

# 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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.499.178,27	0,44%	4.919.072.193,80	0,03%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	86.596,81	0,03%	4.070.369.176,30	0,00%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	26.761.113,86	7,93%	916.546.894,83	2,92%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.784.351,25	0,53%	398.072.014,92	0,45%	7º I b
CAIXA BRASIL 2028 X II TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA F...	33.873.019,63	10,04%	829.445.846,28	4,08%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	237.166,41	0,07%	4.039.305.995,01	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	982.018,50	0,29%	3.355.089.991,95	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.404.684,48	7,83%	8.121.204.821,20	0,33%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.736.811,65	1,70%	470.190.432,46	1,22%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	58.324.414,84	17,29%	20.409.457.658,47	0,29%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	432.560,37	0,13%	385.318.184,48	0,11%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	63.894.462,36	18,94%	15.416.999.740,59	0,41%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	65.764.798,20	19,49%	19.218.803.160,79	0,34%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.586.031,65	0,47%	955.577.883,32	0,17%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.400.760,42	0,42%	1.181.577.816,36	0,12%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	994.717,77	0,29%	789.349.967,85	0,13%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.468.263,88	2,51%	632.719.373,43	1,34%	8º I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.821.824,95	3,21%	833.908.897,61	1,30%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.559.754,79	5,20%	514.556.660,29	3,41%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.384.851,41	1,30%	298.911.637,41	1,47%	8º I
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.335.623,39	0,40%	40.037.989,41	3,34%	8º I
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.527.910,78	1,05%	199.553.250,93	1,77%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	633.744,70	0,19%	617.180.593,14	0,10%	9º III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	195.566,60	0,06%	200.695.462,52	0,10%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	417.046,76	0,12%	2.836.421.099,25	0,01%	9º III
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	309.400,00	0,09%	175.695.000,00	0,18%	11º

## Investimentos

\$ 337.416.673,73

## Disponibilidades Financeiras

\$ 147.725,93

## Total Carteira

\$ 337.564.399,66

## Governança (Pró Gestão)

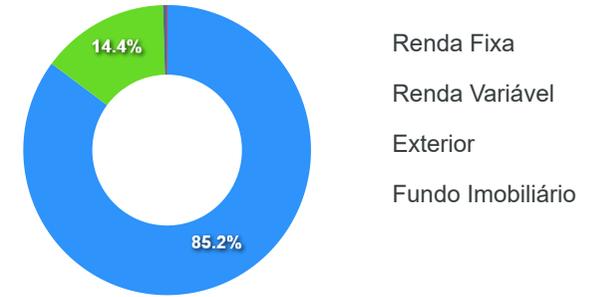
[!\[\]\(6a9b39b98eb945faa14c645ec99e4eaa\_img.jpg\)](#)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	28,86%	97.364.940,86 71,14%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	56,31%	190.002.267,42 3,69%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	14,37%	48.493.707,39 15,63%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,37%	1.246.358,06 9,63%
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,09%	309.400,00 4,91%

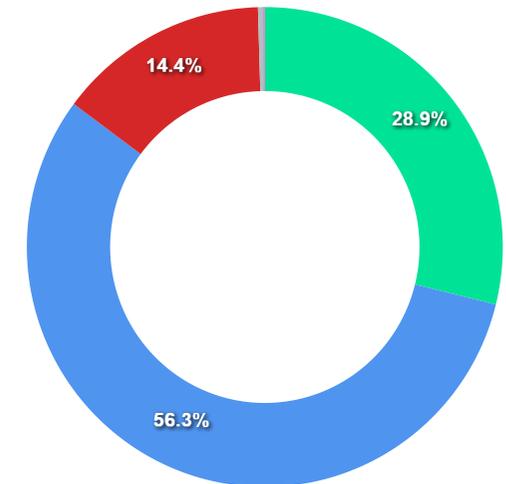
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



