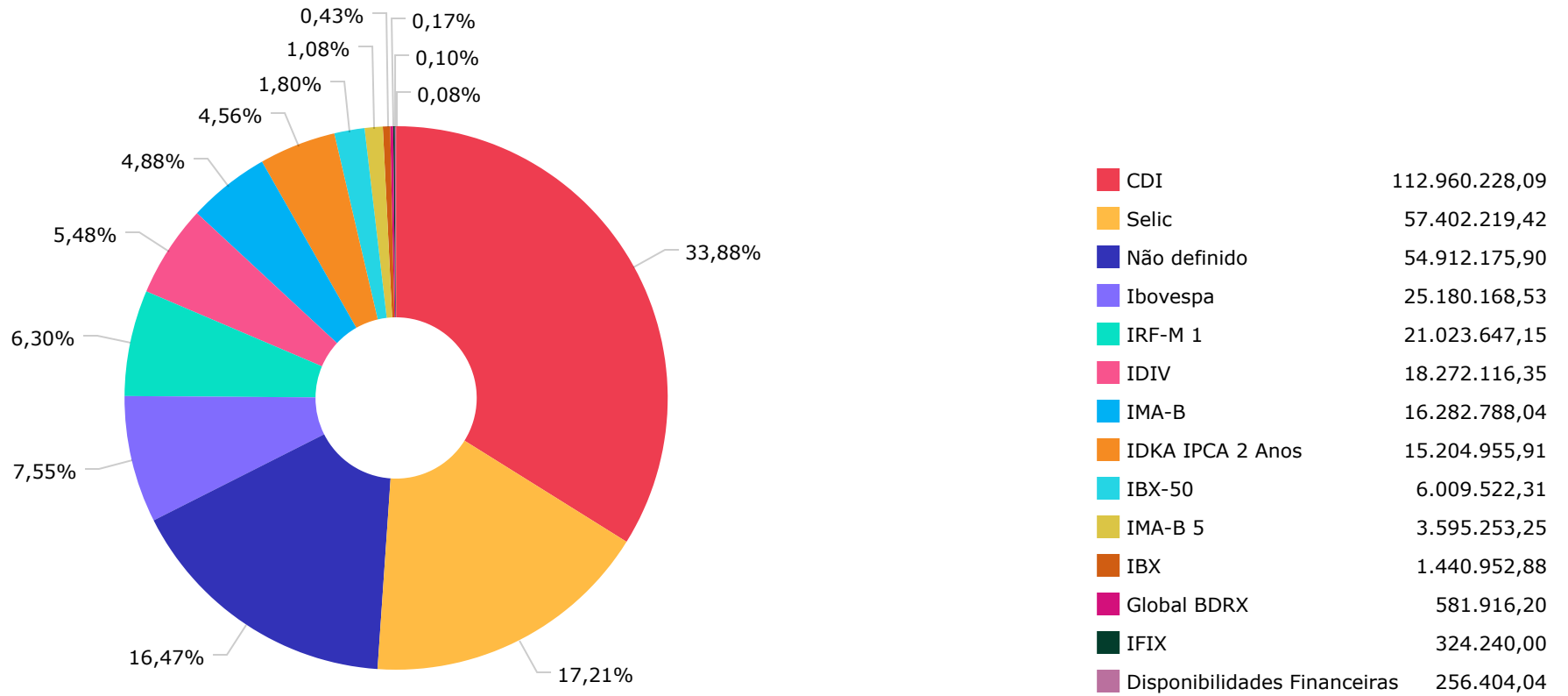
Artigos

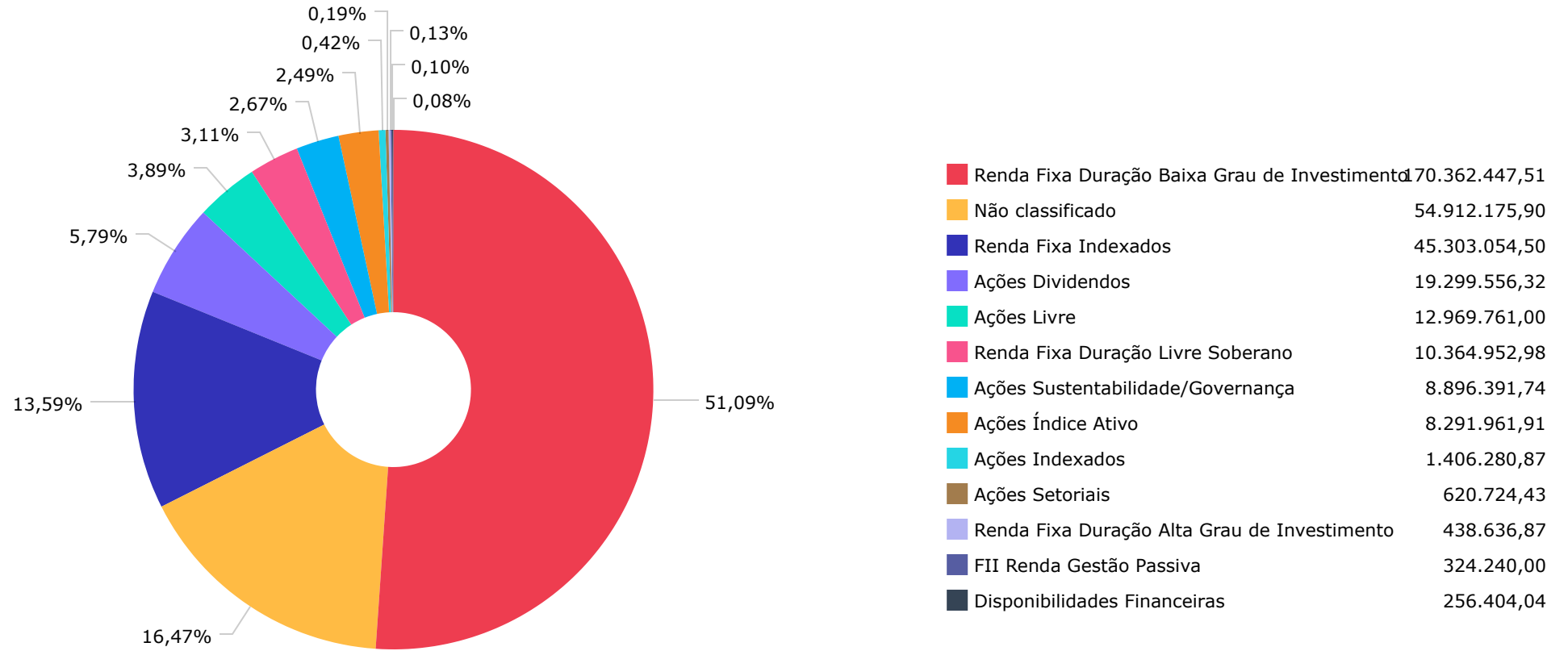


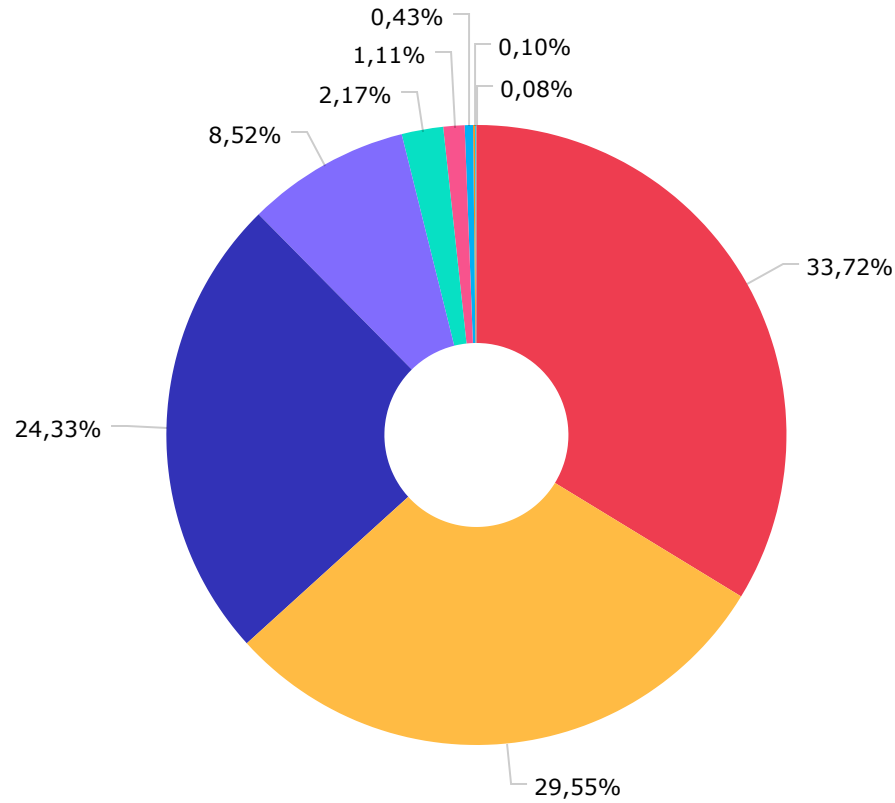
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	333.446.588,07	8° I - Fundos de Ações	15,08%	0,00%	18,00%	30,00%	49.751.940,78
7° I b - FI 100% Títulos TN	32,23%	0,00%	50,00%	100,00%	225.979.973,92	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	100.033.976,42
7° III a - FI Referenciados RF	52,16%	0,00%	25,00%	60,00%	26.153.299,23	9° III - Ações - BDR Nível I	0,36%	0,00%	2,00%	10,00%	32.142.018,18
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	66.689.317,61	11° - Fundos Imobiliários	0,10%	0,00%	1,00%	5,00%	16.348.089,40
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	16.672.329,40						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...								