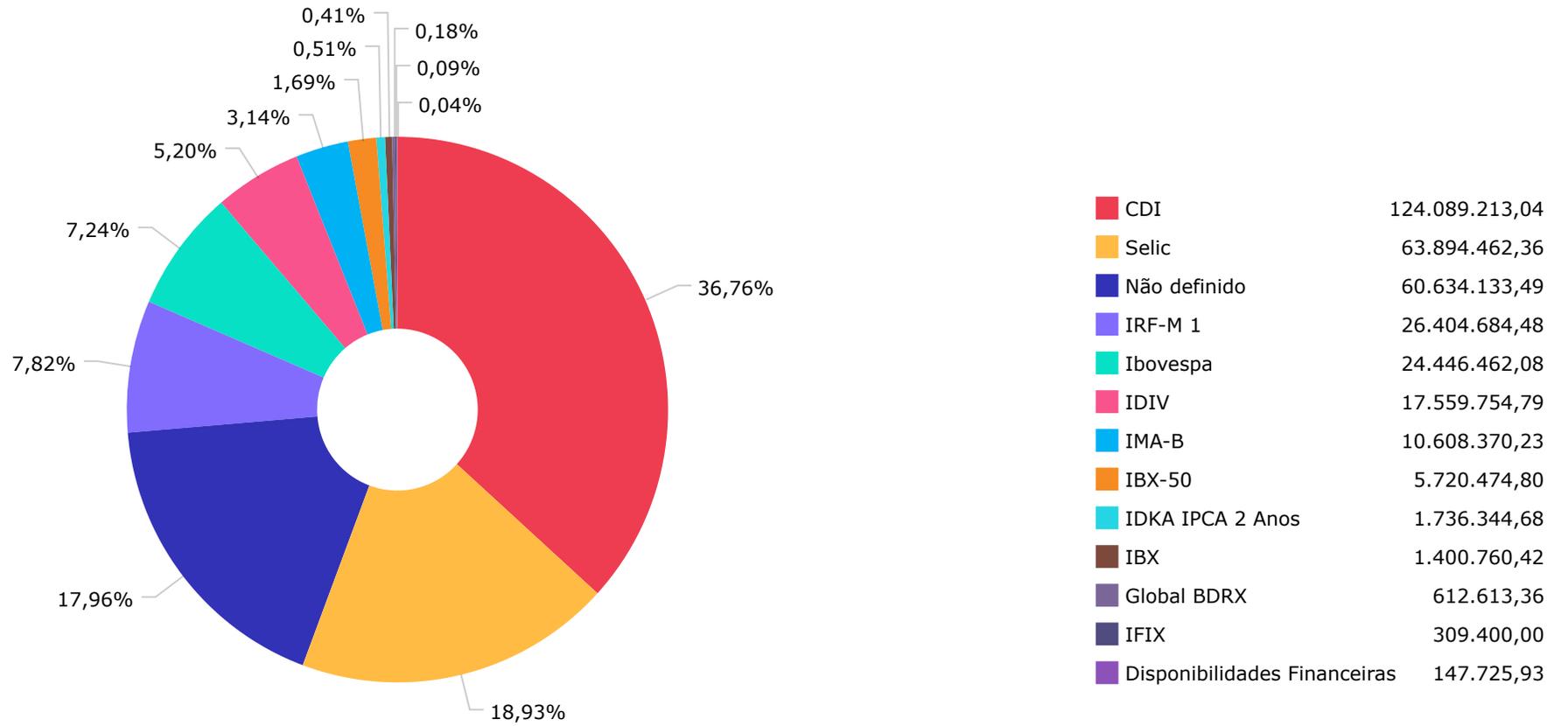
Artigos

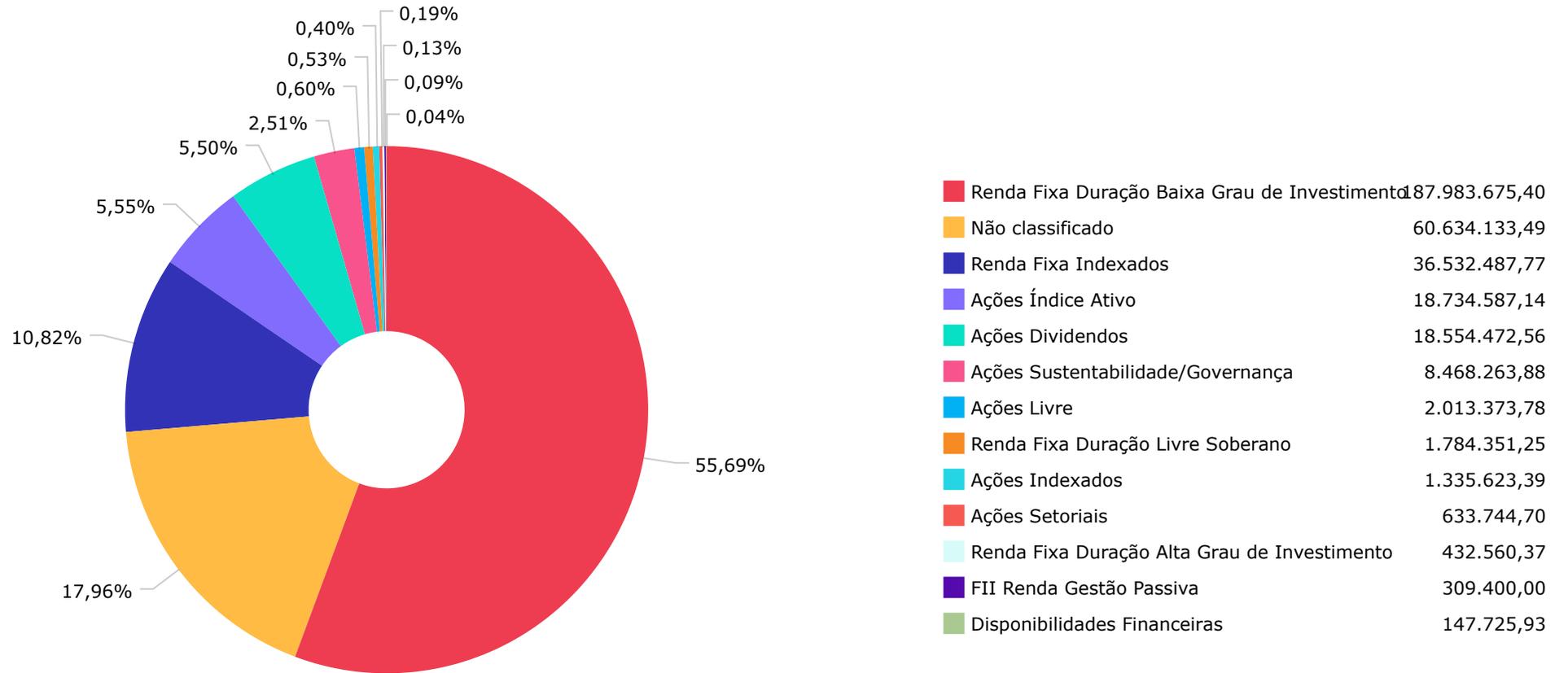


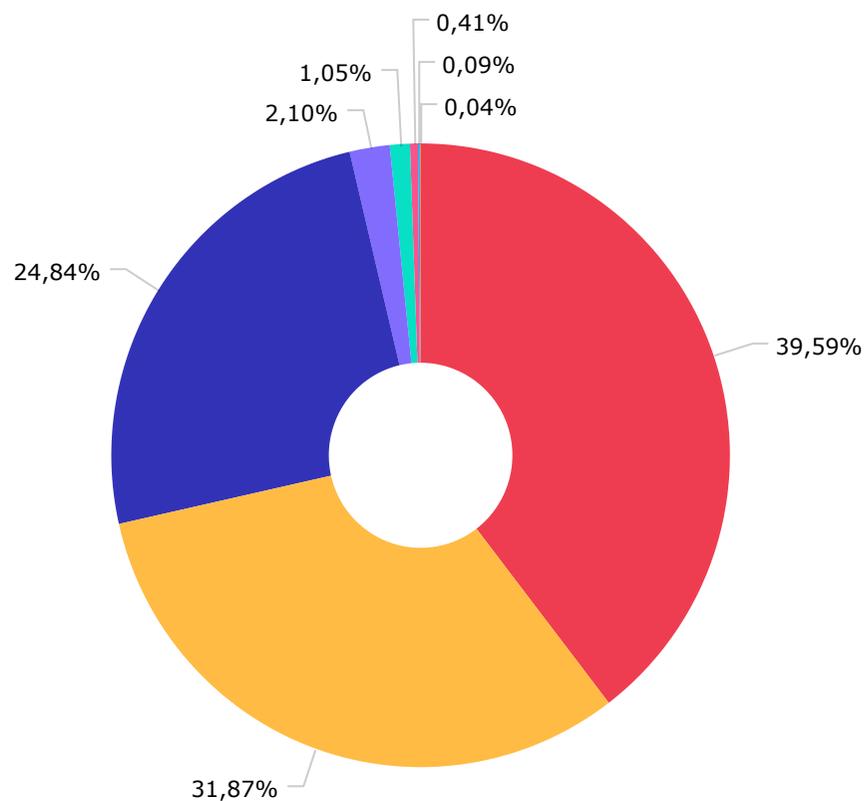
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	337.416.673,73	8° I - Fundos de Ações	14,37%	0,00%	18,00%	30,00%	52.731.294,73
7° I b - FI 100% Títulos TN	28,86%	0,00%	50,00%	100,00%	240.051.732,87	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	101.225.002,12
7° III a - FI Referenciados RF	56,31%	0,00%	25,00%	60,00%	12.447.736,82	9° III - Ações - BDR Nível I	0,37%	0,00%	2,00%	10,00%	32.495.309,31
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	67.483.334,75	11° - Fundos Imobiliários	0,09%	0,00%	1,00%	5,00%	16.561.433,69
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	16.870.833,69						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>NÃO DEFINIDO - BENCHMARK</b>								
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,67						1,04	2,19
CAIXA BRASIL 2028 X II TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,36						1,40	2,95
<b>CDI - BENCHMARK</b>								
	<b>0,93</b>	<b>8,99</b>	<b>2,65</b>	<b>5,27</b>	<b>10,98</b>	<b>25,87</b>		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,91	9,23	2,67	5,40	11,31	26,50	0,02	0,04
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,93	9,12	2,69	5,38	11,11	25,94	0,02	0,05
<b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>								
	<b>6,02</b>	<b>50,50</b>	<b>6,38</b>	<b>29,14</b>	<b>64,77</b>	<b>95,02</b>		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,92	48,88	6,17	28,45	62,54	89,30	6,60	13,89
BRAPRES INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,82	43,12	5,97	27,30	55,85	65,85	6,27	13,20
<b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>								
	<b>-1,60</b>	<b>-3,33</b>	<b>1,61</b>	<b>3,01</b>	<b>14,64</b>	<b>11,79</b>		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,07	29,12	2,92	14,76	47,98	63,48	5,45	11,48
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,33	-0,80	3,40	3,55	17,93	16,83	5,63	11,86
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-1,49	-3,03	1,34	2,75	14,77	9,14	4,54	9,56
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	-1,55	-5,07	1,68	3,17	12,04	5,67	4,54	9,56
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-1,18	-7,43	0,90	1,60	10,72	4,05	4,43	9,33
<b>IBX - BENCHMARK</b>								
	<b>-1,53</b>	<b>-2,74</b>	<b>1,84</b>	<b>2,99</b>	<b>15,29</b>	<b>11,28</b>		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,03	1,40	1,58	4,20	17,86	3,51	4,06	8,54
<b>IBX-50 - BENCHMARK</b>								
	<b>-1,49</b>	<b>-1,71</b>	<b>1,51</b>	<b>3,10</b>	<b>15,95</b>	<b>12,48</b>		
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	-1,63	-2,81	1,18	2,46	14,48	9,91	4,71	9,92
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-1,33	-3,04	0,88	2,61	14,05	4,89	4,52	9,52
<b>IDIV - BENCHMARK</b>								
	<b>-1,72</b>	<b>2,45</b>	<b>4,09</b>	<b>7,11</b>	<b>21,24</b>	<b>28,86</b>		