CAIXA BRASIL 2028 X II TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA								
CDI - BENCHMARK								
	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88	7,33	2,70	5,39	11,61	26,97	0,02	0,05
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89	7,21	2,68	5,34	11,32	26,39	0,01	0,02
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
	0,55	42,25	13,74	27,72	48,00	71,14		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,57	41,02	13,95	26,91	46,38	68,28	9,23	19,43
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,27	36,77	14,84	25,52	41,84	54,42	8,47	17,83
IBOVESPA - BENCHMARK								
	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,80	26,47	6,26	12,15	37,48	61,60	11,09	23,36
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	6,46	1,88	11,18	5,80	17,26	20,95	5,62	11,84
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,80	2,47	10,02	1,71	13,82	26,58	6,07	12,78
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	6,31	-0,75	12,33	4,03	13,14	19,56	5,81	12,25
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5,47	-4,77	10,69	-0,06	8,83	1,51	5,22	11,00
IBX - BENCHMARK								
	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,49	4,31	11,15	5,88	12,40	13,42	6,94	14,61
IBX-50 - BENCHMARK								
	6,51	3,14	11,66	6,63	19,46	24,91		
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	6,53	2,34	11,26	5,93	18,09	22,18	5,82	12,25
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5,90	1,79	11,64	5,34	16,83	18,86	5,86	12,35
IDIV - BENCHMARK								
	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91		