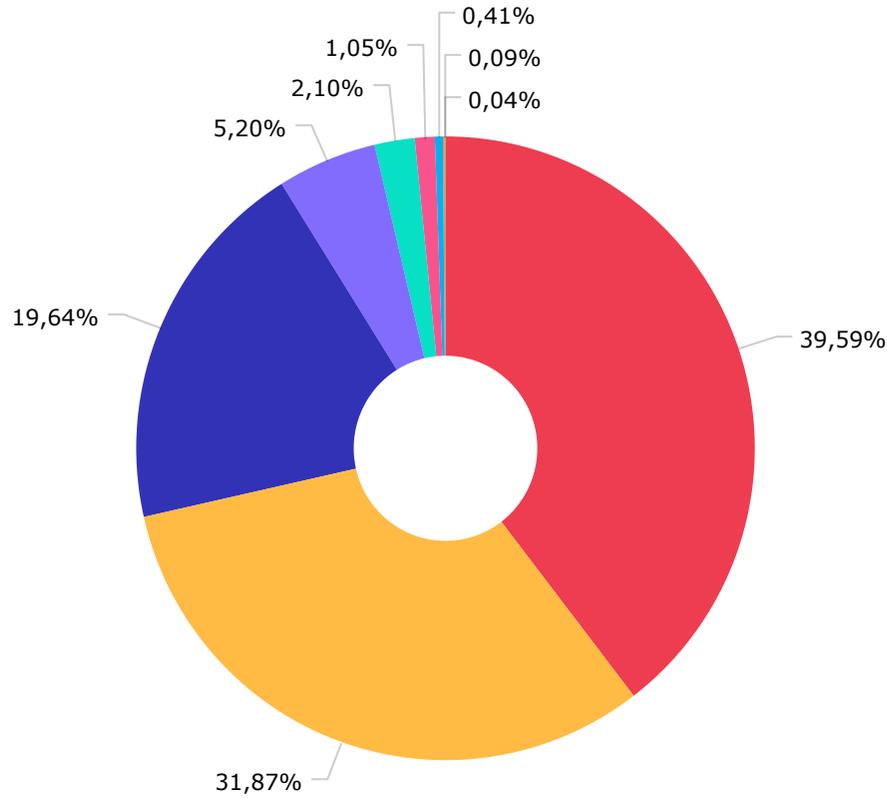
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,08	-2,34	2,48	4,06	15,25	10,93	4,64	9,77
<b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>	<b>0,81</b>	<b>5,86</b>	<b>1,81</b>	<b>3,85</b>	<b>9,37</b>	<b>19,24</b>		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81	5,91	1,93	4,06	9,33	18,99	0,86	1,82
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76	5,52	1,76	3,75	8,86	18,70	0,94	1,97
<b>IMA-B - BENCHMARK</b>	<b>-0,65</b>	<b>0,16</b>	<b>-0,80</b>	<b>1,63</b>	<b>5,62</b>	<b>15,10</b>		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,64	0,17	-0,58	1,70	5,69	14,85	1,85	3,89
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,68	-0,06	-0,87	1,48	5,35	14,56	1,89	3,98
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67	-0,08	-0,90	1,47	5,34	14,51	1,88	3,97
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,68	-0,07	-0,87	1,49	5,34	14,49	1,89	3,98
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,67	-0,12	-0,89	1,45	5,27	14,37	1,89	3,97
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,69	-0,27	-0,91	1,36	4,98	14,18	1,87	3,93
<b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>	<b>0,84</b>	<b>8,08</b>	<b>2,45</b>	<b>4,88</b>	<b>10,15</b>	<b>25,01</b>		
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
<b>SELIC - BENCHMARK</b>	<b>0,93</b>	<b>8,99</b>	<b>2,65</b>	<b>5,27</b>	<b>10,98</b>	<b>25,87</b>		
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93	9,68	2,75	5,56	11,80	27,41	0,02	0,05
<b>IFIX - BENCHMARK</b>	<b>-3,06</b>	<b>-3,22</b>	<b>-4,75</b>	<b>-5,23</b>	<b>1,56</b>	<b>7,13</b>		
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	-4,08	-5,23	-3,49	-1,16	-3,49	10,00	9,54	20,08







CAIXA DTVM	133.649.617,04
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	107.589.855,08
BANCO BRADESCO S.A.	83.866.695,37
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	7.072.435,04
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.527.910,78
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.400.760,42
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	309.400,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	147.725,93



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	133.649.617,04
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	107.589.855,08
BANCO BRADESCO S.A.	66.306.940,58
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	17.559.754,79
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TIT...	7.072.435,04
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	3.527.910,78
INTRAG DTVM LTDA	1.400.760,42
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	309.400,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	147.725,93

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%
Setembro	333.190.184,03	8.742.091,74	7.664.263,63	334.539.628,31	271.616,17	14.756.887,09	0,08% ▲	4,65%	0,86%	7,29%	63,79%	1,24%
Outubro	334.539.628,31	28.714.081,92	27.641.981,50	337.416.673,73	1.804.945,00	16.561.832,09	0,54% ▲	5,21%	1,02%	8,39%	62,10%	1,00%

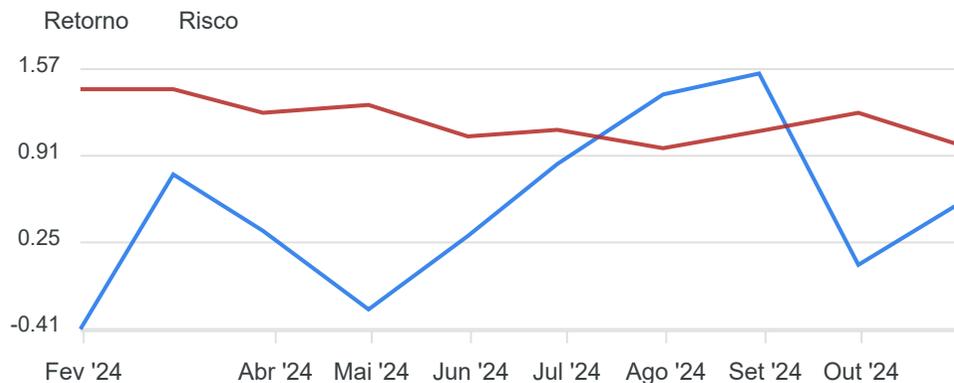
Retorno Acumulado (Períodos)

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%
3º Trim	9.754.998,97	3,02%	2,14%