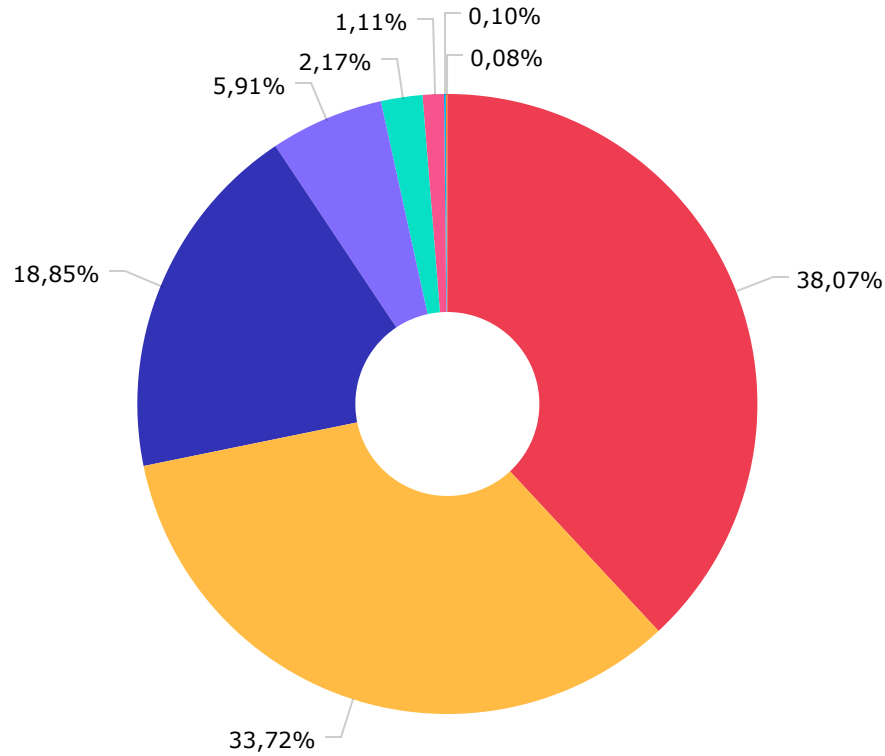
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,64	1,62	12,49	4,48	16,13	20,96	5,90	12,44
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84	6,88	2,50	5,06	10,87	25,57	0,00	0,00
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64	4,56	1,66	3,36	7,81	20,28	1,25	2,63
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59	4,32	1,52	3,11	7,68	20,09	1,34	2,83
IMA-B - BENCHMARK	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,70	1,46	1,68	1,36	5,23	19,40	2,46	5,17
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50	1,33	1,56	1,26	5,08	19,27	2,44	5,13
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,50	1,31	1,56	1,26	5,04	19,20	2,44	5,13
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46	1,29	1,54	1,24	5,04	19,17	2,43	5,11
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,48	1,26	1,53	1,22	4,96	19,05	2,44	5,13
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,48	1,13	1,49	1,07	4,66	18,88	2,48	5,23
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58	4,74	1,86	3,45	7,91	20,66	1,09	2,29
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,75	6,24	2,30	4,51	10,24	25,14	0,30	0,64
SELIC - BENCHMARK	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28		
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91	7,71	2,77	5,61	12,12	27,88	0,04	0,08
IFIX - BENCHMARK	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02		
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	1,14	-0,69	8,21	0,70	-1,86	10,29	4,61	9,71







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	112.431.506,73
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	98.547.997,91
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	81.125.803,11
CAIXA DTVM	28.408.938,81
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	7.222.024,12
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.688.720,47
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.440.952,88
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	324.240,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	256.404,04



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	126.956.936,72
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	112.431.506,73
BANCO BRADESCO S.A.	62.853.686,76
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	19.713.069,23
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	7.222.024,12
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	3.688.720,47
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	324.240,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	256.404,04

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulada %	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%
Agosto	326.952.300,67	83.520.098,87	82.324.822,63	333.190.184,03	5.042.607,12	14.485.270,92	1,54% ▲	4,56%	0,42%	6,38%	71,47%	1,10%

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

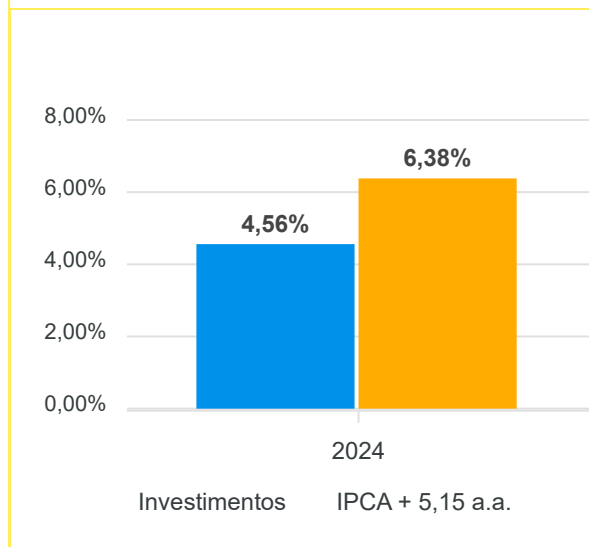


Gráfico Risco x Retorno

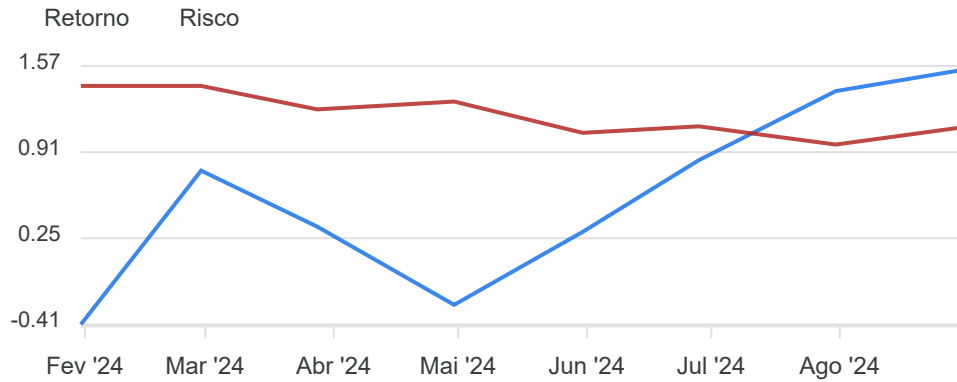
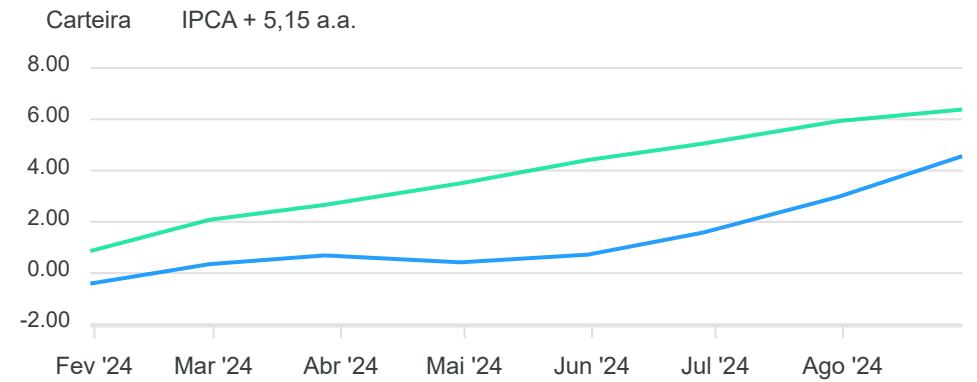
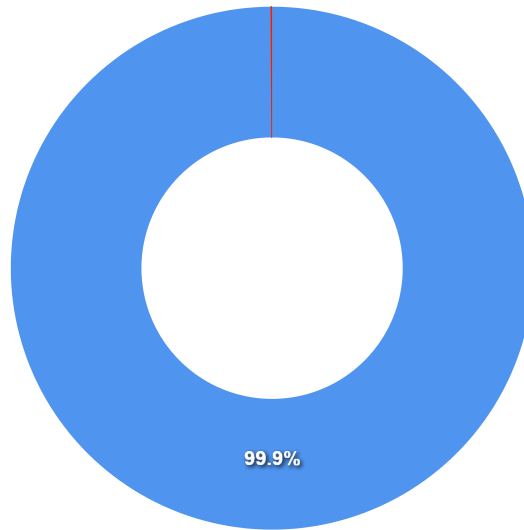