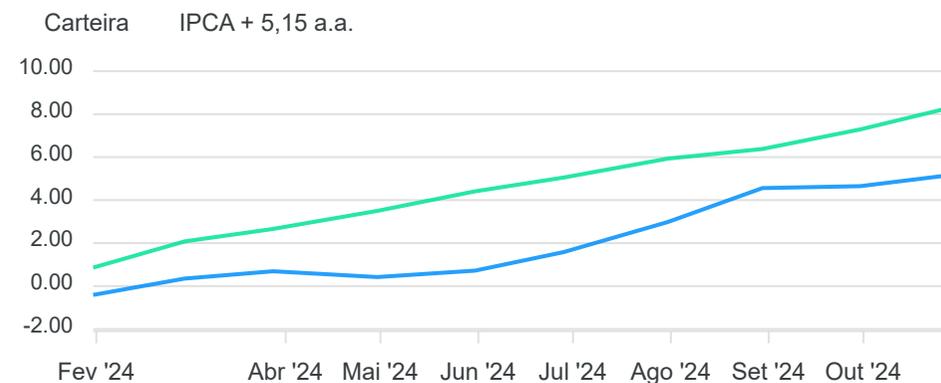
Gráfico Retorno e Meta Acumulado



**Gráfico Risco x Retorno**

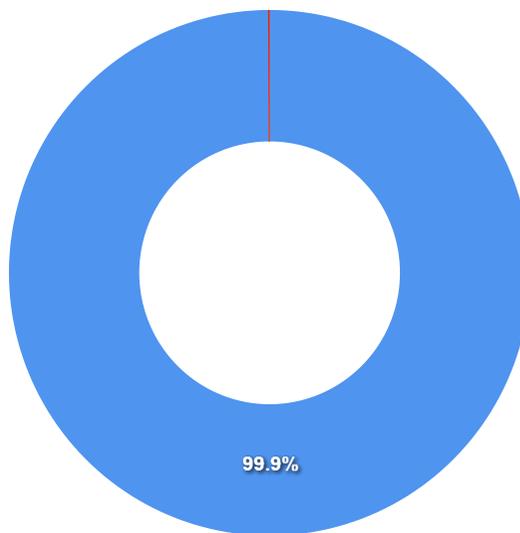


**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



**Liquidez - 31/10/2024**

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	337.254.999,66	99,91
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	309.400,00	0,09



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.479.542,80	0,00	4.000.000,00	1.499.178,27	19.635,47	0,36% ▲	0,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.085.794,90	0,00	1.000.000,00	86.596,81	801,91	0,07% ▲	1,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	52.791.682,58	5.000.000,00	0,00	58.324.414,84	532.732,26	0,92% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	26.582.333,66	0,00	0,00	26.761.113,86	178.780,20	0,67% ▲	1,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	435.573,27	0,00	0,00	432.560,37	-3.012,90	-0,69% ▼	1,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.792.341,38	0,00	3.000.000,00	1.784.351,25	-7.990,13	-0,17% ▼	1,89%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	59.989.973,38	5.090.000,00	1.774.000,00	63.894.462,36	588.488,98	0,90% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL 2028 X II TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	33.752.403,94	0,00	0,00	33.873.019,63	120.615,69	0,36% ▲	1,40%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	62.405.448,93	2.772.079,74	0,00	65.764.798,20	587.269,53	0,90% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.229.145,50	0,00	4.000.000,00	237.166,41	8.020,91	0,19% ▲	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.510.023,34	0,00	1.515.979,32	0,00	5.955,98	0,39% ▲	0,88%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	988.757,49	0,00	0,00	982.018,50	-6.738,99	-0,68% ▼	1,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.193.235,92	5.000.000,00	0,00	26.404.684,48	211.448,56	0,81% ▲	0,14%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.093.692,30	0,00	1.500.000,00	1.586.031,65	-7.660,65	-0,25% ▼	1,85%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.775.808,34	0,00	0,00	5.736.811,65	-38.996,69	-0,68% ▼	1,89%
	284.105.757,73	17.862.079,74	16.789.979,32	287.367.208,28	2.189.350,13	0,77%	0,36%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.400.285,57	0,00	0,00	1.400.760,42	474,85	0,03% ▲	4,06%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.008.136,37	0,00	0,00	994.717,77	-13.418,60	-1,33% ▼	5,63%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.596.204,30	0,00	0,00	8.468.263,88	-127.940,42	-1,49% ▼	4,54%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.756.992,96	0,00	10.852.002,18	0,00	95.009,22	0,88% ▲	-
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.751.987,03	0,00	0,00	17.559.754,79	-192.232,24	-1,08% ▼	4,64%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.443.967,34	0,00	0,00	4.384.851,41	-59.115,93	-1,33% ▼	4,52%
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.357.699,04	0,00	0,00	1.335.623,39	-22.075,65	-1,63% ▼	4,71%
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.583.289,83	0,00	0,00	3.527.910,78	-55.379,05	-1,55% ▼	4,54%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	10.852.002,18	0,00	10.821.824,95	-30.177,23	-0,28% ▼	4,43%
-	48.898.562,44	10.852.002,18	10.852.002,18	48.493.707,39	-404.855,05	-0,83%	4,56%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	322.560,00	0,00	0,00	309.400,00	-13.160,00	-4,08% ▼	9,54%
-	322.560,00	0,00	0,00	309.400,00	-13.160,00	-4,08%	9,54%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	634.192,73	0,00	0,00	633.744,70	-448,03	-0,07% ▼	5,45%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	184.811,67	0,00	0,00	195.566,60	10.754,93	5,82% ▲	6,27%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	393.743,74	0,00	0,00	417.046,76	23.303,02	5,92% ▲	6,60%
	1.212.748,14	0,00	0,00	1.246.358,06	33.609,92	2,77%	3,76%