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/08/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	333.122.348,07	99,98
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	324.240,00	0,10



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.419.068,17	0,00	0,00	5.453.501,76	34.433,59	0,64% ▲	1,25%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.088.257,66	0,00	0,00	1.093.291,82	5.034,16	0,46% ▲	2,43%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	51.825.838,94	25.052.834,73	25.000.000,00	52.351.014,32	472.340,65	0,61% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	602.120,38	0,00	605.115,86	0,00	2.995,48	0,50% ▲	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.490.443,79	0,00	28.644.894,38	0,00	154.450,59	0,54% ▲	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.492.952,66	0,00	0,00	5.539.013,68	46.061,02	0,84% ▲	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.577.375,51	0,00	25.714.812,39	0,00	137.436,88	0,54% ▲	0,08%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	436.541,27	0,00	0,00	438.636,87	2.095,60	0,48% ▲	2,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.802.724,35	0,00	0,00	4.825.939,30	23.214,95	0,48% ▲	2,44%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	54.691.809,36	2.200.000,00	0,00	57.402.219,42	510.410,06	0,90% ▲	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	58.817.032,55	1.267.264,14	0,00	60.609.213,77	524.917,08	0,87% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.187.674,46	0,00	0,00	4.212.440,47	24.766,01	0,59% ▲	1,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.922.190,88	0,00	2.360.000,00	3.595.253,25	33.062,37	0,56% ▲	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	990.659,43	0,00	0,00	995.607,57	4.948,14	0,50% ▲	2,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.867.470,17	0,00	0,00	21.023.647,15	156.176,98	0,75% ▲	0,30%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.091.874,07	0,00	0,00	3.113.569,23	21.695,16	0,70% ▲	2,46%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.786.954,91	0,00	0,00	5.815.743,25	28.788,34	0,50% ▲	2,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	26.500.000,00	0,00	26.503.237,09	3.237,09	0,01% ▲	-
CAIXA BRASIL 2028 X II TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,00	28.500.000,00	0,00	28.408.938,81	-91.061,19	-0,32% ▼	-
	278.090.988,56	83.520.098,87	82.324.822,63	281.381.267,76	2.095.002,96	0,75%	0,29%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.378.991,54	0,00	0,00	1.440.952,88	61.961,34	4,49% ▲	6,94%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	961.978,84	0,00	0,00	1.027.439,97	65.461,13	6,80% ▲	6,07%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.356.465,84	0,00	0,00	8.896.391,74	539.925,90	6,46% ▲	5,62%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.378.912,79	0,00	0,00	10.946.891,92	567.979,13	5,47% ▲	5,22%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.134.633,28	0,00	0,00	18.272.116,35	1.137.483,07	6,64% ▲	5,90%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.346.756,81	0,00	0,00	4.603.241,44	256.484,63	5,90% ▲	5,86%
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.320.058,80	0,00	0,00	1.406.280,87	86.222,07	6,53% ▲	5,82%
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.469.787,21	0,00	0,00	3.688.720,47	218.933,26	6,31% ▲	5,81%
-	47.347.585,11	0,00	0,00	50.282.035,64	2.934.450,53	6,20%	5,72%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	320.600,00	0,00	0,00	324.240,00	3.640,00	1,14% ▲	4,61%
-	320.600,00	0,00	0,00	324.240,00	3.640,00	1,14%	4,61%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	615.775,46	0,00	0,00	620.724,43	4.948,97	0,80% ▲	11,09%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	184.547,71	0,00	0,00	186.891,17	2.343,46	1,27% ▲	8,47%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	392.803,83	0,00	0,00	395.025,03	2.221,20	0,57% ▲	9,23%
	1.193.127,00	0,00	0,00	1.202.640,63	9.513,63	0,80%	7,04%

